

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年3月10日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	F Wりそな国内債券インデックスファンド F Wりそな国内株式インデックスファンド F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） F W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） F Wりそな新興国債券インデックスファンド F Wりそな先進国株式インデックスファンド F Wりそな新興国株式インデックスファンド F Wりそな国内リートインデックスファンド F Wりそな先進国リートインデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	F Wりそな国内債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） 1兆円を上限とします。 F W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） 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

F Wりそな国内債券インデックスファンド  
 F Wりそな国内株式インデックスファンド  
 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）  
 F W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）  
 F Wりそな新興国債券インデックスファンド  
 F Wりそな先進国株式インデックスファンド  
 F Wりそな新興国株式インデックスファンド  
 F Wりそな国内リートインデックスファンド  
 F Wりそな先進国リートインデックスファンド

- ・以下、上記を総称して「FW専用ファンド（スタンダードコース）」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称
F Wりそな国内債券インデックスファンド	国内債券インデックス
F Wりそな国内株式インデックスファンド	国内株インデックス
F Wりそな先進国債券インデックスファンド （為替ヘッジなし）	先進国債券インデックス（ヘッジなし）
F W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）	先進国債券インデックス（ヘッジあり）
F Wりそな新興国債券インデックスファンド	新興国債券インデックス
F Wりそな先進国株式インデックスファンド	先進国株インデックス
F Wりそな新興国株式インデックスファンド	新興国株インデックス
F Wりそな国内リートインデックスファンド	国内リートインデックス
F Wりそな先進国リートインデックスファンド	先進国リートインデックス

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

F Wりそな国内債券インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F W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）：取得申込受付日の翌営業日の基準

価額とします。

F Wリそな新興国債券インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wリそな先進国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wリそな新興国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wリそな国内リートインデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。

F Wリそな先進国リートインデックスファンド：取得申込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「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2022年3月11日から2022年9月9日までとします。

・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、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/>

（９）【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

当ファンドは、投資者と株式会社りそな銀行が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。受益権の取得申込者は、原則として、株式会社りそな銀行と投資一任契約を締結し、投資一任契約の資産を管理する口座を開設した者に限るものとします。

投資一任業者である株式会社りそな銀行が、投資者との投資一任契約に基づく運用財産の効率的な運営および維持のため、ファンドを買付ける場合があります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

東証株価指数（ T O P I X、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F W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） >

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。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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指して運用を行います。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

M S C I - 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目指して運用を行います。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

S & P 先進国 R E I T 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。

ファンドの基本的性格

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券 (クレジット属性 ( ))	(毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (NOMURA-BPI 総合)
その他資産 (投資信託証券(債券 一般))	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産複合 ( )		エマージング		
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。

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(債券 一般)))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(債券)とが異なります。

## &lt; F W りそな国内株式インデックスファンド &gt;

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		東証株価指数
社債		オセアニア		(TOPIX、配 当込み)
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
その他資産 (投資信託証券(株 式一般))	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産複合 ( )		エマージング		
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。

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(株式一般)))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(株式)とが異なります。

< F W りそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし) >

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年5回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	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(債券 公債))		アフリカ			その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円換算 ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

< F W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) >

#### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 2) 属性区分

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

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

#### < F W りそな新興国債券インデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分



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

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	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(株式 一般))	その他 ( )	アフリカ			その他 (MSCI-KOKUSAI 指数(配当込 み、円換算ベー ス))
資産複合 ( )		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式 一般)))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(株式)とが異なります。

#### < F W りそな新興国株式インデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年5回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信		中南米			
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI エマージング・マーケット 指数(配当込み、円換算ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式 一般)))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(株式)とが異なります。

#### < FWRりそな国内リートインデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

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

(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。

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(不動産投信)))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(不動産投信)とが異なります。

#### <FWりそな先進国リートインデックスファンド>

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	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(不 動産投信))	その他 ( )	アフリカ			その他 (S&P先進国REIT 指数(除く日 本、配当込み、 円換算ペー ス))
資産複合 ( )		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(不動産投信)))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(不動産投信)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

1

「FW専用ファンド(スタンダードコース)」は、原則として、投資者と株式会社りそな銀行が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するための専用ファンドです。

- 「FW専用ファンド(スタンダードコース)」の受益権の取得申込者は、株式会社りそな銀行と投資一任契約を締結する必要があります。

※投資一任業者である株式会社りそな銀行は、投資者との投資一任契約に基づく運用財産の効率的な運営および維持のため、ファンドを買い付ける場合があります。

2

「FW専用ファンド(スタンダードコース)」を構成する各ファンドは、各マザーファンドを通じて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。

## ■ ファンドの仕組み





### 3 各ファンドの運用方針は以下の通りです。

#### FWりそな国内債券インデックスファンド

1. 国内の債券を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[NOMURA-BPI総合]は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

2. RM国内債券マザーファンドを通じて、国内の債券への投資を行います。
  - NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。

#### FWりそな国内株式インデックスファンド

1. 国内の株式を実質的な主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX、配当込み)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[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。

2. RM国内株式マザーファンドを通じて、国内の株式への投資を行います。
  - 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。

#### FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)]は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

2. RM先進国債券マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
  - FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)または海外の債券先物取引を活用することがあります。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

**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)**

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、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ます。

\*[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指数で、為替ヘッジを考慮したものです。

2. RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)を通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
  - 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。
3. 為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

**FWりそな新興国債券インデックスファンド**

1. 新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)\*の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

2. RM新興国債券マザーファンドを通じて、新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。
  - JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)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。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

**FWりそな先進国株式インデックスファンド**

1. 日本を除く先進国の株式を実質的な主要投資対象とし、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目指します。

\*[MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)]は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。

2. RM先進国株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式\*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)への投資を行います。
  - 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。
    - \*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券等を含みます。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

### FWりそな新興国株式インデックスファンド

1. 新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)]は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。

2. RM新興国株式マザーファンドを通じて、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)への投資を行います。

- MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)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。

\*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券等を含みます。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

### FWりそな国内リートインデックスファンド

1. 国内の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[東証REIT指数(配当込み)]は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。

2. RM国内リートマザーファンドを通じて、国内の不動産投資信託証券\*への投資を行います。

- 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。

\*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。

### FWりそな先進国リートインデックスファンド

1. 日本を除く先進国の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、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。

\*[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す。

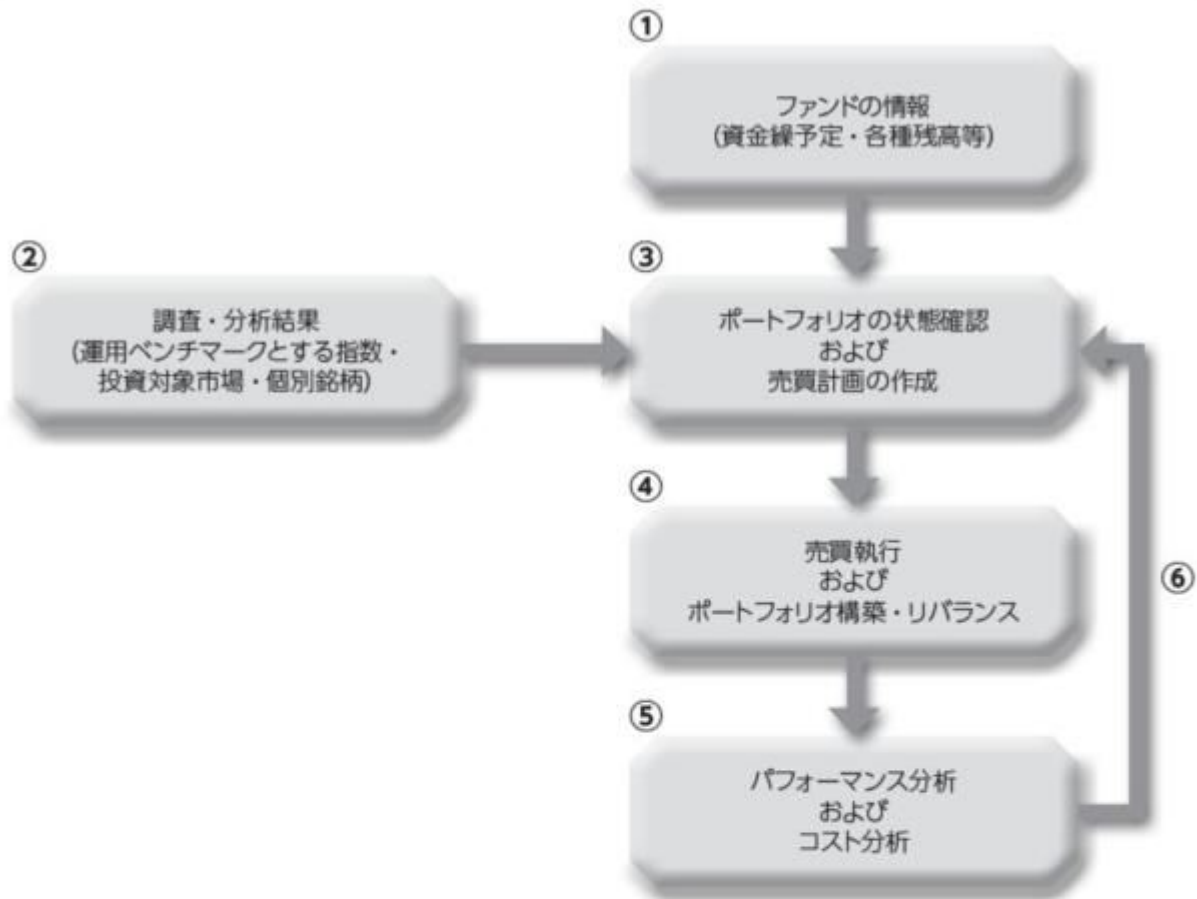
2. RM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券\*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。

- 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。

\*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。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

## ■運用プロセスのイメージ



- ①設定・解約による資金繰予定のほか、個別銘柄・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
- ②運用ベンチマークとする指数および投資対象となる市場・個別銘柄に関する調査・分析を行います。
- ③各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じて個別銘柄の売買計画を作成します。
- ④売買執行（市場での個別銘柄等の売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
- ⑤運用パフォーマンスや運用ベンチマークとの連動性、売買執行に要したコストの分析等を行います。
- ⑥上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## ■ 主な投資制限

### ● FWりそな国内債券インデックスファンド

- 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。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下  
とします。
- 投資信託証券（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。

### ● FWりそな国内株式インデックスファンド

- 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。

### ● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

### ● 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)

### ● FWりそな新興国債券インデックスファンド

- 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。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下  
とします。
- 投資信託証券（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。

### ● FWりそな先進国株式インデックスファンド

### ● FWりそな新興国株式インデックスファンド

- 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。

### ● FWりそな国内リートインデックスファンド

- 不動産投資信託証券および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。

### ● FWりそな先進国リートインデックスファンド

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

## 分配方針

原則、毎年12月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

- **RM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先進国債券マザーファンド**  
「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **RM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・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先進国株式マザーファンド**  
「MSCI-KOKUSA1指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSA1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-KOKUSA1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。

### 信託金限度額

- ・ F Wりそな国内債券インデックスファンド：5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F W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）：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

- ・ F Wりそな新興国債券インデックスファンド：2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな新興国株式インデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内リートインデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国リートインデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2017年1月5日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2021年3月11日

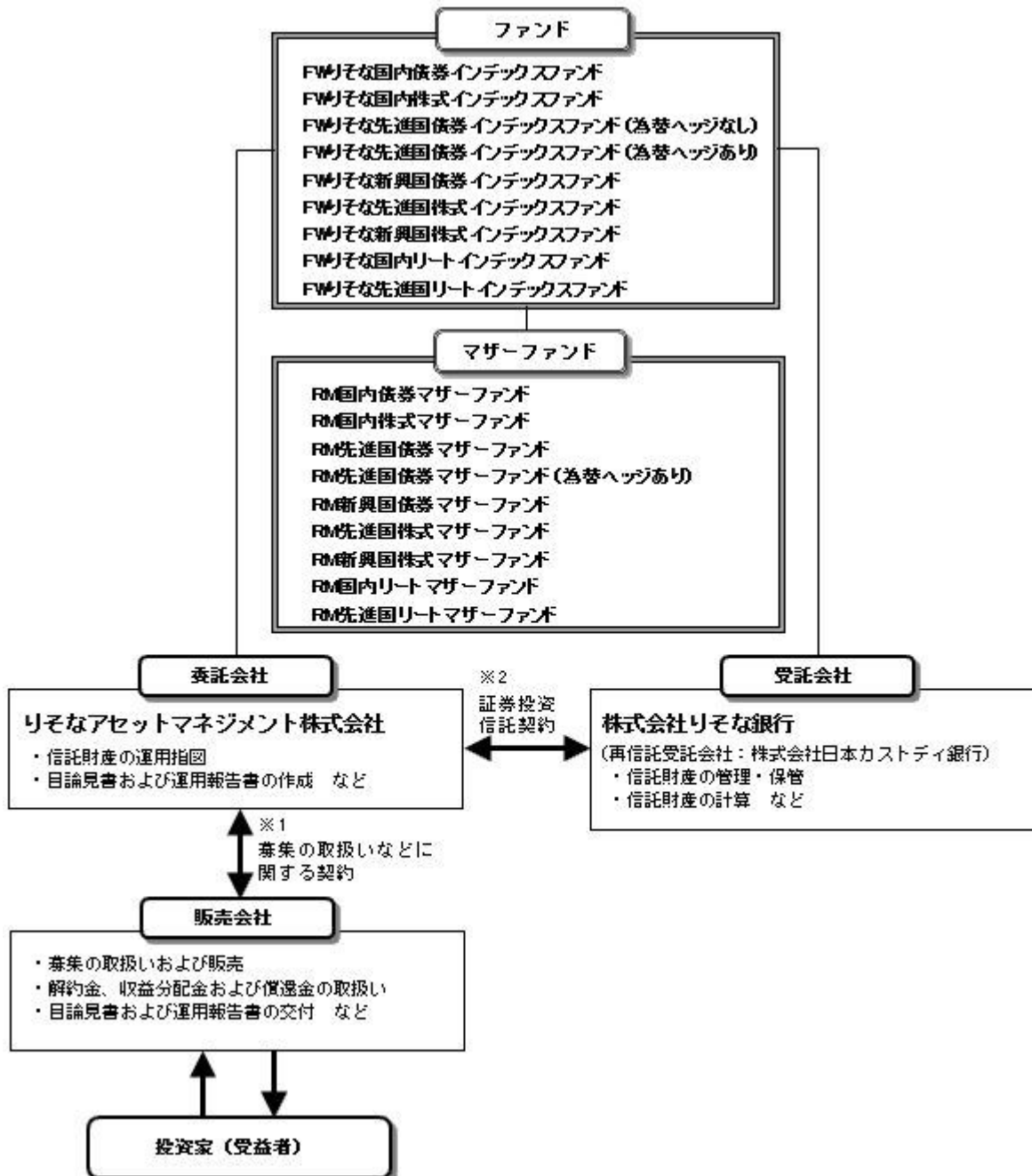
- ・ ファンド総称変更

新総称：FW専用ファンド(スタンダードコース)

旧総称：りそなファンドラップ(スタンダードコース)

## ( 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です。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です。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2021年12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】

#### < F Wりそな国内債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証株価指数（T O P I X、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（T O P I X、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、東証株価指数（T O P I X、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 E T F（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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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。

#### < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目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、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数とした E T F（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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

#### < F W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） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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 E T F（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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

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。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバースファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の

指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

#### < FWRりそな先進国株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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-KOKUSA 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目指して運用を行います。なお、MSCI-KOKUSA I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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

#### < FWRりそな新興国株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

#### < FWRりそな国内リートインデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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目指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

#### < FWRりそな先進国リートインデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

## （２）【投資対象】

### < F Wりそな国内債券インデックスファンド >

R M国内債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の債券に直接投資することがあります。

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（本邦通貨表示のものに限ります。）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、親投資信託「R M国内債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

R M国内株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の株式に直接投資することがあります。

#### 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(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
- イ) 有価証券
- ロ) デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23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、親投資信託「R M国内株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

#### < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

R M先進国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

#### 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、親投資信託「RM先進国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) 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、9) の証券および10) の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

## 金融商品の指図範囲

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

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

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

## その他の投資対象と指図範囲

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、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。

< F W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）>

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

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、親投資信託「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) 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、9) の証券および10) の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2

項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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、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。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

R M新興国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の債券に直接投資することがあります。

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20条、第21条、第22条および第23条に定めるものに限り。 )
  - 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、親投資信託「 R M新興国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、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、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。 )
- 10) 投資証券、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。 )
- 11) 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。 )
- 12) 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。）

- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)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8)および13)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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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。

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

R M先進国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式（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。）および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）に直接投資することができます。

#### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ) 有価証券
  - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23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、親投資信託「R M先進国株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、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。

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

R M新興国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式（D R（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。)および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)に直接投資することがあります。

#### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

#### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

### 金融商品の指図範囲

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

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

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

### その他の投資対象と指図範囲

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

### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

R M国内リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の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。）に直接投資することがあります。

#### 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（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ) 有価証券
  - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23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、親投資信託「R M国内リートマザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

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

## 株予約権証券

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

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

## 金融商品の指図範囲

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

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

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

## その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

## &lt; F Wりそな先進国リートインデックスファンド &gt;

R M先進国リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の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。）、不動産関連株式および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）に直接投資することがあります。

## 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ) 有価証券
  - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23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、親投資信託「RM先進国リートマザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

## 金融商品の指図範囲

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

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

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

ことができます。

その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド >

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	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。 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

## &lt; R M国内株式マザーファンド &gt;

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先進国債券マザーファンド >

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

その他の費用など	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。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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	<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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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>
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
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"> <li>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。）</li> <li>（*）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。</li> <li>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）</li> </ul>

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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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>
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	<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"> <li>・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（*）</li> <li>（*）D R（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。</li> <li>・新興国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>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E T F（上場投資信託証券）に投資し、M S C Iエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、M S C Iエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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>
<b>その他</b>	
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

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

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

## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

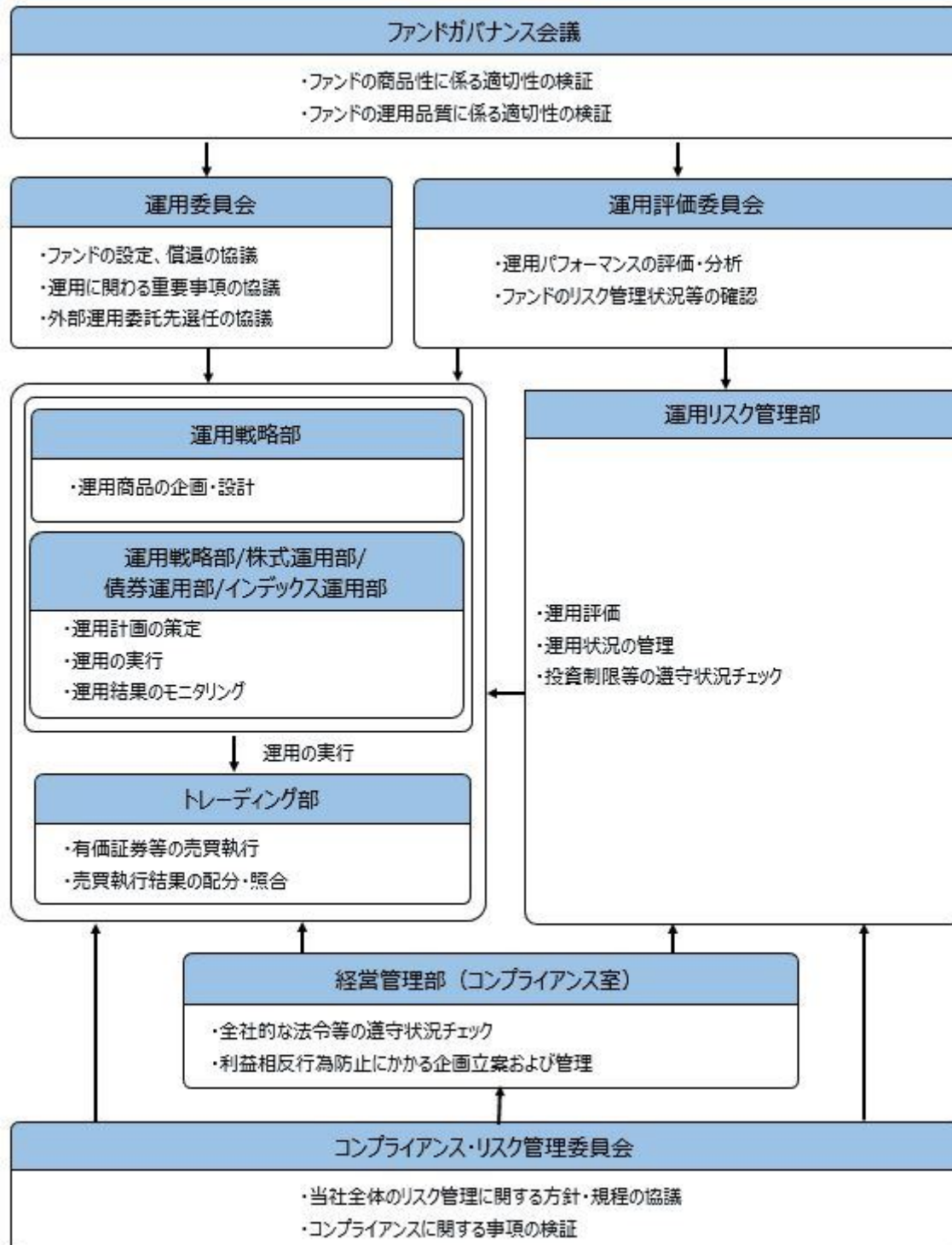
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）</li> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている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</li> <li>・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）</li> </ul>
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	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。
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



ファンドガバナンス会議は3名程度、運用委員会は5名程度、運用評価委員会は5名程度、コンプライアンス

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ともに、流動性リスクを含む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、2022年1月1日現在のものであり、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、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3) 留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。  
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>

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

<分配金受取りコース（一般コース）>

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

#### （５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<FWりそな国内債券インデックスファンド>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。

#### 8) 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取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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8)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。

#### 9) 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を回避するため、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。

#### 10) 金利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を回避するため、金利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. 前記3.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。
5. 金利先渡取引の評価は、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、金利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。

#### 11) 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。

#### 12) 資金の借入れ

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

2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

- 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) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券
    - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
    - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(ホ)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
  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取る配当金も含まれます。))ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

2. 委託者は、信託財産に属する資産の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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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を回避するため、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、金利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. 前記3.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。
5. 金利先渡取引の評価は、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、金利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) 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。

#### 14) 資金の借入れ

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

## 4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## &lt; F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）&gt;

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、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ます。
- 8) 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取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
    - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)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、為替の売予約と合わ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8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

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

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)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。

#### 9) 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。

#### 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 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。
- 13) 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。

#### 14) 資金の借入れ

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

#### < F W 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） >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、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、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。
- 8) 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まれるものとします（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取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)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8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受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取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)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。
- 9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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。

#### 12) 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。

#### 13) 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。

#### 14) 資金の借入れ

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

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

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

4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

2) 投資信託証券（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。

3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のもの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。

#### 7) 投資する株式の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。

#### 8) 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取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)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8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外

貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受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8）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。

#### 9）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。

#### 10）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。

#### 11) 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。

#### 12) 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。

#### 13) 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。

#### 14) 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。

#### 15) 資金の借入れ

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

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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

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

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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、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取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号

から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下口）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て、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) 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。

### 14) 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。

### 15) 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。

### 16) 資金の借入れ

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

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券
  - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
  - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
    - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有

価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、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取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受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取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマ

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

- 4．前記3．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 6．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
  3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
  4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および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) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券
  - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
  - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
  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取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

2. 委託者は、信託財産に属する資産の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わが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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を回避するため、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、金利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. 前記3.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。
5. 金利先渡取引の評価は、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、金利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) 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。

#### 14) 資金の借入れ

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

#### < F W りそな先進国リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合

は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券
    - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
    - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
  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取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えるこ

ととなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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) 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。

八) 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。

#### 14) 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。

#### 15) 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。

#### 16) 資金の借入れ

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

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

##### < F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

##### ・金利（債券価格）変動リスク

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

##### 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。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてNOMURA - B P I総合（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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。

#### 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。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX、配当込み）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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

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

#### < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

##### ・ 金利（債券価格）変動リスク

金利（債券価格）は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇（低下）した場合は値下がり（値上がり）します。債

券価格が値下がりした場合は、基準価額の下落要因となります。

・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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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

## &lt; F W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） &gt;

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

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

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

## 市場リスク

## ・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。

## ・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。当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることとしていますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替変動の影響を受け、基準価額が下落する場合があります。また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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

###### ・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。

###### ・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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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。

###### ・ 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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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

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。

### <FWりそな新興国株式インデックスファンド>

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。

##### ・ 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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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。



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

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

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

#### 市場リスク

##### ・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。

#### 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。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証REIT指数（配当込み）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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戻りに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさ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。

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・ リートの価格変動リスク

リーートの価格は、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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさ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、流動性リスクを含む運用リスクの状況、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、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および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。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。

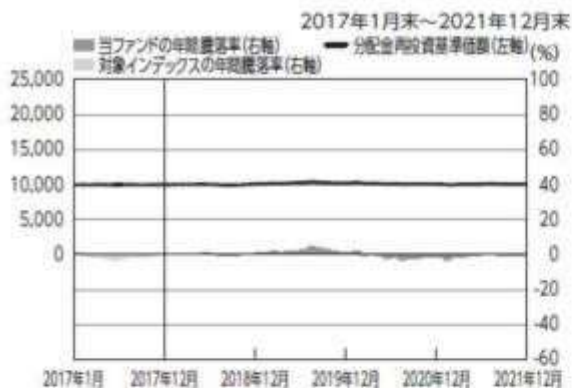
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取り締り役会等に報告します。

上記体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 〔参考情報〕

## FWりそな国内債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

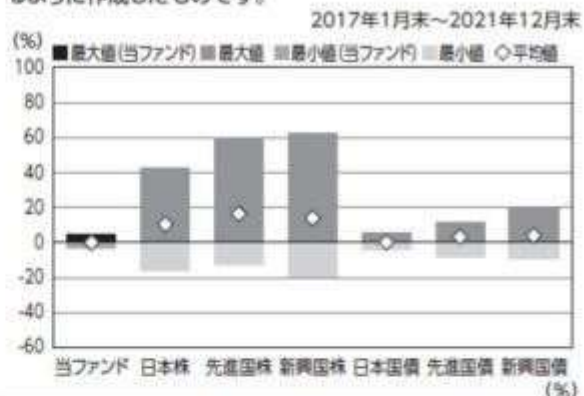


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	4.5	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△3.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	△0.1	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな国内株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

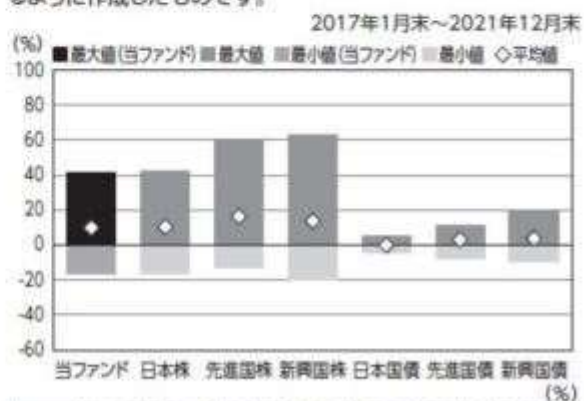


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

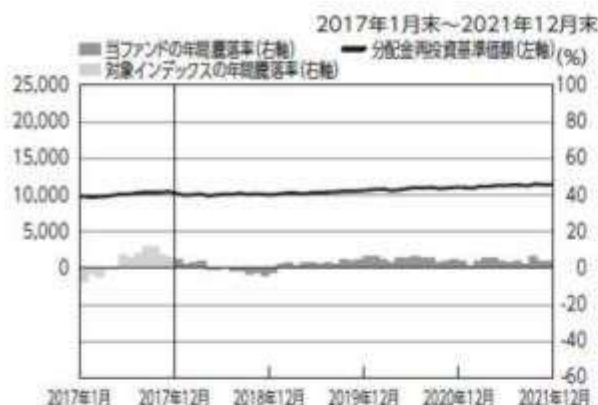


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	41.6	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△16.3	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	10.3	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

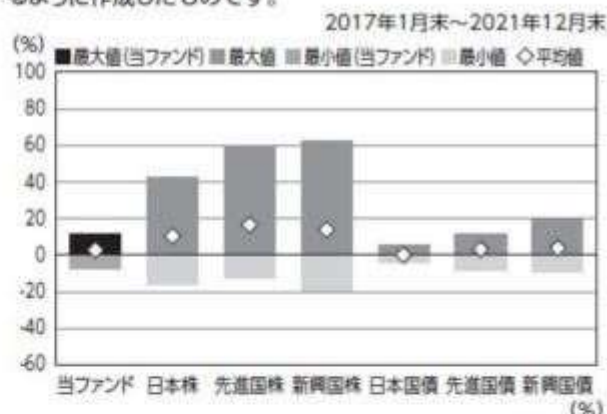


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

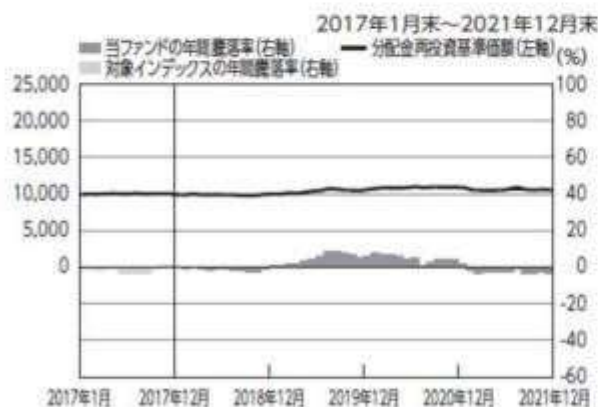


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	11.3	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△7.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	2.9	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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)

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

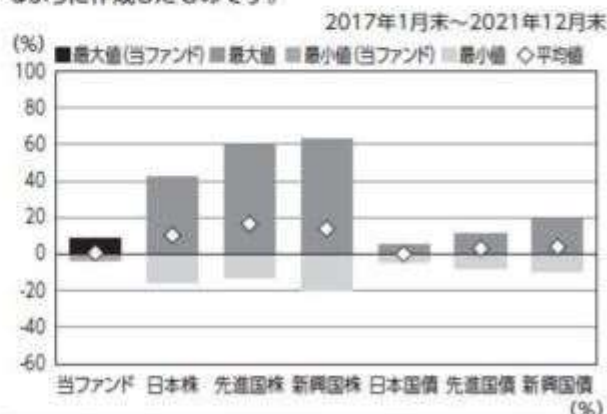


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.7	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△3.8	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	0.9	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな新興国債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	19.0	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△13.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	1.8	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな先進国株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

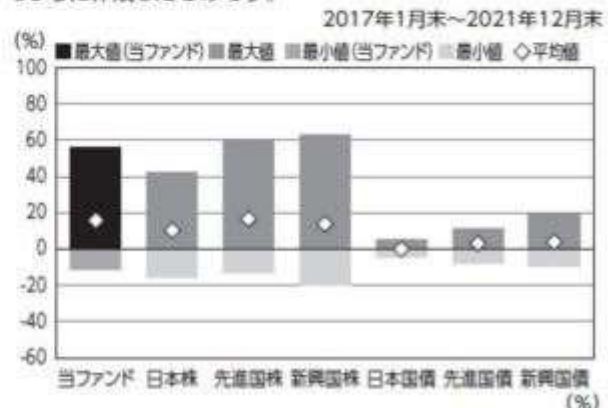


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	56.0	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△11.4	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	16.1	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな新興国株式インデックスファンド

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

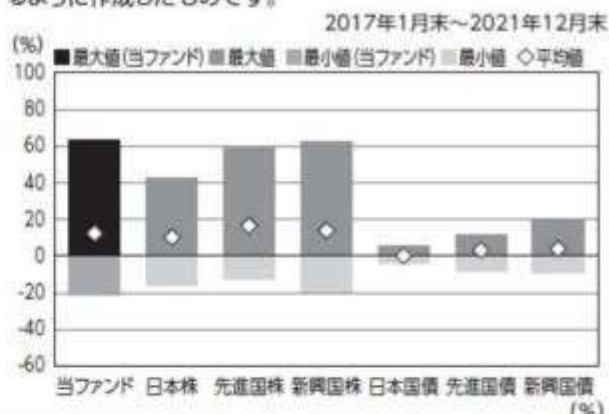


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	62.8	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△21.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	12.6	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな国内リートインデックスファンド

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

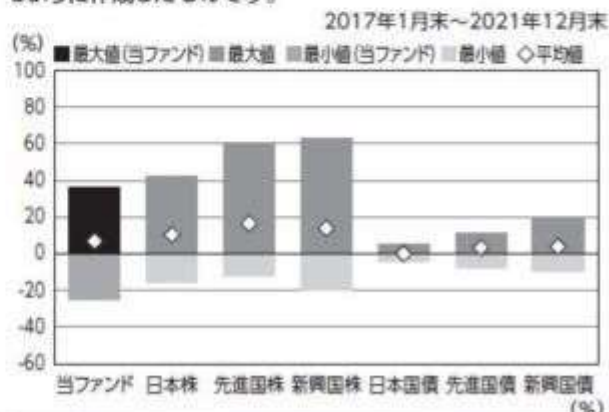


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

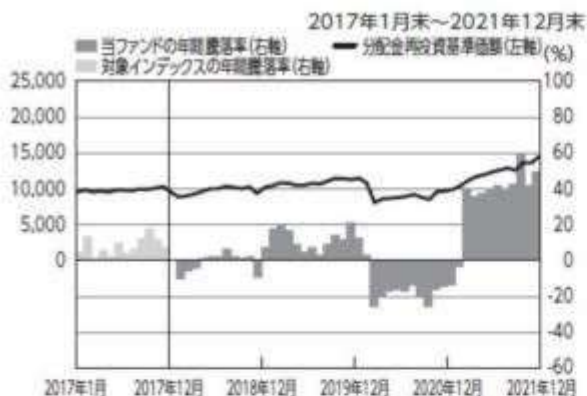


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	35.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△24.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	7.0	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## FWりそな先進国リートインデックスファンド

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

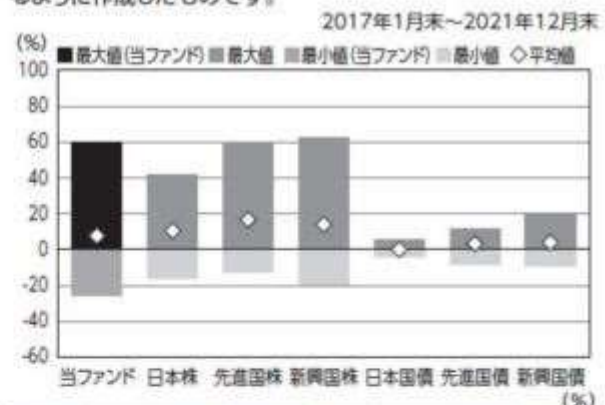


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	60.2	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△25.6	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値	7.7	10.6	16.8	13.9	0.1	3.3	4.0

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 各資産クラスの指数

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

## ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

## 東証株価指数(TOPIX, 配当込み)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

## JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】



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、各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。

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

年率0.275%（税抜0.250%）

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

年率0.330%（税抜0.300%）

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

年率0.385%（税抜0.350%）

< F W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） >

年率0.385%（税抜0.350%）

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

年率0.605%（税抜0.550%）

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

年率0.440%（税抜0.400%）

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

年率0.660%（税抜0.600%）

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

年率0.330%（税抜0.300%）

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

年率0.440%（税抜0.400%）

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。

ファンド	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
F Wりそな国内債券インデックスファンド	0.250%	0.190%		
F Wりそな国内株式インデックスファンド	0.300%	0.240%		
F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	0.350%	0.290%		
F W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）	0.350%	0.290%		
F Wりそな新興国債券インデックスファンド	0.550%	0.490%	0.030%	0.030%
F Wりそな先進国株式インデックスファンド	0.400%	0.340%		
F Wりそな新興国株式インデックスファンド	0.600%	0.540%		
F Wりそな国内リートインデックスファンド	0.300%	0.240%		
F Wりそな先進国リートインデックスファンド	0.400%	0.340%		

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

#### 支払時期

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（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す（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

##### 個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（「国内株インデックス」のみ配当控除の適用があります。その他のファンドは、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）<sup>\*</sup>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せん。）を控除した利益

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

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

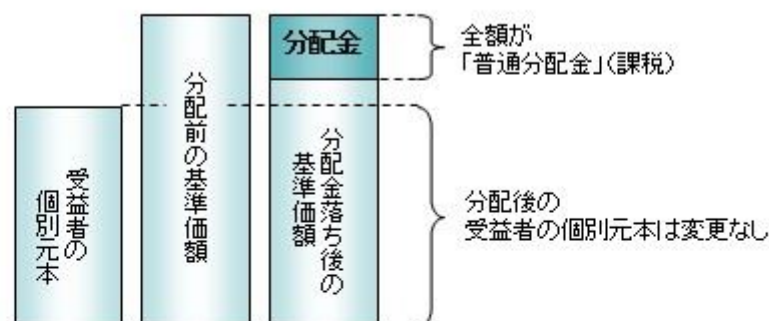
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

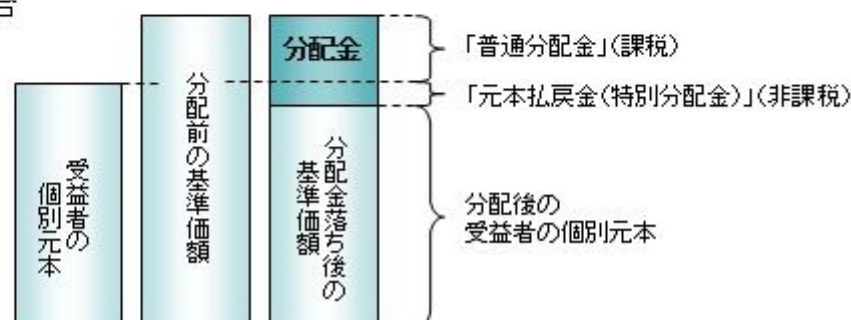
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

##### イ) の場合



##### ロ)、ハ) の場合



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

上記は2021年12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】

### 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	75,867,629,200	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		52,635,469	0.07
合計（純資産総額）		75,920,264,669	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	RM国内債券マザーファンド	72,186,136,252	1.0532	76,033,318,603	1.0510	75,867,629,200	99.93

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.93
合計	99.93

##### 【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 (2017年12月11日)	28,958	28,958	0.9997	0.9997
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,611	47,611	1.0020	1.0020
第3計算期間末 (2019年12月10日)	40,701	40,701	1.0188	1.0188
第4計算期間末 (2020年12月10日)	46,501	46,501	1.0102	1.0102
第5計算期間末 (2021年12月10日)	74,613	74,613	1.0064	1.0064
2020年12月末日	47,542		1.0082	
2021年 1月末日	47,642		1.0055	
2月末日	48,096		0.9969	
3月末日	50,486		1.0035	
4月末日	52,539		1.0052	
5月末日	54,836		1.0054	
6月末日	57,944		1.0057	
7月末日	61,416		1.0104	
8月末日	63,903		1.0094	
9月末日	65,762		1.0057	
10月末日	70,434		1.0044	
11月末日	73,276		1.0065	
12月末日	75,920		1.0041	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.03
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.23
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1.68
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.84

第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.38
-----	-------------------------	------

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,909,645,686	1,943,062,889
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	26,877,211,328	8,328,798,276
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	13,059,303,045	20,624,350,895
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	29,799,407,229	23,715,579,475
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	34,983,169,463	6,880,130,632

(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。

#### 【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	32,627,190,510	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,130,723	0.05
合計（純資産総額）		32,643,321,233	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国内株式マザーファンド	22,385,722,477	1.4435	32,313,850,409	1.4575	32,627,190,510	99.95

##### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

## 【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 (2017年12月11日)	8,186	8,186	1.1849	1.1849
第2計算期間末 (2018年12月10日)	16,834	16,834	1.0571	1.0571
第3計算期間末 (2019年12月10日)	24,185	24,185	1.1689	1.1689
第4計算期間末 (2020年12月10日)	21,542	21,542	1.2313	1.2313
第5計算期間末 (2021年12月10日)	31,643	31,643	1.3938	1.3938
2020年12月末日	22,391		1.2524	
2021年 1月末日	22,742		1.2550	
2月末日	23,388		1.2938	
3月末日	24,832		1.3672	
4月末日	24,511		1.3282	
5月末日	25,977		1.3460	
6月末日	27,799		1.3616	
7月末日	28,935		1.3316	
8月末日	31,122		1.3732	
9月末日	33,443		1.4326	
10月末日	30,214		1.4118	
11月末日	30,276		1.3603	
12月末日	32,643		1.4071	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	18.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10.79
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	10.58
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.34
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	13.20

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	8,464,438,150	1,555,516,946
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10,773,198,886	1,757,205,923
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,880,522,314	4,115,126,539
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	16,155,770,869	19,351,002,239
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	11,958,495,826	6,750,147,822

(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。

## 【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

以下の運用状況は2021年12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	33,944,110,599	99.94
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		19,428,477	0.06
合計（純資産総額）		33,963,539,076	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	30,610,614,663	1.1014	33,715,814,352	1.1089	33,944,110,599	99.94

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

#### 【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 (2017年12月11日)	8,788	8,788	1.0508	1.0508
第2計算期間末 (2018年12月10日)	19,813	19,813	1.0139	1.0139
第3計算期間末 (2019年12月10日)	23,444	23,444	1.0437	1.0437
第4計算期間末 (2020年12月10日)	20,009	20,009	1.1028	1.1028
第5計算期間末 (2021年12月10日)	33,353	33,353	1.1358	1.1358
2020年12月末日	20,387		1.1043	
2021年 1月末日	22,487		1.1025	
2月末日	22,636		1.0924	
3月末日	23,895		1.1159	
4月末日	26,117		1.1152	
5月末日	27,589		1.1293	
6月末日	29,006		1.1274	
7月末日	30,557		1.1348	
8月末日	31,797		1.1342	
9月末日	32,426		1.1260	
10月末日	32,063		1.1499	
11月末日	32,766		1.1367	
12月末日	33,963		1.1433	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	5.08
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	3.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2.94
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.66
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.99

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	9,816,051,299	1,452,754,871
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	16,644,523,180	5,465,983,147
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,262,356,144	5,341,817,591
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	9,148,589,469	13,467,741,798
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	15,847,941,724	4,626,601,163

(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。

## 【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）】

以下の運用状況は2021年12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	175,010,166,692	99.94
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）		101,587,234	0.06

合計（純資産総額）	175,111,753,926	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）	168,847,242,347	1.0477	176,916,136,555	1.0365	175,010,166,692	99.94

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

### 【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 (2017年12月11日)	28,986	28,986	1.0090	1.0090
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,560	47,560	0.9899	0.9899
第3計算期間末 (2019年12月10日)	60,513	60,513	1.0475	1.0475
第4計算期間末 (2020年12月10日)	107,828	107,828	1.0929	1.0929
第5計算期間末 (2021年12月10日)	174,814	174,814	1.0638	1.0638
2020年12月末日	109,987		1.0938	
2021年 1月末日	110,606		1.0866	
2月末日	109,410		1.0543	
3月末日	115,364		1.0518	
4月末日	121,635		1.0505	
5月末日	127,214		1.0520	

6月末日	134,786		1.0560
7月末日	144,244		1.0740
8月末日	150,287		1.0740
9月末日	152,081		1.0567
10月末日	164,156		1.0560
11月末日	171,130		1.0621
12月末日	175,111		1.0521

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1.89
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	5.82
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	4.33
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.66

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,662,448,431	1,934,517,343
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	27,497,514,870	8,180,419,930
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25,565,889,158	15,842,703,502
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	56,096,556,318	15,203,108,711
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	80,271,983,006	14,598,777,195

(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。

## 【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	1,467,395,648	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		844,351	0.06
合計（純資産総額）		1,468,239,999	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新興国債券マザーファンド	1,352,189,134	1.0662	1,441,757,761	1.0852	1,467,395,648	99.94

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

#### 【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 (2017年12月11日)	742	742	1.0790	1.0790
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,769	1,769	0.9796	0.9796
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,302	2,302	1.0120	1.0120

第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,024	1,024	0.9926	0.9926
第5計算期間末 (2021年12月10日)	1,426	1,426	0.9714	0.9714
2020年12月末日	1,040		0.9975	
2021年 1月末日	1,005		0.9911	
2月末日	1,012		0.9891	
3月末日	1,039		0.9832	
4月末日	1,119		1.0023	
5月末日	1,194		1.0262	
6月末日	1,249		1.0248	
7月末日	1,256		1.0100	
8月末日	1,305		1.0071	
9月末日	1,317		0.9958	
10月末日	1,406		1.0005	
11月末日	1,390		0.9603	
12月末日	1,468		0.9883	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	9.21
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	3.31
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1.92
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2.14

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第1期	2017年 1月 5日 ~ 2017年12月11日	735,295,511	47,003,360
第2期	2017年12月12日 ~ 2018年12月10日	1,230,517,990	112,441,673
第3期	2018年12月11日 ~ 2019年12月10日	1,175,865,521	706,944,106
第4期	2019年12月11日 ~ 2020年12月10日	748,245,689	1,991,499,982
第5期	2020年12月11日 ~ 2021年12月10日	651,451,475	214,615,821

(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。

### 【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	54,443,842,683	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		21,522,362	0.04
合計(純資産総額)		54,465,365,045	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先進国株式マザーファンド	25,648,392,464	2.0425	52,387,377,107	2.1227	54,443,842,683	99.96

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

##### 【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 (2017年12月11日)	5,912	5,912	1.1507	1.1507
第2計算期間末 (2018年12月10日)	6,033	6,033	1.1001	1.1001
第3計算期間末 (2019年12月10日)	17,429	17,429	1.2657	1.2657
第4計算期間末 (2020年12月10日)	31,822	31,822	1.4153	1.4153
第5計算期間末 (2021年12月10日)	51,648	51,648	1.9064	1.9064
2020年12月末日	32,802		1.4335	
2021年 1月末日	33,748		1.4630	
2月末日	35,051		1.5119	
3月末日	37,818		1.6139	
4月末日	37,090		1.6889	
5月末日	39,368		1.7133	
6月末日	42,606		1.7548	
7月末日	42,951		1.7800	
8月末日	46,078		1.8238	
9月末日	46,454		1.7806	
10月末日	48,826		1.9104	
11月末日	50,434		1.9034	
12月末日	54,465		1.9807	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	15.07
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	4.40



第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	15.05
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	11.82
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	34.70

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	6,405,695,993	1,267,334,524
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	6,421,790,557	6,075,525,169
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	11,072,413,261	2,786,271,649
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	18,203,027,051	9,489,999,213
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	14,296,687,169	9,688,090,753

(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。

#### 【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	4,078,371,896	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,512,175	0.04
合計（純資産総額）		4,079,884,071	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新興国株式マザーファンド	2,492,282,997	1.6495	4,111,071,317	1.6364	4,078,371,896	99.96

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.96

合 計	99.96
-----	-------

## 【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 (2017年12月11日)	873	873	1.2449	1.2449
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,999	1,999	1.0986	1.0986
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,810	2,810	1.1520	1.1520
第4計算期間末 (2020年12月10日)	3,068	3,068	1.3227	1.3227
第5計算期間末 (2021年12月10日)	4,064	4,064	1.4467	1.4467
2020年12月末日	3,110		1.3293	
2021年 1月末日	3,482		1.4307	
2月末日	3,268		1.4789	
3月末日	3,369		1.4790	
4月末日	3,601		1.5084	
5月末日	3,783		1.5157	
6月末日	4,061		1.5506	
7月末日	3,850		1.4463	
8月末日	4,029		1.4421	
9月末日	4,150		1.4301	
10月末日	3,977		1.4848	
11月末日	3,927		1.4193	
12月末日	4,079		1.4343	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000

第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年1月5日～2017年12月11日	24.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.75
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	4.86
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.82
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	9.37

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

## (4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2017年1月5日～2017年12月11日	814,658,599	112,792,530
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,273,924,653	155,611,382
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,307,480,891	687,984,458
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,443,169,223	1,563,370,580
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	1,505,271,269	1,014,998,282

(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。

## 【FWりそな国内リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	5,114,450,347	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,505,306	0.05
合計(純資産総額)		5,116,955,653	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	RM国内リートマザーファンド	3,399,209,323	1.5037	5,111,527,947	1.5046	5,114,450,347	99.95

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

#### 【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 (2017年12月11日)	1,168	1,168	0.9275	0.9275
第2計算期間末 (2018年12月10日)	2,602	2,602	1.0343	1.0343
第3計算期間末 (2019年12月10日)	3,360	3,360	1.2962	1.2962
第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,675	1,675	1.0464	1.0464
第5計算期間末 (2021年12月10日)	5,010	5,010	1.3215	1.3215
2020年12月末日	1,801		1.1052	
2021年 1月末日	4,289		1.1478	
2月末日	4,405		1.2065	
3月末日	4,724		1.2606	
4月末日	4,497		1.2946	
5月末日	4,742		1.3034	
6月末日	5,203		1.3548	
7月末日	5,235		1.3645	
8月末日	5,451		1.3605	
9月末日	5,471		1.3175	
10月末日	4,755		1.3327	
11月末日	4,760		1.2780	
12月末日	5,116		1.3217	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.25
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25.32
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	19.27
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	26.29

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

## （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,436,731,064	176,969,258
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,606,741,957	350,251,304
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,116,951,844	1,041,002,462
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,323,744,119	2,315,201,107
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	3,961,300,689	1,770,182,099

(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。

## 【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2021年12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	5,793,874,191	99.96

コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,285,070	0.04
合計（純資産総額）		5,796,159,261	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先進国リートマザーファンド	3,773,281,792	1.4510	5,475,316,252	1.5355	5,793,874,191	99.96

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

## 【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 (2017年12月11日)	1,518	1,518	1.0266	1.0266
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,887	1,887	1.0271	1.0271
第3計算期間末 (2019年12月10日)	4,089	4,089	1.1296	1.1296
第4計算期間末 (2020年12月10日)	4,075	4,075	0.9678	0.9678
第5計算期間末 (2021年12月10日)	5,414	5,414	1.3700	1.3700
2020年12月末日	4,134		0.9697	
2021年 1月末日	4,536		0.9919	
2月末日	4,766		1.0436	
3月末日	5,242		1.1201	
4月末日	4,594		1.1711	

5月末日	4,914		1.1969
6月末日	5,323		1.2329
7月末日	5,327		1.2636
8月末日	5,665		1.2894
9月末日	5,707		1.2590
10月末日	5,127		1.3676
11月末日	5,285		1.3608
12月末日	5,796		1.4495

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	2.66
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.05
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	9.98
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.32
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	41.56

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,618,331,745	138,782,803
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,601,705,660	1,243,412,814
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2,308,663,405	525,928,645
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	3,083,593,311	2,492,581,409
第5期	2020年12月11日～2021年12月10日	2,372,238,888	2,631,489,022

(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12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	107,871,750,210	83.39
地方債証券	日本	6,920,501,905	5.35
特殊債券	日本	7,809,948,073	6.04
社債券	日本	5,436,284,000	4.20
	フランス	200,278,000	0.15
	オーストラリア	100,099,000	0.08
	小計	5,736,661,000	4.43
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,014,444,213	0.78
合計（純資産総額）		129,353,305,401	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）	1,980,000,000	100.68	1,993,643,800	100.44	1,988,751,600	0.100	2024/3/20	1.54
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	1,970,000,000	100.71	1,984,117,100	100.48	1,979,456,000	0.100	2024/6/20	1.53
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	1,630,000,000	100.93	1,645,186,400	100.71	1,641,589,300	0.100	2025/6/20	1.27
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	1,490,000,000	100.61	1,499,188,500	100.40	1,495,989,800	0.100	2023/12/20	1.16
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	1,470,000,000	100.47	1,477,034,100	100.42	1,476,218,100	0.100	2031/6/20	1.14
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	1,460,000,000	100.94	1,473,797,100	100.75	1,471,008,400	0.100	2025/12/20	1.14
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	1,380,000,000	100.94	1,393,084,100	100.72	1,390,005,000	0.100	2025/9/20	1.07
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	1,320,000,000	100.51	1,326,813,200	100.59	1,327,867,200	0.100	2031/3/20	1.03
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	1,280,000,000	101.11	1,294,259,800	100.92	1,291,788,800	0.100	2026/12/20	1.00
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	1,280,000,000	100.80	1,290,256,700	100.57	1,287,398,400	0.100	2024/12/20	1.00
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	1,250,000,000	101.03	1,262,930,500	101.08	1,263,525,000	0.100	2029/9/20	0.98



日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	1,250,000,000	100.72	1,259,017,500	100.52	1,256,612,500	0.100	2024/9/20	0.97
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	1,230,000,000	101.23	1,245,218,600	101.02	1,242,644,400	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	1,200,000,000	101.12	1,213,550,900	101.03	1,212,444,000	0.100	2029/12/20	0.94
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	1,200,000,000	100.48	1,205,819,000	100.37	1,204,548,000	0.005	2026/3/20	0.93
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	100.29	1,183,433,800	0.100	2023/6/20	0.91
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	100.94	1,160,810,000	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	1,150,000,000	100.53	1,156,161,000	100.40	1,154,623,000	0.005	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第423回利付国債（2年）	1,130,000,000	100.22	1,132,507,900	100.12	1,131,389,900	0.005	2023/4/1	0.87
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	1,120,000,000	101.20	1,133,526,000	100.97	1,130,908,800	0.100	2027/9/20	0.87
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	1,110,000,000	101.18	1,123,101,600	101.08	1,122,010,200	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	1,100,000,000	101.14	1,112,577,900	101.01	1,111,187,000	0.100	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	1,070,000,000	100.86	1,079,283,800	100.62	1,076,698,200	0.100	2025/3/20	0.83
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	100.34	1,073,659,400	0.100	2023/9/20	0.83
日本	国債証券	第426回利付国債（2年）	1,010,000,000	100.21	1,012,187,600	100.15	1,011,575,600	0.005	2023/7/1	0.78
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	100.23	1,002,350,000	0.100	2023/3/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	980,000,000	100.14	981,444,900	100.71	987,007,000	0.100	2030/12/20	0.76
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	960,000,000	101.16	971,181,100	100.85	968,160,000	0.100	2026/9/20	0.75
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	934,000,000	102.47	957,153,860	101.84	951,204,280	0.400	2025/9/20	0.74
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	870,000,000	101.21	880,544,600	101.12	879,752,700	0.100	2029/3/20	0.68

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.39
地方債証券	5.35
特殊債券	6.04
社債券	4.43
合計	99.22

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年12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	65,117,389,170	99.36
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		421,089,660	0.64
合計（純資産総額）		65,538,478,830	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	697,200,000	1.06

(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	1,210,400	1,717.66	2,079,067,458	2,105.50	2,548,497,200	3.89
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	149,700	11,196.83	1,676,166,116	14,475.00	2,166,907,500	3.31
日本	株式	キーエンス	電気機器	21,700	59,036.04	1,281,082,253	72,280.00	1,568,476,000	2.39
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	176,100	5,625.28	990,612,264	6,972.00	1,227,769,200	1.87
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	15,200	47,145.52	716,611,989	66,280.00	1,007,456,000	1.54
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,478,100	552.51	816,678,860	624.90	923,664,690	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	61,900	13,383.26	828,423,918	13,520.00	836,888,000	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	40,200	18,969.10	762,558,122	19,920.00	800,784,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	46,600	14,563.15	678,643,100	17,110.00	797,326,000	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	30,400	23,195.85	705,153,934	26,090.00	793,136,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	245,300	2,869.28	703,834,390	3,150.00	772,695,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	140,600	8,022.14	1,127,914,029	5,434.00	764,020,400	1.17
日本	株式	任天堂	その他製品	13,500	59,448.47	802,554,357	53,650.00	724,275,000	1.11
日本	株式	日立製作所	電気機器	114,900	5,306.34	609,698,748	6,230.00	715,827,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	176,400	3,124.87	551,228,791	3,652.00	644,212,800	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	163,100	3,623.09	590,926,479	3,943.00	643,103,300	0.98

日本	株式	村田製作所	電気機器	70,200	9,629.57	675,996,440	9,157.00	642,821,400	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	188,100	3,103.93	583,849,534	3,230.00	607,563,000	0.93
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	187,800	3,654.26	686,271,563	3,137.00	589,128,600	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	164,600	3,230.20	531,691,412	3,518.00	579,062,800	0.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	170,900	3,375.23	576,828,502	3,362.00	574,565,800	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	187,800	3,150.05	591,579,677	2,925.00	549,315,000	0.84
日本	株式	S M C	機械	7,000	67,388.65	471,720,598	77,590.00	543,130,000	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	27,000	16,953.89	457,755,211	19,395.00	523,665,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	355,200	1,469.15	521,843,397	1,454.50	516,638,400	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	21,000	25,809.39	541,997,325	24,380.00	511,980,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	52,600	6,856.04	360,628,187	9,529.00	501,225,400	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	182,800	2,259.42	413,022,207	2,723.50	497,855,800	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	77,600	5,512.47	427,767,896	6,392.00	496,019,200	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	92,100	4,432.40	408,224,085	5,056.00	465,657,600	0.71

#### 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	0.23
		建設業	2.20
		食料品	3.25
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.71
		医薬品	4.75
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.74
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.63
		機械	5.51
		電気機器	20.02
		輸送用機器	8.06
		精密機器	2.89
		その他製品	2.21
		電気・ガス業	1.05
陸運業	2.91		
海運業	0.51		
空運業	0.39		

	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.93
	卸売業	5.25
	小売業	4.05
	銀行業	4.71
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.96
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.82
	サービス業	6.26
合 計		99.36

### 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	35	日本円	690,569,250	697,200,000	1.06

(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先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年12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	21,238,961,362	47.24
	カナダ	871,022,470	1.94
	メキシコ	311,274,558	0.69
	ドイツ	3,253,514,736	7.24
	イタリア	3,917,765,740	8.71
	フランス	4,440,941,012	9.88
	オランダ	824,046,646	1.83
	スペイン	2,573,464,534	5.72
	ベルギー	986,170,085	2.19
	オーストリア	610,360,722	1.36
	フィンランド	256,998,164	0.57
	アイルランド	341,346,492	0.76

	イギリス	2,669,552,379	5.94
	スウェーデン	127,969,156	0.28
	ノルウェー	105,941,018	0.24
	デンマーク	195,207,838	0.43
	ポーランド	212,794,208	0.47
	オーストラリア	750,218,768	1.67
	シンガポール	197,703,003	0.44
	マレーシア	210,249,202	0.47
	中国	188,905,692	0.42
	イスラエル	214,126,504	0.48
	小計	44,498,534,289	98.98
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		460,156,571	1.02
合計（純資産総額）		44,958,690,860	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	11,497.04	356,408,314	11,439.09	354,612,034	0.125	2023/4/30	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	11,381.22	261,768,267	11,146.15	256,361,608	0.375	2025/11/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	11,288.30	238,183,192	11,220.73	236,757,597	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	11,073.48	232,543,085	10,912.97	229,172,392	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,010,000	11,470.09	230,548,965	11,341.15	227,957,143	0.250	2024/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,760,000	11,785.16	207,418,843	11,619.71	204,506,982	1.625	2031/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,890,000	11,011.08	208,109,461	10,701.80	202,264,042	0.625	2030/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,511.49	195,695,366	11,444.49	194,556,330	1.375	2028/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	11,044.75	189,969,756	11,138.06	191,574,780	1.125	2031/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	12,124.03	186,710,183	11,837.62	182,299,405	2.125	2024/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	11,481.78	181,412,223	11,433.25	180,645,463	0.750	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,560,000	11,473.80	178,991,330	11,423.37	178,204,608	0.125	2023/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	11,540.10	178,871,603	11,377.09	176,344,975	1.250	2028/5/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,488.19	172,322,964	11,368.55	170,528,376	0.125	2023/12/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	11,503.84	164,504,917	11,469.32	164,011,349	0.125	2022/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,410,000	11,847.39	167,048,218	11,626.90	163,939,341	1.500	2026/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,090,000	14,819.61	161,533,768	14,933.28	162,772,752	3.375	2048/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,380,000	11,524.80	159,042,346	11,613.42	160,265,274	2.000	2051/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	12,535.85	159,205,387	12,591.09	159,906,914	2.375	2051/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	12,149.26	159,155,341	11,977.35	156,903,361	2.250	2041/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	700,000	24,131.44	168,920,099	22,327.91	156,295,383	4.500	2041/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	12,510.22	162,632,881	11,970.16	155,612,172	2.250	2025/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	10,832.76	154,908,559	10,728.75	153,421,263	0.625	2030/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	11,320.07	153,953,057	11,164.57	151,838,252	0.500	2026/2/28	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,340,000	10,598.96	142,026,190	11,270.16	151,020,173	1.875	2051/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,444.26	152,208,658	11,349.68	150,950,853	0.125	2024/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,459.78	152,415,159	11,329.02	150,675,969	0.250	2024/6/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	11,253.10	153,042,197	10,931.84	148,673,040	0.500	2027/10/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	11,490.68	149,378,900	11,431.45	148,608,972	0.125	2023/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	13,222.35	154,701,583	12,552.90	146,868,980	2.875	2028/8/15	0.33

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.98
合計	98.98

## 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12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	146,564,245,205	48.02
	カナダ	5,976,846,934	1.96
	メキシコ	2,178,078,446	0.71
	ドイツ	22,438,238,969	7.35
	イタリア	26,995,160,692	8.85
	フランス	30,484,650,029	9.99
	オランダ	5,802,936,799	1.90
	スペイン	17,732,205,956	5.81
	ベルギー	6,838,282,945	2.24
	オーストリア	4,198,584,001	1.38
	フィンランド	1,785,278,817	0.58
	アイルランド	2,403,939,153	0.79
	イギリス	18,441,943,528	6.04
	スウェーデン	875,406,379	0.29
ノルウェー	744,832,026	0.24	

	デンマーク	1,328,363,401	0.44
	ポーランド	1,470,550,255	0.48
	オーストラリア	5,133,055,284	1.68
	シンガポール	1,370,157,037	0.45
	マレーシア	1,460,043,326	0.48
	中国	1,315,502,877	0.43
	イスラエル	1,460,828,566	0.48
	小計	306,999,130,625	100.59
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,805,412,559	0.59
合計（純資産総額）		305,193,718,066	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		312,684,642,568	102.45

(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	16,620,000	11,081.45	1,841,738,341	11,063.48	1,838,751,415	0.750	2028/1/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,850,000	11,676.32	1,617,171,236	11,619.71	1,609,330,516	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,740,000	11,189.73	1,537,469,994	11,138.06	1,530,370,634	1.125	2031/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,510,000	11,283.60	1,524,414,448	11,220.73	1,515,921,878	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,620,000	10,958.34	1,492,527,258	10,912.97	1,486,346,661	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,650,000	10,737.74	1,465,702,194	10,701.80	1,460,795,872	0.625	2030/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	11,317.33	1,301,493,968	11,310.15	1,300,667,261	0.875	2026/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,280,000	11,459.31	1,292,610,854	11,457.96	1,292,458,795	0.125	2023/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,850,000	11,844.81	1,285,162,157	11,842.11	1,284,869,758	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	11,431.01	1,257,411,188	11,417.08	1,255,879,007	1.125	2026/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	11,449.43	1,247,988,007	11,448.08	1,247,841,197	0.125	2023/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,440,000	12,831.01	1,211,248,221	12,591.09	1,188,599,427	2.375	2051/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,300,000	11,431.90	1,177,486,639	11,431.45	1,177,440,317	0.125	2023/5/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,560,000	11,173.11	1,179,880,849	11,041.92	1,166,026,752	1.750	2041/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,140,000	12,125.62	1,108,281,986	11,977.35	1,094,730,320	2.250	2041/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,760.21	1,088,933,323	10,728.75	1,085,750,475	0.625	2030/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,200,000	11,838.97	1,089,185,406	11,613.42	1,068,435,158	2.000	2051/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,230,000	11,472.50	1,058,911,932	11,469.32	1,058,618,708	0.125	2022/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,589.74	1,056,279,822	12,552.90	1,053,188,677	2.875	2028/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,190,000	11,408.54	1,048,445,400	11,389.22	1,046,669,900	1.250	2028/3/31	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	7,080,000	14,998.29	1,061,879,216	14,731.00	1,042,955,014	1.500	2031/5/25	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,498.40	1,034,856,506	11,486.27	1,033,764,702	1.250	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	11,489.86	1,045,578,064	11,270.16	1,025,584,763	1.875	2051/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,362.71	1,022,644,592	11,363.16	1,022,684,964	0.250	2024/3/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,890,000	11,351.93	1,009,186,982	11,355.52	1,009,506,522	0.375	2024/7/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,560,000	15,502.51	1,016,965,062	15,372.01	1,008,404,246	2.750	2027/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,679.47	992,755,057	11,674.97	992,373,179	1.500	2024/10/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,650,000	11,421.35	987,946,798	11,417.53	987,616,484	0.125	2023/7/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	11,378.89	978,584,694	11,354.63	976,498,233	1.250	2028/9/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,720,000	11,141.21	971,513,901	11,148.40	972,140,760	0.250	2025/7/31	0.32

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	100.59
合計	100.59

## 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	1,291,759,000.00	146,518,032,701	148,569,594,568	48.68
	カナダドル	売建	66,333,000.00	5,916,798,940	5,972,185,521	1.96
	メキシコペソ	売建	406,526,000.00	2,189,444,855	2,269,350,088	0.74
	ユーロ	売建	929,951,000.00	119,192,375,596	121,382,133,257	39.77
	英ポンド	売建	123,958,000.00	18,586,998,490	19,242,161,481	6.30
	スウェーデンクローナ	売建	69,517,000.00	871,659,759	885,820,372	0.29
	ノルウェークローネ	売建	58,209,000.00	734,197,076	761,245,659	0.25
	デンマーククローネ	売建	76,901,000.00	1,325,004,230	1,350,381,560	0.44
	ポーランドズロチ	売建	53,787,000.00	1,493,450,745	1,526,781,645	0.50
	オーストラリアドル	売建	61,393,000.00	4,972,171,365	5,121,404,060	1.68
	シンガポールドル	売建	16,190,000.00	1,345,107,199	1,378,330,790	0.45
	マレーシアリングット	売建	51,690,000.00	1,387,649,064	1,424,736,639	0.47
	中国元	売建	73,560,000.00	1,304,726,363	1,327,912,475	0.44
	イスラエルシェケル	売建	39,972,000.00	1,462,951,216	1,472,604,453	0.48

(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12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	2,060,371,893	28.40
	アイルランド	5,164,674,483	71.18
	小計	7,225,046,376	99.58
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		30,281,352	0.42
合計（純資産総額）		7,255,327,728	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	867,847	6,521.49	5,659,662,489	5,951.13	5,164,674,483	71.18
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	628,532	3,646.13	2,291,711,895	3,278.06	2,060,371,893	28.40

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.58
合計	99.58

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年12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	81,932,866,794	61.91
	カナダ	4,160,200,296	3.14
	パナマ	34,161,623	0.03
	ドイツ	3,052,892,408	2.31
	イタリア	635,750,987	0.48
	フランス	3,715,004,257	2.81
	オランダ	2,376,340,211	1.80
	スペイン	787,326,945	0.59
	ベルギー	271,866,140	0.21
	オーストリア	81,515,884	0.06
	ルクセンブルク	101,987,849	0.08
	フィンランド	437,601,432	0.33
	アイルランド	2,211,390,708	1.67
	ポルトガル	53,296,742	0.04
	イギリス	4,777,006,555	3.61
	スイス	3,984,145,748	3.01
	スウェーデン	1,311,200,743	0.99
	ノルウェー	229,652,252	0.17
	デンマーク	936,962,527	0.71
	ケイマン	218,483,025	0.17
	リベリア	35,213,727	0.03
	オーストラリア	2,195,797,328	1.66
	バミューダ	261,919,670	0.20
	ニュージーランド	107,476,480	0.08
	香港	725,905,353	0.55
	シンガポール	312,339,140	0.24
	イスラエル	255,526,913	0.19
	キュラソー	82,966,824	0.06
	ジャージー	470,674,258	0.36
	マン島	27,571,152	0.02
小計	115,785,043,971	87.49	
投資証券	アメリカ	2,444,133,791	1.85
	カナダ	8,261,206	0.01
	フランス	49,241,146	0.04
	イギリス	78,460,855	0.06
	オーストラリア	168,057,132	0.13
	香港	38,787,558	0.03
	シンガポール	44,741,600	0.03
小計	2,831,683,288	2.14	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,720,479,111	10.37
合計(純資産総額)		132,337,206,370	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	10,428,434,948	7.88
	買建	ドイツ	2,484,325,713	1.88

(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	売建		805,059,851	0.61

(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	290,497	16,210.18	4,709,010,562	20,632.28	5,993,617,651	4.53
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	125,468	27,851.50	3,494,472,670	39,331.08	4,934,793,075	3.73
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,010	387,393.36	3,103,020,848	389,229.98	3,117,732,143	2.36
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	14,795	93,576.30	1,384,461,491	124,933.57	1,848,392,224	1.40
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	5,291	241,683.69	1,278,748,425	337,365.16	1,784,999,072	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	5,064	241,514.11	1,223,027,496	337,018.95	1,706,663,972	1.29
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	メディア・娯楽	41,897	34,086.58	1,428,125,449	39,444.95	1,652,625,439	1.25
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	43,959	18,202.71	800,173,192	34,507.15	1,516,899,816	1.15
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	16,600	42,027.76	697,660,926	58,151.81	965,320,073	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	52,598	16,089.40	846,270,657	18,237.57	959,259,770	0.72
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	46,343	18,963.82	878,840,382	19,731.68	914,425,293	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	18,570	33,997.24	631,328,804	47,254.81	877,521,948	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	42,835	15,259.90	653,658,040	18,885.13	808,944,706	0.61
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	49,856	13,139.40	655,078,165	16,140.03	804,677,754	0.61
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	23,341	28,164.56	657,388,996	34,443.88	803,954,818	0.61

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	29,752	24,124.33	717,747,105	25,093.91	746,594,111	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	133,213	3,881.92	517,122,875	5,133.34	683,827,968	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	7,232	66,210.33	478,833,130	91,813.78	663,997,293	0.50
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	98,807	4,407.59	435,501,136	6,622.85	654,384,098	0.49
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	15,539	38,764.74	602,365,319	41,555.57	645,732,092	0.49
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	12,386	41,070.09	508,694,150	47,901.98	593,313,974	0.45
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	31,972	20,025.83	640,265,905	17,813.14	569,521,949	0.43
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	7,233	54,357.48	393,167,680	77,363.60	559,570,935	0.42
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	8,401	58,819.48	494,142,531	65,479.73	550,095,260	0.42
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	74,415	5,482.07	407,948,748	7,356.67	547,447,283	0.41
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	7,787	64,666.64	503,559,185	70,224.31	546,836,708	0.41
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	11,199	31,437.04	352,063,514	47,781.60	535,106,232	0.40
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	6,937	59,943.37	415,827,199	76,227.20	528,788,118	0.40
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	74,640	5,789.68	432,142,140	7,033.47	524,978,425	0.40
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	7,811	44,058.50	344,140,969	65,304.90	510,096,616	0.39

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	2.95
		素材	3.68
		資本財	5.49
		商業・専門サービス	1.14
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.27
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.62
		メディア・娯楽	6.25
		小売	4.95

	食品・生活必需品小売り	1.28
	食品・飲料・タバコ	3.34
	家庭用品・パーソナル用品	1.55
	ヘルスケア機器・サービス	4.30
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.17
	銀行	5.22
	各種金融	4.20
	保険	2.57
	不動産	0.34
	ソフトウェア・サービス	10.99
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.00
	電気通信サービス	1.28
	公益事業	2.55
	半導体・半導体製造装置	4.85
投資証券		2.14
合計		89.63

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2203	買建	379	米ドル	88,321,015	10,158,683,146	90,666,275	10,428,434,948	7.88
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002203	買建	784	ユーロ	18,516,454	2,416,582,413	19,035,520	2,484,325,713	1.88

(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	売建	5,282,000.00	607,482,820	607,506,060	0.46
	カナダドル	売建	284,000.00	25,568,520	25,569,769	0.02
	ユーロ	売建	770,000.00	100,516,570	100,502,787	0.08
	英ポンド	売建	246,000.00	38,189,040	38,187,195	0.03
	スイスフラン	売建	144,000.00	18,112,608	18,111,600	0.01
	オーストラリアドル	売建	182,000.00	15,184,078	15,182,440	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。

以下の運用状況は2021年12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	52,821,273	0.28
	メキシコ	327,499,392	1.74
	ブラジル	642,133,404	3.41
	チリ	60,382,483	0.32
	コロンビア	28,574,792	0.15
	ペルー	4,039,348	0.02
	オランダ	45,587,296	0.24
	ルクセンブルク	12,111,866	0.06
	ギリシャ	34,092,774	0.18
	トルコ	41,347,201	0.22
	チェコ	22,297,156	0.12
	キプロス	23,336,307	0.12
	ハンガリー	38,186,254	0.20
	ポーランド	117,743,011	0.63
	ロシア	507,897,589	2.70
	ケイマン	3,060,718,134	16.26
	バミューダ	87,168,216	0.46
	香港	189,375,972	1.01
	シンガポール	2,968,437	0.02
	マレーシア	226,272,182	1.20
	タイ	276,938,046	1.47
	フィリピン	120,671,933	0.64
	インドネシア	241,742,880	1.28
	韓国	2,146,799,952	11.40
	台湾	2,587,360,758	13.74
	中国	1,925,891,867	10.23
	インド	2,052,977,670	10.90
	カタール	128,405,205	0.68
	エジプト	12,562,631	0.07
	南アフリカ	504,203,671	2.68
	ジャージー	12,554,274	0.07
	英ヴァージン諸島	2,947,444	0.02
アラブ首長国連邦	183,410,125	0.97	
マン島	6,048,927	0.03	
クウェート	100,841,008	0.54	
サウジアラビア	549,106,969	2.92	

	小計	16,377,016,447	86.98
投資証券	メキシコ	7,049,768	0.04
	南アフリカ	6,914,655	0.04
	小計	13,964,423	0.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,436,464,768	12.94
合計（純資産総額）		18,827,445,638	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	2,061,246,959	10.95

(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		897,202	0.00
	売建		364,917,962	1.94

(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	451,200	2,648.23	1,194,885,740	2,562.43	1,156,171,484	6.14
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	105,600	9,467.65	999,784,278	6,560.80	692,820,480	3.68
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	87,532	8,201.45	717,890,039	7,667.24	671,128,852	3.56
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	278,340	3,383.39	941,735,109	1,631.35	454,069,959	2.41
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	75,000	4,954.87	371,615,938	3,186.00	238,950,000	1.27
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	52,322	3,242.22	169,639,939	3,723.87	194,840,588	1.03
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	62,530	2,195.83	137,305,552	2,922.60	182,750,334	0.97
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,766,000	87.51	154,546,178	79.79	140,922,385	0.75
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	28,000	3,809.36	106,662,289	4,929.36	138,022,164	0.73
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	31,489	4,049.21	127,505,580	3,973.50	125,121,620	0.66
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	10,009	12,207.46	122,184,519	12,357.10	123,682,214	0.66
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	31,894	5,174.42	165,032,953	3,764.20	120,055,395	0.64

ブラジル	株式	VALE SA	素材	75,304	1,934.07	145,643,507	1,558.83	117,386,547	0.62
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	108,197	739.57	80,020,186	1,050.36	113,646,086	0.60
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	94,119	898.32	84,549,198	1,140.33	107,327,190	0.57
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	15,085	7,379.59	111,321,191	6,976.41	105,239,145	0.56
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	228,800	493.41	112,894,168	436.77	99,935,035	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	116,500	1,300.70	151,532,197	837.80	97,603,700	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	16,988	5,185.63	88,093,562	5,726.78	97,286,624	0.52
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	22,462	2,627.52	59,019,398	4,328.69	97,231,259	0.52
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	49,784	1,734.36	86,343,846	1,812.14	90,215,583	0.48
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	66,500	1,767.16	117,516,529	1,289.88	85,777,519	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	2,259	35,433.86	80,045,106	37,168.59	83,963,867	0.45
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	37,000	2,625.68	97,150,516	2,212.50	81,862,500	0.43
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	25,014	6,301.02	157,613,793	3,249.31	81,278,365	0.43
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	5,113	26,074.46	133,318,719	15,677.22	80,157,657	0.43
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	40,237	1,466.87	59,022,515	1,964.80	79,057,658	0.42
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	7,585	9,117.63	69,157,264	10,078.05	76,442,027	0.41
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	627,800	84.78	53,228,130	121.03	75,983,990	0.40
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	262,800	420.04	110,388,320	273.76	71,944,128	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	4.89
		素材	7.52
		資本財	2.75
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.60
		自動車・自動車部品	3.24
		耐久消費財・アパレル	1.50
		消費者サービス	0.78
		メディア・娯楽	6.53
		小売	5.95
		食品・生活必需品小売り	1.08



	食品・飲料・タバコ	3.25
	家庭用品・パーソナル用品	0.79
	ヘルスケア機器・サービス	0.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.76
	銀行	12.66
	各種金融	2.10
	保険	2.29
	不動産	1.62
	ソフトウェア・サービス	2.63
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.09
	電気通信サービス	2.68
	公益事業	2.08
	半導体・半導体製造装置	9.20
投資証券		0.07
合 計		87.06

#### 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 2203	買建	294	米ドル	17,814,655	2,049,041,626	17,920,770	2,061,246,959	10.95

(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	7,800.74	906,156	897,202	0.00
	米ドル	売建	3,165,000.00	364,006,650	364,020,576	1.93
	ブラジルレアル	売建	44,471.20	906,156	897,386	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国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年12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	27,965,006,550	98.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		303,073,570	1.07
合計(純資産総額)		28,268,080,120	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	356,352,000	1.26

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	2,793	640,955.71	1,790,189,309	670,000	1,871,310,000	6.62
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,032	345,331.51	1,392,376,649	407,000	1,641,024,000	5.81
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,464	636,800.57	1,569,076,605	653,000	1,608,992,000	5.69
日本	投資証券	G L P 投資法人	7,982	177,554.18	1,417,237,490	198,900	1,587,619,800	5.62
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	7,970	161,861.03	1,290,032,457	161,800	1,289,546,000	4.56
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,700	292,657.04	1,082,831,060	348,500	1,289,450,000	4.56
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	12,435	101,895.27	1,267,067,797	99,100	1,232,308,500	4.36
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,464	330,267.03	813,777,971	380,000	936,320,000	3.31
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,910	182,592.61	896,529,721	179,800	882,818,000	3.12
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,499	196,580.2	687,834,138	222,100	777,127,900	2.75
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,548	144,209.81	800,076,069	135,200	750,089,600	2.65
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,620	388,866.63	629,963,945	399,000	646,380,000	2.29
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,481	82,050.33	613,818,520	85,700	641,121,700	2.27
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,017	172,149.65	519,375,497	202,600	611,244,200	2.16
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	916	551,137.66	504,842,102	645,000	590,820,000	2.09
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,610	317,821.65	511,692,867	356,500	573,965,000	2.03
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	851	596,578.4	507,688,225	663,000	564,213,000	2.00
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,313	446,388.21	586,107,731	416,000	546,208,000	1.93
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	762	707,464.85	539,088,220	711,000	541,782,000	1.92
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,898	145,801.79	422,533,598	161,100	466,867,800	1.65
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,898	150,930.72	437,397,237	156,100	452,377,800	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	864	452,761.82	391,186,214	497,000	429,408,000	1.52
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,550	58,376.16	440,740,028	56,200	424,310,000	1.50
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,299	167,139.72	384,254,229	173,100	397,956,900	1.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	10,847	38,687.26	419,640,774	36,400	394,830,800	1.40
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,330	104,730.86	348,753,779	118,500	394,605,000	1.40

日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,110	316,230.3	351,015,636	341,500	379,065,000	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	1,683	199,808.49	336,277,702	222,300	374,130,900	1.32
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	2,362	141,719.24	334,740,849	155,200	366,582,400	1.30
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	521	703,550.37	366,549,744	700,000	364,700,000	1.29

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.93
合計	98.93

## 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	174	日本円	348,640,040	356,352,000	1.26

(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12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	65,189,448	0.23
	オーストラリア	27,155,968	0.10
	小計	92,345,416	0.33
投資証券	アメリカ	21,316,180,609	75.52
	カナダ	514,712,901	1.82
	ドイツ	78,779,628	0.28
	イタリア	7,024,678	0.02
	フランス	464,181,286	1.64
	オランダ	42,828,380	0.15
	スペイン	106,604,952	0.38
	ベルギー	363,584,585	1.29
	アイルランド	29,146,495	0.10
	イギリス	1,488,478,212	5.27

	オーストラリア	1,912,693,842	6.78
	ニュージーランド	103,717,754	0.37
	香港	347,929,195	1.23
	シンガポール	910,373,504	3.23
	韓国	46,835,340	0.17
	イスラエル	21,139,386	0.07
	ガーンジー	68,182,795	0.24
	小計	27,822,393,542	98.57
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		310,539,095	1.10
合計（純資産総額）		28,225,278,053	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		100,572,802	0.36
	売建		26,389,525	0.09

(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	105,981	12,529.12	1,327,849,578	19,286.55	2,044,008,237	7.24
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	12,906	84,651.26	1,092,509,283	96,846.83	1,249,905,317	4.43
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	21,861	28,530.71	623,709,873	42,858.75	936,935,186	3.32
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,084	12,386.50	583,206,145	18,260.57	859,780,923	3.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	40,674	16,599.68	675,175,645	20,158.40	819,922,973	2.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	81,051	6,847.14	554,967,593	8,269.93	670,286,745	2.37
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	62,351	8,050.24	501,941,125	9,789.35	610,375,899	2.16
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,026	20,940.54	419,355,278	29,048.30	581,721,276	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	243,674	1,561.62	380,526,777	2,230.65	543,551,603	1.93
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,197	20,280.32	409,601,752	25,715.02	519,366,287	1.84
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	48,903	7,807.55	381,812,989	10,415.06	509,327,728	1.80
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,178	15,192.99	291,371,196	25,927.80	497,243,509	1.76
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	85,510	3,780.70	323,288,290	5,195.45	444,263,220	1.57
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,498	17,036.76	281,072,506	26,260.21	433,241,047	1.53
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	54,569	4,951.61	270,204,460	7,492.40	408,852,928	1.45
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,616	18,257.12	303,360,383	24,201.35	402,129,768	1.42
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	172,079	1,589.65	273,546,690	2,199.75	378,530,918	1.34
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,326	30,649.37	285,836,112	40,511.19	377,807,397	1.34
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	57,296	5,894.16	337,712,343	5,828.06	333,924,721	1.18
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	77,161	3,632.33	280,274,339	4,152.22	320,389,602	1.14

アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	90,098	3,203.30	288,611,554	3,387.33	305,192,469	1.08
香港	投資証券	LINK REIT	299,600	1,029.84	308,541,562	1,002.26	300,277,845	1.06
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,640	13,184.74	193,024,632	20,434.45	299,160,395	1.06
アメリカ	投資証券	UDR INC	41,633	4,975.76	207,156,033	6,880.49	286,455,707	1.01
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	20,341	11,326.01	230,382,561	13,294.01	270,413,490	0.96
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	26,653	8,073.25	215,176,433	9,552.41	254,600,410	0.90
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	41,473	4,006.14	166,146,918	6,068.45	251,677,043	0.89
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,486	7,762.69	190,077,467	10,061.94	246,376,898	0.87
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	88,196	2,056.55	181,380,154	2,789.23	245,999,370	0.87
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	85,296	2,447.62	208,772,673	2,685.71	229,080,917	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	0.33
投資証券			98.57
合計			98.90

## 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	630,000.00	72,456,300	72,459,072	0.26
	カナダドル	買建	44,000.00	3,961,320	3,961,513	0.01
	ユーロ	買建	70,000.00	9,137,870	9,136,617	0.03
	オーストラリアドル	買建	180,000.00	15,017,220	15,015,600	0.05
	英ポンド	売建	170,000.00	26,390,800	26,389,525	0.09

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

## FWりそな国内債券インデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.2%
先物	0.0%
現金等	0.8%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第139回利付国債(5年)	0.10%	2024/3/20	1.5%
2	第140回利付国債(5年)	0.10%	2024/6/20	1.5%
3	第144回利付国債(5年)	0.10%	2025/6/20	1.3%
4	第138回利付国債(5年)	0.10%	2023/12/20	1.2%
5	第363回利付国債(10年)	0.10%	2031/6/20	1.1%
6	第146回利付国債(5年)	0.10%	2025/12/20	1.1%
7	第145回利付国債(5年)	0.10%	2025/9/20	1.1%
8	第362回利付国債(10年)	0.10%	2031/3/20	1.0%
9	第345回利付国債(10年)	0.10%	2026/12/20	1.0%
10	第142回利付国債(5年)	0.10%	2024/12/20	1.0%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(NOMURA-BPI総合)の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## FWりそな国内株式インデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	99.4%
先物	1.1%
現金等	-0.4%
合計	100.0%

## ■組入上位業種

	業種	組入比率
1	電気機器	20.0%
2	輸送用機器	8.1%
3	情報・通信業	7.9%
4	化学	6.7%
5	サービス業	6.3%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	業種	組入比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.9%
2	ソニーグループ	電気機器	3.3%
3	キーエンス	電気機器	2.4%
4	リクルートホールディングス	サービス業	1.9%
5	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.4%
7	日本電産	電気機器	1.3%
8	信越化学工業	化学	1.2%
9	HOYA	精密機器	1.2%
10	ダイキン工業	機械	1.2%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※業種は東証33業種の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(東証株価指数(TOPIX、配当込み))の年間騰落率です。  
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
 ・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.0%
先物	0.0%
現金等	1.0%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	47.2%
ユーロ	38.3%
英ポンド	5.9%
カナダドル	1.9%
豪ドル	1.7%
その他	4.9%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	0.125%	2023/4/30	0.8%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	0.375%	2025/11/30	0.6%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.250%	2031/8/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	0.875%	2030/11/15	0.5%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	0.250%	2024/5/15	0.5%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2031/5/15	0.5%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/8/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	1.375%	2028/10/31	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	1.125%	2031/2/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	2.125%	2024/3/31	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス (FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)) の年間騰落率です。  
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ・2017年は1月5日から12月までの騰落率です。  
 ・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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



## 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)

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	100.5%
先物	0.0%
現金等	-0.6%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	48.0%
ユーロ	38.9%
英ポンド	6.0%
カナダドル	2.0%
豪ドル	1.7%
その他	3.4%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	0.750%	2028/1/31	0.6%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2031/5/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.125%	2031/2/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	1.250%	2031/8/15	0.5%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	0.875%	2030/11/15	0.5%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/8/15	0.5%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	0.875%	2026/6/30	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	0.125%	2023/2/28	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	2.000%	2025/2/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	1.125%	2026/10/31	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## FWりそな新興国債券インデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
投資信託証券	99.6%
先物	0.0%
現金等	0.4%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
中国元	9.9%
インドネシアルピア	9.9%
ブラジルレアル	9.1%
メキシコペソ	8.4%
南アフリカランド	7.7%
その他	55.1%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	アイルランド	—	—	71.2%
2	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	アメリカ	—	—	28.4%
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—

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

※通貨別資産配分は、マザーファンドが実質的に保有している債券の通貨を基準に算出しています。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12月までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

## FWりそな先進国株式インデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	89.6%
先物	9.8%
現金等	0.6%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	65.4%
イギリス	3.9%
カナダ	3.1%
スイス	3.0%
フランス	2.9%
その他	21.7%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ソフトウェアおよび機器	4.5%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.7%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.4%
4	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	1.4%
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.3%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.3%
7	META PLATFORMS INC	アメリカ	メディア・娯楽	1.2%
8	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.1%
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	0.7%
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.7%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。  
※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## FWりそな新興国株式インデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	87.1%
先物	10.9%
現金等	2.0%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
中国	27.1%
台湾	14.0%
韓国	11.4%
インド	10.9%
ブラジル	3.4%
その他	33.3%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	6.1%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	メディア・娯楽	3.7%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.6%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	小売	2.4%
5	MEITUAN	中国	小売	1.3%
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	1.0%
7	INFOSYS LTD	インド	ソフトウェア・サービス	1.0%
8	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	0.7%
9	MEDIATEK INC	台湾	半導体・半導体製造装置	0.7%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	銀行	0.7%

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

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

## FWりそな国内リートインデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	98.9%
先物	1.3%
現金等	-0.2%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.6%
2	日本プロロジスリート投資法人	5.8%
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.7%
4	GLP投資法人	5.6%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.6%
6	大和ハウスリート投資法人	4.6%
7	日本都市ファンド投資法人	4.4%
8	アドバンス・レジデンス投資法人	3.3%
9	オリックス不動産投資法人	3.1%
10	産業ファンド投資法人	2.7%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(東証REIT指数(配当込み))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

## FWりそな先進国リートインデックスファンド

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
2021年12月10日	0円
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	98.9%
先物	0.0%
現金等	1.1%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	75.8%
オーストラリア	6.9%
イギリス	5.3%
シンガポール	3.1%
カナダ	1.8%
その他	7.1%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	7.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.4%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.3%
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.0%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.9%
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	2.4%
7	WELLTOWER INC	アメリカ	2.2%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.9%
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース(一般コース)＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

＜F Wリそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)＞

＜F Wリそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)＞

＜F Wリそな新興国債券インデックスファンド＞

＜F Wリそな先進国株式インデックスファンド＞

・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

＜F Wリそな新興国株式インデックスファンド＞

・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

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

＜F Wリそな先進国リートインデックスファンド＞

・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

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(6) 申込金額

F Wリそな国内債券インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな国内株式インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな新興国債券インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな先進国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな新興国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wリそな国内リートインデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た

額です。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

( 7 ) 申込単位

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

( 8 ) 申込代金の支払い

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

( 9 ) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所<sup>\*</sup>における取引の停止、外国為替取引の停止（「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。）、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

## 2【換金（解約）手続等】

( 1 ) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

( 2 ) 取扱時間

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

( 3 ) 解約請求不可日

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

< F W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） >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

・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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

・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

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

・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

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア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

F Wりそな国内債券インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F W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）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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

F Wりそな国内債券インデックスファンド：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。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：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。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）：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。

F W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）：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。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：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。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：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。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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（「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。）、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回で

きます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

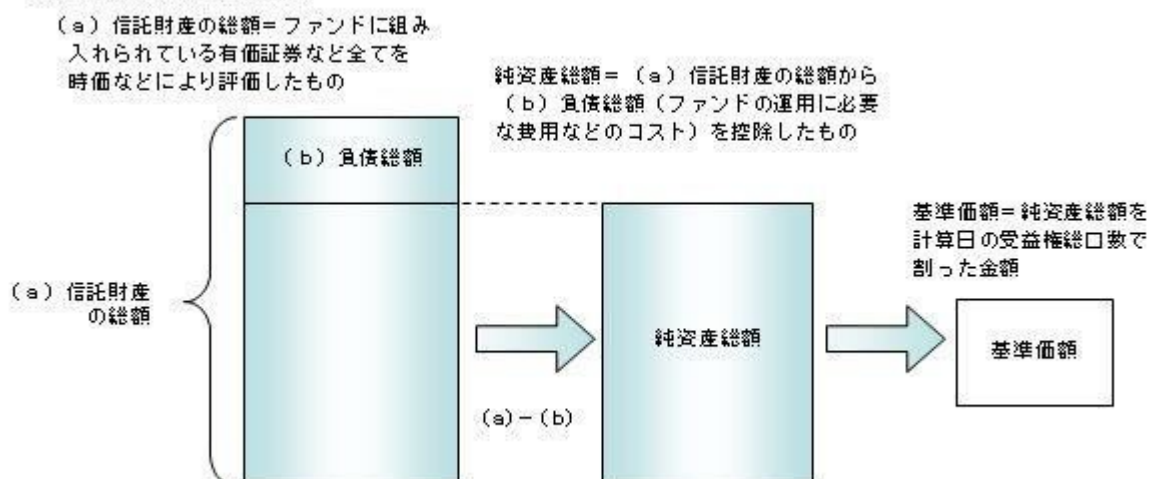
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

無期限とします（2017年1月5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12月11日から翌年12月10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) 各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
  - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

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

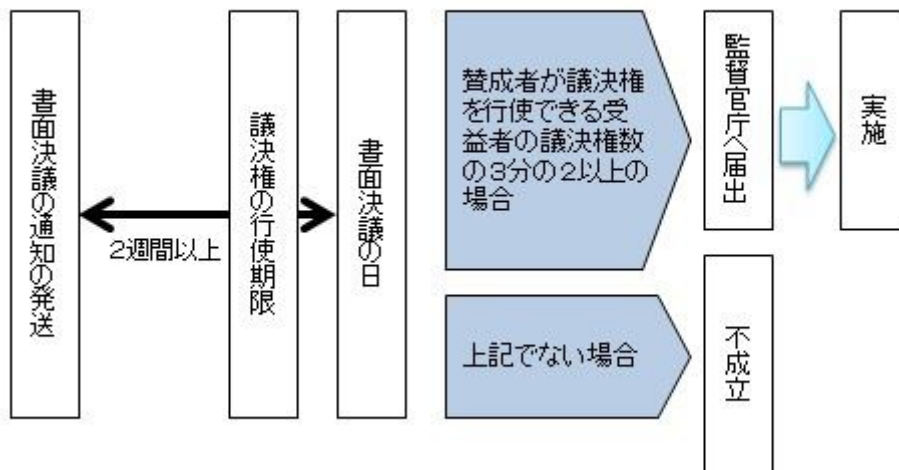
除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)

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

#### 書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知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、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

#### <書面決議の主な流れ>



#### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

#### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、每期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

#### 関係法人との契約について

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

#### 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

1. 他の受益者の氏名または名称および住所

## 2. 他の受益者が有する受益権の内容

### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

#### (2) 解約請求権

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

#### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

FWりそな国内債券インデックスファンド  
FWりそな国内株式インデックスファンド  
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）  
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）  
FWりそな新興国債券インデックスファンド  
FWりそな先進国株式インデックスファンド  
FWりそな新興国株式インデックスファンド  
FWりそな国内リートインデックスファンド  
FWりそな先進国リートインデックスファンド

- (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5期計算期間(2020年12月11日から2021年12月10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】

## 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	153,454,206	203,340,188
親投資信託受益証券	46,468,877,458	74,562,218,603
流動資産合計	46,622,331,664	74,765,558,791
資産合計	46,622,331,664	74,765,558,791
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	52,724,440	59,391,577
未払受託者報酬	7,955,774	10,744,535
未払委託者報酬	58,342,220	78,793,205
未払利息	416	551
その他未払費用	2,254,047	2,793,482
流動負債合計	121,276,897	151,723,350
負債合計	121,276,897	151,723,350
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	46,033,775,753	74,136,814,584
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	467,279,014	477,020,857
（分配準備積立金）	557,649,580	719,782,179
元本等合計	46,501,054,767	74,613,835,441
純資産合計	46,501,054,767	74,613,835,441
負債純資産合計	46,622,331,664	74,765,558,791

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日	自	2020年12月11日
	至	2020年12月10日	至	2021年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		298,886,845		2,058,855
営業収益合計		298,886,845		2,058,855
営業費用				
支払利息		115,332		146,129
受託者報酬		15,557,494		18,963,930
委託者報酬		114,088,072		139,068,697
その他費用		4,429,380		4,931,143
営業費用合計		134,190,278		163,109,899
営業利益又は営業損失( )		433,077,123		165,168,754
経常利益又は経常損失( )		433,077,123		165,168,754
当期純利益又は当期純損失( )		433,077,123		165,168,754
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( )		166,256,016		20,900,346
期首剰余金又は期首欠損金( )		751,188,301		467,279,014
剰余金増加額又は欠損金減少額		396,927,159		218,552,641
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		396,927,159		218,552,641
剰余金減少額又は欠損金増加額		414,015,339		64,542,390
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		414,015,339		64,542,390
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		467,279,014		477,020,857



## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 39,949,947,999円	期首元本額 46,033,775,753円
期中追加設定元本額 29,799,407,229円	期中追加設定元本額 34,983,169,463円
期中一部解約元本額 23,715,579,475円	期中一部解約元本額 6,880,130,632円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 46,033,775,753口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 74,136,814,584口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0102円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0064円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,102円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,064円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 225,117,945円	A 費用控除後の配当等収益額 229,015,411円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 511,886,280円	C 収益調整金額 1,244,618,163円
D 分配準備積立金額 332,531,635円	D 分配準備積立金額 490,766,768円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,069,535,860円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,964,400,342円
F 当ファンドの期末残存口数 46,033,775,753口	F 当ファンドの期末残存口数 74,136,814,584口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 232円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 264円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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。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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	145,611,162	14,121,340
合計	145,611,162	14,121,340

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	70,789,156,559	74,562,218,603	
	合計	70,789,156,559	74,562,218,603	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M国内債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,293,470	92,341,257
親投資信託受益証券	21,531,872,895	31,627,850,409
流動資産合計	21,601,166,365	31,720,191,666
資産合計	21,601,166,365	31,720,191,666
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,869,174	25,367,539
未払受託者報酬	2,427,302	5,003,518
未払委託者報酬	21,845,676	45,031,544
未払利息	187	250
その他未払費用	687,636	1,300,813
流動負債合計	58,829,975	76,703,664
負債合計	58,829,975	76,703,664
純資産の部		
元本等		
元本	17,495,078,572	22,703,426,576
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	4,047,257,818	8,940,061,426
( 分配準備積立金 )	2,369,011,422	4,028,818,882
元本等合計	21,542,336,390	31,643,488,002
純資産合計	21,542,336,390	31,643,488,002
負債純資産合計	21,601,166,365	31,720,191,666

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,905,491,768		3,187,877,514
<b>営業収益合計</b>		<b>1,905,491,768</b>		<b>3,187,877,514</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		41,802		72,447
受託者報酬		5,255,387		8,968,031
委託者報酬		47,298,450		80,712,079
その他費用		1,496,603		2,331,813
<b>営業費用合計</b>		<b>54,092,242</b>		<b>92,084,370</b>
営業利益又は営業損失（ ）		1,959,584,010		3,095,793,144
経常利益又は経常損失（ ）		1,959,584,010		3,095,793,144
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,959,584,010		3,095,793,144
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（ ）		3,895,277,130		755,728,428
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,495,323,461		4,047,257,818
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,154,143,844		4,298,083,919
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,154,143,844		4,298,083,919
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,537,902,607		1,745,345,027
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,537,902,607		1,745,345,027
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,047,257,818		8,940,061,426

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 20,690,309,942円	期首元本額 17,495,078,572円
期中追加設定元本額 16,155,770,869円	期中追加設定元本額 11,958,495,826円
期中一部解約元本額 19,351,002,239円	期中一部解約元本額 6,750,147,822円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 17,495,078,572口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 22,703,426,576口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.2313円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.3938円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,313円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (13,938円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 289,119,286円	A 費用控除後の配当等収益額 569,842,144円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 1,646,573,834円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 1,770,222,572円
C 収益調整金額 2,955,497,809円	C 収益調整金額 5,231,283,738円
D 分配準備積立金額 433,318,302円	D 分配準備積立金額 1,688,754,166円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 5,324,509,231円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,260,102,620円
F 当ファンドの期末残存口数 17,495,078,572口	F 当ファンドの期末残存口数 22,703,426,576口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,043円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 4,078円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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。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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	1,951,116,293	2,638,070,047
合計	1,951,116,293	2,638,070,047

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国内株式マザーファンド	21,912,048,226	31,627,850,409	
合計		21,912,048,226	31,627,850,409	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M国内株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	63,110,227	106,049,350
親投資信託受益証券	19,996,624,390	33,332,314,352
<b>流動資産合計</b>	<b>20,059,734,617</b>	<b>33,438,363,702</b>
<b>資産合計</b>	<b>20,059,734,617</b>	<b>33,438,363,702</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	11,266,707	23,504,965
未払受託者報酬	3,287,076	5,158,876
未払委託者報酬	35,062,123	55,027,970
未払利息	171	287
その他未払費用	931,252	1,341,210
<b>流動負債合計</b>	<b>50,547,329</b>	<b>85,033,308</b>
<b>負債合計</b>	<b>50,547,329</b>	<b>85,033,308</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	18,143,222,685	29,364,563,246
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,865,964,603	3,988,767,148
（分配準備積立金）	1,160,304,781	1,664,620,859
<b>元本等合計</b>	<b>20,009,187,288</b>	<b>33,353,330,394</b>
<b>純資産合計</b>	<b>20,009,187,288</b>	<b>33,353,330,394</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>20,059,734,617</b>	<b>33,438,363,702</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,303,120,525		868,289,962
<b>営業収益合計</b>		<b>1,303,120,525</b>		<b>868,289,962</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		48,602		65,650
受託者報酬		7,172,228		9,050,083
委託者報酬		76,503,731		96,534,138
その他費用		2,042,787		2,353,188
<b>営業費用合計</b>		<b>85,767,348</b>		<b>108,003,059</b>
営業利益又は営業損失（ ）		1,217,353,177		760,286,903
経常利益又は経常損失（ ）		1,217,353,177		760,286,903
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,217,353,177		760,286,903
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（ ）		403,203,505		60,970,638
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		982,433,667		1,865,964,603
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>725,383,412</b>		<b>1,918,120,797</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		725,383,412		1,918,120,797
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>656,002,148</b>		<b>494,634,517</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		656,002,148		494,634,517
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,865,964,603		3,988,767,148

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 22,462,375,014円	期首元本額 18,143,222,685円
期中追加設定元本額 9,148,589,469円	期中追加設定元本額 15,847,941,724円
期中一部解約元本額 13,467,741,798円	期中一部解約元本額 4,626,601,163円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 18,143,222,685口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 29,364,563,246口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.1028円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.1358円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,028円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,358円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 354,687,985円	A 費用控除後の配当等収益額 390,465,749円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 437,513,281円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 308,850,516円
C 収益調整金額 1,104,798,241円	C 収益調整金額 2,719,559,922円
D 分配準備積立金額 368,103,515円	D 分配準備積立金額 965,304,594円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 2,265,103,022円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 4,384,180,781円
F 当ファンドの期末残存口数 18,143,222,685口	F 当ファンドの期末残存口数 29,364,563,246口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,248円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,492円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	952,201,688	846,535,515
合計	952,201,688	846,535,515

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先進国債券マザーファンド	30,263,586,665	33,332,314,352	
	合計	30,263,586,665	33,332,314,352	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M先進国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。



## 【F W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)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	325,104,537	519,648,864
親投資信託受益証券	107,761,394,898	174,704,236,555
<b>流動資産合計</b>	108,086,499,435	175,223,885,419
<b>資産合計</b>	108,086,499,435	175,223,885,419
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	70,912,184	109,625,381
未払受託者報酬	15,623,173	25,105,122
未払委託者報酬	166,647,164	267,787,887
未払利息	881	1,409
その他未払費用	4,426,482	6,527,244
<b>流動負債合計</b>	257,609,884	409,047,043
<b>負債合計</b>	257,609,884	409,047,043
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	98,661,659,291	164,334,865,102
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,167,230,260	10,479,973,274
(分配準備積立金)	4,333,756,736	5,500,692,160
<b>元本等合計</b>	107,828,889,551	174,814,838,376
<b>純資産合計</b>	107,828,889,551	174,814,838,376
<b>負債純資産合計</b>	108,086,499,435	175,223,885,419

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日	自	2020年12月11日
	至	2020年12月10日	至	2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,325,627,677		2,168,358,343
<b>営業収益合計</b>		<b>3,325,627,677</b>		<b>2,168,358,343</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		177,981		314,326
受託者報酬		27,010,799		44,068,920
委託者報酬		288,115,104		470,068,325
その他費用		7,684,057		11,459,381
<b>営業費用合計</b>		<b>322,987,941</b>		<b>525,910,952</b>
営業利益又は営業損失（ ）		3,002,639,736		2,694,269,295
経常利益又は経常損失（ ）		3,002,639,736		2,694,269,295
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,002,639,736		2,694,269,295
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（ ）		425,223,166		255,827,724
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,745,360,747		9,167,230,260
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>4,660,235,378</b>		<b>5,026,115,739</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,660,235,378		5,026,115,739
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>815,782,435</b>		<b>1,274,931,154</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		815,782,435		1,274,931,154
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,167,230,260		10,479,973,274

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 57,768,211,684円	期首元本額 98,661,659,291円
期中追加設定元本額 56,096,556,318円	期中追加設定元本額 80,271,983,006円
期中一部解約元本額 15,203,108,711円	期中一部解約元本額 14,598,777,195円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 98,661,659,291口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 164,334,865,102口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0929円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0638円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,929円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,638円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 1,454,324,582円	A 費用控除後の配当等収益額 1,670,242,208円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 1,123,091,988円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 4,833,473,524円	C 収益調整金額 9,399,695,810円
D 分配準備積立金額 1,756,340,166円	D 分配準備積立金額 3,830,449,952円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,167,230,260円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 14,900,387,970円
F 当ファンドの期末残存口数 98,661,659,291口	F 当ファンドの期末残存口数 164,334,865,102口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 929円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 906円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	3,153,598,112	2,150,400,705
合計	3,153,598,112	2,150,400,705

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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	166,734,335,327	174,704,236,555	
合計		166,734,335,327	174,704,236,555	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

当ファンドは「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,214,465	5,642,062
親投資信託受益証券	1,023,755,687	1,425,857,761
流動資産合計	1,029,970,152	1,431,499,823
資産合計	1,029,970,152	1,431,499,823
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	962,657	645,796
未払受託者報酬	245,687	217,851
未払委託者報酬	4,258,601	3,775,996
未払利息	16	15
その他未払費用	69,520	56,546
流動負債合計	5,536,481	4,696,204
負債合計	5,536,481	4,696,204
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,032,035,590	1,468,871,244
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,601,919	42,067,625
( 分配準備積立金 )	83,731,849	111,244,024
元本等合計	1,024,433,671	1,426,803,619
純資産合計	1,024,433,671	1,426,803,619
負債純資産合計	1,029,970,152	1,431,499,823

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		159,125,253		27,557,926
営業収益合計		159,125,253		27,557,926
営業費用				
支払利息		5,283		3,829
受託者報酬		584,014		392,907
委託者報酬		10,122,972		6,810,190
その他費用		166,518		101,992
営業費用合計		10,878,787		7,308,918
営業利益又は営業損失( )		170,004,040		34,866,844
経常利益又は経常損失( )		170,004,040		34,866,844
当期純利益又は当期純損失( )		170,004,040		34,866,844
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( )		169,929,989		2,225,338
期首剰余金又は期首欠損金( )		27,396,810		7,601,919
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,626,476
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,224,117
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,402,359
剰余金減少額又は欠損金増加額		34,924,678		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,400,004		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,524,674		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,601,919		42,067,625



## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,275,289,883円	期首元本額 1,032,035,590円
期中追加設定元本額 748,245,689円	期中追加設定元本額 651,451,475円
期中一部解約元本額 1,991,499,982円	期中一部解約元本額 214,615,821円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,032,035,590口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,468,871,244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 7,601,919円	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 42,067,625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	4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 0.9926円	1口当たり純資産額 0.9714円
(10,000口当たり純資産額) (9,926円)	(10,000口当たり純資産額) (9,714円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 42,819,884円	A 費用控除後の配当等収益額 42,002,617円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 77,475,038円	C 収益調整金額 161,891,401円
D 分配準備積立金額 40,911,965円	D 分配準備積立金額 69,241,407円
E 当ファンドの分配対象収益額 161,206,887円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 273,135,425円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 1,032,035,590口	F 当ファンドの期末残存口数 1,468,871,244口
G 10,000口当たり収益分配対象額 1,562円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 1,859円 (G=E/F×10,000)
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	1,796,158	28,462,734
合計	1,796,158	28,462,734

## 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新興国債券マザーファンド	1,337,326,732	1,425,857,761	
合計		1,337,326,732	1,425,857,761	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M新興国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	116,467,684	153,124,019
親投資信託受益証券	31,807,223,408	51,624,677,107
流動資産合計	31,923,691,092	51,777,801,126
資産合計	31,923,691,092	51,777,801,126
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	40,622,070	26,553,703
未払受託者報酬	4,468,342	7,546,701
未払委託者報酬	55,109,502	93,075,988
未払利息	315	415
その他未払費用	1,265,928	1,962,056
流動負債合計	101,466,157	129,138,863
負債合計	101,466,157	129,138,863
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,483,796,307	27,092,392,723
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	9,338,428,628	24,556,269,540
( 分配準備積立金 )	5,338,978,713	13,111,484,009
元本等合計	31,822,224,935	51,648,662,263
純資産合計	31,822,224,935	51,648,662,263
負債純資産合計	31,923,691,092	51,777,801,126

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,790,540,102		11,766,653,699
<b>営業収益合計</b>		<b>3,790,540,102</b>		<b>11,766,653,699</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		50,642		102,525
受託者報酬		7,265,215		13,402,665
委託者報酬		89,604,256		165,299,409
その他費用		2,065,476		3,485,005
<b>営業費用合計</b>		<b>98,985,589</b>		<b>182,289,604</b>
営業利益又は営業損失（ ）		3,691,554,513		11,584,364,095
経常利益又は経常損失（ ）		3,691,554,513		11,584,364,095
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,691,554,513		11,584,364,095
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（ ）		487,210,302		2,007,017,979
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,658,851,232		9,338,428,628
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>3,623,540,908</b>		<b>10,046,689,463</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,623,540,908		10,046,689,463
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>2,122,728,327</b>		<b>4,406,194,667</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,122,728,327		4,406,194,667
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,338,428,628		24,556,269,540

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 13,770,768,469円	期首元本額 22,483,796,307円
期中追加設定元本額 18,203,027,051円	期中追加設定元本額 14,296,687,169円
期中一部解約元本額 9,489,999,213円	期中一部解約元本額 9,688,090,753円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 22,483,796,307口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 27,092,392,723口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.4153円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.9064円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (14,153円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (19,064円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 303,852,917円	A 費用控除後の配当等収益額 552,767,445円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 3,874,911,898円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 9,024,578,671円
C 収益調整金額 4,632,086,182円	C 収益調整金額 11,444,785,531円
D 分配準備積立金額 1,160,213,898円	D 分配準備積立金額 3,534,137,893円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,971,064,895円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 24,556,269,540円
F 当ファンドの期末残存口数 22,483,796,307口	F 当ファンドの期末残存口数 27,092,392,723口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 4,434円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 9,063円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	4,359,189,743	10,334,489,862
合計	4,359,189,743	10,334,489,862

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先進国株式マザーファンド	25,275,239,710	51,624,677,107	
	合計	25,275,239,710	51,624,677,107	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M先進国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	12,955,216	17,269,294
親投資信託受益証券	3,066,595,071	4,062,971,317
<b>流動資産合計</b>	<b>3,079,550,287</b>	<b>4,080,240,611</b>
<b>資産合計</b>	<b>3,079,550,287</b>	<b>4,080,240,611</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	3,933,003	2,062,051
未払受託者報酬	375,076	658,913
未払委託者報酬	7,126,355	12,519,338
未払利息	35	46
その他未払費用	106,184	171,225
<b>流動負債合計</b>	<b>11,540,653</b>	<b>15,411,573</b>
<b>負債合計</b>	<b>11,540,653</b>	<b>15,411,573</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,319,474,416	2,809,747,403
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	748,535,218	1,255,081,635
( 分配準備積立金 )	438,145,780	458,987,968
<b>元本等合計</b>	<b>3,068,009,634</b>	<b>4,064,829,038</b>
<b>純資産合計</b>	<b>3,068,009,634</b>	<b>4,064,829,038</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,079,550,287</b>	<b>4,080,240,611</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		209,964,796		301,976,246
<b>営業収益合計</b>		209,964,796		301,976,246
<b>営業費用</b>				
支払利息		6,778		12,872
受託者報酬		761,879		1,224,165
委託者報酬		14,475,479		23,259,049
その他費用		217,039		318,146
<b>営業費用合計</b>		15,461,175		24,814,232
営業利益又は営業損失( )		194,503,621		277,162,014
経常利益又は経常損失( )		194,503,621		277,162,014
当期純利益又は当期純損失( )		194,503,621		277,162,014
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( )		215,677,290		111,641,585
期首剰余金又は期首欠損金( )		370,778,860		748,535,218
剰余金増加額又は欠損金減少額		176,269,481		703,311,217
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		176,269,481		703,311,217
剰余金減少額又は欠損金増加額		208,694,034		362,285,229
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		208,694,034		362,285,229
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		748,535,218		1,255,081,635

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,439,675,773円	期首元本額 2,319,474,416円
期中追加設定元本額 1,443,169,223円	期中追加設定元本額 1,505,271,269円
期中一部解約元本額 1,563,370,580円	期中一部解約元本額 1,014,998,282円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,319,474,416口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,809,747,403口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.3227円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.4467円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (13,227円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (14,467円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 35,483,306円	A 費用控除後の配当等収益額 58,986,591円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 356,208,603円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 106,533,838円
C 収益調整金額 310,389,438円	C 収益調整金額 796,093,667円
D 分配準備積立金額 46,453,871円	D 分配準備積立金額 293,467,539円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 748,535,218円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,255,081,635円
F 当ファンドの期末残存口数 2,319,474,416口	F 当ファンドの期末残存口数 2,809,747,403口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,227円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 4,466円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	424,661,167	218,270,518
合計	424,661,167	218,270,518

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新興国株式マザーファンド	2,462,556,105	4,062,971,317	
	合計	2,462,556,105	4,062,971,317	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M新興国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。



## 【F Wりそな国内リートインデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	7,176,660	14,437,015
親投資信託受益証券	1,674,252,142	5,008,427,947
<b>流動資産合計</b>	<b>1,681,428,802</b>	<b>5,022,864,962</b>
<b>資産合計</b>	<b>1,681,428,802</b>	<b>5,022,864,962</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	2,435,934	3,333,639
未払受託者報酬	379,915	839,333
未払委託者報酬	3,419,169	7,553,948
未払利息	19	39
その他未払費用	107,549	218,142
<b>流動負債合計</b>	<b>6,342,586</b>	<b>11,945,101</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,342,586</b>	<b>11,945,101</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,600,744,853	3,791,863,443
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	74,341,363	1,219,056,418
（分配準備積立金）	265,241,220	554,144,995
<b>元本等合計</b>	<b>1,675,086,216</b>	<b>5,010,919,861</b>
<b>純資産合計</b>	<b>1,675,086,216</b>	<b>5,010,919,861</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,681,428,802</b>	<b>5,022,864,962</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日	自	2020年12月11日
	至	2020年12月10日	至	2021年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		858,329,577		881,275,805
<b>営業収益合計</b>		<b>858,329,577</b>		<b>881,275,805</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,878		11,664
受託者報酬		874,076		1,489,579
委託者報酬		7,866,545		13,406,177
その他費用		248,835		387,170
<b>営業費用合計</b>		<b>8,995,334</b>		<b>15,294,590</b>
営業利益又は営業損失（ ）		867,324,911		865,981,215
経常利益又は経常損失（ ）		867,324,911		865,981,215
当期純利益又は当期純損失（ ）		867,324,911		865,981,215
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（ ）		608,365,343		274,318,646
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		767,816,785		74,341,363
剰余金増加額又は欠損金減少額		135,645,159		760,553,574
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		135,645,159		760,553,574
剰余金減少額又は欠損金増加額		570,161,013		207,501,088
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		570,161,013		207,501,088
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		74,341,363		1,219,056,418

## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,592,201,841円	期首元本額 1,600,744,853円
期中追加設定元本額 1,323,744,119円	期中追加設定元本額 3,961,300,689円
期中一部解約元本額 2,315,201,107円	期中一部解約元本額 1,770,182,099円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,600,744,853口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 3,791,863,443口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0464円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.3215円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,464円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (13,215円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 67,090,645円	A 費用控除後の配当等収益額 158,221,660円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 232,276,323円
C 収益調整金額 204,303,890円	C 収益調整金額 951,346,943円
D 分配準備積立金額 198,150,575円	D 分配準備積立金額 163,647,012円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 469,545,110円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,505,491,938円
F 当ファンドの期末残存口数 1,600,744,853口	F 当ファンドの期末残存口数 3,791,863,443口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,933円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,970円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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。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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 (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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	281,117,477	657,619,316
合計	281,117,477	657,619,316

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国内リートマザーファンド	3,329,850,374	5,008,427,947	
	合計	3,329,850,374	5,008,427,947	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R M国内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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	15,407,973	17,308,502
親投資信託受益証券	4,073,969,983	5,412,016,252
<b>流動資産合計</b>	4,089,377,956	5,429,324,754
<b>資産合計</b>	4,089,377,956	5,429,324,754
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	5,055,152	2,775,828
未払受託者報酬	616,322	881,178
未払委託者報酬	7,601,284	10,867,786
未払利息	41	46
その他未払費用	174,527	229,016
<b>流動負債合計</b>	13,447,326	14,753,854
<b>負債合計</b>	13,447,326	14,753,854
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	4,211,588,450	3,952,338,316
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	135,657,820	1,462,232,584
( 分配準備積立金 )	313,799,014	1,221,326,291
<b>元本等合計</b>	4,075,930,630	5,414,570,900
<b>純資産合計</b>	4,075,930,630	5,414,570,900
<b>負債純資産合計</b>	4,089,377,956	5,429,324,754

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年12月11日	自	2020年12月11日
	至	2020年12月10日	至	2021年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		783,071,217		1,694,346,269
営業収益合計		783,071,217		1,694,346,269
営業費用				
支払利息		7,783		12,294
受託者報酬		1,194,282		1,638,568
委託者報酬		14,729,334		20,208,872
その他費用		339,729		425,902
営業費用合計		16,271,128		22,285,636
営業利益又は営業損失（ ）		799,342,345		1,672,060,633
経常利益又は経常損失（ ）		799,342,345		1,672,060,633
当期純利益又は当期純損失（ ）		799,342,345		1,672,060,633
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（ ）		643,492,636		473,641,613
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		469,190,928		135,657,820
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		406,595,178
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		406,595,178
剰余金減少額又は欠損金増加額		448,999,039		7,123,794
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		190,605,670		7,123,794
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		258,393,369		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		135,657,820		1,462,232,584



## (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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 3,620,576,548円	期首元本額 4,211,588,450円
期中追加設定元本額 3,083,593,311円	期中追加設定元本額 2,372,238,888円
期中一部解約元本額 2,492,581,409円	期中一部解約元本額 2,631,489,022円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 4,211,588,450口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 3,952,338,316口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 135,657,820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 0.9678円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,678円)	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.3700円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (13,700円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 115,081,898円	A 費用控除後の配当等収益額 134,720,115円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 918,919,784円
C 収益調整金額 538,871,491円	C 収益調整金額 636,159,560円
D 分配準備積立金額 198,717,116円	D 分配準備積立金額 167,686,392円
E 当ファンドの分配対象収益額 852,670,505円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 1,857,485,851円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 4,211,588,450口	F 当ファンドの期末残存口数 3,952,338,316口
G 10,000口当たり収益分配対象額 2,024円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 4,699円 (G=E/F×10,000)
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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、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。</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4期 2020年12月10日現在	第5期 2021年12月10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 （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 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 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	第5期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10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	184,400,237	1,282,645,013
合計	184,400,237	1,282,645,013

## 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先進国リートマザーファンド	3,730,109,761	5,412,016,252	
合計		3,730,109,761	5,412,016,252	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「R M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。

「R M国内債券マザーファンド」「R M国内株式マザーファンド」「R M先進国債券マザーファンド」「R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」「R M新興国債券マザーファンド」「R M先進国株式マザーファンド」「R M新興国株式マザーファンド」「R M国内リートマザーファンド」及び「R M先進国リートマザーファンド」の状況は次の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## R M国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年12月10日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,709
コール・ローン	1,187,379,980
国債証券	106,148,510,940
地方債証券	6,410,444,210
特殊債券	7,620,011,644
社債券	5,443,244,000

2021年12月10日現在

未収入金	100,566,000
未収利息	234,439,216
前払費用	18,531,401
流動資産合計	127,163,135,100
資産合計	127,163,135,100
負債の部	
流動負債	
未払金	540,635,500
未払解約金	63,856,000
未払利息	3,220
流動負債合計	604,494,720
負債合計	604,494,720
純資産の部	
元本等	
元本	120,152,804,390
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,405,835,990
元本等合計	126,558,640,380
純資産合計	126,558,640,380
負債純資産合計	127,163,135,100

## 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	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

2021年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	77,035,480,535円
期中追加設定元本額	57,523,156,347円
期中一部解約元本額	14,405,832,492円
期末元本額	120,152,804,390円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	7,279,241,303円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,364,984,080円
りそなラップ型ファンド(成長型)	234,659,346円
DCりそな グローバルバランス	614,152,046円
つみたてバランスファンド	3,586,849,979円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,017,983,372円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	745,376,335円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	225,374,618円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	239,086,334円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	69,671,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	14,994,287円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,198,630円
リスクコントロール・オープン	93,670,613円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,374,996,816円
FWりそな国内債券インデックスファンド	70,789,156,559円
Smart-i 国内債券インデックス	1,391,086,441円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,034,330,794円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	755,192,806円
Smart-i 8資産バランス 成長型	288,830,001円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,181,167,995円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	4,076,633,681円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	2,484,377,994円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,764,651,625円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,011,181,805円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	351,481,716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)	14,705,370円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,716,433,262円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,418,833,079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)	379,125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)	107,369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)	15,340円
2. 計算日における受益権の総数	120,152,804,390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	1.0533円
(10,000口当たり純資産額)	(10,533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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	281,088,740	
地方債証券	7,076,910	
特殊債券	17,676,262	
社債券	7,347,000	
合計	298,494,912	

(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

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 2 0 回利付国債（2年）	100,000,000	100,226,000	
	第4 2 1 回利付国債（2年）	600,000,000	601,464,000	
	第4 2 3 回利付国債（2年）	1,030,000,000	1,031,606,800	
	第4 2 4 回利付国債（2年）	600,000,000	600,990,000	
	第4 2 5 回利付国債（2年）	350,000,000	350,588,000	
	第4 2 6 回利付国債（2年）	680,000,000	681,264,800	
	第4 2 7 回利付国債（2年）	840,000,000	841,646,400	
	第4 2 8 回利付国債（2年）	420,000,000	420,865,200	
	第4 2 9 回利付国債（2年）	350,000,000	350,756,000	
	第4 3 0 回利付国債（2年）	460,000,000	461,039,600	
	第1 3 5 回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,002,660,000	
	第1 3 6 回利付国債（5年）	1,180,000,000	1,183,846,800	
	第1 3 7 回利付国債（5年）	1,070,000,000	1,074,076,700	
	第1 3 8 回利付国債（5年）	1,490,000,000	1,496,630,500	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	1,980,000,000	1,989,880,200	
	第1 4 0 回利付国債（5年）	1,840,000,000	1,849,972,800	
	第1 4 1 回利付国債（5年）	1,250,000,000	1,257,462,500	
	第1 4 2 回利付国債（5年）	1,190,000,000	1,197,746,900	
	第1 4 3 回利付国債（5年）	1,070,000,000	1,077,532,800	
	第1 4 4 回利付国債（5年）	1,550,000,000	1,562,043,500	
	第1 4 5 回利付国債（5年）	1,380,000,000	1,390,695,000	
	第1 4 6 回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,411,298,000	
	第1 4 7 回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,205,388,000	
第1 4 8 回利付国債（5年）	960,000,000	964,348,800		
第1 4 9 回利付国債（5年）	830,000,000	833,776,500		



第1回利付国債(40年)	100,000,000	143,777,000	
第2回利付国債(40年)	180,000,000	250,714,800	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	154,022,000	
第4回利付国債(40年)	170,000,000	239,200,200	
第5回利付国債(40年)	240,000,000	326,899,200	
第6回利付国債(40年)	230,000,000	309,122,300	
第7回利付国債(40年)	250,000,000	323,900,000	
第8回利付国債(40年)	320,000,000	388,832,000	
第9回利付国債(40年)	510,000,000	466,425,600	
第10回利付国債(40年)	420,000,000	448,194,600	
第11回利付国債(40年)	340,000,000	352,379,400	
第12回利付国債(40年)	360,000,000	337,719,600	
第13回利付国債(40年)	410,000,000	383,514,000	
第14回利付国債(40年)	260,000,000	259,199,200	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	414,694,890	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	301,107,510	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	261,145,410	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,133,100	
第332回利付国債(10年)	652,000,000	661,434,440	
第333回利付国債(10年)	225,000,000	228,654,000	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	265,711,050	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	350,892,600	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	213,912,300	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,136,900	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	641,544,010	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	392,003,150	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	952,026,200	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	447,189,600	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	383,336,400	
第343回利付国債(10年)	780,000,000	787,074,600	
第344回利付国債(10年)	960,000,000	968,966,400	
第345回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,292,582,400	
第346回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,161,557,500	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	687,160,400	
第348回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,132,331,200	
第349回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,062,064,500	
第350回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,244,723,100	
第351回利付国債(10年)	710,000,000	718,605,200	
第352回利付国債(10年)	970,000,000	982,212,300	
第353回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,124,496,600	
第354回利付国債(10年)	870,000,000	881,762,400	
第355回利付国債(10年)	750,000,000	760,207,500	

第356回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,266,600,000
第357回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,033,147,800
第358回利付国債(10年)	720,000,000	728,964,000
第359回利付国債(10年)	840,000,000	849,685,200
第360回利付国債(10年)	860,000,000	869,064,400
第361回利付国債(10年)	980,000,000	988,829,800
第362回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,330,375,200
第363回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,479,055,200
第364回利付国債(10年)	160,000,000	160,777,600
第1回利付国債(30年)	60,000,000	73,366,800
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,187,600
第10回利付国債(30年)	30,000,000	33,267,900
第11回利付国債(30年)	80,000,000	94,306,400
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,106,400
第13回利付国債(30年)	200,000,000	243,826,000
第14回利付国債(30年)	60,000,000	76,259,400
第15回利付国債(30年)	200,000,000	257,432,000
第16回利付国債(30年)	140,000,000	180,882,800
第17回利付国債(30年)	160,000,000	205,315,200
第18回利付国債(30年)	60,000,000	76,430,400
第19回利付国債(30年)	100,000,000	127,808,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	130,909,000
第21回利付国債(30年)	180,000,000	231,388,200
第22回利付国債(30年)	50,000,000	65,813,500
第23回利付国債(30年)	220,000,000	290,567,200
第24回利付国債(30年)	170,000,000	225,124,200
第25回利付国債(30年)	200,000,000	259,726,000
第26回利付国債(30年)	205,000,000	270,007,550
第27回利付国債(30年)	295,000,000	394,801,450
第28回利付国債(30年)	290,000,000	389,852,800
第29回利付国債(30年)	150,000,000	200,134,500
第30回利付国債(30年)	190,000,000	251,347,200
第31回利付国債(30年)	170,000,000	222,798,600
第32回利付国債(30年)	315,000,000	420,093,450
第33回利付国債(30年)	290,000,000	372,307,800
第34回利付国債(30年)	335,000,000	443,653,900
第35回利付国債(30年)	406,000,000	524,531,700
第36回利付国債(30年)	325,000,000	421,294,250
第37回利付国債(30年)	450,000,000	576,675,000
第38回利付国債(30年)	290,000,000	367,050,100
第39回利付国債(30年)	300,000,000	386,475,000
第40回利付国債(30年)	265,000,000	336,597,700
第41回利付国債(30年)	255,000,000	319,175,850

第42回利付国債(30年)	250,000,000	313,242,500	
第43回利付国債(30年)	180,000,000	225,772,200	
第44回利付国債(30年)	260,000,000	326,448,200	
第45回利付国債(30年)	290,000,000	352,045,500	
第46回利付国債(30年)	340,000,000	413,011,600	
第47回利付国債(30年)	320,000,000	396,153,600	
第48回利付国債(30年)	353,000,000	421,390,220	
第49回利付国債(30年)	330,000,000	394,109,100	
第50回利付国債(30年)	310,000,000	327,995,500	
第51回利付国債(30年)	330,000,000	311,166,900	
第52回利付国債(30年)	370,000,000	365,167,800	
第53回利付国債(30年)	310,000,000	312,718,700	
第54回利付国債(30年)	340,000,000	358,455,200	
第55回利付国債(30年)	230,000,000	242,323,400	
第56回利付国債(30年)	300,000,000	315,501,000	
第57回利付国債(30年)	310,000,000	325,785,200	
第58回利付国債(30年)	490,000,000	513,980,600	
第59回利付国債(30年)	280,000,000	286,731,200	
第60回利付国債(30年)	280,000,000	299,717,600	
第61回利付国債(30年)	260,000,000	265,119,400	
第62回利付国債(30年)	360,000,000	348,296,400	
第63回利付国債(30年)	300,000,000	281,835,000	
第64回利付国債(30年)	260,000,000	243,848,800	
第65回利付国債(30年)	300,000,000	280,890,000	
第66回利付国債(30年)	340,000,000	318,182,200	
第67回利付国債(30年)	220,000,000	216,829,800	
第68回利付国債(30年)	330,000,000	325,211,700	
第69回利付国債(30年)	340,000,000	343,729,800	
第70回利付国債(30年)	390,000,000	393,342,300	
第71回利付国債(30年)	320,000,000	322,761,600	
第72回利付国債(30年)	150,000,000	151,116,000	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	50,703,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,106,400	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	61,741,800	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	124,276,800	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	395,496,400	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	20,913,000	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	94,721,400	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	63,011,400	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	116,970,700	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	105,832,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	222,894,000	

第73回利付国債(20年)	180,000,000	191,503,800
第75回利付国債(20年)	100,000,000	107,243,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	106,587,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,383,000
第78回利付国債(20年)	50,000,000	53,549,000
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,490,200
第80回利付国債(20年)	90,000,000	97,023,600
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,383,800
第82回利付国債(20年)	170,000,000	184,152,500
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,887,700
第84回利付国債(20年)	120,000,000	130,168,800
第85回利付国債(20年)	150,000,000	164,136,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	110,281,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	98,867,700
第88回利付国債(20年)	185,000,000	205,102,100
第89回利付国債(20年)	120,000,000	132,495,600
第90回利付国債(20年)	170,000,000	188,693,200
第91回利付国債(20年)	80,000,000	89,180,000
第92回利付国債(20年)	255,000,000	283,225,950
第93回利付国債(20年)	80,000,000	88,845,600
第94回利付国債(20年)	140,000,000	156,220,400
第95回利付国債(20年)	185,000,000	209,518,050
第96回利付国債(20年)	70,000,000	78,500,800
第97回利付国債(20年)	130,000,000	147,223,700
第98回利付国債(20年)	70,000,000	78,868,300
第99回利付国債(20年)	85,000,000	96,236,150
第100回利付国債(20年)	151,000,000	172,733,430
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,130,600
第102回利付国債(20年)	145,000,000	168,559,600
第103回利付国債(20年)	100,000,000	115,593,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,428,300
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,780,560
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,207,600
第107回利付国債(20年)	80,000,000	92,310,400
第108回利付国債(20年)	220,000,000	250,747,200
第109回利付国債(20年)	80,000,000	91,576,000
第110回利付国債(20年)	195,000,000	226,065,450
第111回利付国債(20年)	50,000,000	58,599,500
第112回利付国債(20年)	205,000,000	238,708,150
第113回利付国債(20年)	85,000,000	99,370,950
第114回利付国債(20年)	160,000,000	187,848,000
第115回利付国債(20年)	100,000,000	118,210,000
第116回利付国債(20年)	140,000,000	166,145,000

第117回利付国債(20年)	225,000,000	265,151,250	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	153,774,350	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	173,514,000	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	273,523,200	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	239,577,350	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	220,379,100	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	315,191,000	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	236,076,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	144,260,400	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	118,366,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	152,673,300	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	264,930,750	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	280,315,200	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	257,556,200	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	34,829,400	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	93,066,400	
第133回利付国債(20年)	355,000,000	416,517,950	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	52,907,850	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	46,621,600	
第136回利付国債(20年)	350,000,000	404,372,500	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	198,619,500	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	103,275,000	
第139回利付国債(20年)	370,000,000	428,434,100	
第140回利付国債(20年)	420,000,000	491,862,000	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	217,141,900	
第142回利付国債(20年)	330,000,000	390,927,900	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	390,325,250	
第144回利付国債(20年)	300,000,000	346,209,000	
第145回利付国債(20年)	545,000,000	642,462,350	
第146回利付国債(20年)	560,000,000	661,533,600	
第147回利付国債(20年)	475,000,000	556,643,000	
第148回利付国債(20年)	595,000,000	691,324,550	
第149回利付国債(20年)	540,000,000	628,414,200	
第150回利付国債(20年)	590,000,000	680,275,900	
第151回利付国債(20年)	565,000,000	637,901,950	
第152回利付国債(20年)	660,000,000	745,767,000	
第153回利付国債(20年)	470,000,000	538,046,600	
第154回利付国債(20年)	408,000,000	462,055,920	
第155回利付国債(20年)	540,000,000	597,277,800	
第156回利付国債(20年)	570,000,000	582,574,200	
第157回利付国債(20年)	480,000,000	476,635,200	
第158回利付国債(20年)	300,000,000	310,461,000	

	第159回利付国債(20年)	400,000,000	419,352,000
	第160回利付国債(20年)	510,000,000	542,150,400
	第161回利付国債(20年)	480,000,000	502,468,800
	第162回利付国債(20年)	360,000,000	376,542,000
	第163回利付国債(20年)	420,000,000	438,921,000
	第164回利付国債(20年)	530,000,000	544,744,600
	第165回利付国債(20年)	430,000,000	441,446,600
	第166回利付国債(20年)	710,000,000	751,144,500
	第167回利付国債(20年)	440,000,000	450,599,600
	第168回利付国債(20年)	540,000,000	543,067,200
	第169回利付国債(20年)	410,000,000	404,612,600
	第170回利付国債(20年)	590,000,000	581,173,600
	第171回利付国債(20年)	370,000,000	363,780,300
	第172回利付国債(20年)	480,000,000	479,587,200
	第173回利付国債(20年)	470,000,000	468,787,400
	第174回利付国債(20年)	570,000,000	567,520,500
	第175回利付国債(20年)	470,000,000	475,781,000
	第176回利付国債(20年)	510,000,000	515,431,500
	第177回利付国債(20年)	450,000,000	445,959,000
	第178回利付国債(20年)	240,000,000	241,958,400
	国債証券合計	100,044,000,000	106,148,510,940
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	114,263,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,333,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	101,723,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,333,000
	第789回東京都公募公債	100,000,000	100,315,000
	第808回東京都公募公債	100,000,000	100,305,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,233,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,437,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,295,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,298,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,963,000
	第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,952,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	111,590,600
	第444回大阪府公募公債	100,000,000	100,349,000
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	100,063,000
	第471回大阪府公募公債	140,000,000	139,434,400
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,426,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,938,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,935,000
	令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	100,483,000
	平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,485,000

	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,506,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,771,000	
	平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	115,855,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,276,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,191,000	
	令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	100,098,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,750,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,062,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	116,677,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,480,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,520,000	
	令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,269,000	
	平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	115,425,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,011,000	
	第11回千葉県公募公債	100,000,000	117,184,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,832,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,315,000	
	第15回千葉県公募公債	100,000,000	100,152,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,319,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,611,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,385,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,019,000	
	第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,405,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,718,000	
	第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,721,000	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,432,000	
	第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,957,000	
	第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,872,000	
	令和3年度第2回堺市公募公債	100,000,000	100,123,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,844,000	
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	118,215,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,196,000	
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	115,390,810	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	117,421,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	116,346,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,524,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,834,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,340,400	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,986,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,257,000	
	地方債証券合計	6,184,500,000	6,410,444,210	
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	100,859,000	

第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,481,000	
第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,279,000	
第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,094,000	
第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,836,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,348,000	
第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,578,000	
第27回道路債券	100,000,000	105,443,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	172,737,000	
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	100,863,000	
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	115,884,420	
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	128,955,800	
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	101,435,000	
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	101,702,000	
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	105,068,240	
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	134,732,990	
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	100,539,000	
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	100,872,000	
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	101,087,000	
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	100,637,000	
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	100,468,000	
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	99,778,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	125,603,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	107,560,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,668,780	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,481,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,022,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,957,000	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,602,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,424,930	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,906,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,642,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,516,000	
F14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,270,000	



F 1 5 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,994,000	
第 1 0 回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	116,959,000	
第 9 7 回都市再生債券	100,000,000	107,079,000	
第 2 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	111,365,000	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	70,280,000	70,057,212	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	75,257,000	75,231,412	
第 1 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,795,000	
第 9 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,226,000	
第 1 1 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,862,000	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,495,000	81,638,833	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,516,000	81,441,934	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,074,000	82,890,636	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,164,000	82,088,457	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,562,000	85,378,868	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,805,000	87,098,939	
第 1 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,108,000	90,823,743	
第 1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,835,000	93,174,776	
第 1 6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,831,000	96,564,107	
第 1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,615,000	98,721,954	
第 1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,526,000	99,305,340	
第 1 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,883,000	99,237,001	
第 1 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,058,000	99,403,712	
第 1 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,404,000	99,898,037	
第 1 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,848,000	100,788,568	
第 1 7 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,763,000	
第 2 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,893,000	
第 1 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	47,946,000	47,886,546	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	49,132,000	49,103,012	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	52,838,000	52,845,397	
第 3 3 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,007,000	
第 3 4 0 回信金中金債	100,000,000	100,102,000	
第 3 5 8 回信金中金債（ 5 年 ）	100,000,000	99,930,000	
第 3 7 2 回信金中金債	100,000,000	100,039,000	
第 3 7 6 回信金中金債	100,000,000	99,999,000	
第 3 1 回国際協力機構債券	100,000,000	101,904,000	
第 8 7 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,063,000	
第 8 8 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,021,000	
第 2 9 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,104,000	
第 5 2 回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,954,000	
第 1 1 6 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,044,000	
特殊債券合計	7,375,177,000	7,620,011,644	

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	100,203,000	
	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	100,099,000	
	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	100,106,000	
	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	99,476,000	
	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	99,955,000	
	第27回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	99,829,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,982,000	
	第18回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
	第54回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,236,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,208,000	
	第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,882,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,954,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,789,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,266,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,648,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,888,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,917,000	
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	100,198,000	
	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	100,029,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,293,000	
	第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
	第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,929,000	
	第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,976,000	
	第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,975,000	
	第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
	第81アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,695,000	
	第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,774,000	
	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	100,381,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,323,000		
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000		
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,409,000		

第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,489,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,255,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,659,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,218,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,680,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,017,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,061,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,235,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,240,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,254,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,953,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,045,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,548,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,176,000	
第493回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,822,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,424,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,950,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,451,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,914,000	
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	101,343,000	
社債券合計	5,400,000,000	5,443,244,000	
合計		125,622,210,794	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	959,352,798

2021年12月10日現在	
株式	62,955,195,340
派生商品評価勘定	155,750
未収配当金	35,924,008
差入委託証拠金	31,500,000
流動資産合計	63,982,127,896
資産合計	63,982,127,896
負債の部	
流動負債	
前受金	4,550,000
未払金	109,981,600
未払解約金	184,388,000
未払利息	2,602
流動負債合計	298,922,202
負債合計	298,922,202
純資産の部	
元本等	
元本	44,120,726,991
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,562,478,703
元本等合計	63,683,205,694
純資産合計	63,683,205,694
負債純資産合計	63,982,127,896

## 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	34,557,691,090円
期中追加設定元本額	53,101,020,069円
期中一部解約元本額	43,537,984,168円

期末元本額	44,120,726,991円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,083,823,828円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,627,463,440円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,329,720,981円
DCりそな グローバルバランス	73,454,384円
つみたてバランスファンド	3,944,130,939円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	380,413,856円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	218,979,068円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	145,222,377円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	48,046,066円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	29,805,662円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,786,343円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	27,929,996円
リスクコントロール・オープン	10,358,498円
FWりそな国内株式アクティブファンド	321,707,867円
FWりそな国内株式インデックスファンド	21,912,048,226円
Smart-i TOPIXインデックス	1,743,404,571円
Smart-i 8資産バランス 安定型	72,019,313円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	199,787,289円
Smart-i 8資産バランス 成長型	230,653,924円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	239,627,155円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	443,592,308円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	263,484,616円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	192,818,646円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	219,825,528円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	37,078,977円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	5,358,996円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	523,928,749円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	873,063,328円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	821,709,119円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	1,084,578,592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）	250,700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）	267,735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）	385,914円
2. 計算日における受益権の総数	44,120,726,991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	1.4434円
(10,000口当たり純資産額)	(14,434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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,190,537,569
合計		2,190,537,569

（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12月10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	690,569,250	-	690,725,000	155,750
合計		690,569,250	-	690,725,000	155,750

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,100	3,105.00	3,415,500	

日本水産	31,600	533.00	16,842,800
マルハニチロ	4,900	2,356.00	11,544,400
雪国まいたけ	2,300	1,225.00	2,817,500
カネコ種苗	1,000	1,365.00	1,365,000
サカタのタネ	3,800	3,265.00	12,407,000
ホクト	2,600	1,885.00	4,901,000
ホクリヨウ	400	698.00	279,200
住石ホールディングス	5,500	131.00	720,500
日鉄鉱業	700	6,320.00	4,424,000
三井松島ホールディングス	1,300	1,353.00	1,758,900
I N P E X	126,700	986.00	124,926,200
石油資源開発	3,700	2,592.00	9,590,400
K & O エナジーグループ	1,500	1,481.00	2,221,500
ヒノキヤグループ	700	2,251.00	1,575,700
ショーボンドホールディングス	4,500	5,150.00	23,175,000
ミライト・ホールディングス	10,200	1,953.00	19,920,600
タマホーム	1,900	2,220.00	4,218,000
サンヨーホームズ	400	739.00	295,600
日本アクア	1,300	740.00	962,000
ファーストコーポレーション	1,000	711.00	711,000
ベステラ	600	1,316.00	789,600
Robot Home	5,200	224.00	1,164,800
キャンディル	500	512.00	256,000
スペースバリューホールディングス	3,200	1,147.00	3,670,400
ダイセキ環境ソリューション	600	1,629.00	977,400
第一カッター興業	800	1,351.00	1,080,800
安藤・間	17,400	885.00	15,399,000
東急建設	9,300	666.00	6,193,800
コムシスホールディングス	10,200	2,539.00	25,897,800
ピーアールホールディングス	4,300	351.00	1,509,300
高松コンストラクショングループ	2,000	1,950.00	3,900,000
東建コーポレーション	1,000	9,150.00	9,150,000
ソネック	300	1,017.00	305,100
ヤマウラ	1,500	939.00	1,408,500
オリエンタル白石	10,600	230.00	2,438,000
大成建設	21,100	3,490.00	73,639,000



大林組	72,900	876.00	63,860,400	
清水建設	68,300	712.00	48,629,600	
飛島建設	2,000	1,017.00	2,034,000	
長谷工コーポレーション	21,700	1,431.00	31,052,700	
松井建設	2,900	765.00	2,218,500	
銭高組	300	3,820.00	1,146,000	
鹿島建設	53,400	1,326.00	70,808,400	
不動テトラ	1,500	1,686.00	2,529,000	
大末建設	800	1,153.00	922,400	
鉄建建設	1,600	1,808.00	2,892,800	
西松建設	4,400	3,410.00	15,004,000	
三井住友建設	16,400	423.00	6,937,200	
大豊建設	1,100	3,690.00	4,059,000	
佐田建設	1,600	471.00	753,600	
ナカノフドー建設	1,700	338.00	574,600	
奥村組	4,300	3,260.00	14,018,000	
東鉄工業	3,400	2,435.00	8,279,000	
イチケン	500	1,888.00	944,000	
富士ピー・エス	900	512.00	460,800	
浅沼組	800	5,340.00	4,272,000	
戸田建設	30,300	725.00	21,967,500	
熊谷組	3,700	2,879.00	10,652,300	
北野建設	400	2,081.00	832,400	
植木組	600	1,477.00	886,200	
矢作建設工業	3,200	745.00	2,384,000	
ピーエス三菱	2,400	604.00	1,449,600	
日本ハウスホールディングス	5,000	397.00	1,985,000	
大東建託	7,500	12,970.00	97,275,000	
新日本建設	3,100	826.00	2,560,600	
N I P P O	6,000	3,995.00	23,970,000	
東亜道路工業	400	4,740.00	1,896,000	
日本道路	700	8,160.00	5,712,000	
東亜建設工業	1,800	2,491.00	4,483,800	
日本国土開発	7,100	562.00	3,990,200	
若築建設	1,200	1,944.00	2,332,800	
東洋建設	8,200	580.00	4,756,000	

五洋建設	28,900	674.00	19,478,600	
世紀東急工業	3,500	844.00	2,954,000	
福田組	800	4,375.00	3,500,000	
住友林業	18,700	2,355.00	44,038,500	
日本基礎技術	2,000	592.00	1,184,000	
巴コーポレーション	3,200	463.00	1,481,600	
大和ハウス工業	67,400	3,333.00	224,644,200	
ライト工業	4,600	2,002.00	9,209,200	
積水ハウス	79,100	2,369.50	187,427,450	
日特建設	1,500	673.00	1,009,500	
北陸電気工事	1,300	1,112.00	1,445,600	
ユアテック	4,200	643.00	2,700,600	
日本リーテック	1,500	1,669.00	2,503,500	
四電工	800	1,671.00	1,336,800	
中電工	3,400	2,116.00	7,194,400	
関電工	11,900	841.00	10,007,900	
きんでん	16,300	1,724.00	28,101,200	
東京エネシス	2,400	1,100.00	2,640,000	
トーエネック	700	3,275.00	2,292,500	
住友電設	1,800	2,060.00	3,708,000	
日本電設工業	4,000	1,646.00	6,584,000	
エクシオグループ	11,100	2,466.00	27,372,600	
新日本空調	1,900	2,251.00	4,276,900	
九電工	5,600	3,560.00	19,936,000	
三機工業	4,700	1,424.00	6,692,800	
日揮ホールディングス	22,500	990.00	22,275,000	
中外炉工業	700	1,606.00	1,124,200	
ヤマト	2,100	771.00	1,619,100	
太平電業	1,600	2,804.00	4,486,400	
高砂熱学工業	6,600	1,894.00	12,500,400	
三晃金属工業	300	2,307.00	692,100	
朝日工業社	500	3,245.00	1,622,500	
明星工業	4,700	713.00	3,351,100	
大気社	3,500	3,050.00	10,675,000	
ダイダン	1,600	2,287.00	3,659,200	
日比谷総合設備	2,300	2,040.00	4,692,000	

フィル・カンパニー	400	2,250.00	900,000	
テスホールディングス	1,300	2,587.00	3,363,100	
インフロニア・ホールディングス	31,100	1,018.00	31,659,800	
東洋エンジニアリング	3,100	721.00	2,235,100	
レイズネクスト	3,500	1,179.00	4,126,500	
ニッポン	6,800	1,636.00	11,124,800	
日清製粉グループ本社	26,400	1,662.00	43,876,800	
日東富士製粉	300	3,570.00	1,071,000	
昭和産業	2,200	2,625.00	5,775,000	
鳥越製粉	2,100	714.00	1,499,400	
中部飼料	2,600	936.00	2,433,600	
フィード・ワン	3,100	700.00	2,170,000	
東洋精糖	400	1,118.00	447,200	
日本甜菜製糖	1,200	1,698.00	2,037,600	
D M三井製糖ホールディングス	2,100	1,931.00	4,055,100	
塩水港精糖	2,700	216.00	583,200	
日新製糖	1,100	1,689.00	1,857,900	
森永製菓	5,500	3,755.00	20,652,500	
中村屋	600	3,680.00	2,208,000	
江崎グリコ	6,400	3,665.00	23,456,000	
名糖産業	1,000	1,700.00	1,700,000	
井村屋グループ	1,300	2,278.00	2,961,400	
不二家	1,300	2,316.00	3,010,800	
山崎製パン	17,500	1,524.00	26,670,000	
第一屋製パン	500	573.00	286,500	
モロゾフ	400	5,320.00	2,128,000	
亀田製菓	1,300	4,405.00	5,726,500	
寿スピリッツ	2,200	5,910.00	13,002,000	
カルビー	10,600	2,656.00	28,153,600	
森永乳業	4,300	5,530.00	23,779,000	
六甲バター	1,700	1,611.00	2,738,700	
ヤクルト本社	17,300	5,870.00	101,551,000	
明治ホールディングス	15,400	6,920.00	106,568,000	
雪印メグミルク	5,600	2,091.00	11,709,600	
プリマハム	2,900	2,446.00	7,093,400	
日本ハム	8,900	4,020.00	35,778,000	

林兼産業	700	538.00	376,600	
丸大食品	2,300	1,485.00	3,415,500	
S Foods	2,100	3,445.00	7,234,500	
柿安本店	800	2,735.00	2,188,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	15,000	651.00	9,765,000	
サッポロホールディングス	8,000	2,279.00	18,232,000	
アサヒグループホールディングス	54,900	4,550.00	249,795,000	
キリンホールディングス	85,800	1,850.50	158,772,900	
宝ホールディングス	15,900	1,230.00	19,557,000	
オエノンホールディングス	6,600	371.00	2,448,600	
養命酒製造	700	1,782.00	1,247,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	16,400	1,359.00	22,287,600	
サントリー食品インターナショナル	15,600	4,165.00	64,974,000	
ダイトーグループホールディングス	1,200	4,985.00	5,982,000	
伊藤園	7,100	6,210.00	44,091,000	
キーコーヒー	2,300	2,028.00	4,664,400	
ユニカフェ	700	1,051.00	735,700	
ジャパンフーズ	300	1,222.00	366,600	
日清オイリオグループ	2,900	2,859.00	8,291,100	
不二製油グループ本社	5,100	2,322.00	11,842,200	
かどや製油	300	4,095.00	1,228,500	
J - オイルミルズ	2,200	1,707.00	3,755,400	
キッコーマン	16,800	8,760.00	147,168,000	
味の素	51,600	3,401.00	175,491,600	
ブルドックソース	1,000	2,130.00	2,130,000	
キューピー	12,300	2,404.00	29,569,200	
ハウス食品グループ本社	8,700	2,929.00	25,482,300	
カゴメ	8,900	2,927.00	26,050,300	
焼津水産化学工業	1,100	965.00	1,061,500	
アリアケジャパン	2,100	6,550.00	13,755,000	
ピエトロ	300	1,795.00	538,500	
エバラ食品工業	500	2,465.00	1,232,500	
やまみ	300	1,887.00	566,100	
ニチレイ	11,100	2,623.00	29,115,300	
東洋水産	11,200	4,785.00	53,592,000	

イトアンドホールディングス	900	2,148.00	1,933,200	
大冷	300	1,935.00	580,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,200	647.00	776,400	
日清食品ホールディングス	9,200	8,340.00	76,728,000	
永谷園ホールディングス	1,000	2,015.00	2,015,000	
一正蒲鉾	900	852.00	766,800	
フジッコ	2,500	1,863.00	4,657,500	
ロック・フィールド	2,500	1,508.00	3,770,000	
日本たばこ産業	125,200	2,332.50	292,029,000	
ケンコーマヨネーズ	1,300	1,336.00	1,736,800	
わらべや日洋ホールディングス	1,500	2,026.00	3,039,000	
なとり	1,300	1,988.00	2,584,400	
イフジ産業	400	933.00	373,200	
ピクルスコーポレーション	1,100	1,911.00	2,102,100	
ファーマフーズ	2,200	2,151.00	4,732,200	
ユーグレナ	11,900	722.00	8,591,800	
紀文食品	1,400	987.00	1,381,800	
ミヨシ油脂	900	1,312.00	1,180,800	
理研ビタミン	2,400	1,664.00	3,993,600	
片倉工業	2,400	2,165.00	5,196,000	
ゲンゼ	1,500	4,115.00	6,172,500	
東洋紡	9,000	1,258.00	11,322,000	
ユニチカ	6,200	301.00	1,866,200	
富士紡ホールディングス	1,000	4,030.00	4,030,000	
倉敷紡績	1,900	1,974.00	3,750,600	
シキボウ	1,200	926.00	1,111,200	
日本毛織	6,900	911.00	6,285,900	
ダイトウボウ	3,600	100.00	360,000	
トーア紡コーポレーション	800	427.00	341,600	
ダイドーリミテッド	2,900	159.00	461,100	
帝国繊維	2,600	2,130.00	5,538,000	
帝人	21,400	1,374.00	29,403,600	
東レ	164,900	692.70	114,226,230	
住江織物	500	1,516.00	758,000	
日本フェルト	1,300	443.00	575,900	
イチカワ	300	1,363.00	408,900	

日東製網	200	1,430.00	286,000	
アツギ	1,800	637.00	1,146,600	
ダイニック	900	708.00	637,200	
セーレン	4,700	2,516.00	11,825,200	
ソトー	800	805.00	644,000	
東海染工	300	1,129.00	338,700	
小松マテーレ	3,700	1,277.00	4,724,900	
ワコールホールディングス	5,700	2,124.00	12,106,800	
ホギメディカル	3,100	3,185.00	9,873,500	
クラウディアホールディングス	500	247.00	123,500	
T S Iホールディングス	7,600	354.00	2,690,400	
マツオカコーポレーション	700	1,222.00	855,400	
ワールド	3,000	1,216.00	3,648,000	
三陽商会	1,100	928.00	1,020,800	
ナイガイ	800	305.00	244,000	
オンワードホールディングス	13,700	305.00	4,178,500	
ルックホールディングス	700	1,310.00	917,000	
キムラタン	11,900	19.00	226,100	
ゴールドウイン	4,100	6,500.00	26,650,000	
デサント	4,400	4,180.00	18,392,000	
キング	1,100	551.00	606,100	
ヤマトインターナショナル	2,000	296.00	592,000	
特種東海製紙	1,400	4,080.00	5,712,000	
王子ホールディングス	95,200	553.00	52,645,600	
日本製紙	10,900	1,129.00	12,306,100	
三菱製紙	3,200	322.00	1,030,400	
北越コーポレーション	14,900	763.00	11,368,700	
中越パルプ工業	900	982.00	883,800	
巴川製紙所	700	817.00	571,900	
大王製紙	11,000	1,889.00	20,779,000	
阿波製紙	600	362.00	217,200	
レンゴー	21,500	851.00	18,296,500	
トモク	1,400	1,827.00	2,557,800	
ザ・バック	1,700	2,867.00	4,873,900	
北の達人コーポレーション	8,100	359.00	2,907,900	
クラレ	33,300	1,004.00	33,433,200	

旭化成	151,000	1,102.50	166,477,500
共和レザー	1,400	624.00	873,600
昭和電工	19,800	2,568.00	50,846,400
住友化学	167,400	534.00	89,391,600
住友精化	1,000	3,145.00	3,145,000
日産化学	12,400	6,620.00	82,088,000
ラサ工業	800	1,688.00	1,350,400
クレハ	1,800	8,070.00	14,526,000
多木化学	900	6,100.00	5,490,000
テイカ	1,700	1,299.00	2,208,300
石原産業	3,800	1,186.00	4,506,800
片倉コープアグリ	500	1,165.00	582,500
日本曹達	2,900	3,380.00	9,802,000
東ソー	32,900	1,684.00	55,403,600
トクヤマ	7,300	1,843.00	13,453,900
セントラル硝子	3,700	2,038.00	7,540,600
東亜合成	13,000	1,220.00	15,860,000
大阪ソーダ	2,100	2,879.00	6,045,900
関東電化工業	5,000	1,051.00	5,255,000
デンカ	8,300	3,610.00	29,963,000
信越化学工業	39,100	19,470.00	761,277,000
日本カーバイド工業	800	1,304.00	1,043,200
堺化学工業	1,600	2,337.00	3,739,200
第一稀元素化学工業	2,100	1,290.00	2,709,000
エア・ウォーター	21,600	1,783.00	38,512,800
日本酸素ホールディングス	21,900	2,575.00	56,392,500
日本化学工業	700	2,672.00	1,870,400
東邦アセチレン	400	1,263.00	505,200
日本パーカラライジング	11,500	1,123.00	12,914,500
高圧ガス工業	3,600	803.00	2,890,800
チタン工業	300	1,678.00	503,400
四国化成工業	3,000	1,430.00	4,290,000
戸田工業	500	3,140.00	1,570,000
ステラ ケミファ	1,100	2,592.00	2,851,200
保土谷化学工業	700	5,860.00	4,102,000
日本触媒	3,800	5,260.00	19,988,000

大日精化工業	1,900	2,272.00	4,316,800	
カネカ	5,900	3,850.00	22,715,000	
三菱瓦斯化学	21,200	1,932.00	40,958,400	
三井化学	20,700	3,180.00	65,826,000	
J S R	21,200	4,320.00	91,584,000	
東京応化工業	3,900	7,130.00	27,807,000	
大阪有機化学工業	1,900	3,570.00	6,783,000	
三菱ケミカルホールディングス	152,300	840.10	127,947,230	
K Hネオケム	3,800	3,015.00	11,457,000	
ダイセル	32,800	799.00	26,207,200	
住友ベークライト	3,600	5,540.00	19,944,000	
積水化学工業	47,700	1,948.00	92,919,600	
日本ゼオン	20,500	1,249.00	25,604,500	
アイカ工業	6,300	3,505.00	22,081,500	
宇部興産	10,700	1,967.00	21,046,900	
積水樹脂	3,400	2,115.00	7,191,000	
タキロンシーアイ	4,900	549.00	2,690,100	
旭有機材	1,300	1,730.00	2,249,000	
ニチバン	1,300	1,864.00	2,423,200	
リケンテクノス	5,600	511.00	2,861,600	
大倉工業	1,200	2,193.00	2,631,600	
積水化成成品工業	3,100	495.00	1,534,500	
群栄化学工業	500	3,600.00	1,800,000	
タイガースポリマー	1,200	455.00	546,000	
ミライアル	700	1,808.00	1,265,600	
ダイキアクシス	900	836.00	752,400	
ダイキョーニシカワ	4,800	554.00	2,659,200	
竹本容器	800	830.00	664,000	
森六ホールディングス	1,200	1,840.00	2,208,000	
恵和	600	5,620.00	3,372,000	
日本化薬	17,900	1,183.00	21,175,700	
カーリットホールディングス	2,300	692.00	1,591,600	
日本精化	1,800	2,227.00	4,008,600	
扶桑化学工業	2,100	4,785.00	10,048,500	
トリケミカル研究所	2,300	3,785.00	8,705,500	
A D E K A	10,500	2,578.00	27,069,000	



日油	7,800	5,730.00	44,694,000	
新日本理化	3,700	253.00	936,100	
ハリマ化成グループ	1,700	810.00	1,377,000	
花王	51,400	6,031.00	309,993,400	
第一工業製薬	800	3,170.00	2,536,000	
石原ケミカル	1,100	1,335.00	1,468,500	
日華化学	800	839.00	671,200	
ニイタカ	500	2,211.00	1,105,500	
三洋化成工業	1,400	5,250.00	7,350,000	
有機合成薬品工業	1,600	280.00	448,000	
大日本塗料	2,800	851.00	2,382,800	
日本ペイントホールディングス	85,600	1,310.00	112,136,000	
関西ペイント	23,600	2,629.00	62,044,400	
神東塗料	1,700	181.00	307,700	
中国塗料	5,400	903.00	4,876,200	
日本特殊塗料	1,700	833.00	1,416,100	
藤倉化成	2,800	483.00	1,352,400	
太陽ホールディングス	3,400	3,365.00	11,441,000	
D I C	9,600	2,960.00	28,416,000	
サカタインクス	4,500	1,025.00	4,612,500	
東洋インキS Cホールディングス	4,800	1,956.00	9,388,800	
T & K T O K A	1,800	822.00	1,479,600	
富士フイルムホールディングス	40,900	8,608.00	352,067,200	
資生堂	43,300	6,738.00	291,755,400	
ライオン	28,100	1,586.00	44,566,600	
高砂香料工業	1,600	2,822.00	4,515,200	
マンダム	4,900	1,423.00	6,972,700	
ミルボン	2,900	5,680.00	16,472,000	
ファンケル	9,400	3,530.00	33,182,000	
コーセー	4,400	13,970.00	61,468,000	
コタ	1,500	1,552.00	2,328,000	
シーボン	300	1,697.00	509,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,900	2,105.00	20,839,500	
ノエビアホールディングス	2,000	5,360.00	10,720,000	
アジュバンホールディングス	500	1,120.00	560,000	
新日本製薬	600	1,124.00	674,400	

エステー	1,500	1,556.00	2,334,000	
アグロ カネショウ	800	1,255.00	1,004,000	
コニシ	3,800	1,734.00	6,589,200	
長谷川香料	4,000	2,751.00	11,004,000	
星光PMC	1,300	704.00	915,200	
小林製薬	6,500	9,140.00	59,410,000	
荒川化学工業	1,900	1,189.00	2,259,100	
メック	1,700	4,270.00	7,259,000	
日本高純度化学	600	2,598.00	1,558,800	
タカラバイオ	6,100	2,623.00	16,000,300	
JCU	2,600	5,110.00	13,286,000	
新田ゼラチン	1,500	606.00	909,000	
OATアグリオ	500	2,106.00	1,053,000	
デクセリアルズ	6,000	3,890.00	23,340,000	
アース製薬	1,900	6,490.00	12,331,000	
北興化学工業	2,200	878.00	1,931,600	
大成ラミック	700	2,825.00	1,977,500	
クミアイ化学工業	8,700	831.00	7,229,700	
日本農薬	4,100	488.00	2,000,800	
アキレス	1,500	1,257.00	1,885,500	
有沢製作所	3,400	953.00	3,240,200	
日東電工	14,100	8,500.00	119,850,000	
レック	3,000	867.00	2,601,000	
三光合成	2,400	385.00	924,000	
きもと	3,500	216.00	756,000	
藤森工業	2,100	3,770.00	7,917,000	
前澤化成工業	1,500	1,281.00	1,921,500	
未来工業	800	1,600.00	1,280,000	
ウェーブロックホールディングス	900	777.00	699,300	
JSP	1,400	1,637.00	2,291,800	
エフピコ	4,300	4,045.00	17,393,500	
天馬	1,800	2,574.00	4,633,200	
信越ポリマー	4,200	1,129.00	4,741,800	
東リ	5,800	225.00	1,305,000	
ニフコ	7,800	3,350.00	26,130,000	
バルカー	1,900	2,533.00	4,812,700	

ユニ・チャーム	44,800	4,784.00	214,323,200	
ショーエイコーポレーション	600	714.00	428,400	
協和キリン	27,300	3,205.00	87,496,500	
武田薬品工業	182,800	3,081.00	563,206,800	
アステラス製薬	201,700	1,777.00	358,420,900	
大日本住友製薬	14,400	1,336.00	19,238,400	
塩野義製薬	29,200	7,700.00	224,840,000	
わかもと製薬	2,800	292.00	817,600	
日本新薬	6,100	8,080.00	49,288,000	
中外製薬	72,700	3,700.00	268,990,000	
科研製薬	3,600	4,135.00	14,886,000	
エーザイ	27,800	6,714.00	186,649,200	
ロート製薬	11,900	3,430.00	40,817,000	
小野薬品工業	53,400	2,747.00	146,689,800	
久光製薬	6,100	3,900.00	23,790,000	
持田製薬	2,900	3,430.00	9,947,000	
参天製薬	43,400	1,412.00	61,280,800	
扶桑薬品工業	800	2,462.00	1,969,600	
日本ケミファ	300	1,971.00	591,300	
ツムラ	7,200	3,340.00	24,048,000	
日医工	7,200	696.00	5,011,200	
キッセイ薬品工業	4,100	2,140.00	8,774,000	
生化学工業	4,100	979.00	4,013,900	
栄研化学	4,100	1,956.00	8,019,600	
日水製薬	900	1,104.00	993,600	
鳥居薬品	1,200	2,830.00	3,396,000	
JCRファーマ	6,600	2,249.00	14,843,400	
東和薬品	3,300	2,717.00	8,966,100	
富士製薬工業	1,400	1,017.00	1,423,800	
ゼリア新薬工業	4,200	1,975.00	8,295,000	
第一三共	182,800	2,807.50	513,211,000	
キョーリン製薬ホールディングス	4,700	1,793.00	8,427,100	
大幸薬品	3,500	787.00	2,754,500	
ダイト	1,500	2,987.00	4,480,500	
大塚ホールディングス	48,300	4,094.00	197,740,200	
大正製薬ホールディングス	5,500	5,420.00	29,810,000	

ペプチドリーム	12,200	2,779.00	33,903,800	
あすか製薬ホールディングス	2,600	964.00	2,506,400	
サワイグループホールディングス	5,100	4,485.00	22,873,500	
日本コークス工業	19,600	127.00	2,489,200	
ニチレキ	3,000	1,454.00	4,362,000	
ユシロ化学工業	1,200	1,101.00	1,321,200	
ビービー・カストロール	800	1,406.00	1,124,800	
富士石油	6,200	261.00	1,618,200	
MORESCO	800	1,146.00	916,800	
出光興産	25,800	2,958.00	76,316,400	
E N E O Sホールディングス	349,900	431.00	150,806,900	
コスモエネルギーホールディングス	6,700	2,340.00	15,678,000	
横浜ゴム	13,500	1,864.00	25,164,000	
TOYO TIRE	12,200	1,802.00	21,984,400	
ブリヂストン	67,000	4,923.00	329,841,000	
住友ゴム工業	20,900	1,213.00	25,351,700	
藤倉コンポジット	1,900	815.00	1,548,500	
オカモト	1,400	4,105.00	5,747,000	
フコク	1,000	946.00	946,000	
ニッタ	2,400	2,899.00	6,957,600	
住友理工	4,500	610.00	2,745,000	
三ツ星ベルト	2,800	2,040.00	5,712,000	
バンドー化学	3,800	883.00	3,355,400	
日東紡績	3,500	2,983.00	10,440,500	
A G C	21,400	5,600.00	119,840,000	
日本板硝子	11,200	517.00	5,790,400	
石塚硝子	400	1,948.00	779,200	
日本山村硝子	900	800.00	720,000	
日本電気硝子	9,300	2,997.00	27,872,100	
オハラ	900	1,405.00	1,264,500	
住友大阪セメント	4,300	3,625.00	15,587,500	
太平洋セメント	13,200	2,309.00	30,478,800	
日本ヒューム	2,300	703.00	1,616,900	
日本コンクリート工業	4,600	265.00	1,219,000	
三谷セキサン	1,100	7,880.00	8,668,000	
アジアパイルホールディングス	3,600	433.00	1,558,800	

東海カーボン	19,500	1,212.00	23,634,000
日本カーボン	1,200	4,365.00	5,238,000
東洋炭素	1,500	3,380.00	5,070,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,300	4,745.00	6,168,500
TOTO	16,600	5,510.00	91,466,000
日本碍子	25,200	1,875.00	47,250,000
日本特殊陶業	17,700	1,974.00	34,939,800
ダントーホールディングス	1,500	213.00	319,500
MARUWA	800	14,640.00	11,712,000
品川リフラクトリーズ	500	3,595.00	1,797,500
黒崎播磨	400	4,160.00	1,664,000
ヨータイ	1,500	1,275.00	1,912,500
イソライト工業	1,000	882.00	882,000
東京窯業	2,900	309.00	896,100
ニッカトー	1,100	684.00	752,400
フジインコーポレーテッド	1,900	7,740.00	14,706,000
クニミネ工業	700	1,039.00	727,300
エーアンドエーマテリアル	400	919.00	367,600
ニチアス	5,400	2,770.00	14,958,000
ニチハ	3,200	3,080.00	9,856,000
日本製鉄	102,900	1,839.50	189,284,550
神戸製鋼所	42,900	573.00	24,581,700
中山製鋼所	3,600	431.00	1,551,600
合同製鐵	1,200	1,373.00	1,647,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	62,100	1,407.00	87,374,700
東京製鐵	7,800	1,378.00	10,748,400
共英製鋼	2,600	1,359.00	3,533,400
大和工業	4,400	3,710.00	16,324,000
東京鐵鋼	1,000	1,325.00	1,325,000
大阪製鐵	1,200	1,172.00	1,406,400
淀川製鋼所	3,000	2,468.00	7,404,000
丸一鋼管	8,100	2,632.00	21,319,200
モリ工業	700	2,708.00	1,895,600
大同特殊鋼	3,800	4,150.00	15,770,000
日本高周波鋼業	800	349.00	279,200
日本冶金工業	1,700	2,174.00	3,695,800

山陽特殊製鋼	2,400	1,934.00	4,641,600
愛知製鋼	1,300	2,521.00	3,277,300
日立金属	24,400	2,131.00	51,996,400
日本金属	600	921.00	552,600
大平洋金属	1,400	2,152.00	3,012,800
新日本電工	14,800	295.00	4,366,000
栗本鐵工所	1,000	1,541.00	1,541,000
虹技	300	1,007.00	302,100
日本鑄鉄管	200	1,101.00	220,200
三菱製鋼	1,500	1,009.00	1,513,500
日亜鋼業	3,000	276.00	828,000
日本精線	400	4,785.00	1,914,000
エンビプロ・ホールディングス	1,000	1,854.00	1,854,000
シンニッタン	2,700	223.00	602,100
新家工業	600	1,678.00	1,006,800
大紀アルミニウム工業所	3,500	1,421.00	4,973,500
日本軽金属ホールディングス	5,800	1,690.00	9,802,000
三井金属鉱業	6,200	3,025.00	18,755,000
東邦亜鉛	1,300	2,216.00	2,880,800
三菱マテリアル	15,200	2,027.00	30,810,400
住友金属鉱山	29,400	4,441.00	130,565,400
D O W Aホールディングス	6,300	4,490.00	28,287,000
古河機械金属	3,800	1,251.00	4,753,800
エス・サイエンス	10,400	28.00	291,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,700	812.00	2,192,400
東邦チタニウム	4,100	963.00	3,948,300
U A C J	3,500	2,394.00	8,379,000
C Kサンエツ	500	3,965.00	1,982,500
古河電気工業	7,100	2,304.00	16,358,400
住友電気工業	86,000	1,522.50	130,935,000
フジクラ	25,600	583.00	14,924,800
昭和電線ホールディングス	2,000	1,836.00	3,672,000
東京特殊電線	300	2,892.00	867,600
タツタ電線	4,100	479.00	1,963,900
カナレ電気	300	1,732.00	519,600
平河ヒューテック	1,300	1,202.00	1,562,600

リョービ	2,800	1,128.00	3,158,400	
アーレスティ	2,400	371.00	890,400	
アサヒホールディングス	9,200	2,005.00	18,446,000	
稲葉製作所	1,300	1,336.00	1,736,800	
宮地エンジニアリンググループ	700	3,150.00	2,205,000	
トーカロ	5,900	1,522.00	8,979,800	
アルファC o	900	1,190.00	1,071,000	
SUMCO	35,400	2,372.00	83,968,800	
川田テクノロジーズ	500	3,805.00	1,902,500	
RS Technologies	700	6,350.00	4,445,000	
ジェイテックコーポレーション	300	1,914.00	574,200	
信和	1,400	766.00	1,072,400	
東洋製罐グループホールディングス	14,600	1,422.00	20,761,200	
ホッカンホールディングス	1,300	1,456.00	1,892,800	
コロナ	1,300	906.00	1,177,800	
横河ブリッジホールディングス	3,900	2,149.00	8,381,100	
駒井ハルテック	400	2,129.00	851,600	
高田機工	200	2,718.00	543,600	
三和ホールディングス	21,700	1,244.00	26,994,800	
文化シャッター	7,300	1,056.00	7,708,800	
三協立山	3,000	733.00	2,199,000	
アルインコ	1,700	968.00	1,645,600	
東洋シャッター	500	618.00	309,000	
LIXIL	36,200	3,070.00	111,134,000	
日本ファイルコン	1,600	532.00	851,200	
ノーリツ	4,400	1,747.00	7,686,800	
長府製作所	2,300	2,045.00	4,703,500	
リンナイ	4,300	10,900.00	46,870,000	
ダイニチ工業	1,100	771.00	848,100	
日東精工	2,900	623.00	1,806,700	
三洋工業	300	1,862.00	558,600	
岡部	4,700	738.00	3,468,600	
ジーテクト	2,900	1,442.00	4,181,800	
東プレ	4,300	1,140.00	4,902,000	
高周波熱錬	4,100	582.00	2,386,200	
東京製綱	1,400	973.00	1,362,200	

サンコール	2,000	457.00	914,000	
モリテック スチール	1,800	380.00	684,000	
パイオラックス	3,400	1,761.00	5,987,400	
エイチワン	2,300	670.00	1,541,000	
日本発條	21,100	992.00	20,931,200	
中央発條	1,100	901.00	991,100	
アドバネクス	300	1,215.00	364,500	
立川ブラインド工業	1,000	1,197.00	1,197,000	
三益半導体工業	1,800	2,439.00	4,390,200	
日本ドライケミカル	600	1,921.00	1,152,600	
日本製鋼所	7,000	3,700.00	25,900,000	
三浦工業	10,000	3,975.00	39,750,000	
タクマ	7,800	1,413.00	11,021,400	
ツガミ	5,100	1,556.00	7,935,600	
オークマ	2,700	5,060.00	13,662,000	
芝浦機械	2,600	3,700.00	9,620,000	
アマダ	36,300	1,154.00	41,890,200	
アイダエンジニアリング	6,000	973.00	5,838,000	
滝澤鉄工所	700	1,210.00	847,000	
F U J I	10,600	2,701.00	28,630,600	
牧野フライス製作所	2,500	3,835.00	9,587,500	
オーエスジー	10,600	1,758.00	18,634,800	
ダイジェット工業	300	991.00	297,300	
旭ダイヤモンド工業	6,000	652.00	3,912,000	
D M G 森精機	13,600	1,986.00	27,009,600	
ソディック	5,100	830.00	4,233,000	
ディスコ	3,400	33,050.00	112,370,000	
日東工器	1,300	1,782.00	2,316,600	
日進工具	1,800	1,528.00	2,750,400	
パンチ工業	1,900	536.00	1,018,400	
富士ダイス	1,200	676.00	811,200	
豊和工業	1,200	788.00	945,600	
O K K	900	747.00	672,300	
石川製作所	600	1,448.00	868,800	
東洋機械金属	1,500	518.00	777,000	
津田駒工業	400	665.00	266,000	



エンシュウ	500	670.00	335,000
島精機製作所	3,400	2,075.00	7,055,000
オプトラン	2,900	2,492.00	7,226,800
N Cホールディングス	600	1,553.00	931,800
イワキポンプ	1,500	1,033.00	1,549,500
フリュー	2,000	1,280.00	2,560,000
ヤマシンフィルタ	4,600	501.00	2,304,600
日阪製作所	2,800	854.00	2,391,200
やまびこ	4,500	1,302.00	5,859,000
野村マイクロ・サイエンス	600	4,955.00	2,973,000
平田機工	1,100	6,020.00	6,622,000
ペガサスミシン製造	2,300	493.00	1,133,900
マルマエ	900	2,841.00	2,556,900
タツモ	1,100	1,567.00	1,723,700
ナブテスコ	13,100	3,235.00	42,378,500
三井海洋開発	2,400	1,413.00	3,391,200
レオン自動機	2,500	1,390.00	3,475,000
S M C	6,800	76,120.00	517,616,000
ホソカワミクロン	1,600	3,150.00	5,040,000
ユニオンツール	900	4,015.00	3,613,500
オイレス工業	3,200	1,764.00	5,644,800
日精エー・エス・ビー機械	800	3,085.00	2,468,000
サトーホールディングス	3,000	2,198.00	6,594,000
技研製作所	2,000	4,290.00	8,580,000
日本エアーテック	1,100	1,255.00	1,380,500
カワタ	700	892.00	624,400
日精樹脂工業	1,600	1,021.00	1,633,600
オカダアイヨン	700	1,489.00	1,042,300
ワイエイシイホールディングス	900	909.00	818,100
小松製作所	105,400	2,709.50	285,581,300
住友重機械工業	13,300	2,663.00	35,417,900
日立建機	9,300	3,365.00	31,294,500
日工	3,200	627.00	2,006,400
巴工業	900	2,348.00	2,113,200
井関農機	2,200	1,441.00	3,170,200
T O W A	2,000	3,190.00	6,380,000

丸山製作所	500	1,573.00	786,500	
北川鉄工所	1,000	1,474.00	1,474,000	
ローツェ	1,100	11,980.00	13,178,000	
タカキタ	800	658.00	526,400	
クボタ	113,500	2,550.00	289,425,000	
荏原実業	1,100	2,534.00	2,787,400	
三菱化工機	700	2,281.00	1,596,700	
月島機械	4,300	1,141.00	4,906,300	
帝国電機製作所	1,600	1,473.00	2,356,800	
東京機械製作所	900	1,155.00	1,039,500	
新東工業	5,100	716.00	3,651,600	
澁谷工業	2,000	3,040.00	6,080,000	
アイチ コーポレーション	3,400	809.00	2,750,600	
小森コーポレーション	5,900	727.00	4,289,300	
鶴見製作所	1,800	1,620.00	2,916,000	
住友精密工業	300	2,142.00	642,600	
日本ギア工業	800	276.00	220,800	
酒井重工業	400	2,797.00	1,118,800	
荏原製作所	9,700	6,550.00	63,535,000	
石井鐵工所	300	2,978.00	893,400	
西島製作所	2,100	917.00	1,925,700	
北越工業	2,200	1,005.00	2,211,000	
ダイキン工業	29,600	26,470.00	783,512,000	
オルガノ	700	7,570.00	5,299,000	
トーヨーカネツ	900	2,537.00	2,283,300	
栗田工業	12,600	5,200.00	65,520,000	
椿本チエイン	3,000	3,035.00	9,105,000	
大同工業	1,000	941.00	941,000	
木村化工機	1,900	921.00	1,749,900	
アネスト岩田	3,600	926.00	3,333,600	
ダイフク	12,800	9,580.00	122,624,000	
サムコ	600	3,080.00	1,848,000	
加藤製作所	1,100	843.00	927,300	
油研工業	400	1,714.00	685,600	
タダノ	12,200	1,098.00	13,395,600	
フジテック	8,600	2,537.00	21,818,200	

C K D	6,900	2,230.00	15,387,000	
キトー	2,000	1,883.00	3,766,000	
平和	6,500	1,925.00	12,512,500	
理想科学工業	1,900	2,085.00	3,961,500	
S A N K Y O	5,000	3,100.00	15,500,000	
日本金銭機械	2,400	691.00	1,658,400	
マースグループホールディングス	1,500	1,649.00	2,473,500	
フクシマガリレイ	1,600	4,645.00	7,432,000	
オーイズミ	800	389.00	311,200	
ダイコク電機	1,100	1,212.00	1,333,200	
竹内製作所	3,500	2,750.00	9,625,000	
アマノ	6,100	2,652.00	16,177,200	
J U K I	3,200	905.00	2,896,000	
サンデンホールディングス	3,200	247.00	790,400	
ジャノメ	2,000	656.00	1,312,000	
マックス	3,100	1,861.00	5,769,100	
グローリー	6,000	2,200.00	13,200,000	
新晃工業	2,200	1,900.00	4,180,000	
大和冷機工業	3,400	1,236.00	4,202,400	
セガサミーホールディングス	23,100	1,902.00	43,936,200	
日本ピストンリング	800	1,266.00	1,012,800	
リケン	1,000	2,534.00	2,534,000	
T P R	3,100	1,463.00	4,535,300	
ツバキ・ナカシマ	5,100	1,492.00	7,609,200	
ホシザキ	6,800	8,580.00	58,344,000	
大豊工業	1,900	764.00	1,451,600	
日本精工	43,800	779.00	34,120,200	
N T N	49,900	227.00	11,327,300	
ジェイテクト	22,300	1,060.00	23,638,000	
不二越	2,000	4,100.00	8,200,000	
日本トムソン	6,400	680.00	4,352,000	
T H K	13,500	2,752.00	37,152,000	
ユーシン精機	1,800	756.00	1,360,800	
前澤給装工業	1,700	1,034.00	1,757,800	
イーグル工業	2,900	1,094.00	3,172,600	
前澤工業	1,400	615.00	861,000	

日本ピラー工業	2,400	3,345.00	8,028,000	
キット	7,800	741.00	5,779,800	
マキタ	28,300	4,979.00	140,905,700	
三井E & Sホールディングス	8,400	379.00	3,183,600	
日立造船	19,700	795.00	15,661,500	
三菱重工業	36,500	2,653.50	96,852,750	
I H I	14,500	2,276.00	33,002,000	
サノヤスホールディングス	2,800	124.00	347,200	
スター精密	3,600	1,608.00	5,788,800	
日清紡ホールディングス	14,200	876.00	12,439,200	
イビデン	12,200	6,860.00	83,692,000	
コニカミノルタ	50,800	492.00	24,993,600	
ブラザー工業	28,400	2,085.00	59,214,000	
ミネベアミツミ	40,100	3,290.00	131,929,000	
日立製作所	111,900	6,540.00	731,826,000	
東芝	40,600	4,682.00	190,089,200	
三菱電機	232,600	1,479.00	344,015,400	
富士電機	14,000	6,100.00	85,400,000	
東洋電機製造	900	1,052.00	946,800	
安川電機	25,000	5,710.00	142,750,000	
シンフォニアテクノロジー	2,800	1,299.00	3,637,200	
明電舎	3,900	2,677.00	10,440,300	
オリジン	600	1,285.00	771,000	
山洋電気	1,000	5,780.00	5,780,000	
デンヨー	2,000	1,746.00	3,492,000	
P H Cホールディングス	2,700	2,129.00	5,748,300	
東芝テック	2,500	4,500.00	11,250,000	
芝浦メカトロニクス	400	8,250.00	3,300,000	
マブチモーター	5,400	3,870.00	20,898,000	
日本電産	60,300	13,430.00	809,829,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	456.00	456,000	
トレックス・セミコンダクター	1,200	3,325.00	3,990,000	
東光高岳	1,300	1,349.00	1,753,700	
ダブル・スコープ	6,700	792.00	5,306,400	
ダイヘン	2,500	4,545.00	11,362,500	
ヤーマン	3,800	997.00	3,788,600	

JVCケンウッド	18,900	167.00	3,156,300	
ミマキエンジニアリング	2,100	884.00	1,856,400	
I - P E X	1,100	1,987.00	2,185,700	
日新電機	5,500	1,483.00	8,156,500	
大崎電気工業	4,300	453.00	1,947,900	
オムロン	19,400	11,750.00	227,950,000	
日東工業	3,100	1,606.00	4,978,600	
I D E C	2,900	2,843.00	8,244,700	
正興電機製作所	700	1,215.00	850,500	
不二電機工業	400	1,169.00	467,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,800	2,501.00	19,507,800	
サクサホールディングス	500	1,354.00	677,000	
メルコホールディングス	600	4,115.00	2,469,000	
テクノメディカ	500	1,685.00	842,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	1,312.00	787,200	
日本電気	29,600	5,330.00	157,768,000	
富士通	20,900	19,620.00	410,058,000	
沖電気工業	9,400	890.00	8,366,000	
岩崎通信機	900	849.00	764,100	
電気興業	1,200	2,640.00	3,168,000	
サンケン電気	2,200	5,970.00	13,134,000	
ナカヨ	400	1,249.00	499,600	
アイホン	1,300	1,985.00	2,580,500	
ルネサスエレクトロニクス	126,000	1,456.00	183,456,000	
セイコーエプソン	28,900	1,958.00	56,586,200	
ワコム	18,000	932.00	16,776,000	
アルバック	4,300	6,520.00	28,036,000	
アクセル	1,000	955.00	955,000	
E I Z O	1,800	4,085.00	7,353,000	
ジャパンディスプレイ	79,300	37.00	2,934,100	
日本信号	5,900	925.00	5,457,500	
京三製作所	5,000	477.00	2,385,000	
能美防災	3,100	2,098.00	6,503,800	
ホーチキ	1,700	1,245.00	2,116,500	
星和電機	1,100	515.00	566,500	

エレコム	5,300	1,467.00	7,775,100
パナソニック	248,100	1,246.50	309,256,650
シャープ	26,500	1,304.00	34,556,000
アンリツ	15,000	1,765.00	26,475,000
富士通ゼネラル	6,300	2,789.00	17,570,700
ソニーグループ	145,700	13,870.00	2,020,859,000
T D K	33,700	4,575.00	154,177,500
帝国通信工業	1,000	1,271.00	1,271,000
タムラ製作所	9,000	632.00	5,688,000
アルプスアルパイン	20,600	1,069.00	22,021,400
池上通信機	700	708.00	495,600
日本電波工業	2,100	1,788.00	3,754,800
鈴木	1,000	902.00	902,000
メイコー	1,900	4,065.00	7,723,500
日本トリム	400	3,545.00	1,418,000
ローランド ディー . ジー .	1,400	2,924.00	4,093,600
フォスター電機	2,300	721.00	1,658,300
S M K	500	2,316.00	1,158,000
ヨコオ	1,700	2,847.00	4,839,900
ティアック	3,800	133.00	505,400
ホシデン	5,600	1,197.00	6,703,200
ヒロセ電機	3,600	19,450.00	70,020,000
日本航空電子工業	5,300	1,990.00	10,547,000
T O A	2,500	809.00	2,022,500
マクセル	4,600	1,443.00	6,637,800
古野電気	2,800	1,181.00	3,306,800
ユニデンホールディングス	500	3,415.00	1,707,500
スミダコーポレーション	2,200	1,168.00	2,569,600
アイコム	900	2,373.00	2,135,700
リオン	900	2,400.00	2,160,000
本多通信工業	1,800	439.00	790,200
横河電機	23,300	2,089.00	48,673,700
新電元工業	900	3,545.00	3,190,500
アズビル	13,600	5,110.00	69,496,000
東亜ディーケーケー	1,100	852.00	937,200
日本光電工業	9,600	3,315.00	31,824,000

チノー	700	1,547.00	1,082,900	
共和電業	2,200	400.00	880,000	
日本電子材料	1,100	2,255.00	2,480,500	
堀場製作所	4,300	6,890.00	29,627,000	
アドバンテスト	17,300	10,130.00	175,249,000	
小野測器	1,000	501.00	501,000	
エスベック	1,900	2,182.00	4,145,800	
キーエンス	21,100	72,370.00	1,527,007,000	
日置電機	1,100	8,890.00	9,779,000	
シスメックス	19,700	14,280.00	281,316,000	
日本マイクロニクス	4,000	1,806.00	7,224,000	
メガチップス	2,200	4,950.00	10,890,000	
OBARA GROUP	1,100	3,430.00	3,773,000	
澤藤電機	300	1,759.00	527,700	
原田工業	1,100	997.00	1,096,700	
コーセル	2,800	938.00	2,626,400	
イリソ電子工業	2,000	4,540.00	9,080,000	
オブテックスグループ	3,800	1,640.00	6,232,000	
千代田インテグレ	1,000	2,115.00	2,115,000	
アイ・オー・データ機器	900	786.00	707,400	
レーザーテック	10,200	30,220.00	308,244,000	
スタンレー電気	16,300	3,020.00	49,226,000	
岩崎電気	800	2,297.00	1,837,600	
ウシオ電機	11,900	2,018.00	24,014,200	
岡谷電機産業	1,600	321.00	513,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,000	282.00	564,000	
エノモト	600	1,681.00	1,008,600	
日本セラミック	2,200	2,878.00	6,331,600	
遠藤照明	1,100	1,093.00	1,202,300	
古河電池	1,700	1,478.00	2,512,600	
双信電機	1,000	657.00	657,000	
山一電機	1,700	2,316.00	3,937,200	
図研	1,500	3,685.00	5,527,500	
日本電子	4,800	8,990.00	43,152,000	
カシオ計算機	16,800	1,527.00	25,653,600	
ファナック	20,400	24,030.00	490,212,000	

日本シイエムケイ	4,600	610.00	2,806,000	
エンプラス	600	2,626.00	1,575,600	
大真空	3,100	1,525.00	4,727,500	
ローム	10,400	10,600.00	110,240,000	
浜松ホトニクス	16,700	7,030.00	117,401,000	
三井ハイテック	2,300	8,750.00	20,125,000	
新光電気工業	6,800	5,460.00	37,128,000	
京セラ	32,700	7,088.00	231,777,600	
太陽誘電	11,300	6,580.00	74,354,000	
村田製作所	68,300	8,770.00	598,991,000	
双葉電子工業	4,000	713.00	2,852,000	
北陸電気工業	900	1,378.00	1,240,200	
ニチコン	7,300	1,243.00	9,073,900	
日本ケミコン	2,200	1,954.00	4,298,800	
K O A	3,500	1,577.00	5,519,500	
市光工業	2,800	536.00	1,500,800	
小糸製作所	12,800	6,540.00	83,712,000	
ミツバ	4,300	459.00	1,973,700	
S C R E E Nホールディングス	4,000	11,700.00	46,800,000	
キヤノン電子	2,100	1,610.00	3,381,000	
キヤノン	115,600	2,637.00	304,837,200	
リコー	64,500	1,007.00	64,951,500	
象印マホービン	6,300	1,601.00	10,086,300	
M U T O Hホールディングス	300	1,662.00	498,600	
東京エレクトロン	14,800	61,840.00	915,232,000	
トヨタ紡織	9,500	2,200.00	20,900,000	
芦森工業	400	915.00	366,000	
ユニプレス	3,500	774.00	2,709,000	
豊田自動織機	18,800	9,210.00	173,148,000	
モリタホールディングス	3,700	1,319.00	4,880,300	
三櫻工業	3,200	1,001.00	3,203,200	
デンソー	51,200	8,694.00	445,132,800	
東海理化電機製作所	6,100	1,579.00	9,631,900	
川崎重工業	17,000	1,985.00	33,745,000	
名村造船所	6,900	219.00	1,511,100	
日本車輛製造	800	2,029.00	1,623,200	



三菱ロジスネクスト	3,100	1,179.00	3,654,900	
近畿車輛	300	1,010.00	303,000	
日産自動車	274,300	546.40	149,877,520	
いすゞ自動車	73,000	1,485.00	108,405,000	
トヨタ自動車	1,178,100	2,052.00	2,417,461,200	
日野自動車	29,000	969.00	28,101,000	
三菱自動車工業	86,100	330.00	28,413,000	
エフテック	1,600	519.00	830,400	
レシップホールディングス	900	584.00	525,600	
G M B	400	726.00	290,400	
ファルテック	400	707.00	282,800	
武蔵精密工業	5,200	1,803.00	9,375,600	
日産車体	3,400	744.00	2,529,600	
新明和工業	6,600	877.00	5,788,200	
極東開発工業	4,300	1,542.00	6,630,600	
トピー工業	1,900	1,102.00	2,093,800	
ティラド	700	2,972.00	2,080,400	
曙ブレーキ工業	12,700	191.00	2,425,700	
タチエス	4,100	1,223.00	5,014,300	
N O K	11,300	1,267.00	14,317,100	
フタバ産業	5,800	414.00	2,401,200	
K Y B	2,400	2,959.00	7,101,600	
大同メタル工業	4,500	596.00	2,682,000	
プレス工業	11,500	392.00	4,508,000	
ミクニ	2,900	310.00	899,000	
太平洋工業	4,900	1,119.00	5,483,100	
河西工業	2,800	292.00	817,600	
アイシン	17,000	4,395.00	74,715,000	
マツダ	73,000	914.00	66,722,000	
今仙電機製作所	1,500	586.00	879,000	
本田技研工業	183,100	3,185.00	583,173,500	
スズキ	53,200	4,597.00	244,560,400	
S U B A R U	66,700	2,087.50	139,236,250	
安永	1,100	963.00	1,059,300	
ヤマハ発動機	30,300	2,960.00	89,688,000	
T B K	2,500	413.00	1,032,500	

エクセディ	3,500	1,747.00	6,114,500
豊田合成	7,500	2,434.00	18,255,000
愛三工業	3,600	804.00	2,894,400
盟和産業	300	989.00	296,700
日本プラスト	1,800	522.00	939,600
ヨロズ	2,200	1,125.00	2,475,000
エフ・シー・シー	3,800	1,525.00	5,795,000
シマノ	9,400	31,640.00	297,416,000
テイ・エス テック	9,800	1,410.00	13,818,000
ジャムコ	1,400	906.00	1,268,400
テルモ	65,800	4,678.00	307,812,400
クリエートメディック	700	995.00	696,500
日機装	7,000	894.00	6,258,000
日本エム・ディ・エム	1,300	1,944.00	2,527,200
島津製作所	29,900	4,870.00	145,613,000
JMS	2,000	615.00	1,230,000
クボテック	500	271.00	135,500
長野計器	1,700	1,633.00	2,776,100
ブイ・テクノロジー	1,000	3,500.00	3,500,000
東京計器	1,500	1,003.00	1,504,500
愛知時計電機	300	4,710.00	1,413,000
インターアクション	1,200	2,392.00	2,870,400
オーバル	2,100	255.00	535,500
東京精密	3,900	4,895.00	19,090,500
マニー	9,300	1,637.00	15,224,100
ニコン	35,500	1,183.00	41,996,500
トプコン	10,900	1,676.00	18,268,400
オリンパス	122,000	2,442.50	297,985,000
理研計器	1,900	5,510.00	10,469,000
タムロン	1,800	2,798.00	5,036,400
H O Y A	45,400	17,880.00	811,752,000
シード	1,100	557.00	612,700
ノーリツ鋼機	2,100	2,557.00	5,369,700
エー・アンド・デイ	2,100	1,218.00	2,557,800
朝日インテック	25,500	2,527.00	64,438,500
シチズン時計	27,200	515.00	14,008,000

リズム	700	1,264.00	884,800
大研医器	1,800	560.00	1,008,000
メニコン	7,700	3,805.00	29,298,500
シンシア	200	529.00	105,800
松風	1,000	2,095.00	2,095,000
セイコーホールディングス	3,300	2,238.00	7,385,400
ニプロ	17,300	1,103.00	19,081,900
中本パックス	600	1,669.00	1,001,400
スノーピーク	3,000	3,685.00	11,055,000
パラマウントベッドホールディングス	4,500	1,932.00	8,694,000
トランザクション	1,300	1,008.00	1,310,400
粧美堂	700	387.00	270,900
ニホンフラッシュ	2,000	1,075.00	2,150,000
前田工織	2,600	3,980.00	10,348,000
永大産業	3,000	288.00	864,000
アートネイチャー	2,000	707.00	1,414,000
バンダイナムコホールディングス	20,800	8,989.00	186,971,200
アイフィスジャパン	600	668.00	400,800
共立印刷	3,800	142.00	539,600
S H O E I	2,200	4,865.00	10,703,000
フランスベッドホールディングス	3,000	910.00	2,730,000
パイロットコーポレーション	3,900	4,295.00	16,750,500
萩原工業	1,500	1,352.00	2,028,000
トッパン・フォームズ	3,200	1,548.00	4,953,600
フジシールインターナショナル	5,600	2,088.00	11,692,800
タカラトミー	9,700	1,097.00	10,640,900
広済堂ホールディングス	1,400	797.00	1,115,800
エステールホールディングス	600	637.00	382,200
タカノ	800	668.00	534,400
プロネクサス	1,800	1,084.00	1,951,200
ホクシン	1,600	158.00	252,800
ウッドワン	700	1,031.00	721,700
大建工業	1,400	2,235.00	3,129,000
凸版印刷	35,400	1,920.00	67,968,000
大日本印刷	27,500	2,769.00	76,147,500
共同印刷	700	2,984.00	2,088,800

N I S S H A	4,800	1,636.00	7,852,800	
光村印刷	200	1,474.00	294,800	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,100	1,800.00	1,980,000	
アシックス	20,600	2,734.00	56,320,400	
ツツミ	600	2,132.00	1,279,200	
ローランド	1,600	4,125.00	6,600,000	
小松ウオール工業	700	1,953.00	1,367,100	
ヤマハ	13,800	5,840.00	80,592,000	
河合楽器製作所	700	3,500.00	2,450,000	
クリナップ	2,200	534.00	1,174,800	
ピジョン	14,100	2,272.00	32,035,200	
兼松サステック	100	1,809.00	180,900	
キングジム	1,900	885.00	1,681,500	
リンテック	5,000	2,728.00	13,640,000	
イトーキ	4,300	363.00	1,560,900	
任天堂	13,100	53,800.00	704,780,000	
三菱鉛筆	3,800	1,240.00	4,712,000	
タカラスタANDARD	4,800	1,478.00	7,094,400	
コクヨ	11,200	1,730.00	19,376,000	
ナカバヤシ	2,100	502.00	1,054,200	
グローブライド	2,100	3,170.00	6,657,000	
オカムラ	8,000	1,335.00	10,680,000	
美津濃	2,300	2,202.00	5,064,600	
東京電力ホールディングス	174,100	306.00	53,274,600	
中部電力	71,200	1,199.00	85,368,800	
関西電力	88,100	1,065.00	93,826,500	
中国電力	36,300	938.00	34,049,400	
北陸電力	21,300	588.00	12,524,400	
東北電力	54,500	812.00	44,254,000	
四国電力	20,900	830.00	17,347,000	
九州電力	47,900	866.00	41,481,400	
北海道電力	20,200	510.00	10,302,000	
沖縄電力	4,900	1,451.00	7,109,900	
電源開発	19,800	1,508.00	29,858,400	
エフオン	1,400	639.00	894,600	
イーレックス	3,400	2,460.00	8,364,000	

レノバ	4,500	4,800.00	21,600,000	
東京瓦斯	44,600	1,995.00	88,977,000	
大阪瓦斯	42,100	1,871.00	78,769,100	
東邦瓦斯	10,700	2,999.00	32,089,300	
北海道瓦斯	1,200	1,511.00	1,813,200	
広島ガス	4,400	363.00	1,597,200	
西部ガスホールディングス	2,600	2,291.00	5,956,600	
静岡ガス	6,100	981.00	5,984,100	
メタウォーター	2,600	1,941.00	5,046,600	
SBSホールディングス	1,700	3,420.00	5,814,000	
東武鉄道	22,700	2,626.00	59,610,200	
相鉄ホールディングス	7,400	2,053.00	15,192,200	
東急	58,700	1,580.00	92,746,000	
京浜急行電鉄	29,900	1,140.00	34,086,000	
小田急電鉄	34,600	2,156.00	74,597,600	
京王電鉄	12,100	5,040.00	60,984,000	
京成電鉄	16,200	3,160.00	51,192,000	
富士急行	2,800	4,240.00	11,872,000	
新京成電鉄	500	2,057.00	1,028,500	
東日本旅客鉄道	40,900	7,090.00	289,981,000	
西日本旅客鉄道	28,200	5,051.00	142,438,200	
東海旅客鉄道	19,300	16,045.00	309,668,500	
西武ホールディングス	30,400	1,106.00	33,622,400	
鴻池運輸	3,700	1,159.00	4,288,300	
西日本鉄道	6,400	2,584.00	16,537,600	
ハマキョウレックス	1,600	2,940.00	4,704,000	
サカイ引越センター	1,100	4,345.00	4,779,500	
近鉄グループホールディングス	22,000	3,225.00	70,950,000	
阪急阪神ホールディングス	27,500	3,410.00	93,775,000	
南海電気鉄道	9,800	2,141.00	20,981,800	
京阪ホールディングス	9,800	2,622.00	25,695,600	
神戸電鉄	500	3,210.00	1,605,000	
名古屋鉄道	18,100	1,721.00	31,150,100	
山陽電気鉄道	1,700	2,000.00	3,400,000	
アルプス物流	1,500	1,046.00	1,569,000	
日本通運	7,600	6,750.00	51,300,000	

ヤマトホールディングス	30,900	2,723.00	84,140,700
山九	6,100	4,665.00	28,456,500
丸運	1,200	263.00	315,600
丸全昭和運輸	1,800	3,275.00	5,895,000
センコーグループホールディングス	11,000	935.00	10,285,000
トナミホールディングス	500	3,875.00	1,937,500
ニッコンホールディングス	7,400	2,126.00	15,732,400
日本石油輸送	200	2,627.00	525,400
福山通運	3,600	3,950.00	14,220,000
セイノーホールディングス	15,000	1,199.00	17,985,000
エスライン	700	900.00	630,000
神奈川中央交通	500	3,315.00	1,657,500
日立物流	4,300	5,600.00	24,080,000
丸和運輸機関	4,700	1,377.00	6,471,900
C & F ロジホールディングス	2,200	1,695.00	3,729,000
九州旅客鉄道	17,000	2,434.00	41,378,000
S Gホールディングス	41,600	2,604.00	108,326,400
日本郵船	18,400	8,120.00	149,408,000
商船三井	12,200	7,820.00	95,404,000
川崎汽船	6,800	6,840.00	46,512,000
N S ユナイテッド海運	1,200	3,465.00	4,158,000
明治海運	2,600	727.00	1,890,200
飯野海運	10,200	543.00	5,538,600
共栄タンカー	400	874.00	349,600
乾汽船	1,500	2,240.00	3,360,000
日本航空	50,500	2,163.00	109,231,500
A N Aホールディングス	56,000	2,378.00	133,168,000
パスコ	400	1,309.00	523,600
トランコム	600	9,200.00	5,520,000
日新	1,800	1,634.00	2,941,200
三菱倉庫	7,000	2,892.00	20,244,000
三井倉庫ホールディングス	2,300	2,407.00	5,536,100
住友倉庫	7,800	1,960.00	15,288,000
澁澤倉庫	1,300	2,286.00	2,971,800
東陽倉庫	3,700	324.00	1,198,800
日本トランスシティ	4,800	636.00	3,052,800

ケイヒン	400	1,324.00	529,600	
中央倉庫	1,300	970.00	1,261,000	
川西倉庫	400	1,144.00	457,600	
安田倉庫	1,800	982.00	1,767,600	
ファイズホールディングス	500	545.00	272,500	
東洋埠頭	700	1,499.00	1,049,300	
宇徳	1,600	723.00	1,156,800	
上組	12,100	2,165.00	26,196,500	
サンリツ	600	826.00	495,600	
キムラユニティー	600	1,318.00	790,800	
キューソー流通システム	1,100	908.00	998,800	
近鉄エクスプレス	4,200	3,060.00	12,852,000	
東海運	1,200	310.00	372,000	
エーアイティー	1,400	1,299.00	1,818,600	
内外トランスライン	800	2,019.00	1,615,200	
日本コンセプト	700	1,831.00	1,281,700	
NEC ネットエスアイ	7,500	1,841.00	13,807,500	
クロスキャット	600	1,587.00	952,200	
システナ	32,600	460.00	14,996,000	
デジタルアーツ	1,200	9,100.00	10,920,000	
日鉄ソリューションズ	3,300	3,645.00	12,028,500	
キューブシステム	1,200	967.00	1,160,400	
WOW WORLD	300	1,462.00	438,600	
コア	1,000	1,625.00	1,625,000	
ラクーンホールディングス	1,600	1,350.00	2,160,000	
ソリトンシステムズ	1,100	1,335.00	1,468,500	
ソフトクリエイイトホールディングス	1,000	4,445.00	4,445,000	
T I S	21,800	3,460.00	75,428,000	
J N S ホールディングス	1,100	498.00	547,800	
グリー	14,000	791.00	11,074,000	
G M O ペパボ	200	2,526.00	505,200	
コーエーテクモホールディングス	7,300	4,790.00	34,967,000	
三菱総合研究所	1,000	3,885.00	3,885,000	
ボルテージ	600	368.00	220,800	
電算	300	2,355.00	706,500	
A G S	1,200	870.00	1,044,000	

ファインデックス	1,900	1,061.00	2,015,900	
ブレインパッド	600	5,060.00	3,036,000	
K L a b	4,200	527.00	2,213,400	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,300	942.00	3,108,600	
イーブックイニシアティブジャパン	200	4,720.00	944,000	
ネクソン	51,500	2,255.00	116,132,500	
アイスタイル	6,900	286.00	1,973,400	
エムアップホールディングス	700	4,255.00	2,978,500	
エイチーム	1,600	1,025.00	1,640,000	
エニグモ	2,500	1,051.00	2,627,500	
テクノスジャパン	1,800	502.00	903,600	
e n i s h	1,400	371.00	519,400	
コロプラ	7,500	677.00	5,077,500	
オルトプラス	1,800	332.00	597,600	
ブロードリーフ	11,300	488.00	5,514,400	
クロス・マーケティンググループ	900	1,025.00	922,500	
デジタルハーツホールディングス	1,000	2,544.00	2,544,000	
システム情報	1,700	874.00	1,485,800	
メディアドゥ	800	4,600.00	3,680,000	
じげん	6,400	307.00	1,964,800	
ブイキューブ	2,300	1,064.00	2,447,200	
エンカレッジ・テクノロジー	500	621.00	310,500	
サイバーリンクス	800	1,085.00	868,000	
ディー・エル・イー	1,500	285.00	427,500	
フィックスターズ	2,400	898.00	2,155,200	
C A R T A H O L D I N G S	900	2,120.00	1,908,000	
オブティム	1,600	1,381.00	2,209,600	
セレス	800	2,472.00	1,977,600	
S H I F T	1,200	23,620.00	28,344,000	
ティーガイア	2,000	1,599.00	3,198,000	
セック	300	2,271.00	681,300	
テクマトリックス	3,900	1,976.00	7,706,400	
プロシップ	800	1,521.00	1,216,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,200	2,862.00	17,744,400	
G M O ペイメントゲートウェイ	4,400	14,920.00	65,648,000	



ザッパラス	900	573.00	515,700
システムリサーチ	700	2,014.00	1,409,800
インターネットイニシアティブ	6,100	4,775.00	29,127,500
さくらインターネット	2,400	565.00	1,356,000
ヴィンクス	600	844.00	506,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	4,325.00	2,162,500
SRAホールディングス	1,100	2,877.00	3,164,700
システムインテグレータ	700	562.00	393,400
朝日ネット	2,100	615.00	1,291,500
eBASE	2,700	636.00	1,717,200
アバント	2,400	1,291.00	3,098,400
アドソル日進	800	1,771.00	1,416,800
ODKソリューションズ	500	673.00	336,500
フリービット	1,400	1,175.00	1,645,000
コムチュア	2,600	3,525.00	9,165,000
サイバーコム	300	1,134.00	340,200
アステリア	1,600	801.00	1,281,600
アイル	1,300	1,550.00	2,015,000
マークライنز	1,100	2,818.00	3,099,800
メディカル・データ・ビジョン	2,900	1,230.00	3,567,000
gumi	3,200	730.00	2,336,000
ショーケース	500	523.00	261,500
モバイルファクトリー	500	911.00	455,500
テラスカイ	800	1,984.00	1,587,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,379.00	1,379,000
PCIホールディングス	1,000	1,167.00	1,167,000
パイブドHD	400	2,505.00	1,002,000
アイビーシー	400	714.00	285,600
ネオジャパン	600	1,293.00	775,800
PR TIMES	500	3,240.00	1,620,000
ラクス	7,900	3,040.00	24,016,000
ランドコンピュータ	500	844.00	422,000
ダブルスタンダード	700	3,070.00	2,149,000
オープンドア	1,400	1,992.00	2,788,800
マイネット	800	601.00	480,800

アカツキ	1,000	2,691.00	2,691,000	
ベネフィットジャパン	200	2,653.00	530,600	
Ubicomホールディングス	600	2,617.00	1,570,200	
カナミックネットワーク	2,400	492.00	1,180,800	
ノムラシステムコーポレーション	1,100	270.00	297,000	
チェンジ	4,200	2,075.00	8,715,000	
シンクロ・フード	1,200	363.00	435,600	
オークネット	1,200	1,632.00	1,958,400	
キャピタル・アセット・プランニング	500	764.00	382,000	
セグエグループ	600	765.00	459,000	
エイトレッド	300	2,270.00	681,000	
マクロミル	4,700	1,014.00	4,765,800	
ビーグリー	500	1,805.00	902,500	
オロ	700	3,295.00	2,306,500	
ユーザーローカル	700	1,634.00	1,143,800	
テモナ	500	507.00	253,500	
ニーズウェル	500	566.00	283,000	
マネーフォワード	3,500	7,040.00	24,640,000	
サインポスト	700	1,270.00	889,000	
電算システムホールディングス	900	2,610.00	2,349,000	
ソルクシーズ	1,900	468.00	889,200	
フェイス	600	683.00	409,800	
プロトコーポレーション	2,400	1,352.00	3,244,800	
ハイマックス	600	1,081.00	648,600	
野村総合研究所	44,100	4,885.00	215,428,500	
サイバネットシステム	1,600	710.00	1,136,000	
CEホールディングス	1,200	494.00	592,800	
日本システム技術	400	2,840.00	1,136,000	
インテージホールディングス	2,800	1,690.00	4,732,000	
東邦システムサイエンス	600	1,005.00	603,000	
ソースネクスト	9,800	205.00	2,009,000	
インフォコム	2,500	2,022.00	5,055,000	
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,581.00	6,194,400	
HEROZ	700	1,436.00	1,005,200	
ラクスル	2,500	5,430.00	13,575,000	
I P S	600	2,049.00	1,229,400	

F I G	2,500	331.00	827,500	
システムサポート	700	1,226.00	858,200	
イーソル	1,400	670.00	938,000	
アルテリア・ネットワークス	2,900	1,590.00	4,611,000	
E d u L a b	200	1,198.00	239,600	
東海ソフト	400	1,027.00	410,800	
ウイングアーク1 s t	1,300	2,098.00	2,727,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	2,760.00	1,380,000	
サーバーワークス	400	3,465.00	1,386,000	
東名	200	1,176.00	235,200	
ヴィッツ	200	1,345.00	269,000	
トピラシステムズ	500	954.00	477,000	
S a n s a n	8,100	2,574.00	20,849,400	
L i n k - U	400	1,100.00	440,000	
ギフトィ	2,000	2,429.00	4,858,000	
ベース	400	4,180.00	1,672,000	
フォーカスシステムズ	1,500	988.00	1,482,000	
クレスコ	1,700	1,987.00	3,377,900	
フジ・メディア・ホールディングス	22,000	1,151.00	25,322,000	
オービック	7,200	20,870.00	150,264,000	
ジャストシステム	3,200	5,370.00	17,184,000	
T D C ソフト	2,000	1,109.00	2,218,000	
Zホールディングス	331,700	714.50	236,999,650	
トレンドマイクロ	12,200	6,810.00	83,082,000	
I Dホールディングス	1,400	852.00	1,192,800	
日本オラクル	4,600	10,340.00	47,564,000	
アルファシステムズ	600	3,995.00	2,397,000	
フューチャー	2,400	3,660.00	8,784,000	
C A C H o l d i n g s	1,300	1,538.00	1,999,400	
S Bテクノロジー	1,000	2,611.00	2,611,000	
トーセ	600	729.00	437,400	
オービックビジネスコンサルタント	2,200	4,985.00	10,967,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	10,400	3,830.00	39,832,000	
アイティフォー	2,800	803.00	2,248,400	
東計電算	300	4,945.00	1,483,500	

エクスネット	400	995.00	398,000	
大塚商会	12,300	5,220.00	64,206,000	
サイボウズ	3,000	2,069.00	6,207,000	
電通国際情報サービス	3,300	3,690.00	12,177,000	
A C C E S S	2,600	740.00	1,924,000	
デジタルガレージ	3,800	5,040.00	19,152,000	
E Mシステムズ	3,800	763.00	2,899,400	
ウェザーニューズ	700	10,040.00	7,028,000	
C I J	1,500	852.00	1,278,000	
ビジネスエンジニアリング	300	3,565.00	1,069,500	
日本エンタープライズ	2,300	182.00	418,600	
WOWOW	1,100	1,992.00	2,191,200	
スカラ	2,000	656.00	1,312,000	
インテリジェント ウェイブ	1,300	544.00	707,200	
I M A G I C A G R O U P	1,900	647.00	1,229,300	
ネットワンシステムズ	8,700	3,350.00	29,145,000	
システムソフト	4,900	119.00	583,100	
アルゴグラフィックス	1,800	3,175.00	5,715,000	
マーベラス	3,600	745.00	2,682,000	
エイベックス	3,900	1,665.00	6,493,500	
日本ユニシス	7,100	3,255.00	23,110,500	
兼松エレクトロニクス	1,200	3,940.00	4,728,000	
都築電気	1,200	1,798.00	2,157,600	
T B Sホールディングス	13,900	1,737.00	24,144,300	
日本テレビホールディングス	19,100	1,186.00	22,652,600	
朝日放送グループホールディングス	2,300	707.00	1,626,100	
テレビ朝日ホールディングス	5,500	1,470.00	8,085,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	19,300	424.00	8,183,200	
テレビ東京ホールディングス	1,600	1,979.00	3,166,400	
日本BS放送	800	1,105.00	884,000	
ビジョン	3,900	1,296.00	5,054,400	
スマートバリュー	600	473.00	283,800	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,200	2,990.00	6,578,000	
ワイヤレスゲート	900	322.00	289,800	
コネクシオ	1,600	1,438.00	2,300,800	
日本通信	18,900	207.00	3,912,300	

クロップス	400	1,050.00	420,000	
日本電信電話	266,900	3,086.00	823,653,400	
K D D I	166,400	3,334.00	554,777,600	
ソフトバンク	345,700	1,490.00	515,093,000	
光通信	2,700	17,770.00	47,979,000	
エムティーアイ	2,200	638.00	1,403,600	
G M Oインターネット	8,100	2,822.00	22,858,200	
ファイバーゲート	700	1,147.00	802,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	310.00	155,000	
K A D O K A W A	6,700	5,710.00	38,257,000	
学研ホールディングス	3,200	1,014.00	3,244,800	
ゼンリン	3,700	990.00	3,663,000	
昭文社ホールディングス	900	483.00	434,700	
インプレスホールディングス	1,900	224.00	425,600	
アイネット	1,200	1,394.00	1,672,800	
松竹	1,500	11,290.00	16,935,000	
東宝	13,500	5,030.00	67,905,000	
東映	700	18,350.00	12,845,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	60,800	2,389.00	145,251,200	
ピー・シー・エー	1,300	1,555.00	2,021,500	
ビジネスブレイン太田昭和	800	1,942.00	1,553,600	
D T S	4,400	2,562.00	11,272,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,600	5,930.00	62,858,000	
シーイーシー	2,400	1,288.00	3,091,200	
カブコン	21,500	2,780.00	59,770,000	
アイ・エス・ピー	1,100	1,015.00	1,116,500	
ジャステック	1,300	1,044.00	1,357,200	
S C S K	15,800	2,304.00	36,403,200	
日本システムウエア	900	2,176.00	1,958,400	
アイネス	2,100	1,432.00	3,007,200	
T K C	3,900	3,290.00	12,831,000	
富士ソフト	2,400	5,530.00	13,272,000	
N S D	7,300	2,242.00	16,366,600	
コナミホールディングス	8,300	5,870.00	48,721,000	
福井コンピュータホールディングス	1,000	3,415.00	3,415,000	
J B C Cホールディングス	1,500	1,830.00	2,745,000	

ミロク情報サービス	2,000	1,464.00	2,928,000
ソフトバンクグループ	136,900	5,518.00	755,414,200
ハウスイ	200	909.00	181,800
高千穂交易	900	1,318.00	1,186,200
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,491.00	596,400
伊藤忠食品	600	4,915.00	2,949,000
エレマテック	1,800	1,048.00	1,886,400
JALUX	600	2,547.00	1,528,200
あらた	1,800	3,970.00	7,146,000
トーメンデバイス	300	6,610.00	1,983,000
東京エレクトロン デバイス	700	6,580.00	4,606,000
フィールズ	2,000	578.00	1,156,000
双日	25,300	1,649.00	41,719,700
アルフレッサ ホールディングス	25,500	1,615.00	41,182,500
横浜冷凍	6,400	847.00	5,420,800
神栄	300	796.00	238,800
ラサ商事	1,200	905.00	1,086,000
アルコニックス	2,800	1,207.00	3,379,600
神戸物産	17,800	4,050.00	72,090,000
ハイパー	600	546.00	327,600
あい ホールディングス	3,300	1,999.00	6,596,700
ディーブイエックス	800	1,117.00	893,600
ダイワボウホールディングス	11,100	1,869.00	20,745,900
マクニカ・富士エレホールディングス	5,500	2,691.00	14,800,500
ラクト・ジャパン	800	2,411.00	1,928,800
グリムス	1,000	2,422.00	2,422,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,000	800.00	3,200,000
八洲電機	1,700	942.00	1,601,400
メディアスホールディングス	1,300	936.00	1,216,800
レスターホールディングス	2,200	1,905.00	4,191,000
ジューテックホールディングス	500	1,082.00	541,000
大光	900	698.00	628,200
OCHIホールディングス	700	1,270.00	889,000
TOKAIホールディングス	11,100	856.00	9,501,600
黒谷	600	624.00	374,400
Cominix	400	722.00	288,800

三洋貿易	2,300	1,003.00	2,306,900	
ビューティガレージ	400	3,080.00	1,232,000	
ウイン・パートナーズ	1,700	966.00	1,642,200	
ミタチ産業	600	910.00	546,000	
シップヘルスケアホールディングス	7,300	2,555.00	18,651,500	
明治電機工業	700	1,268.00	887,600	
デリカフーズホールディングス	900	606.00	545,400	
スターティアホールディングス	500	1,216.00	608,000	
コメダホールディングス	5,000	2,023.00	10,115,000	
ピーバンドットコム	300	580.00	174,000	
アセンテック	800	1,176.00	940,800	
富士興産	600	1,080.00	648,000	
協栄産業	200	1,523.00	304,600	
フルサト・マルカホールディングス	2,200	2,136.00	4,699,200	
ヤマエグループホールディングス	1,500	1,042.00	1,563,000	
小野建	2,200	1,647.00	3,623,400	
南陽	500	1,906.00	953,000	
佐島電機	1,400	926.00	1,296,400	
エコートレーディング	500	625.00	312,500	
伯東	1,400	2,337.00	3,271,800	
コンドーテック	1,800	992.00	1,785,600	
中山福	1,200	365.00	438,000	
ナガイレーベン	3,000	2,353.00	7,059,000	
三菱食品	2,200	2,740.00	6,028,000	
松田産業	1,700	2,630.00	4,471,000	
第一興商	4,300	3,630.00	15,609,000	
メディバルホールディングス	24,700	2,089.00	51,598,300	
S P K	900	1,376.00	1,238,400	
萩原電気ホールディングス	800	2,057.00	1,645,600	
アズワン	1,600	14,590.00	23,344,000	
スズデン	800	1,695.00	1,356,000	
尾家産業	600	1,062.00	637,200	
シモジマ	1,400	1,148.00	1,607,200	
ドウシシャ	2,200	1,575.00	3,465,000	
小津産業	500	1,913.00	956,500	
高速	1,400	1,579.00	2,210,600	

たけびし	900	1,443.00	1,298,700
リックス	500	1,499.00	749,500
丸文	2,000	825.00	1,650,000
ハピネット	1,900	1,514.00	2,876,600
橋本総業ホールディングス	500	2,021.00	1,010,500
日本ライフライン	6,800	1,081.00	7,350,800
タカショー	1,700	750.00	1,275,000
I D O M	6,900	724.00	4,995,600
進和	1,400	2,078.00	2,909,200
エスケイジャパン	600	447.00	268,200
ダイトロン	1,000	2,100.00	2,100,000
シークス	3,300	1,383.00	4,563,900
田中商事	700	629.00	440,300
オーハシテクニカ	1,300	1,444.00	1,877,200
白銅	700	2,890.00	2,023,000
ダイコー通産	300	1,230.00	369,000
伊藤忠商事	160,200	3,460.00	554,292,000
丸紅	226,000	1,047.50	236,735,000
高島	300	2,212.00	663,600
長瀬産業	12,600	1,848.00	23,284,800
蝶理	1,300	1,761.00	2,289,300
豊田通商	23,000	4,960.00	114,080,000
三共生興	3,000	560.00	1,680,000
兼松	8,500	1,266.00	10,761,000
ツカモトコーポレーション	400	1,313.00	525,200
三井物産	177,900	2,570.00	457,203,000
日本紙パルプ商事	1,200	3,905.00	4,686,000
カメイ	2,700	1,007.00	2,718,900
東都水産	100	4,505.00	450,500
O U Gホールディングス	300	2,601.00	780,300
スターゼン	1,700	1,951.00	3,316,700
山善	9,600	1,029.00	9,878,400
椿本興業	500	4,140.00	2,070,000
住友商事	144,600	1,639.00	236,999,400
内田洋行	1,000	5,210.00	5,210,000
三菱商事	171,700	3,542.00	608,161,400



第一実業	1,000	5,170.00	5,170,000	
キャノンマーケティングジャパン	5,700	2,273.00	12,956,100	
西華産業	1,200	1,594.00	1,912,800	
佐藤商事	1,900	1,130.00	2,147,000	
菱洋エレクトロ	1,400	2,257.00	3,159,800	
東京産業	2,100	773.00	1,623,300	
ユアサ商事	2,200	2,925.00	6,435,000	
神鋼商事	500	3,270.00	1,635,000	
トルク	1,200	208.00	249,600	
阪和興業	4,600	3,155.00	14,513,000	
正栄食品工業	1,500	3,935.00	5,902,500	
カナデン	1,900	1,048.00	1,991,200	
菱電商事	1,800	1,766.00	3,178,800	
岩谷産業	5,500	5,780.00	31,790,000	
ナイス	800	1,712.00	1,369,600	
ニチモウ	300	1,997.00	599,100	
極東貿易	700	2,457.00	1,719,900	
アステナホールディングス	3,200	488.00	1,561,600	
三愛石油	5,600	1,314.00	7,358,400	
稲畑産業	5,000	1,620.00	8,100,000	
G S Iクレオス	1,100	1,063.00	1,169,300	
明和産業	2,100	855.00	1,795,500	
クワザワホールディングス	900	596.00	536,400	
ワキタ	4,900	1,078.00	5,282,200	
東邦ホールディングス	7,300	1,808.00	13,198,400	
サンゲツ	6,100	1,606.00	9,796,600	
ミツウロコグループホールディングス	3,400	1,293.00	4,396,200	
シナネンホールディングス	800	3,555.00	2,844,000	
伊藤忠エネクス	5,100	985.00	5,023,500	
サンリオ	7,100	2,523.00	17,913,300	
サンワテクノス	1,400	1,726.00	2,416,400	
リョーサン	2,500	2,178.00	5,445,000	
新光商事	3,400	905.00	3,077,000	
トーヨー	1,000	1,331.00	1,331,000	
三信電気	1,100	1,435.00	1,578,500	
東陽テクニカ	2,300	1,112.00	2,557,600	

モスフードサービス	3,000	3,165.00	9,495,000	
加賀電子	2,100	3,050.00	6,405,000	
ソーダニッカ	2,400	755.00	1,812,000	
立花エレテック	1,800	1,583.00	2,849,400	
フォーバル	1,000	1,073.00	1,073,000	
PALTAC	3,200	4,530.00	14,496,000	
三谷産業	2,700	321.00	866,700	
太平洋興発	800	605.00	484,000	
西本Wismettacホールディングス	500	3,195.00	1,597,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,961.00	392,200	
コア商事ホールディングス	1,700	636.00	1,081,200	
国際紙パルプ商事	4,700	299.00	1,405,300	
ヤマタネ	1,100	1,643.00	1,807,300	
丸紅建材リース	200	1,798.00	359,600	
日鉄物産	1,600	4,810.00	7,696,000	
泉州電業	600	5,630.00	3,378,000	
トラスコ中山	4,800	2,701.00	12,964,800	
オートバックスセブン	7,700	1,365.00	10,510,500	
モリト	1,700	681.00	1,157,700	
加藤産業	3,300	3,265.00	10,774,500	
北恵	600	874.00	524,400	
イノテック	1,400	1,385.00	1,939,000	
イエローハット	4,000	1,615.00	6,460,000	
J Kホールディングス	1,800	1,133.00	2,039,400	
日伝	1,900	2,278.00	4,328,200	
北沢産業	1,500	247.00	370,500	
杉本商事	1,100	2,213.00	2,434,300	
因幡電機産業	6,100	2,678.00	16,335,800	
東テク	800	2,673.00	2,138,400	
ミスミグループ本社	28,700	4,755.00	136,468,500	
アルテック	1,500	303.00	454,500	
タキヒヨー	700	1,751.00	1,225,700	
蔵王産業	400	1,904.00	761,600	
スズケン	9,000	3,340.00	30,060,000	
ジェコス	1,600	802.00	1,283,200	
グローセル	2,700	408.00	1,101,600	

ローソン	5,100	5,740.00	29,274,000
サンエー	1,700	4,225.00	7,182,500
カワチ薬品	1,800	2,226.00	4,006,800
エービーシー・マート	3,600	5,290.00	19,044,000
ハードオフコーポレーション	1,000	718.00	718,000
アスクル	3,700	1,395.00	5,161,500
ゲオホールディングス	3,100	1,270.00	3,937,000
アダストリア	2,500	1,880.00	4,700,000
ジーフット	1,400	383.00	536,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	396.00	118,800
くら寿司	2,400	3,560.00	8,544,000
キャンドゥ	1,100	2,465.00	2,711,500
アイケイ	700	435.00	304,500
パルグループホールディングス	2,000	1,636.00	3,272,000
エディオン	10,500	1,042.00	10,941,000
サーラコーポレーション	4,600	621.00	2,856,600
ワッツ	1,100	758.00	833,800
ハローズ	1,000	2,790.00	2,790,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,424.00	2,705,600
あみやき亭	500	2,952.00	1,476,000
ひらまつ	4,800	200.00	960,000
大黒天物産	700	6,050.00	4,235,000
ハニーズホールディングス	1,800	1,011.00	1,819,800
ファーマライズホールディングス	600	740.00	444,000
アルペン	1,800	2,161.00	3,889,800
ハブ	700	682.00	477,400
クオールホールディングス	2,800	1,422.00	3,981,600
ジinzホールディングス	1,600	6,530.00	10,448,000
ビックカメラ	13,600	966.00	13,137,600
D C Mホールディングス	14,100	1,085.00	15,298,500
ペッパーフードサービス	3,100	389.00	1,205,900
MonotaRO	29,000	2,244.00	65,076,000
東京一番フーズ	600	585.00	351,000
DDホールディングス	1,200	482.00	578,400
きちりホールディングス	600	458.00	274,800
アークランドサービスホールディングス	1,700	2,339.00	3,976,300

J.フロント リテイリング	27,400	965.00	26,441,000	
ドトール・日レスホールディングス	4,000	1,584.00	6,336,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	14,100	4,285.00	60,418,500	
ブロンコビリー	1,300	2,402.00	3,122,600	
Z O Z O	15,800	3,505.00	55,379,000	
トレジャー・ファクトリー	700	912.00	638,400	
物語コーポレーション	1,200	7,100.00	8,520,000	
三越伊勢丹ホールディングス	40,100	809.00	32,440,900	
H a m e e	600	1,088.00	652,800	
マーケットエンタープライズ	100	819.00	81,900	
ウエルシアホールディングス	12,100	3,910.00	47,311,000	
クリエイトSDホールディングス	3,400	3,225.00	10,965,000	
丸善CHIホールディングス	2,700	373.00	1,007,100	
ミサワ	500	665.00	332,500	
ティーライフ	300	1,329.00	398,700	
エー・ピーホールディングス	400	445.00	178,000	
チムニー	700	1,255.00	878,500	
シュッピン	1,900	1,028.00	1,953,200	
オイシックス・ラ・大地	3,300	3,140.00	10,362,000	
ネクステージ	4,600	2,363.00	10,869,800	
ジョイフル本田	6,700	1,483.00	9,936,100	
鳥貴族ホールディングス	800	1,691.00	1,352,800	
ホットランド	1,700	1,330.00	2,261,000	
すかいらーくホールディングス	29,600	1,552.00	45,939,200	
SFPホールディングス	1,100	1,359.00	1,494,900	
綿半ホールディングス	1,700	1,269.00	2,157,300	
ヨシックスホールディングス	400	2,018.00	807,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,700	1,052.00	7,048,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,200	1,194.00	1,432,800	
B E E N O S	1,200	2,851.00	3,421,200	
あさひ	1,900	1,349.00	2,563,100	
日本調剤	1,400	1,347.00	1,885,800	
コスモス薬品	2,300	17,740.00	40,802,000	
トーエル	1,100	823.00	905,300	
オンリー	200	759.00	151,800	

セブン&アイ・ホールディングス	89,600	4,971.00	445,401,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,200	713.00	8,698,600	
ツルハホールディングス	5,000	11,940.00	59,700,000	
サンマルクホールディングス	1,800	1,439.00	2,590,200	
フェリシモ	500	1,352.00	676,000	
トリドールホールディングス	5,700	2,462.00	14,033,400	
TOKYO BASE	2,100	644.00	1,352,400	
ウイルプラスホールディングス	400	918.00	367,200	
JMホールディングス	1,500	1,751.00	2,626,500	
サツドラホールディングス	1,000	647.00	647,000	
アレンザホールディングス	1,700	1,073.00	1,824,100	
串カツ田中ホールディングス	600	2,084.00	1,250,400	
パロックジャパンリミテッド	1,600	841.00	1,345,600	
クスリのアオキホールディングス	2,300	7,120.00	16,376,000	
力の源ホールディングス	1,200	602.00	722,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	13,400	4,380.00	58,692,000	
メディカルシステムネットワーク	2,200	609.00	1,339,800	
一家ホールディングス	500	529.00	264,500	
はるやまホールディングス	1,100	507.00	557,700	
ノジマ	3,700	2,340.00	8,658,000	
カッパ・クリエイト	3,200	1,340.00	4,288,000	
ライトオン	1,700	734.00	1,247,800	
良品計画	26,400	1,820.00	48,048,000	
三城ホールディングス	2,800	232.00	649,600	
アドヴァングループ	2,300	972.00	2,235,600	
アルビス	700	2,199.00	1,539,300	
コナカ	2,700	327.00	882,900	
ハウス オブ ローゼ	300	1,666.00	499,800	
G-7ホールディングス	2,500	1,734.00	4,335,000	
イオン北海道	4,000	1,380.00	5,520,000	
コジマ	3,900	570.00	2,223,000	
ヒマラヤ	800	950.00	760,000	
コーナン商事	3,300	3,375.00	11,137,500	
エコス	800	1,883.00	1,506,400	
ワタミ	2,800	911.00	2,550,800	

マルシェ	600	418.00	250,800	
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	45,800	1,761.00	80,653,800	
西松屋チェーン	5,000	1,520.00	7,600,000	
ゼンショーホールディングス	11,200	2,674.00	29,948,800	
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,465.00	2,197,500	
ハークスレイ	1,000	456.00	456,000	
サイゼリヤ	3,400	3,030.00	10,302,000	
V Tホールディングス	8,600	456.00	3,921,600	
魚力	600	2,028.00	1,216,800	
ポブラ	500	166.00	83,000	
フジ・コーポレーション	1,200	1,172.00	1,406,400	
ユナイテッドアローズ	2,400	1,868.00	4,483,200	
ハイデイ日高	3,300	1,660.00	5,478,000	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	1,300	207.00	269,100	
コロワイド	9,400	1,631.00	15,331,400	
ピーシーデポコーポレーション	2,700	317.00	855,900	
壱番屋	1,600	4,600.00	7,360,000	
トップカルチャー	800	297.00	237,600	
P L A N T	600	700.00	420,000	
スギホールディングス	4,600	7,010.00	32,246,000	
薬王堂ホールディングス	1,100	2,286.00	2,514,600	
ヴィア・ホールディングス	2,900	160.00	464,000	
スクロール	3,500	779.00	2,726,500	
ヨンドシーホールディングス	2,100	1,676.00	3,519,600	
木曽路	3,000	2,177.00	6,531,000	
S R Sホールディングス	3,100	779.00	2,414,900	
千趣会	4,100	405.00	1,660,500	
タカキュー	1,800	124.00	223,200	
リテールパートナーズ	2,800	1,285.00	3,598,000	
ケーヨー	4,200	843.00	3,540,600	
上新電機	2,600	2,138.00	5,558,800	
日本瓦斯	11,100	1,575.00	17,482,500	
ロイヤルホールディングス	3,900	1,906.00	7,433,400	
東天紅	200	992.00	198,400	
いなげや	2,800	1,402.00	3,925,600	

チヨダ	2,200	760.00	1,672,000
ライフコーポレーション	2,100	3,400.00	7,140,000
リンガーハット	2,800	2,209.00	6,185,200
MrMaxHD	2,900	579.00	1,679,100
テンアライド	2,200	311.00	684,200
AOKIホールディングス	4,400	628.00	2,763,200
オークワ	3,600	993.00	3,574,800
コメリ	3,500	2,548.00	8,918,000
青山商事	4,700	716.00	3,365,200
しまむら	2,700	10,010.00	27,027,000
はせがわ	1,200	246.00	295,200
高島屋	16,700	1,047.00	17,484,900
松屋	4,600	871.00	4,006,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	10,800	811.00	8,758,800
近鉄百貨店	900	2,563.00	2,306,700
丸井グループ	19,400	2,202.00	42,718,800
アクシアル リテイリング	1,800	3,385.00	6,093,000
井筒屋	1,100	420.00	462,000
イオン	88,100	2,789.50	245,754,950
イズミ	4,100	3,220.00	13,202,000
平和堂	4,200	1,935.00	8,127,000
フジ	2,800	1,936.00	5,420,800
ヤオコー	2,600	6,860.00	17,836,000
ゼビオホールディングス	3,100	908.00	2,814,800
ケーズホールディングス	21,100	1,106.00	23,336,600
Olympicグループ	1,200	645.00	774,000
日産東京販売ホールディングス	3,300	231.00	762,300
シルバーライフ	500	1,377.00	688,500
Genky DrugStores	1,000	5,280.00	5,280,000
ナルミヤ・インターナショナル	500	1,021.00	510,500
ブックオフグループホールディングス	1,300	994.00	1,292,200
ギフト	400	2,776.00	1,110,400
アインホールディングス	3,300	6,240.00	20,592,000
元気寿司	600	2,507.00	1,504,200
ヤマダホールディングス	83,800	384.00	32,179,200
アークランドサカモト	3,600	1,718.00	6,184,800

ニトリホールディングス	9,100	18,520.00	168,532,000	
グルメ杵屋	1,800	1,030.00	1,854,000	
愛眼	1,600	180.00	288,000	
ケーユーホールディングス	1,200	1,041.00	1,249,200	
吉野家ホールディングス	8,000	2,337.00	18,696,000	
松屋フーズホールディングス	1,100	3,560.00	3,916,000	
サガミホールディングス	3,500	1,060.00	3,710,000	
関西スーパーマーケット	1,700	1,545.00	2,626,500	
王将フードサービス	1,500	6,120.00	9,180,000	
プレナス	2,600	1,981.00	5,150,600	
ミニストップ	1,700	1,414.00	2,403,800	
アークス	4,400	2,143.00	9,429,200	
バローホールディングス	5,100	2,168.00	11,056,800	
藤久	500	795.00	397,500	
ベルク	1,000	5,530.00	5,530,000	
大庄	1,200	952.00	1,142,400	
ファーストリテイリング	3,100	68,000.00	210,800,000	
サンドラッグ	8,600	3,110.00	26,746,000	
サックスパー ホールディングス	2,200	531.00	1,168,200	
ヤマザワ	500	1,641.00	820,500	
やまや	500	2,429.00	1,214,500	
ベルーナ	4,900	711.00	3,483,900	
島根銀行	700	575.00	402,500	
じもとホールディングス	1,600	611.00	977,600	
めぶきフィナンシャルグループ	119,200	233.00	27,773,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,900	1,441.00	4,178,900	
九州フィナンシャルグループ	46,800	408.00	19,094,400	
ゆうちょ銀行	54,200	965.00	52,303,000	
富山第一銀行	5,400	277.00	1,495,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	131,000	423.00	55,413,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	15,000	719.00	10,785,000	
三十三フィナンシャルグループ	2,100	1,456.00	3,057,600	
第四北越フィナンシャルグループ	3,700	2,455.00	9,083,500	
ひろぎんホールディングス	33,800	664.00	22,443,200	
おきなわフィナンシャルグループ	2,100	2,253.00	4,731,300	
十六フィナンシャルグループ	3,100	2,124.00	6,584,400	



北國フィナンシャルホールディングス	2,100	2,345.00	4,924,500	
新生銀行	15,000	1,870.00	28,050,000	
あおぞら銀行	12,800	2,565.00	32,832,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,471,100	627.00	922,379,700	
りそなホールディングス	259,800	437.10	113,558,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	43,400	3,826.00	166,048,400	
三井住友フィナンシャルグループ	158,800	3,864.00	613,603,200	
千葉銀行	76,600	673.00	51,551,800	
群馬銀行	44,100	344.00	15,170,400	
武蔵野銀行	3,400	1,693.00	5,756,200	
千葉興業銀行	5,400	254.00	1,371,600	
筑波銀行	8,900	162.00	1,441,800	
七十七銀行	7,200	1,233.00	8,877,600	
青森銀行	1,800	1,760.00	3,168,000	
秋田銀行	1,500	1,538.00	2,307,000	
山形銀行	2,600	857.00	2,228,200	
岩手銀行	1,500	1,771.00	2,656,500	
東邦銀行	19,100	207.00	3,953,700	
東北銀行	1,100	987.00	1,085,700	
みちのく銀行	1,500	809.00	1,213,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	19,300	1,894.00	36,554,200	
静岡銀行	55,900	829.00	46,341,100	
スルガ銀行	20,100	515.00	10,351,500	
八十二銀行	51,700	375.00	19,387,500	
山梨中央銀行	2,500	834.00	2,085,000	
大垣共立銀行	4,500	1,910.00	8,595,000	
福井銀行	2,000	1,376.00	2,752,000	
清水銀行	900	1,560.00	1,404,000	
富山銀行	400	1,771.00	708,400	
滋賀銀行	4,300	1,957.00	8,415,100	
南都銀行	3,600	1,900.00	6,840,000	
百五銀行	22,000	337.00	7,414,000	
京都銀行	8,200	5,000.00	41,000,000	
紀陽銀行	8,100	1,417.00	11,477,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	14,300	806.00	11,525,800	
山陰合同銀行	13,600	620.00	8,432,000	

中国銀行	18,300	895.00	16,378,500
鳥取銀行	700	1,113.00	779,100
伊予銀行	30,400	562.00	17,084,800
百十四銀行	2,400	1,469.00	3,525,600
四国銀行	3,500	745.00	2,607,500
阿波銀行	3,500	2,200.00	7,700,000
大分銀行	1,300	1,781.00	2,315,300
宮崎銀行	1,400	2,018.00	2,825,200
佐賀銀行	1,300	1,447.00	1,881,100
琉球銀行	5,000	751.00	3,755,000
セブン銀行	68,100	235.00	16,003,500
みずほフィナンシャルグループ	293,400	1,446.50	424,403,100
高知銀行	800	711.00	568,800
山口フィナンシャルグループ	26,700	649.00	17,328,300
長野銀行	800	1,168.00	934,400
名古屋銀行	1,700	2,535.00	4,309,500
北洋銀行	34,500	251.00	8,659,500
愛知銀行	800	3,770.00	3,016,000
中京銀行	800	1,390.00	1,112,000
大光銀行	800	1,270.00	1,016,000
愛媛銀行	3,200	776.00	2,483,200
トマト銀行	800	1,055.00	844,000
京葉銀行	9,800	443.00	4,341,400
栃木銀行	11,100	186.00	2,064,600
北日本銀行	700	1,476.00	1,033,200
東和銀行	4,000	513.00	2,052,000
福島銀行	2,600	211.00	548,600
大東銀行	1,100	719.00	790,900
トモニホールディングス	17,700	298.00	5,274,600
フィデアホールディングス	2,100	1,251.00	2,627,100
池田泉州ホールディングス	26,300	162.00	4,260,600
F P G	7,700	574.00	4,419,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,800	1,252.00	2,253,600
マーキュリアホールディングス	800	680.00	544,000
S B Iホールディングス	28,300	2,998.00	84,843,400
日本アジア投資	1,800	199.00	358,200

ジャフコ グループ	2,900	7,200.00	20,880,000	
大和証券グループ本社	171,800	657.00	112,872,600	
野村ホールディングス	350,200	503.70	176,395,740	
岡三証券グループ	18,000	384.00	6,912,000	
丸三証券	6,800	513.00	3,488,400	
東洋証券	7,500	150.00	1,125,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	26,300	388.00	10,204,400	
光世証券	500	518.00	259,000	
水戸証券	6,100	278.00	1,695,800	
いちよし証券	4,300	640.00	2,752,000	
松井証券	11,200	788.00	8,825,600	
マネックスグループ	18,700	798.00	14,922,600	
極東証券	3,100	765.00	2,371,500	
岩井コスモホールディングス	2,200	1,334.00	2,934,800	
アイザワ証券グループ	3,800	1,082.00	4,111,600	
マネーパートナーズグループ	2,400	223.00	535,200	
スパークス・グループ	10,600	321.00	3,402,600	
小林洋行	600	243.00	145,800	
かんぽ生命保険	23,100	1,800.00	41,580,000	
S O M P Oホールディングス	40,400	4,935.00	199,374,000	
アニコム ホールディングス	7,000	767.00	5,369,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	51,400	3,383.00	173,886,200	
第一生命ホールディングス	112,900	2,399.50	270,903,550	
東京海上ホールディングス	75,500	6,050.00	456,775,000	
T & Dホールディングス	59,500	1,454.00	86,513,000	
アドバンスクリエイト	1,100	1,060.00	1,166,000	
全国保証	5,500	5,080.00	27,940,000	
あんしん保証	700	300.00	210,000	
ジェイリース	800	2,138.00	1,710,400	
イントラスト	1,000	723.00	723,000	
日本モーゲージサービス	1,300	1,077.00	1,400,100	
C a s a	800	910.00	728,000	
アルヒ	3,400	1,007.00	3,423,800	
プレミアグループ	1,200	3,710.00	4,452,000	
クレディセゾン	14,700	1,168.00	17,169,600	

芙蓉総合リース	2,400	7,670.00	18,408,000
みずほリース	3,500	3,135.00	10,972,500
東京センチュリー	4,400	5,630.00	24,772,000
日本証券金融	9,000	847.00	7,623,000
アイフル	38,500	361.00	13,898,500
リコーリース	2,000	3,810.00	7,620,000
イオンフィナンシャルサービス	12,500	1,264.00	15,800,000
アコム	45,200	336.00	15,187,200
ジャックス	2,500	2,899.00	7,247,500
オリエントコーポレーション	62,100	126.00	7,824,600
オリックス	139,300	2,249.00	313,285,700
三菱HCキャピタル	84,700	551.00	46,669,700
九州リースサービス	1,100	595.00	654,500
日本取引所グループ	58,100	2,392.00	138,975,200
イー・ギャランティ	3,400	2,525.00	8,585,000
アサックス	1,200	706.00	847,200
NECキャピタルソリューション	900	1,975.00	1,777,500
いちご	25,500	295.00	7,522,500
日本駐車場開発	25,100	138.00	3,463,800
スター・マイカ・ホールディングス	1,200	1,306.00	1,567,200
SREホールディングス	600	8,370.00	5,022,000
ADワークスグループ	4,600	159.00	731,400
ヒューリック	54,800	1,102.00	60,389,600
三栄建築設計	900	1,695.00	1,525,500
野村不動産ホールディングス	11,900	2,567.00	30,547,300
三重交通グループホールディングス	4,600	478.00	2,198,800
サムティ	3,700	2,254.00	8,339,800
ディア・ライフ	3,000	531.00	1,593,000
コーセーアールイー	700	715.00	500,500
日本商業開発	1,500	1,850.00	2,775,000
プレサンスコーポレーション	3,000	1,940.00	5,820,000
THEグローバル社	1,400	199.00	278,600
ハウスコム	400	1,296.00	518,400
日本管理センター	1,100	1,069.00	1,175,900
サンセイランディック	700	830.00	581,000
エストラスト	300	630.00	189,000

フージャースホールディングス	2,900	666.00	1,931,400	
オープンハウス	7,300	6,370.00	46,501,000	
東急不動産ホールディングス	67,600	603.00	40,762,800	
飯田グループホールディングス	19,100	2,588.00	49,430,800	
イーランド	400	1,609.00	643,600	
ムゲンエステート	1,400	499.00	698,600	
ビーロッド	1,600	535.00	856,000	
ファーストブラザーズ	500	923.00	461,500	
ハウスドゥ	1,100	960.00	1,056,000	
シーアールイー	600	1,690.00	1,014,000	
プロパティエージェント	300	1,745.00	523,500	
ケイアイスター不動産	1,000	8,470.00	8,470,000	
アグレ都市デザイン	400	1,685.00	674,000	
グッドコムアセット	1,000	1,126.00	1,126,000	
ジェイ・エス・ビー	500	2,897.00	1,448,500	
テンポイノベーション	600	892.00	535,200	
グローバル・リンク・マネジメント	400	988.00	395,200	
フェイスネットワーク	200	1,269.00	253,800	
パーク24	12,300	1,679.00	20,651,700	
パラカ	600	1,560.00	936,000	
宮越ホールディングス	900	1,202.00	1,081,800	
三井不動産	104,600	2,387.50	249,732,500	
三菱地所	150,700	1,569.00	236,448,300	
平和不動産	3,900	3,725.00	14,527,500	
東京建物	22,700	1,683.00	38,204,100	
ダイビル	5,800	2,240.00	12,992,000	
京阪神ビルディング	3,500	1,566.00	5,481,000	
住友不動産	48,100	3,452.00	166,041,200	
テーオーシー	4,100	615.00	2,521,500	
東京楽天地	400	4,025.00	1,610,000	
レオパレス21	23,700	188.00	4,455,600	
スターツコーポレーション	3,100	2,528.00	7,836,800	
フジ住宅	2,700	675.00	1,822,500	
空港施設	2,300	558.00	1,283,400	
明和地所	1,100	574.00	631,400	
ゴールドクレスト	1,800	1,603.00	2,885,400	

エスリード	900	1,652.00	1,486,800
日神グループホールディングス	3,700	483.00	1,787,100
日本エスコン	4,300	811.00	3,487,300
タカラレーベン	9,600	282.00	2,707,200
A V A N T I A	1,200	868.00	1,041,600
イオンモール	11,500	1,643.00	18,894,500
毎日コムネット	800	729.00	583,200
ファースト住建	900	1,231.00	1,107,900
ランド	124,600	11.00	1,370,600
カチタス	5,700	4,510.00	25,707,000
トーセイ	3,200	1,036.00	3,315,200
穴吹興産	500	1,907.00	953,500
サンフロンティア不動産	3,200	1,006.00	3,219,200
F J ネクストホールディングス	2,300	1,016.00	2,336,800
インテリックス	500	652.00	326,000
ランドビジネス	900	260.00	234,000
サンネクスタグループ	700	1,074.00	751,800
グランディハウス	1,600	479.00	766,400
日本空港ビルデング	8,700	5,000.00	43,500,000
明豊ファシリティワークス	1,000	825.00	825,000
日本工営	1,300	3,295.00	4,283,500
L I F U L L	6,800	259.00	1,761,200
ミクシィ	5,100	2,042.00	10,414,200
ジェイエイシーリクルートメント	1,800	2,175.00	3,915,000
日本M & A センターホールディングス	36,500	3,240.00	118,260,000
メンバーズ	700	2,385.00	1,669,500
中広	400	393.00	157,200
UTグループ	3,200	4,155.00	13,296,000
アイティメディア	1,100	1,935.00	2,128,500
E・Jホールディングス	1,200	1,197.00	1,436,400
夢真ビーネックスグループ	5,900	1,735.00	10,236,500
コシダカホールディングス	5,900	636.00	3,752,400
アルトナー	500	847.00	423,500
パソナグループ	2,400	3,735.00	8,964,000
C D S	600	1,640.00	984,000
リンクアンドモチベーション	4,900	638.00	3,126,200

エス・エム・エス	7,500	4,630.00	34,725,000	
サニーサイドアップグループ	800	760.00	608,000	
パーソルホールディングス	22,200	3,395.00	75,369,000	
リニカル	1,300	824.00	1,071,200	
クックパッド	7,000	250.00	1,750,000	
エスクリ	1,000	441.00	441,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,100	644.00	708,400	
学情	900	1,135.00	1,021,500	
スタジオアリス	1,000	2,093.00	2,093,000	
シミックホールディングス	1,200	1,543.00	1,851,600	
エプコ	500	833.00	416,500	
N J S	500	1,873.00	936,500	
総合警備保障	8,800	4,660.00	41,008,000	
カカクコム	16,300	3,285.00	53,545,500	
アイロムグループ	800	1,691.00	1,352,800	
セントケア・ホールディング	1,400	761.00	1,065,400	
サイネックス	400	600.00	240,000	
ルネサンス	1,500	1,143.00	1,714,500	
ディップ	3,900	4,070.00	15,873,000	
デジタルホールディングス	1,500	1,439.00	2,158,500	
新日本科学	2,700	1,535.00	4,144,500	
キャリアデザインセンター	600	966.00	579,600	
ベネフィット・ワン	8,100	5,050.00	40,905,000	
エムスリー	39,200	5,813.00	227,869,600	
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	300.00	420,000	
プラス	300	659.00	197,700	
アウトソーシング	12,700	1,638.00	20,802,600	
ウェルネット	2,200	464.00	1,020,800	
ワールドホールディングス	900	2,661.00	2,394,900	
ディー・エヌ・エー	8,500	1,739.00	14,781,500	
博報堂D Yホールディングス	30,900	1,889.00	58,370,100	
ぐるなび	3,600	467.00	1,681,200	
タカミヤ	2,700	448.00	1,209,600	
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	1,009.00	1,513,500	
ファンコミュニケーションズ	5,600	418.00	2,340,800	
ライク	600	1,765.00	1,059,000	

ビジネス・ブレイクスルー	800	438.00	350,400
エスプール	6,300	1,230.00	7,749,000
WDBホールディングス	1,000	3,225.00	3,225,000
手間いらず	300	5,440.00	1,632,000
ティア	1,300	446.00	579,800
CDG	200	1,373.00	274,600
アドウェイズ	3,300	959.00	3,164,700
バリューコマース	1,700	4,750.00	8,075,000
インフォマート	24,400	1,009.00	24,619,600
J Pホールディングス	5,700	248.00	1,413,600
エコナックホールディングス	3,900	95.00	370,500
レッグス	500	1,463.00	731,500
プレステージ・インターナショナル	8,300	708.00	5,876,400
アミューズ	1,200	2,062.00	2,474,400
ドリームインキュベータ	600	1,265.00	759,000
クイック	1,500	1,468.00	2,202,000
TAC	1,200	226.00	271,200
電通グループ	22,900	3,990.00	91,371,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,000	967.00	967,000
ぴあ	800	3,610.00	2,888,000
イオンファンタジー	900	1,827.00	1,644,300
シーティーエス	2,500	807.00	2,017,500
ネクシィーズグループ	800	740.00	592,000
H.U.グループホールディングス	5,800	2,806.00	16,274,800
アルプス技研	2,000	1,952.00	3,904,000
サニックス	3,900	246.00	959,400
ダイオーズ	400	1,024.00	409,600
日本空調サービス	2,300	794.00	1,826,200
オリエンタルランド	26,300	18,825.00	495,097,500
ダスキン	5,200	2,808.00	14,601,600
明光ネットワークジャパン	2,600	562.00	1,461,200
ファルコホールディングス	1,100	1,881.00	2,069,100
秀英予備校	500	412.00	206,000
田谷	400	533.00	213,200
ラウンドワン	6,200	1,455.00	9,021,000
リゾートトラスト	10,200	1,916.00	19,543,200



ビー・エム・エル	2,900	3,600.00	10,440,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,400	985.00	3,349,000	
リソー教育	10,200	402.00	4,100,400	
早稲田アカデミー	1,200	1,046.00	1,255,200	
ユー・エス・エス	24,900	1,804.00	44,919,600	
東京個別指導学院	2,000	636.00	1,272,000	
サイバーエージェント	54,800	1,984.00	108,723,200	
楽天グループ	114,100	1,145.00	130,644,500	
クリーク・アンド・リバー社	1,200	2,147.00	2,576,400	
モーニングスター	3,900	651.00	2,538,900	
テー・オー・ダブリュー	3,900	318.00	1,240,200	
山田コンサルティンググループ	1,100	1,144.00	1,258,400	
セントラルスポーツ	800	2,424.00	1,939,200	
フルキャストホールディングス	1,900	2,564.00	4,871,600	
エン・ジャパン	3,600	3,420.00	12,312,000	
リソルホールディングス	200	4,175.00	835,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,300	3,330.00	44,289,000	
アトラグループ	500	296.00	148,000	
インターワークス	600	426.00	255,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	7,080.00	7,080,000	
Keeper 技研	1,400	2,404.00	3,365,600	
ファーストロジック	400	750.00	300,000	
三機サービス	400	1,001.00	400,400	
Gunosy	1,400	840.00	1,176,000	
デザインワン・ジャパン	500	190.00	95,000	
イー・ガーディアン	900	3,585.00	3,226,500	
リブセンス	1,200	185.00	222,000	
ジャパンマテリアル	6,800	1,788.00	12,158,400	
ベクトル	3,100	1,280.00	3,968,000	
ウチヤマホールディングス	1,100	303.00	333,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,700	1,510.00	2,567,000	
キャリアリンク	800	1,326.00	1,060,800	
I B J	1,800	983.00	1,769,400	
アサンテ	1,000	1,723.00	1,723,000	
バリューHR	900	2,679.00	2,411,100	
M & A キャピタルパートナーズ	1,800	5,590.00	10,062,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	900	1,693.00	1,523,700
E R Iホールディングス	600	1,459.00	875,400
アピスト	300	2,810.00	843,000
シグマクシス・ホールディングス	1,300	2,702.00	3,512,600
ウィルグループ	1,600	1,313.00	2,100,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	184.00	533,600
メドピア	1,700	3,855.00	6,553,500
レアジョブ	400	976.00	390,400
リクルートホールディングス	171,500	6,911.00	1,185,236,500
エラン	3,100	1,253.00	3,884,300
土木管理総合試験所	1,000	335.00	335,000
ネットマーケティング	1,100	447.00	491,700
日本郵政	290,200	881.20	255,724,240
ベルシステム24ホールディングス	3,200	1,279.00	4,092,800
鎌倉新書	2,500	683.00	1,707,500
S M N	500	622.00	311,000
一蔵	300	405.00	121,500
グローバルキッズCOMPANY	400	781.00	312,400
エアトリ	1,400	3,505.00	4,907,000
アトラエ	1,500	2,538.00	3,807,000
ストライク	800	5,520.00	4,416,000
ソラスト	5,500	1,210.00	6,655,000
セラク	700	1,713.00	1,199,100
インソース	2,200	2,861.00	6,294,200
ベйкаレント・コンサルティング	1,600	48,650.00	77,840,000
Orchestra Holdings	400	3,795.00	1,518,000
アイモバイル	600	1,317.00	790,200
キャリアインデックス	800	986.00	788,800
MS - Japan	900	920.00	828,000
船場	400	790.00	316,000
グレイステクノロジー	2,900	411.00	1,191,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,000	2,279.00	15,953,000
フルテック	300	1,466.00	439,800
グリーンズ	800	533.00	426,400
ツナググループ・ホールディングス	500	279.00	139,500

GameWith	700	495.00	346,500	
ソウルドアウト	500	1,153.00	576,500	
MS&Consulting	300	727.00	218,100	
ウェルビー	1,500	1,340.00	2,010,000	
エル・ティー・エス	300	2,723.00	816,900	
ミダックホールディングス	1,000	4,295.00	4,295,000	
日総工産	1,700	891.00	1,514,700	
キュービーネットホールディングス	1,000	1,721.00	1,721,000	
RPAホールディングス	3,100	388.00	1,202,800	
スプリックス	600	1,760.00	1,056,000	
マネジメントソリューションズ	1,100	3,110.00	3,421,000	
プロレド・パートナーズ	500	1,222.00	611,000	
and factory	500	415.00	207,500	
テノ・ホールディングス	300	631.00	189,300	
フロンティア・マネジメント	600	759.00	455,400	
ピアラ	400	623.00	249,200	
コプロ・ホールディングス	400	1,236.00	494,400	
ギークス	400	1,979.00	791,600	
カーブスホールディングス	6,100	818.00	4,989,800	
フォーラムエンジニアリング	1,500	841.00	1,261,500	
ダイレクトマーケティングミックス	1,200	3,810.00	4,572,000	
ポピンズホールディングス	500	3,095.00	1,547,500	
LITALICO	1,800	4,395.00	7,911,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,100	750.00	825,000	
リログループ	12,100	2,100.00	25,410,000	
東祥	1,700	1,705.00	2,898,500	
TREホールディングス	3,000	1,759.00	5,277,000	
人・夢・技術グループ	900	1,947.00	1,752,300	
エイチ・アイ・エス	4,900	1,803.00	8,834,700	
ラックランド	600	3,065.00	1,839,000	
共立メンテナンス	4,000	4,040.00	16,160,000	
イチネンホールディングス	2,300	1,347.00	3,098,100	
建設技術研究所	1,300	2,398.00	3,117,400	
スペース	1,600	943.00	1,508,800	
燦ホールディングス	1,000	1,519.00	1,519,000	
スバル興業	100	8,520.00	852,000	

東京テアトル	900	1,228.00	1,105,200	
タナベ経営	900	712.00	640,800	
ナガワ	700	11,610.00	8,127,000	
東京都競馬	1,700	4,175.00	7,097,500	
常磐興産	900	1,431.00	1,287,900	
カナモト	3,900	2,266.00	8,837,400	
西尾レントオール	2,100	2,685.00	5,638,500	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	12,200	23.00	280,600	
トランス・コスモス	2,800	3,250.00	9,100,000	
乃村工藝社	9,500	1,014.00	9,633,000	
藤田観光	1,000	2,435.00	2,435,000	
KNT-CTホールディングス	1,400	1,480.00	2,072,000	
日本管財	2,400	2,770.00	6,648,000	
トーカイ	2,000	2,020.00	4,040,000	
白洋舎	300	1,828.00	548,400	
セコム	21,900	7,790.00	170,601,000	
セントラル警備保障	1,100	2,465.00	2,711,500	
丹青社	4,500	823.00	3,703,500	
メイテック	2,700	6,900.00	18,630,000	
応用地質	2,500	1,991.00	4,977,500	
船井総研ホールディングス	4,500	2,572.00	11,574,000	
進学会ホールディングス	700	281.00	196,700	
オオバ	1,600	775.00	1,240,000	
いであ	600	1,911.00	1,146,600	
学究社	700	1,546.00	1,082,200	
ベネッセホールディングス	7,400	2,332.00	17,256,800	
イオンディライト	2,700	3,670.00	9,909,000	
ナック	1,100	962.00	1,058,200	
ダイセキ	4,100	5,110.00	20,951,000	
ステップ	800	1,852.00	1,481,600	
合 計	25,611,300		62,955,195,340	

## (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先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2021年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	162,808,533
コール・ローン	180,380,321
国債証券	43,610,014,405
派生商品評価勘定	59,429
未収利息	174,499,896
前払費用	15,137,380
流動資産合計	44,142,899,964
資産合計	44,142,899,964
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	297,465
未払金	212,425,255
未払解約金	20,160,000
未払利息	489
流動負債合計	232,883,209
負債合計	232,883,209
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	39,866,142,490
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,043,874,265
元本等合計	43,910,016,755
純資産合計	43,910,016,755
負債純資産合計	44,142,899,964

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2021年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	27,229,225,343円
期中追加設定元本額	20,188,471,346円
期中一部解約元本額	7,551,554,199円
期末元本額	39,866,142,490円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,921,843,324円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	766,216,932円
りそなラップ型ファンド(成長型)	454,714,103円
DCりそな グローバルバランス	70,068,030円
つみたてバランスファンド	840,221,841円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	630,669,578円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	156,394,519円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	46,909,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	50,135,011円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	14,332,393円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,075,917円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,624,286円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	208,869,288円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	196,476,008円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	126,623,083円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	30,263,586,665円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	920,639,511円
Smart-i 8資産バランス 安定型	217,715,525円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	158,977,342円
Smart-i 8資産バランス 成長型	61,367,306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)	1,094,292円
りそなFT先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	753,342,783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)	142,788円
りそなVII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)	52,001円
りそなVIII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)	50,903円
2. 計算日における受益権の総数	39,866,142,490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	1.1014円
(10,000口当たり純資産額)	(11,014円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

2021年12月10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12月10日現在

#### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

#### 2. 時価の算定方法

##### 国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

##### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		795,120,288
合計		795,120,288

(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12月10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	144,975,599	-	144,737,563	238,036
	米ドル	68,397,049	-	68,339,022	58,027



	カナダドル	2,377,606	-	2,373,692	3,914
	メキシコペソ	1,774,767	-	1,767,595	7,172
	ユーロ	54,743,935	-	54,607,106	136,829
	英ポンド	9,752,189	-	9,747,159	5,030
	スウェーデンク ローナ	3,303,977	-	3,291,867	12,110
	ポーランドズロチ	1,271,133	-	1,265,500	5,633
	オーストラリアド ル	3,354,943	-	3,345,622	9,321
	合計	144,975,599	-	144,737,563	238,036

## (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

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	670,000.00	680,710.95	
		US TREASURY N/B	830,000.00	828,256.91	
		US TREASURY N/B	460,000.00	466,025.03	
		US TREASURY N/B	720,000.00	733,275.00	

US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,426,332.62	
US TREASURY N/B	560,000.00	566,857.76	
US TREASURY N/B	400,000.00	406,234.36	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,124,728.44	
US TREASURY N/B	650,000.00	662,238.26	
US TREASURY N/B	300,000.00	303,990.21	
US TREASURY N/B	390,000.00	395,286.29	
US TREASURY N/B	410,000.00	420,802.51	
US TREASURY N/B	930,000.00	927,148.15	
US TREASURY N/B	490,000.00	497,713.62	
US TREASURY N/B	420,000.00	433,018.32	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,083,894.26	
US TREASURY N/B	640,000.00	651,374.97	
US TREASURY N/B	700,000.00	696,103.45	
US TREASURY N/B	320,000.00	325,181.24	
US TREASURY N/B	400,000.00	413,062.48	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,292,078.06	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,015,537.50	
US TREASURY N/B	470,000.00	476,076.91	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,437.50	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,550,006.17	
US TREASURY N/B	450,000.00	446,844.69	
US TREASURY N/B	640,000.00	647,024.96	
US TREASURY N/B	320,000.00	331,356.22	
US TREASURY N/B	570,000.00	565,702.71	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,237,921.80	
US TREASURY N/B	830,000.00	823,321.07	
US TREASURY N/B	530,000.00	536,873.41	
US TREASURY N/B	130,000.00	134,732.80	
US TREASURY N/B	730,000.00	723,812.07	
US TREASURY N/B	630,000.00	624,512.07	
US TREASURY N/B	890,000.00	901,785.46	
US TREASURY N/B	480,000.00	499,312.46	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,503.89	
US TREASURY N/B	940,000.00	930,948.74	

US TREASURY N/B	540,000.00	549,861.31
US TREASURY N/B	150,000.00	156,222.64
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,104,103.12
US TREASURY N/B	710,000.00	738,344.47
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,130,692.92
US TREASURY N/B	440,000.00	452,392.16
US TREASURY N/B	340,000.00	354,569.51
US TREASURY N/B	240,000.00	239,137.48
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,482,597.60
US TREASURY N/B	140,000.00	144,380.46
US TREASURY N/B	450,000.00	467,455.05
US TREASURY N/B	250,000.00	246,796.87
US TREASURY N/B	420,000.00	433,453.10
US TREASURY N/B	440,000.00	456,396.86
US TREASURY N/B	690,000.00	719,810.13
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,312,076.12
US TREASURY N/B	490,000.00	504,623.41
US TREASURY N/B	340,000.00	351,992.95
US TREASURY N/B	410,000.00	405,035.14
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,586,560.82
US TREASURY N/B	240,000.00	237,515.61
US TREASURY N/B	320,000.00	328,912.48
US TREASURY N/B	700,000.00	723,542.96
US TREASURY N/B	850,000.00	883,966.76
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,981,420.21
US TREASURY N/B	650,000.00	668,332.01
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,309,686.24
US TREASURY N/B	390,000.00	401,166.79
US TREASURY N/B	600,000.00	613,335.90
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,036,300.75
US TREASURY N/B	220,000.00	227,124.21
US TREASURY N/B	730,000.00	746,596.03
US TREASURY N/B	950,000.00	986,849.55
US TREASURY N/B	630,000.00	621,312.86
US TREASURY N/B	650,000.00	666,681.60

US TREASURY N/B	600,000.00	605,414.04
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,172,335.87
US TREASURY N/B	220,000.00	227,287.50
US TREASURY N/B	710,000.00	721,065.98
US TREASURY N/B	750,000.00	743,466.75
US TREASURY N/B	310,000.00	321,491.79
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,045,892.48
US TREASURY N/B	750,000.00	777,831.97
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,570,310.01
US TREASURY N/B	400,000.00	413,468.72
US TREASURY N/B	700,000.00	710,691.38
US TREASURY N/B	400,000.00	415,078.12
US TREASURY N/B	860,000.00	879,585.12
US TREASURY N/B	430,000.00	449,652.33
US TREASURY N/B	550,000.00	555,951.16
US TREASURY N/B	730,000.00	751,757.35
US TREASURY N/B	340,000.00	358,407.80
US TREASURY N/B	960,000.00	962,474.97
US TREASURY N/B	250,000.00	262,695.30
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,139,246.78
US TREASURY N/B	250,000.00	264,951.15
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,035,073.35
US TREASURY N/B	570,000.00	589,749.58
US TREASURY N/B	240,000.00	254,531.23
US TREASURY N/B	850,000.00	825,296.87
US TREASURY N/B	290,000.00	306,595.68
US TREASURY N/B	650,000.00	630,601.53
US TREASURY N/B	470,000.00	499,338.24
US TREASURY N/B	630,000.00	610,238.66
US TREASURY N/B	810,000.00	835,249.15
US TREASURY N/B	310,000.00	328,151.92
US TREASURY N/B	1,000,000.00	967,343.70
US TREASURY N/B	230,000.00	245,947.25
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,141,004.65
US TREASURY N/B	570,000.00	609,877.71

US TREASURY N/B	770,000.00	743,260.51	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,353,777.23	
US TREASURY N/B	480,000.00	511,893.74	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,227,855.44	
US TREASURY N/B	300,000.00	317,343.75	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,093,760.44	
US TREASURY N/B	330,000.00	349,155.44	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,275,810.87	
US TREASURY N/B	670,000.00	681,567.95	
US TREASURY N/B	350,000.00	368,634.73	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,320,315.60	
US TREASURY N/B	430,000.00	448,711.70	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	980,312.50	
US TREASURY N/B	450,000.00	472,306.63	
US TREASURY N/B	870,000.00	852,396.07	
US TREASURY N/B	730,000.00	742,489.78	
US TREASURY N/B	470,000.00	488,634.74	
US TREASURY N/B	730,000.00	714,858.19	
US TREASURY N/B	450,000.00	462,937.50	
US TREASURY N/B	560,000.00	551,009.36	
US TREASURY N/B	520,000.00	535,132.78	
US TREASURY N/B	600,000.00	583,265.57	
US TREASURY N/B	610,000.00	617,339.03	
US TREASURY N/B	320,000.00	322,112.48	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,006,784.72	
US TREASURY N/B	400,000.00	407,203.12	
US TREASURY N/B	810,000.00	795,761.65	
US TREASURY N/B	350,000.00	356,398.42	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,162,778.87	
US TREASURY N/B	850,000.00	880,613.26	
US TREASURY N/B	300,000.00	305,460.93	
US TREASURY N/B	590,000.00	589,815.62	
US TREASURY N/B	440,000.00	450,965.59	
US TREASURY N/B	140,000.00	146,852.34	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,211,183.54	

US TREASURY N/B	300,000.00	289,992.18
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,083,917.13
US TREASURY N/B	580,000.00	612,942.14
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,196,923.75
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,128,997.21
US TREASURY N/B	250,000.00	237,431.62
US TREASURY N/B	800,000.00	840,374.96
US TREASURY N/B	410,000.00	391,325.77
US TREASURY N/B	810,000.00	766,683.95
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,294,550.00
US TREASURY N/B	690,000.00	725,685.90
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,131,048.40
US TREASURY N/B	1,040,000.00	995,718.67
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,107,953.12
US TREASURY N/B	850,000.00	920,158.15
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,094,564.00
US TREASURY N/B	600,000.00	595,125.00
US TREASURY N/B	920,000.00	912,309.35
US TREASURY N/B	840,000.00	917,076.55
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,536,376.89
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,208,467.09
US TREASURY N/B	830,000.00	808,471.87
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,280,647.25
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,256,374.91
US TREASURY N/B	920,000.00	910,153.05
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,695,085.81
US TREASURY N/B	890,000.00	991,515.62
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,234,851.53
US TREASURY N/B	930,000.00	992,956.62
US TREASURY N/B	850,000.00	863,646.41
US TREASURY N/B	680,000.00	697,345.30
US TREASURY N/B	960,000.00	965,587.48
US TREASURY N/B	120,000.00	166,260.93
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,337,776.15
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,764,418.18

US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,000,742.03	
US TREASURY N/B	660,000.00	886,153.09	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,673,304.57	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,786,674.91	
US TREASURY N/B	2,110,000.00	2,068,129.57	
US TREASURY N/B	350,000.00	346,472.63	
US TREASURY N/B	80,000.00	111,146.87	
US TREASURY N/B	90,000.00	132,292.96	
US TREASURY N/B	280,000.00	389,550.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	141,167.96	
US TREASURY N/B	70,000.00	88,530.85	
US TREASURY N/B	140,000.00	193,353.11	
US TREASURY N/B	190,000.00	270,223.03	
US TREASURY N/B	40,000.00	56,134.37	
US TREASURY N/B	190,000.00	274,713.26	
US TREASURY N/B	210,000.00	296,124.59	
US TREASURY N/B	950,000.00	836,111.24	
US TREASURY N/B	150,000.00	199,066.39	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	973,157.75	
US TREASURY N/B	210,000.00	291,760.53	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,097,015.52	
US TREASURY N/B	230,000.00	340,004.67	
US TREASURY N/B	940,000.00	933,757.73	
US TREASURY N/B	250,000.00	354,023.42	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,381,026.49	
US TREASURY N/B	230,000.00	301,830.05	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,107,403.05	
US TREASURY N/B	130,000.00	157,000.38	
US TREASURY N/B	450,000.00	456,855.43	
US TREASURY N/B	180,000.00	217,814.05	
US TREASURY N/B	200,000.00	237,867.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	229,015.62	
US TREASURY N/B	870,000.00	996,285.89	
US TREASURY N/B	320,000.00	387,474.97	
US TREASURY N/B	590,000.00	688,778.86	

US TREASURY N/B	360,000.00	469,265.61	
US TREASURY N/B	320,000.00	425,262.49	
US TREASURY N/B	410,000.00	536,219.11	
US TREASURY N/B	390,000.00	493,289.04	
US TREASURY N/B	430,000.00	524,818.35	
US TREASURY N/B	380,000.00	455,599.21	
US TREASURY N/B	530,000.00	586,498.79	
US TREASURY N/B	450,000.00	541,863.27	
US TREASURY N/B	410,000.00	484,744.88	
US TREASURY N/B	290,000.00	350,684.76	
US TREASURY N/B	530,000.00	589,521.43	
US TREASURY N/B	460,000.00	512,199.19	
US TREASURY N/B	620,000.00	660,372.59	
US TREASURY N/B	350,000.00	417,347.63	
US TREASURY N/B	440,000.00	536,885.93	
US TREASURY N/B	350,000.00	428,257.79	
US TREASURY N/B	480,000.00	563,268.72	
US TREASURY N/B	520,000.00	610,857.78	
US TREASURY N/B	640,000.00	788,174.96	
US TREASURY N/B	760,000.00	958,163.99	
US TREASURY N/B	630,000.00	777,508.57	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,438,544.50	
US TREASURY N/B	810,000.00	1,004,874.57	
US TREASURY N/B	780,000.00	948,096.08	
US TREASURY N/B	800,000.00	864,374.96	
US TREASURY N/B	630,000.00	699,496.87	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,190,721.78	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	910,192.10	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,062,890.50	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,072,980.42	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,338,586.70	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,416,744.43	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,420,429.54	
US TREASURY N/B	520,000.00	521,056.22	
米ドル 小計	178,370,000.00	182,762,494.30	



カナダドル	GOV OF CANADA	330,000.00	327,986.34
	GOV OF CANADA	300,000.00	303,393.60
	GOV OF CANADA	380,000.00	376,783.68
	GOV OF CANADA	270,000.00	272,431.89
	GOV OF CANADA	230,000.00	227,449.07
	GOV OF CANADA	380,000.00	386,810.36
	GOV OF CANADA	140,000.00	138,715.78
	GOV OF CANADA	100,000.00	99,332.30
	GOV OF CANADA	210,000.00	215,448.03
	GOV OF CANADA	530,000.00	520,121.33
	GOV OF CANADA	70,000.00	72,366.70
	GOV OF CANADA	180,000.00	181,805.04
	GOV OF CANADA	30,000.00	29,658.99
	GOV OF CANADA	200,000.00	200,160.80
	GOV OF CANADA	150,000.00	155,222.70
	GOV OF CANADA	490,000.00	476,380.45
	GOV OF CANADA	350,000.00	334,745.95
	GOV OF CANADA	130,000.00	131,038.57
	GOV OF CANADA	360,000.00	354,057.48
	GOV OF CANADA	130,000.00	129,102.61
	GOV OF CANADA	160,000.00	157,017.28
	GOV OF CANADA	150,000.00	155,893.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	157,009.08
	GOV OF CANADA	130,000.00	138,004.88
	GOV OF CANADA	590,000.00	581,909.92
	GOV OF CANADA	510,000.00	468,725.19
	GOV OF CANADA	640,000.00	640,088.32
	GOV OF CANADA	170,000.00	169,179.75
	GOV OF CANADA	130,000.00	185,792.10
	GOV OF CANADA	120,000.00	173,110.92
	GOV OF CANADA	140,000.00	190,964.06
	GOV OF CANADA	180,000.00	239,343.12
	GOV OF CANADA	200,000.00	240,123.40
GOV OF CANADA	710,000.00	740,477.46	
	180,000.00	176,016.78	

	GOV OF CANADA			
	GOV OF CANADA	110,000.00	137,483.72	
	カナダドル 小計	9,200,000.00	9,484,151.15 (846,365,648)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	2,990,000.00	3,003,903.50	
	UNITED MEXICAN STATE	4,690,000.00	4,786,651.98	
	UNITED MEXICAN STATE	5,150,000.00	5,273,085.00	
	UNITED MEXICAN STATE	4,220,000.00	4,553,176.59	
	UNITED MEXICAN STATE	320,000.00	297,068.60	
	UNITED MEXICAN STATE	7,270,000.00	6,911,608.62	
	UNITED MEXICAN STATE	1,030,000.00	954,501.00	
	UNITED MEXICAN STATE	5,380,000.00	5,452,407.26	
	UNITED MEXICAN STATE	5,150,000.00	5,513,891.27	
	UNITED MEXICAN STATE	4,720,000.00	4,848,289.60	
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,857,422.00	
	UNITED MEXICAN STATE	980,000.00	1,196,998.85	
	UNITED MEXICAN STATE	4,130,000.00	4,418,934.80	
	UNITED MEXICAN STATE	3,430,000.00	3,409,399.42	
	UNITED MEXICAN STATE	3,720,000.00	3,779,021.89	
	メキシコペソ 小計	54,990,000.00	56,256,360.38 (304,459,422)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	80,753.04	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	192,184.81	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	230,201.84	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	193,220.50	
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	181,484.35	
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	112,032.63	
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	278,056.74	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	148,188.60	
	GOV OF AUSTRIA	270,000.00	286,436.68	
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	273,361.29	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	179,847.79	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	171,268.32	
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	242,974.07	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	192,851.52	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	191,718.80	

GOV OF AUSTRIA	100,000.00	129,601.90	
GOV OF AUSTRIA	170,000.00	171,491.58	
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	355,868.26	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	66,691.80	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	263,440.88	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	206,288.32	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	87,754.96	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	131,941.77	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	70,380.31	
GOV OF AUSTRIA	94,000.00	163,768.77	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	70,954.40	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	167,307.52	
GOV OF BELGIUM	230,000.00	233,948.64	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	281,939.84	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	248,241.60	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	388,533.30	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	232,262.65	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	331,576.05	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	256,807.68	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	174,200.53	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	441,944.00	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	290,862.36	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	315,763.89	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	255,927.27	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	375,706.80	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	250,487.00	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	156,470.94	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	388,872.28	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	217,521.12	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	426,725.52	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	164,250.52	
GOV OF BELGIUM	130,000.00	163,001.31	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	148,840.20	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	529,018.10	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	291,201.50	

GOV OF BELGIUM	190,000.00	234,187.16
GOV OF BELGIUM	200,000.00	253,945.40
GOV OF BELGIUM	110,000.00	161,451.95
GOV OF BELGIUM	120,000.00	180,096.88
GOV OF BELGIUM	90,000.00	81,800.95
GOV OF FINLAND	90,000.00	92,782.89
GOV OF FINLAND	130,000.00	131,561.82
GOV OF FINLAND	30,000.00	31,945.11
GOV OF FINLAND	90,000.00	91,692.81
GOV OF FINLAND	80,000.00	93,424.16
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,484.08
GOV OF FINLAND	130,000.00	136,011.46
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,855.16
GOV OF FINLAND	120,000.00	126,568.26
GOV OF FINLAND	70,000.00	84,705.11
GOV OF FINLAND	140,000.00	148,070.30
GOV OF FINLAND	120,000.00	127,330.80
GOV OF FINLAND	120,000.00	121,853.28
GOV OF FINLAND	60,000.00	65,131.74
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,793.76
GOV OF FINLAND	50,000.00	56,941.65
GOV OF FINLAND	80,000.00	80,067.12
GOV OF FINLAND	70,000.00	70,985.53
GOV OF FINLAND	90,000.00	135,523.80
GOV OF FINLAND	70,000.00	90,672.89
GOV OF FINLAND	70,000.00	66,992.59
GOV OF FRANCE	300,000.00	302,778.90
GOV OF FRANCE	770,000.00	777,196.42
GOV OF FRANCE	1,050,000.00	1,087,687.65
GOV OF FRANCE	710,000.00	776,294.83
GOV OF FRANCE	510,000.00	517,474.13
GOV OF FRANCE	780,000.00	791,912.53
GOV OF FRANCE	600,000.00	643,063.85
GOV OF FRANCE	740,000.00	792,129.30
GOV OF FRANCE	890,000.00	906,635.47

GOV OF FRANCE	900,000.00	933,298.20	
GOV OF FRANCE	340,000.00	428,017.50	
GOV OF FRANCE	790,000.00	837,957.74	
GOV OF FRANCE	940,000.00	959,322.15	
GOV OF FRANCE	550,000.00	647,076.65	
GOV OF FRANCE	820,000.00	855,923.38	
GOV OF FRANCE	750,000.00	776,141.25	
GOV OF FRANCE	360,000.00	367,473.60	
GOV OF FRANCE	690,000.00	743,722.02	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,116,524.48	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,006,407.98	
GOV OF FRANCE	860,000.00	923,024.24	
GOV OF FRANCE	620,000.00	887,773.66	
GOV OF FRANCE	820,000.00	865,703.52	
GOV OF FRANCE	830,000.00	842,742.99	
GOV OF FRANCE	910,000.00	1,118,892.77	
GOV OF FRANCE	910,000.00	918,174.97	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,126,222.36	
GOV OF FRANCE	840,000.00	840,030.24	
GOV OF FRANCE	540,000.00	880,066.72	
GOV OF FRANCE	720,000.00	817,112.16	
GOV OF FRANCE	580,000.00	935,321.56	
GOV OF FRANCE	770,000.00	879,814.32	
GOV OF FRANCE	480,000.00	776,457.60	
GOV OF FRANCE	520,000.00	650,607.88	
GOV OF FRANCE	360,000.00	365,641.56	
GOV OF FRANCE	650,000.00	1,151,704.69	
GOV OF FRANCE	210,000.00	210,646.28	
GOV OF FRANCE	450,000.00	725,431.50	
GOV OF FRANCE	510,000.00	691,070.40	
GOV OF FRANCE	590,000.00	726,395.02	
GOV OF FRANCE	540,000.00	552,722.40	
GOV OF FRANCE	170,000.00	172,589.95	
GOV OF FRANCE	370,000.00	738,817.11	
GOV OF FRANCE	290,000.00	609,988.41	

GOV OF FRANCE	250,000.00	340,250.00	
GOV OF FRANCE	140,000.00	120,590.26	
GOV OF GERMANY	220,000.00	221,613.48	
GOV OF GERMANY	270,000.00	277,217.23	
GOV OF GERMANY	490,000.00	494,471.54	
GOV OF GERMANY	290,000.00	292,949.30	
GOV OF GERMANY	370,000.00	382,070.51	
GOV OF GERMANY	310,000.00	313,418.68	
GOV OF GERMANY	480,000.00	502,440.72	
GOV OF GERMANY	100,000.00	101,298.42	
GOV OF GERMANY	410,000.00	415,826.51	
GOV OF GERMANY	120,000.00	121,722.36	
GOV OF GERMANY	440,000.00	464,277.00	
GOV OF GERMANY	570,000.00	579,948.53	
GOV OF GERMANY	410,000.00	432,539.75	
GOV OF GERMANY	400,000.00	418,764.80	
GOV OF GERMANY	440,000.00	449,227.68	
GOV OF GERMANY	510,000.00	529,901.73	
GOV OF GERMANY	370,000.00	378,658.74	
GOV OF GERMANY	490,000.00	520,627.45	
GOV OF GERMANY	500,000.00	513,032.50	
GOV OF GERMANY	520,000.00	545,309.02	
GOV OF GERMANY	470,000.00	483,206.53	
GOV OF GERMANY	530,000.00	546,027.20	
GOV OF GERMANY	400,000.00	411,731.70	
GOV OF GERMANY	660,000.00	689,164.74	
GOV OF GERMANY	140,000.00	196,915.18	
GOV OF GERMANY	550,000.00	584,008.63	
GOV OF GERMANY	550,000.00	568,602.80	
GOV OF GERMANY	170,000.00	235,986.52	
GOV OF GERMANY	500,000.00	533,085.50	
GOV OF GERMANY	190,000.00	258,124.31	
GOV OF GERMANY	490,000.00	516,041.54	
GOV OF GERMANY	390,000.00	403,866.25	
GOV OF GERMANY	530,000.00	559,567.11	

GOV OF GERMANY	570,000.00	591,594.45	
GOV OF GERMANY	210,000.00	327,919.20	
GOV OF GERMANY	380,000.00	394,739.65	
GOV OF GERMANY	520,000.00	540,207.20	
GOV OF GERMANY	170,000.00	177,552.25	
GOV OF GERMANY	370,000.00	576,531.22	
GOV OF GERMANY	460,000.00	477,225.62	
GOV OF GERMANY	500,000.00	517,554.50	
GOV OF GERMANY	330,000.00	548,328.88	
GOV OF GERMANY	540,000.00	556,190.82	
GOV OF GERMANY	340,000.00	349,290.37	
GOV OF GERMANY	460,000.00	765,139.16	
GOV OF GERMANY	340,000.00	616,885.46	
GOV OF GERMANY	370,000.00	723,632.68	
GOV OF GERMANY	340,000.00	589,448.14	
GOV OF GERMANY	520,000.00	845,057.72	
GOV OF GERMANY	540,000.00	902,628.90	
GOV OF GERMANY	530,000.00	724,217.97	
GOV OF GERMANY	480,000.00	490,923.84	
GOV OF GERMANY	130,000.00	134,555.59	
GOV OF GERMANY	130,000.00	132,113.67	
GOV OF IRELAND	90,000.00	95,209.96	
GOV OF IRELAND	140,000.00	152,952.45	
GOV OF IRELAND	200,000.00	239,050.80	
GOV OF IRELAND	200,000.00	213,022.13	
GOV OF IRELAND	110,000.00	113,175.42	
GOV OF IRELAND	150,000.00	161,283.45	
GOV OF IRELAND	200,000.00	218,744.03	
GOV OF IRELAND	160,000.00	194,290.24	
GOV OF IRELAND	150,000.00	153,213.15	
GOV OF IRELAND	120,000.00	135,650.88	
GOV OF IRELAND	120,000.00	119,289.81	
GOV OF IRELAND	110,000.00	124,177.30	
GOV OF IRELAND	90,000.00	91,579.50	
GOV OF IRELAND	90,000.00	108,351.74	

GOV OF IRELAND	90,000.00	91,072.08	
GOV OF IRELAND	150,000.00	199,457.40	
GOV OF IRELAND	120,000.00	145,521.60	
GOV OF ITALY	260,000.00	261,555.58	
GOV OF ITALY	320,000.00	325,540.48	
GOV OF ITALY	270,000.00	274,829.84	
GOV OF ITALY	370,000.00	395,719.14	
GOV OF ITALY	350,000.00	355,799.87	
GOV OF ITALY	340,000.00	368,982.28	
GOV OF ITALY	290,000.00	293,521.18	
GOV OF ITALY	340,000.00	357,241.40	
GOV OF ITALY	490,000.00	499,261.00	
GOV OF ITALY	460,000.00	462,593.48	
GOV OF ITALY	280,000.00	281,328.09	
GOV OF ITALY	200,000.00	221,148.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	401,860.40	
GOV OF ITALY	330,000.00	346,530.36	
GOV OF ITALY	190,000.00	199,307.15	
GOV OF ITALY	180,000.00	180,545.40	
GOV OF ITALY	270,000.00	298,719.90	
GOV OF ITALY	330,000.00	345,059.91	
GOV OF ITALY	340,000.00	366,285.40	
GOV OF ITALY	400,000.00	405,299.20	
GOV OF ITALY	370,000.00	430,344.78	
GOV OF ITALY	350,000.00	367,623.55	
GOV OF ITALY	360,000.00	378,894.24	
GOV OF ITALY	340,000.00	362,184.32	
GOV OF ITALY	310,000.00	339,748.53	
GOV OF ITALY	400,000.00	430,654.12	
GOV OF ITALY	380,000.00	385,959.92	
GOV OF ITALY	340,000.00	402,997.58	
GOV OF ITALY	360,000.00	357,432.65	
GOV OF ITALY	440,000.00	468,028.44	
GOV OF ITALY	300,000.00	326,346.75	
GOV OF ITALY	220,000.00	217,571.20	



GOV OF ITALY	470,000.00	493,522.27	
GOV OF ITALY	360,000.00	370,190.52	
GOV OF ITALY	400,000.00	440,546.96	
GOV OF ITALY	410,000.00	448,235.78	
GOV OF ITALY	380,000.00	391,754.99	
GOV OF ITALY	450,000.00	609,302.61	
GOV OF ITALY	420,000.00	459,546.36	
GOV OF ITALY	400,000.00	393,858.24	
GOV OF ITALY	310,000.00	308,970.18	
GOV OF ITALY	350,000.00	447,402.83	
GOV OF ITALY	440,000.00	507,527.68	
GOV OF ITALY	130,000.00	128,262.68	
GOV OF ITALY	350,000.00	411,316.00	
GOV OF ITALY	480,000.00	650,527.68	
GOV OF ITALY	400,000.00	488,974.31	
GOV OF ITALY	510,000.00	534,164.31	
GOV OF ITALY	440,000.00	444,769.16	
GOV OF ITALY	430,000.00	459,241.72	
GOV OF ITALY	490,000.00	489,806.94	
GOV OF ITALY	400,000.00	586,146.80	
GOV OF ITALY	390,000.00	377,723.61	
GOV OF ITALY	370,000.00	368,568.84	
GOV OF ITALY	400,000.00	425,649.60	
GOV OF ITALY	100,000.00	98,877.80	
GOV OF ITALY	340,000.00	509,019.78	
GOV OF ITALY	330,000.00	377,918.64	
GOV OF ITALY	430,000.00	622,935.41	
GOV OF ITALY	260,000.00	326,335.51	
GOV OF ITALY	280,000.00	286,420.96	
GOV OF ITALY	270,000.00	304,015.68	
GOV OF ITALY	460,000.00	626,996.41	
GOV OF ITALY	270,000.00	255,280.95	
GOV OF ITALY	320,000.00	393,549.12	
GOV OF ITALY	400,000.00	619,652.00	
GOV OF ITALY	230,000.00	288,169.30	

GOV OF ITALY	330,000.00	518,697.96	
GOV OF ITALY	290,000.00	301,035.95	
GOV OF ITALY	340,000.00	540,450.40	
GOV OF ITALY	220,000.00	213,330.76	
GOV OF ITALY	300,000.00	391,533.57	
GOV OF ITALY	310,000.00	370,767.19	
GOV OF ITALY	290,000.00	393,261.41	
GOV OF ITALY	230,000.00	333,829.82	
GOV OF ITALY	280,000.00	319,263.84	
GOV OF ITALY	280,000.00	273,061.60	
GOV OF ITALY	160,000.00	185,838.72	
GOV OF ITALY	90,000.00	88,116.51	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	168,029.72	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	416,259.11	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	284,131.40	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	288,924.30	
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	350,672.60	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	336,232.32	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	287,436.24	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	321,522.00	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	288,045.24	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	270,210.25	
GOV OF NETHERLANDS	50,000.00	51,299.60	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	261,876.50	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	236,021.40	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	275,857.38	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	364,297.08	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	536,415.66	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	110,557.70	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	221,026.00	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	584,039.28	
GOV OF NETHERLANDS	350,000.00	594,330.80	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	186,246.55	
GOV OF SPAIN	280,000.00	299,292.00	
GOV OF SPAIN	410,000.00	413,439.30	

GOV OF SPAIN	500,000.00	507,736.00	
GOV OF SPAIN	320,000.00	350,543.04	
GOV OF SPAIN	290,000.00	323,597.66	
GOV OF SPAIN	400,000.00	441,906.40	
GOV OF SPAIN	370,000.00	374,188.40	
GOV OF SPAIN	350,000.00	356,671.70	
GOV OF SPAIN	390,000.00	427,026.60	
GOV OF SPAIN	490,000.00	496,656.65	
GOV OF SPAIN	410,000.00	438,380.61	
GOV OF SPAIN	340,000.00	402,872.80	
GOV OF SPAIN	390,000.00	428,536.68	
GOV OF SPAIN	450,000.00	455,422.05	
GOV OF SPAIN	380,000.00	417,462.68	
GOV OF SPAIN	360,000.00	463,911.12	
GOV OF SPAIN	450,000.00	484,559.10	
GOV OF SPAIN	80,000.00	80,635.76	
GOV OF SPAIN	400,000.00	436,402.40	
GOV OF SPAIN	380,000.00	399,132.24	
GOV OF SPAIN	410,000.00	447,050.06	
GOV OF SPAIN	130,000.00	130,126.62	
GOV OF SPAIN	540,000.00	589,060.89	
GOV OF SPAIN	430,000.00	470,312.50	
GOV OF SPAIN	360,000.00	487,589.40	
GOV OF SPAIN	340,000.00	485,886.01	
GOV OF SPAIN	460,000.00	506,726.47	
GOV OF SPAIN	410,000.00	425,598.04	
GOV OF SPAIN	360,000.00	369,698.40	
GOV OF SPAIN	410,000.00	471,367.16	
GOV OF SPAIN	470,000.00	511,602.99	
GOV OF SPAIN	440,000.00	431,810.09	
GOV OF SPAIN	360,000.00	364,408.20	
GOV OF SPAIN	390,000.00	609,612.12	
GOV OF SPAIN	350,000.00	423,496.50	
GOV OF SPAIN	420,000.00	485,966.46	
GOV OF SPAIN	360,000.00	544,519.80	

	GOV OF SPAIN	190,000.00	191,539.30	
	GOV OF SPAIN	350,000.00	600,251.15	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	315,367.38	
	GOV OF SPAIN	370,000.00	629,078.68	
	GOV OF SPAIN	100,000.00	101,536.40	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	505,208.09	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	467,592.18	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	373,052.52	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	328,400.90	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	418,630.42	
	GOV OF SPAIN	90,000.00	85,101.66	
	ユーロ 小計	114,224,000.00	132,115,983.21 (16,926,699,768)	
英ポンド	UK TREASURY	610,000.00	609,341.20	
	UK TREASURY	380,000.00	382,923.34	
	UK TREASURY	230,000.00	237,673.92	
	UK TREASURY	570,000.00	566,438.97	
	UK TREASURY	220,000.00	223,437.19	
	UK TREASURY	210,000.00	223,443.36	
	UK TREASURY	200,000.00	198,546.00	
	UK TREASURY	250,000.00	286,679.50	
	UK TREASURY	250,000.00	252,114.50	
	UK TREASURY	220,000.00	232,743.72	
	UK TREASURY	240,000.00	236,821.72	
	UK TREASURY	250,000.00	261,873.39	
	UK TREASURY	280,000.00	277,692.35	
	UK TREASURY	280,000.00	291,522.00	
	UK TREASURY	180,000.00	219,239.71	
	UK TREASURY	230,000.00	224,264.53	
	UK TREASURY	240,000.00	257,426.97	
	UK TREASURY	140,000.00	192,171.00	
	UK TREASURY	140,000.00	138,704.44	
	UK TREASURY	260,000.00	265,020.60	
	UK TREASURY	260,000.00	253,097.00	
	UK TREASURY	340,000.00	460,838.72	

	UK TREASURY	420,000.00	400,617.00
	UK TREASURY	350,000.00	472,972.50
	UK TREASURY	180,000.00	181,630.80
	UK TREASURY	180,000.00	259,525.80
	UK TREASURY	390,000.00	375,152.70
	UK TREASURY	270,000.00	392,015.70
	UK TREASURY	430,000.00	481,415.10
	UK TREASURY	190,000.00	305,970.30
	UK TREASURY	160,000.00	164,448.00
	UK TREASURY	210,000.00	325,236.66
	UK TREASURY	240,000.00	379,176.00
	UK TREASURY	370,000.00	390,683.00
	UK TREASURY	340,000.00	573,359.00
	UK TREASURY	350,000.00	511,964.29
	UK TREASURY	350,000.00	536,928.00
	UK TREASURY	200,000.00	197,184.90
	UK TREASURY	260,000.00	452,504.52
	UK TREASURY	340,000.00	385,451.20
	UK TREASURY	190,000.00	229,356.60
	UK TREASURY	160,000.00	293,568.00
	UK TREASURY	210,000.00	197,906.52
	UK TREASURY	180,000.00	197,376.84
	UK TREASURY	210,000.00	374,110.12
	UK TREASURY	120,000.00	142,729.37
	UK TREASURY	240,000.00	295,202.40
	UK TREASURY	290,000.00	588,286.75
	UK TREASURY	310,000.00	405,199.37
	UK TREASURY	200,000.00	419,430.80
	UK TREASURY	260,000.00	244,946.00
	UK TREASURY	260,000.00	442,481.00
	UK TREASURY	260,000.00	559,091.00
	UK TREASURY	210,000.00	308,131.80
	英bond 小計	14,310,000.00	17,776,066.17 (2,665,698,882)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,810,000.00	1,871,639.18
	GOV OF SWEDEN	1,360,000.00	1,485,923.76

	GOV OF SWEDEN	1,470,000.00	1,549,343.25
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,112,772.73
	GOV OF SWEDEN	1,150,000.00	1,217,919.00
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	932,068.87
	GOV OF SWEDEN	640,000.00	783,107.20
	GOV OF SWEDEN	780,000.00	1,200,134.73
	スウェーデンクローナ 小計	9,200,000.00	10,152,908.72 (127,215,946)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,550,000.00	1,571,367.66
	GOV OF NORWAY	1,160,000.00	1,206,794.40
	GOV OF NORWAY	860,000.00	872,091.60
	GOV OF NORWAY	790,000.00	794,340.41
	GOV OF NORWAY	690,000.00	701,805.90
	GOV OF NORWAY	720,000.00	744,616.80
	GOV OF NORWAY	690,000.00	704,603.85
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	1,051,822.10
	GOV OF NORWAY	540,000.00	529,659.00
	ノルウェークローネ 小計	8,060,000.00	8,177,101.72 (103,195,023)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	870,000.00	906,001.47
	GOV OF DENMARK	690,000.00	701,115.90
	GOV OF DENMARK	860,000.00	935,952.62
	GOV OF DENMARK	1,350,000.00	1,417,925.25
	GOV OF DENMARK	1,530,000.00	1,619,321.40
	GOV OF DENMARK	990,000.00	999,518.04
	GOV OF DENMARK	2,000,000.00	3,646,617.00
	GOV OF DENMARK	810,000.00	838,917.00
	デンマーククローネ 小計	9,100,000.00	11,065,368.68 (190,656,302)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	560,000.00	559,150.03
	GOV OF POLAND	380,000.00	365,389.00
	GOV OF POLAND	470,000.00	479,400.00
	GOV OF POLAND	540,000.00	533,998.49
	GOV OF POLAND	670,000.00	656,144.86
	GOV OF POLAND	570,000.00	527,782.66

	GOV OF POLAND	650,000.00	652,295.59
	GOV OF POLAND	780,000.00	756,697.89
	GOV OF POLAND	570,000.00	496,812.00
	GOV OF POLAND	610,000.00	587,470.87
	GOV OF POLAND	630,000.00	614,911.50
	GOV OF POLAND	80,000.00	93,812.00
	GOV OF POLAND	850,000.00	825,732.50
	GOV OF POLAND	620,000.00	533,042.32
	ポーランドズロチ 小計	7,980,000.00	7,682,639.71 (213,724,122)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	363,653.86
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	293,602.70
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	391,899.36
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	310,201.02
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	298,023.80
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	427,413.85
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	307,372.03
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	387,075.48
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	354,340.50
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	345,032.65
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	215,960.96
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	324,072.15
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	358,250.87
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	459,694.11
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	472,645.59
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	433,527.70
	GOV OF AUSTRALIA	520,000.00	487,869.98
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	382,884.92
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	320,891.77
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	411,799.50
	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	154,326.16
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	269,617.54
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	196,695.50
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	247,279.57
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	268,335.36
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	234,472.19

	オーストラリアドル 小計	8,330,000.00	8,716,939.12 (706,159,238)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	151,875.13
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	133,993.45
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,808.60
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	147,558.65
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	93,753.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	116,724.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	165,568.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	132,240.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	117,161.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	130,212.00
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	152,740.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	59,630.11
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	127,017.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	134,945.85
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,375.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	101,218.95
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	135,900.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	115,560.00
GOV OF SINGAPORE	40,000.00	39,013.40	
	シンガポールドル 小計	2,140,000.00	2,252,294.14 (187,233,211)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	325,031.84
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,959.64
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	123,045.57
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	265,037.05
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	279,794.19
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	248,616.91
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	103,399.96
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	540,114.22
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	200,438.46
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	289,701.01
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	124,223.47
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	273,920.15



	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	807,495.46
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	81,310.68
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	358,986.46
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	266,778.70
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	398,986.55
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	219,775.98
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	191,629.80
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	301,557.67
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	219,083.12
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	228,920.31
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	358,592.85
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	131,170.57
	GOV OF MALAYSIA	360,000.00	343,221.84
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	152,070.49
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	189,486.52
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	162,880.11
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	314,687.52
	マレーシアリングット 小計	7,440,000.00	7,642,917.10 (205,537,912)
中国元	GOV OF CHINA	1,040,000.00	1,041,409.61
	GOV OF CHINA	580,000.00	578,854.90
	GOV OF CHINA	1,240,000.00	1,248,904.44
	GOV OF CHINA	600,000.00	598,053.00
	GOV OF CHINA	1,130,000.00	1,105,154.12
	GOV OF CHINA	1,200,000.00	1,198,992.00
	GOV OF CHINA	1,090,000.00	1,092,081.90
	GOV OF CHINA	800,000.00	820,793.44
	GOV OF CHINA	740,000.00	724,065.65
	GOV OF CHINA	780,000.00	801,789.30
	GOV OF CHINA	610,000.00	649,248.86
	GOV OF CHINA	530,000.00	557,766.43
	中国元 小計	10,340,000.00	10,417,113.65 (185,338,160)
イスラエルシェケル	GOV OF ISRAEL	190,000.00	192,346.50
	GOV OF ISRAEL	670,000.00	671,407.00
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	391,039.00

	GOV OF ISRAEL	390,000.00	432,568.50	
	GOV OF ISRAEL	110,000.00	110,687.50	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	434,493.50	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	296,170.00	
	GOV OF ISRAEL	190,000.00	192,337.00	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	335,049.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	415,359.00	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	312,340.00	
	GOV OF ISRAEL	490,000.00	496,639.50	
	GOV OF ISRAEL	290,000.00	284,881.50	
	GOV OF ISRAEL	340,000.00	568,225.00	
	GOV OF ISRAEL	440,000.00	594,550.00	
	イスラエルシュケル 小計	5,120,000.00	5,728,093.00 (209,670,543)	
	合計		43,610,014,405 (43,610,014,405)	

(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 248銘柄	100.0%	47.7%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 341銘柄	100.0%	38.8%
英ポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	6.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
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 29銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 12銘柄	100.0%	0.4%

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12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	253,315,191
コール・ローン	1,789,605,076
国債証券	300,496,162,992
派生商品評価勘定	684,185,133
未収入金	1,948,325
未収利息	1,201,706,983
前払費用	126,649,821
流動資産合計	304,553,573,521
資産合計	
304,553,573,521	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	165,495,113
未払金	1,212,726,507
未払解約金	236,715,000
未払利息	4,853
流動負債合計	1,614,941,473
負債合計	
1,614,941,473	
純資産の部	
元本等	
元本	289,108,179,101
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	13,830,452,947
元本等合計	302,938,632,048
純資産合計	
302,938,632,048	
負債純資産合計	
304,553,573,521	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	190,933,135,042円
期中追加設定元本額	157,544,516,288円
期中一部解約元本額	59,369,472,229円
期末元本額	289,108,179,101円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	27,616,546,940円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	16,581,799,063円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,545,647,285円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,047,671,110円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	755,101,711円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	228,299,944円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	240,007,676円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	69,866,564円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,189,275円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,236,525円
リスクコントロール・オープン	375,957,117円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,609,454,458円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,446,207,063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)	166,734,335,327円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,023,895,027円

Smart-i 8資産バランス 安定型	1,044,063,037円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	764,989,854円
Smart-i 8資産バランス 成長型	289,914,699円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	8,738,377,556円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	16,323,465,468円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	9,983,710,876円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	7,059,428,607円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,064,048,063円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,416,355,826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)	7,674,872,294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)	14,870,286円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	2,611,166,543円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,817,391,492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)	1,462,902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)	809,455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)	37,058円
2. 計算日における受益権の総数	289,108,179,101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	1.0478円
(10,000口当たり純資産額)	(10,478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12月10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12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
国債証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		6,901,332,815
合計		6,901,332,815

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,097,424,312	-	1,092,662,284	4,762,028
	米ドル	463,374,534	-	462,174,540	1,199,994
	カナダドル	42,619,147	-	42,334,127	285,020
	ユーロ	468,016,274	-	465,118,285	2,897,989
	英ポンド	27,045,256	-	27,007,129	38,127
	オーストラリアドル	45,904,705	-	45,639,963	264,742
	イスラエルシェケル	50,464,396	-	50,388,240	76,156
	売建	303,097,028,090	-	302,573,576,042	523,452,048
	米ドル	144,439,033,084	-	144,236,358,334	202,674,750
	カナダドル	5,839,270,150	-	5,848,291,228	9,021,078
	メキシコペソ	2,061,857,761	-	2,136,719,265	74,861,504
	ユーロ	117,657,406,009	-	117,396,703,360	260,702,649
	英ポンド	18,477,314,684	-	18,277,665,157	199,649,527
	スウェーデンクローナ	867,915,325	-	871,659,759	3,744,434
	ノルウェークローネ	681,412,823	-	681,858,765	445,942
	デンマーククローネ	1,327,920,487	-	1,325,004,230	2,916,257
	ポーランドズロチ	1,417,691,713	-	1,442,594,871	24,903,158
	オーストラリアドル	4,906,491,018	-	4,899,839,570	6,651,448
	シンガポールドル	1,299,163,147	-	1,301,554,860	2,391,713
	マレーシアリンギット	1,392,158,693	-	1,387,649,064	4,509,629
	中国元	1,302,443,458	-	1,304,726,363	2,282,905
	イスラエルシェケル	1,426,949,738	-	1,462,951,216	36,001,478
合計		304,194,452,402	-	303,666,238,326	518,690,020

## (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

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	4,180,000.00	4,246,823.57	
		US TREASURY N/B	6,470,000.00	6,456,412.35	
		US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,596,497.54	
		US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,521,862.50	
		US TREASURY N/B	9,230,000.00	9,206,328.74	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,358,533.18	
		US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,396,782.72	
		US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,916,099.93	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,717,174.10	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,528,955.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,330,591.61	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,540,107.30	
		US TREASURY N/B	11,280,000.00	11,238,139.92	



US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,502,392.25	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,169,006.84	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,411,916.86	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,850,182.64	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,489,267.25	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,675,974.46	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,855,925.04	
US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,600,749.89	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,488,380.69	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,878,290.65	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,093,354.28	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,858,781.16	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,237,233.86	
US TREASURY N/B	7,750,000.00	7,716,093.75	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,200,857.53	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,291,456.25	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,050,985.63	
US TREASURY N/B	8,650,000.00	8,589,347.93	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,123,050.65	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	4,028,049.09	
US TREASURY N/B	7,960,000.00	7,899,988.76	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,610,605.25	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,951,718.60	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,350,087.38	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,207,545.20	
US TREASURY N/B	6,850,000.00	6,791,935.29	
US TREASURY N/B	6,940,000.00	6,879,545.66	
US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,374,096.19	
US TREASURY N/B	7,130,000.00	7,080,145.61	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,011,002.55	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,869,394.46	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,874,671.74	
US TREASURY N/B	5,980,000.00	5,948,231.25	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,698,771.46	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,959,179.50	

US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,488,156.88	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,316,267.77	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,982,031.00	
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,523,429.44	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,980,074.88	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,804,730.30	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,399,915.62	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,519,226.39	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,128,317.08	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,090,831.12	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,869,814.23	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,853,718.66	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,478,518.62	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,891,015.40	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,511,753.50	
US TREASURY N/B	6,080,000.00	6,017,062.27	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,384,615.48	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,038,880.43	
US TREASURY N/B	8,040,000.00	8,361,285.63	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	5,973,834.07	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,228,557.73	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,173,229.95	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,448,146.06	
US TREASURY N/B	6,540,000.00	6,685,361.31	
US TREASURY N/B	8,890,000.00	8,774,013.05	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,527,926.54	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,090,937.20	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,347,000.79	
US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,810,790.32	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,707,752.96	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,502,378.03	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,684,218.36	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,603,475.00	
US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,818,602.98	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,939,023.00	

US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,509,710.12	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,631,151.60	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,662,616.77	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,963,202.60	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,343,773.34	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,954,534.19	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,490,468.72	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,886,538.92	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,739,742.12	
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,325,598.78	
US TREASURY N/B	10,850,000.00	11,173,379.91	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,424,523.38	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,150,673.33	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,658,476.43	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,262,354.36	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,691,903.68	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,946,789.38	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	6,156,157.98	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,619,550.59	
US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,165,387.50	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,241,320.18	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,511,226.33	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,390,449.05	
US TREASURY N/B	8,720,000.00	8,446,478.01	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,496,382.34	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,000,668.19	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,771,405.90	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,598,486.23	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,821,057.66	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,353,913.98	
US TREASURY N/B	7,180,000.00	6,930,663.01	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,800,414.74	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,834,285.91	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,618,070.24	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,798,281.25	

US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,259,472.00	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,983,691.97	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,982,779.84	
US TREASURY N/B	6,860,000.00	6,978,442.01	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,790,511.57	
US TREASURY N/B	7,720,000.00	7,494,732.71	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,786,186.65	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,813,090.62	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,623,925.75	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,544,195.12	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,512,732.40	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,807,050.68	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,225,765.52	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,777,625.00	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,315,370.95	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,675,663.90	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,610,343.24	
US TREASURY N/B	5,830,000.00	5,900,141.89	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,301,652.92	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,790,363.37	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,402,498.40	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,487,597.39	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,566,068.62	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,932,109.10	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,946,729.54	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,596,417.90	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,997,187.50	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,787,787.29	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,298,020.19	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,800,667.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	992,773.40	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,706,593.68	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,009,534.16	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,882,401.21	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,362,218.40	

US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,095,006.84	
US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,669,867.20	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,830,101.28	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	4,094,603.79	
US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,502,615.75	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,768,893.75	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,511,005.98	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,846,945.16	
US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,582,780.65	
US TREASURY N/B	16,620,000.00	16,012,331.25	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,332,853.15	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,902,655.90	
US TREASURY N/B	9,190,000.00	9,115,331.25	
US TREASURY N/B	7,730,000.00	7,665,381.83	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,648,805.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,442,870.85	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,131,936.96	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,649,562.50	
US TREASURY N/B	8,390,000.00	9,183,444.81	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,613,251.63	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,507,952.47	
US TREASURY N/B	6,080,000.00	6,062,424.54	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,219,125.00	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	7,159,972.49	
US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,416,848.75	
US TREASURY N/B	6,460,000.00	6,563,712.71	
US TREASURY N/B	3,990,000.00	4,091,776.12	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,336,667.89	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,080,696.08	
US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,467,338.93	
US TREASURY N/B	13,650,000.00	12,743,020.29	
US TREASURY N/B	13,620,000.00	12,976,241.16	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,309,926.40	
US TREASURY N/B	13,740,000.00	13,366,979.60	
US TREASURY N/B	13,850,000.00	14,059,913.37	

US TREASURY N/B	11,510,000.00	11,281,597.85	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,949,609.00	
US TREASURY N/B	540,000.00	750,241.38	
US TREASURY N/B	130,000.00	191,089.83	
US TREASURY N/B	690,000.00	959,962.50	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,698,600.55	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,214,137.44	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,781,610.87	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,905,783.51	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,245,374.88	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,127,770.25	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,339,611.24	
US TREASURY N/B	4,640,000.00	4,083,743.34	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,871,224.11	
US TREASURY N/B	8,140,000.00	7,136,490.21	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,694,989.79	
US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,048,324.71	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,660,906.16	
US TREASURY N/B	8,360,000.00	8,304,483.74	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,600,185.88	
US TREASURY N/B	9,140,000.00	9,635,558.91	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,417,288.96	
US TREASURY N/B	10,560,000.00	10,258,049.47	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,256,003.11	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,076,171.50	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,621,504.65	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,272,589.41	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,877,928.08	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,129,990.53	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,712,324.83	
US TREASURY N/B	3,710,000.00	4,331,134.87	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,167,542.90	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,003,416.37	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,106,653.71	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,427,726.42	

US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,796,595.65	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,357,046.84	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,740,313.07	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,010,351.50	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,062,168.91	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,200,849.19	
US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,414,775.12	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,465,040.76	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,526,747.67	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,647,176.39	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,587,374.18	
US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,903,263.90	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	4,025,024.39	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,757,642.32	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	5,726,583.81	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,673,339.45	
US TREASURY N/B	5,090,000.00	6,281,775.65	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	7,298,303.76	
US TREASURY N/B	5,280,000.00	6,550,293.55	
US TREASURY N/B	5,190,000.00	6,308,485.48	
US TREASURY N/B	5,670,000.00	6,126,257.52	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	6,373,193.75	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,353,937.81	
US TREASURY N/B	6,850,000.00	5,881,901.83	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	7,528,807.85	
US TREASURY N/B	8,570,000.00	8,066,177.41	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	9,090,402.23	
US TREASURY N/B	9,440,000.00	10,530,761.79	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,469,530.56	
US TREASURY N/B	4,770,000.00	4,779,688.82	
	米ドル 小計	1,230,340,000.00	1,259,575,668.67 (142,924,051,123)
カナダドル	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,236,270.50
	GOV OF CANADA	2,160,000.00	2,184,433.92
	GOV OF CANADA	2,100,000.00	2,082,225.60

	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,341,979.31
	GOV OF CANADA	1,960,000.00	1,938,261.64
	GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,626,238.76
	GOV OF CANADA	1,640,000.00	1,624,956.28
	GOV OF CANADA	1,140,000.00	1,132,388.22
	GOV OF CANADA	840,000.00	861,792.12
	GOV OF CANADA	2,310,000.00	2,266,943.91
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,219,895.80
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,121,131.08
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,097,382.63
	GOV OF CANADA	840,000.00	840,675.36
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,293,522.50
	GOV OF CANADA	3,490,000.00	3,392,995.45
	GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,161,502.42
	GOV OF CANADA	850,000.00	856,790.65
	GOV OF CANADA	2,790,000.00	2,743,945.47
	GOV OF CANADA	910,000.00	903,718.27
	GOV OF CANADA	920,000.00	902,849.36
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,039,290.00
	GOV OF CANADA	670,000.00	876,634.03
	GOV OF CANADA	1,340,000.00	1,422,511.84
	GOV OF CANADA	3,850,000.00	3,797,208.80
	GOV OF CANADA	3,750,000.00	3,446,508.75
	GOV OF CANADA	4,140,000.00	4,140,571.32
	GOV OF CANADA	1,520,000.00	1,512,666.00
	GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,457,753.40
	GOV OF CANADA	690,000.00	995,387.79
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,309,467.84
	GOV OF CANADA	1,270,000.00	1,688,698.68
	GOV OF CANADA	1,210,000.00	1,452,746.57
	GOV OF CANADA	4,740,000.00	4,943,469.24
	GOV OF CANADA	1,550,000.00	1,515,700.05
	GOV OF CANADA	740,000.00	924,890.48
	カナダドル 小計	63,470,000.00	65,353,404.04 (5,832,137,776)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	21,430,000.00	21,529,649.50



	UNITED MEXICAN STATE	29,990,000.00	30,608,036.91
	UNITED MEXICAN STATE	35,200,000.00	36,041,280.00
	UNITED MEXICAN STATE	33,220,000.00	35,842,778.79
	UNITED MEXICAN STATE	45,780,000.00	43,523,169.60
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	815,496.00
	UNITED MEXICAN STATE	42,840,000.00	43,416,566.42
	UNITED MEXICAN STATE	36,240,000.00	38,800,664.04
	UNITED MEXICAN STATE	33,576,000.00	34,488,595.68
	UNITED MEXICAN STATE	9,600,000.00	9,851,520.00
	UNITED MEXICAN STATE	8,200,000.00	10,015,704.68
	UNITED MEXICAN STATE	28,000,000.00	29,958,880.00
	UNITED MEXICAN STATE	22,210,000.00	22,076,606.74
	UNITED MEXICAN STATE	27,010,000.00	27,438,543.36
	メキシコペソ 小計	374,176,000.00	384,407,491.72 (2,080,413,345)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	790,000.00	797,436.27
	GOV OF AUSTRIA	1,160,000.00	1,173,338.84
	GOV OF AUSTRIA	1,580,000.00	1,653,267.76
	GOV OF AUSTRIA	1,460,000.00	1,484,747.00
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,291,741.55
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	712,934.94
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,433,061.66
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,271,952.15
	GOV OF AUSTRIA	1,840,000.00	1,952,012.94
	GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,419,375.95
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,687,802.40
	GOV OF AUSTRIA	1,360,000.00	1,455,780.72
	GOV OF AUSTRIA	1,380,000.00	1,457,844.42
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,349,960.64
	GOV OF AUSTRIA	1,370,000.00	1,382,393.56
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,334,899.57
	GOV OF AUSTRIA	1,110,000.00	1,119,739.14
	GOV OF AUSTRIA	1,620,000.00	2,620,484.46
	GOV OF AUSTRIA	420,000.00	400,150.80
	GOV OF AUSTRIA	780,000.00	1,284,274.29

GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,263,515.96
GOV OF AUSTRIA	710,000.00	778,825.27
GOV OF AUSTRIA	460,000.00	1,011,553.60
GOV OF AUSTRIA	470,000.00	472,553.51
GOV OF AUSTRIA	730,000.00	1,271,821.33
GOV OF AUSTRIA	310,000.00	439,917.31
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,610,334.88
GOV OF BELGIUM	1,160,000.00	1,179,914.88
GOV OF BELGIUM	1,710,000.00	1,854,296.64
GOV OF BELGIUM	1,660,000.00	1,717,004.40
GOV OF BELGIUM	2,950,000.00	3,097,765.50
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,466,922.00
GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,160,592.39
GOV OF BELGIUM	1,980,000.00	2,118,663.36
GOV OF BELGIUM	1,080,000.00	1,106,685.72
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,444,502.75
GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,402,307.64
GOV OF BELGIUM	2,030,000.00	2,210,347.23
GOV OF BELGIUM	1,510,000.00	1,545,800.74
GOV OF BELGIUM	2,100,000.00	2,320,542.00
GOV OF BELGIUM	1,800,000.00	1,803,506.40
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,607,383.41
GOV OF BELGIUM	1,430,000.00	1,635,551.06
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,631,408.40
GOV OF BELGIUM	2,270,000.00	3,725,642.04
GOV OF BELGIUM	1,030,000.00	1,208,414.54
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,228,779.17
GOV OF BELGIUM	990,000.00	982,345.32
GOV OF BELGIUM	1,970,000.00	3,361,824.70
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	2,158,317.00
GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,565,356.28
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	1,929,985.04
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,027,421.50
GOV OF BELGIUM	880,000.00	1,320,710.51
GOV OF BELGIUM	590,000.00	536,250.76

GOV OF FINLAND	660,000.00	680,407.86
GOV OF FINLAND	660,000.00	667,929.24
GOV OF FINLAND	610,000.00	649,550.57
GOV OF FINLAND	460,000.00	468,652.14
GOV OF FINLAND	520,000.00	607,257.04
GOV OF FINLAND	670,000.00	707,554.17
GOV OF FINLAND	840,000.00	878,843.28
GOV OF FINLAND	500,000.00	511,594.80
GOV OF FINLAND	910,000.00	959,809.30
GOV OF FINLAND	470,000.00	568,734.31
GOV OF FINLAND	510,000.00	539,398.95
GOV OF FINLAND	1,240,000.00	1,315,751.60
GOV OF FINLAND	360,000.00	365,559.84
GOV OF FINLAND	490,000.00	531,909.21
GOV OF FINLAND	870,000.00	889,507.14
GOV OF FINLAND	390,000.00	444,144.87
GOV OF FINLAND	580,000.00	580,486.62
GOV OF FINLAND	470,000.00	476,617.13
GOV OF FINLAND	680,000.00	1,023,957.60
GOV OF FINLAND	470,000.00	608,803.69
GOV OF FINLAND	440,000.00	421,096.28
GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,139,637.56
GOV OF FRANCE	6,190,000.00	6,247,851.74
GOV OF FRANCE	6,720,000.00	6,961,200.96
GOV OF FRANCE	4,330,000.00	4,734,305.09
GOV OF FRANCE	4,100,000.00	4,160,086.30
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,502,776.93
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	4,480,011.55
GOV OF FRANCE	4,620,000.00	4,945,455.90
GOV OF FRANCE	6,150,000.00	6,264,953.31
GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,444,239.50
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	4,091,343.75
GOV OF FRANCE	5,060,000.00	5,367,172.36
GOV OF FRANCE	5,240,000.00	5,347,710.80
GOV OF FRANCE	5,800,000.00	6,823,717.40

GOV OF FRANCE	5,000,000.00	5,219,045.00	
GOV OF FRANCE	5,010,000.00	5,184,623.55	
GOV OF FRANCE	1,830,000.00	1,867,990.80	
GOV OF FRANCE	4,950,000.00	5,335,397.10	
GOV OF FRANCE	6,110,000.00	7,257,409.12	
GOV OF FRANCE	6,360,000.00	6,809,313.64	
GOV OF FRANCE	6,480,000.00	6,954,880.32	
GOV OF FRANCE	4,750,000.00	6,801,491.75	
GOV OF FRANCE	5,230,000.00	5,521,499.28	
GOV OF FRANCE	5,340,000.00	5,421,985.02	
GOV OF FRANCE	5,930,000.00	7,291,246.32	
GOV OF FRANCE	6,430,000.00	6,487,763.88	
GOV OF FRANCE	7,080,000.00	8,136,382.01	
GOV OF FRANCE	5,580,000.00	5,580,200.88	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,747,178.24	
GOV OF FRANCE	4,660,000.00	5,288,531.48	
GOV OF FRANCE	3,510,000.00	5,660,308.12	
GOV OF FRANCE	5,210,000.00	5,953,029.36	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	5,629,317.60	
GOV OF FRANCE	3,580,000.00	4,479,185.02	
GOV OF FRANCE	2,920,000.00	2,965,759.32	
GOV OF FRANCE	4,280,000.00	7,583,532.54	
GOV OF FRANCE	1,510,000.00	1,514,647.17	
GOV OF FRANCE	3,150,000.00	5,078,020.50	
GOV OF FRANCE	3,700,000.00	5,013,648.00	
GOV OF FRANCE	3,950,000.00	4,863,153.10	
GOV OF FRANCE	3,760,000.00	3,848,585.60	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,116,758.50	
GOV OF FRANCE	2,370,000.00	4,732,423.11	
GOV OF FRANCE	2,040,000.00	4,290,953.11	
GOV OF FRANCE	1,790,000.00	2,436,190.00	
GOV OF FRANCE	1,110,000.00	956,108.49	
GOV OF GERMANY	2,110,000.00	2,125,474.74	
GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,402,549.37	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,149,437.52	

GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,485,018.20	
GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,591,883.73	
GOV OF GERMANY	1,810,000.00	1,829,960.68	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,773,891.47	
GOV OF GERMANY	1,460,000.00	1,478,957.07	
GOV OF GERMANY	2,500,000.00	2,535,527.50	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,318,658.90	
GOV OF GERMANY	3,730,000.00	3,935,802.75	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,184,629.75	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,101,626.50	
GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,941,822.72	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,817,882.72	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,054,727.62	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,507,334.90	
GOV OF GERMANY	4,000,000.00	4,250,020.00	
GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,406,535.80	
GOV OF GERMANY	350,000.00	359,830.41	
GOV OF GERMANY	3,660,000.00	3,838,136.59	
GOV OF GERMANY	2,980,000.00	3,063,735.02	
GOV OF GERMANY	3,670,000.00	3,780,980.80	
GOV OF GERMANY	2,590,000.00	2,665,962.87	
GOV OF GERMANY	3,490,000.00	3,644,219.61	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,362,982.16	
GOV OF GERMANY	3,790,000.00	4,024,350.48	
GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,905,043.46	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,401,509.88	
GOV OF GERMANY	3,640,000.00	3,880,862.44	
GOV OF GERMANY	1,630,000.00	2,214,434.87	
GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,391,130.12	
GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,609,597.33	
GOV OF GERMANY	3,160,000.00	3,336,286.92	
GOV OF GERMANY	3,380,000.00	3,508,051.30	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,795,748.00	
GOV OF GERMANY	3,040,000.00	3,157,917.33	
GOV OF GERMANY	4,220,000.00	4,383,989.20	

GOV OF GERMANY	700,000.00	731,097.50	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,225,458.47	
GOV OF GERMANY	3,490,000.00	3,620,690.03	
GOV OF GERMANY	3,830,000.00	3,964,467.47	
GOV OF GERMANY	750,000.00	778,677.00	
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,735,567.67	
GOV OF GERMANY	3,260,000.00	3,357,744.58	
GOV OF GERMANY	2,320,000.00	2,383,393.28	
GOV OF GERMANY	3,160,000.00	5,256,173.36	
GOV OF GERMANY	2,360,000.00	4,281,910.84	
GOV OF GERMANY	2,430,000.00	4,752,506.52	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	4,247,493.95	
GOV OF GERMANY	3,460,000.00	5,622,884.06	
GOV OF GERMANY	3,840,000.00	6,418,694.40	
GOV OF GERMANY	3,580,000.00	4,891,887.42	
GOV OF GERMANY	4,260,000.00	4,356,949.08	
GOV OF GERMANY	980,000.00	995,933.82	
GOV OF IRELAND	890,000.00	941,520.76	
GOV OF IRELAND	920,000.00	1,005,116.18	
GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,613,592.90	
GOV OF IRELAND	1,370,000.00	1,459,201.64	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,080,310.87	
GOV OF IRELAND	890,000.00	956,948.47	
GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,378,087.45	
GOV OF IRELAND	1,160,000.00	1,408,604.24	
GOV OF IRELAND	1,080,000.00	1,103,134.68	
GOV OF IRELAND	760,000.00	859,122.24	
GOV OF IRELAND	1,150,000.00	1,143,194.06	
GOV OF IRELAND	700,000.00	790,219.21	
GOV OF IRELAND	590,000.00	600,354.50	
GOV OF IRELAND	730,000.00	878,853.04	
GOV OF IRELAND	460,000.00	465,479.52	
GOV OF IRELAND	1,210,000.00	1,608,956.36	
GOV OF IRELAND	850,000.00	1,030,778.00	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,800,709.57	

GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,861,684.62	
GOV OF ITALY	2,290,000.00	2,330,964.20	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,074,851.72	
GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,358,444.94	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,723,957.42	
GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,287,440.92	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	2,616,267.90	
GOV OF ITALY	2,210,000.00	2,251,769.00	
GOV OF ITALY	4,870,000.00	4,897,457.06	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,527,209.65	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,189,365.20	
GOV OF ITALY	2,070,000.00	2,079,627.57	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,995,174.80	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,118,949.70	
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,354,090.50	
GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,422,950.30	
GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,143,554.00	
GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,186,939.30	
GOV OF ITALY	3,110,000.00	3,151,201.28	
GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,733,270.90	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,520,847.20	
GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,378,613.84	
GOV OF ITALY	2,010,000.00	2,141,148.48	
GOV OF ITALY	2,340,000.00	2,564,553.42	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,487,027.54	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,437,641.60	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,152,863.42	
GOV OF ITALY	3,430,000.00	3,405,538.95	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,552,882.40	
GOV OF ITALY	2,170,000.00	2,360,574.82	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,780,128.00	
GOV OF ITALY	3,120,000.00	3,276,147.88	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,344,539.96	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,841,527.89	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,186,516.00	

GOV OF ITALY	3,910,000.00	4,030,952.72	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,493,334.96	
GOV OF ITALY	3,190,000.00	3,490,364.02	
GOV OF ITALY	2,590,000.00	2,550,232.10	
GOV OF ITALY	2,210,000.00	2,202,658.38	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,400,261.50	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,941,353.60	
GOV OF ITALY	500,000.00	493,318.00	
GOV OF ITALY	2,640,000.00	3,102,497.90	
GOV OF ITALY	3,280,000.00	4,445,272.48	
GOV OF ITALY	3,490,000.00	4,266,300.93	
GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,901,245.37	
GOV OF ITALY	2,810,000.00	2,840,457.59	
GOV OF ITALY	2,620,000.00	2,798,170.48	
GOV OF ITALY	2,810,000.00	2,808,892.86	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,641,662.95	
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,227,600.83	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,171,567.76	
GOV OF ITALY	2,790,000.00	2,968,905.96	
GOV OF ITALY	1,000,000.00	988,778.00	
GOV OF ITALY	2,530,000.00	3,787,706.01	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,920,280.40	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,969,402.38	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,347,105.44	
GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,698,067.12	
GOV OF ITALY	1,810,000.00	2,038,031.04	
GOV OF ITALY	3,090,000.00	4,211,780.29	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,673,508.45	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,594,964.51	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	3,516,525.10	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,255,238.00	
GOV OF ITALY	2,430,000.00	3,819,503.16	
GOV OF ITALY	2,710,000.00	2,813,129.05	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	3,036,059.60	
GOV OF ITALY	2,040,000.00	1,978,158.00	



GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,649,377.14	
GOV OF ITALY	2,250,000.00	2,691,052.19	
GOV OF ITALY	2,080,000.00	2,820,633.71	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	2,307,780.06	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,132,226.36	
GOV OF ITALY	1,840,000.00	1,794,404.80	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,463,479.92	
GOV OF ITALY	560,000.00	548,280.54	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,564,776.83	
GOV OF NETHERLANDS	2,140,000.00	2,226,986.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,830,000.00	1,857,001.65	
GOV OF NETHERLANDS	1,970,000.00	2,108,077.30	
GOV OF NETHERLANDS	2,360,000.00	2,434,080.40	
GOV OF NETHERLANDS	2,360,000.00	2,479,713.36	
GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,960,725.78	
GOV OF NETHERLANDS	1,950,000.00	2,089,893.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	2,043,749.56	
GOV OF NETHERLANDS	1,990,000.00	2,150,873.59	
GOV OF NETHERLANDS	840,000.00	861,833.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,400,000.00	1,466,508.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,610,000.00	1,652,149.80	
GOV OF NETHERLANDS	1,250,000.00	1,277,117.50	
GOV OF NETHERLANDS	2,200,000.00	2,862,334.20	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	3,153,473.88	
GOV OF NETHERLANDS	1,220,000.00	1,226,185.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,326,156.00	
GOV OF NETHERLANDS	2,280,000.00	4,035,180.48	
GOV OF NETHERLANDS	2,550,000.00	4,330,124.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,176,294.00	
GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,426,403.00	
GOV OF SPAIN	2,860,000.00	2,883,991.36	
GOV OF SPAIN	2,810,000.00	2,853,476.32	
GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,837,207.73	
GOV OF SPAIN	1,790,000.00	1,997,378.66	
GOV OF SPAIN	2,750,000.00	3,038,106.50	

GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,245,130.40	
GOV OF SPAIN	2,420,000.00	2,466,130.04	
GOV OF SPAIN	3,310,000.00	3,624,251.40	
GOV OF SPAIN	2,470,000.00	2,503,554.95	
GOV OF SPAIN	2,940,000.00	3,143,509.74	
GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,092,641.20	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,153,590.44	
GOV OF SPAIN	2,690,000.00	2,722,411.81	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,152,941.82	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,208,718.58	
GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,295,001.88	
GOV OF SPAIN	1,130,000.00	1,138,980.11	
GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,912,986.02	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,615,366.52	
GOV OF SPAIN	2,790,000.00	3,042,121.14	
GOV OF SPAIN	1,610,000.00	1,611,568.14	
GOV OF SPAIN	3,230,000.00	3,523,456.79	
GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,270,312.50	
GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,763,006.60	
GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,772,761.96	
GOV OF SPAIN	2,730,000.00	3,007,311.48	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,446,306.08	
GOV OF SPAIN	2,720,000.00	2,793,276.80	
GOV OF SPAIN	2,890,000.00	3,322,563.64	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,124,043.79	
GOV OF SPAIN	2,760,000.00	2,708,626.99	
GOV OF SPAIN	2,390,000.00	2,419,265.55	
GOV OF SPAIN	2,650,000.00	4,142,236.20	
GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,746,677.30	
GOV OF SPAIN	2,720,000.00	3,147,211.36	
GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,947,768.55	
GOV OF SPAIN	1,900,000.00	1,915,393.22	
GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,550,056.83	
GOV OF SPAIN	2,340,000.00	2,459,865.56	
GOV OF SPAIN	2,470,000.00	4,199,525.36	

	GOV OF SPAIN	760,000.00	771,676.64
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	3,255,785.51
	GOV OF SPAIN	2,330,000.00	3,301,484.18
	GOV OF SPAIN	1,860,000.00	2,569,917.36
	GOV OF SPAIN	2,570,000.00	2,482,324.45
	GOV OF SPAIN	1,770,000.00	2,849,907.09
	GOV OF SPAIN	590,000.00	557,888.66
	ユーロ 小計	786,400,000.00	910,740,370.23 (116,684,056,233)
英bond	UK TREASURY	3,920,000.00	3,915,766.40
	UK TREASURY	2,390,000.00	2,408,386.27
	UK TREASURY	1,950,000.00	2,015,061.54
	UK TREASURY	3,730,000.00	3,706,697.19
	UK TREASURY	1,920,000.00	1,949,997.31
	UK TREASURY	1,330,000.00	1,415,141.28
	UK TREASURY	1,420,000.00	1,409,676.60
	UK TREASURY	1,040,000.00	1,192,586.72
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,521,145.00
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,322,407.50
	UK TREASURY	2,160,000.00	2,131,395.55
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,539,815.59
	UK TREASURY	2,110,000.00	2,092,610.22
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,676,251.50
	UK TREASURY	1,480,000.00	1,802,637.63
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,482,096.06
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,630,370.84
	UK TREASURY	1,210,000.00	1,660,906.50
	UK TREASURY	830,000.00	822,319.26
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,620,702.90
	UK TREASURY	2,660,000.00	2,589,377.00
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,938,233.44
	UK TREASURY	3,150,000.00	3,004,627.50
	UK TREASURY	2,060,000.00	2,783,781.00
	UK TREASURY	1,320,000.00	1,331,959.20
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,946,443.50

	UK TREASURY	2,780,000.00	2,674,165.40
	UK TREASURY	1,900,000.00	2,758,629.00
	UK TREASURY	2,310,000.00	2,586,206.70
	UK TREASURY	1,710,000.00	2,753,732.70
	UK TREASURY	850,000.00	873,630.00
	UK TREASURY	1,680,000.00	2,601,893.28
	UK TREASURY	1,520,000.00	2,401,448.00
	UK TREASURY	2,880,000.00	3,040,992.00
	UK TREASURY	2,170,000.00	3,659,379.50
	UK TREASURY	2,560,000.00	3,744,653.31
	UK TREASURY	2,410,000.00	3,697,132.80
	UK TREASURY	1,420,000.00	1,400,012.92
	UK TREASURY	1,860,000.00	3,237,147.72
	UK TREASURY	2,310,000.00	2,618,800.80
	UK TREASURY	1,320,000.00	1,593,424.80
	UK TREASURY	1,500,000.00	2,752,200.00
	UK TREASURY	1,120,000.00	1,055,501.44
	UK TREASURY	980,000.00	1,074,607.24
	UK TREASURY	1,350,000.00	2,404,993.68
	UK TREASURY	700,000.00	832,588.11
	UK TREASURY	1,790,000.00	2,201,717.90
	UK TREASURY	1,890,000.00	3,834,006.75
	UK TREASURY	2,330,000.00	3,045,530.88
	UK TREASURY	1,410,000.00	2,956,987.14
	UK TREASURY	1,720,000.00	1,620,412.00
	UK TREASURY	1,750,000.00	2,978,237.50
	UK TREASURY	1,830,000.00	3,935,140.50
	UK TREASURY	1,450,000.00	2,127,576.87
	英bond 小計	98,420,000.00	122,371,142.44 (18,350,776,520)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	12,400,000.00	12,822,279.52
	GOV OF SWEDEN	9,680,000.00	10,576,280.88
	GOV OF SWEDEN	9,470,000.00	9,981,143.25
	GOV OF SWEDEN	7,110,000.00	7,463,975.61
	GOV OF SWEDEN	8,240,000.00	8,726,654.40
	GOV OF SWEDEN	6,300,000.00	6,314,014.97

	GOV OF SWEDEN	4,350,000.00	5,322,681.75
	GOV OF SWEDEN	5,360,000.00	8,247,079.84
	スウェーデンクローナ 小計	62,910,000.00	69,454,110.22 (870,260,001)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	9,520,000.00	9,651,238.90
	GOV OF NORWAY	7,370,000.00	7,667,305.80
	GOV OF NORWAY	6,490,000.00	6,581,249.40
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,398,570.39
	GOV OF NORWAY	7,630,000.00	7,760,549.30
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,443,852.70
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,534,714.30
	GOV OF NORWAY	5,980,000.00	5,933,864.30
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,442,783.50
	ノルウェークローネ 小計	52,630,000.00	53,414,128.59 (674,086,302)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	6,620,000.00	6,893,942.22
	GOV OF DENMARK	4,310,000.00	4,379,434.10
	GOV OF DENMARK	6,640,000.00	7,226,424.88
	GOV OF DENMARK	8,370,000.00	8,791,136.55
	GOV OF DENMARK	11,550,000.00	12,224,289.00
	GOV OF DENMARK	5,860,000.00	5,916,339.20
	GOV OF DENMARK	13,990,000.00	25,508,085.91
	GOV OF DENMARK	5,800,000.00	6,007,060.00
	デンマーククローネ 小計	63,140,000.00	76,946,711.86 (1,325,791,845)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	5,650,000.00	5,641,424.42
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,222,800.00
	GOV OF POLAND	3,910,000.00	3,866,544.65
	GOV OF POLAND	3,560,000.00	3,486,381.69
	GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,194,474.02
	GOV OF POLAND	4,450,000.00	4,465,716.06
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	5,646,130.41
	GOV OF POLAND	1,490,000.00	1,298,684.00
	GOV OF POLAND	5,090,000.00	4,902,011.03
	GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,314,141.00

	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,313,368.00
	GOV OF POLAND	5,800,000.00	5,634,410.00
	GOV OF POLAND	3,810,000.00	3,275,631.11
	ポーランドズロチ 小計	52,710,000.00	51,261,716.39 (1,426,054,814)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	2,500,000.00	2,673,925.50
	GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,688,215.57
	GOV OF AUSTRALIA	2,990,000.00	2,929,447.71
	GOV OF AUSTRALIA	2,340,000.00	2,503,001.35
	GOV OF AUSTRALIA	2,100,000.00	2,018,870.90
	GOV OF AUSTRALIA	2,200,000.00	2,474,501.26
	GOV OF AUSTRALIA	2,490,000.00	2,391,738.61
	GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,674,339.68
	GOV OF AUSTRALIA	2,310,000.00	2,480,383.52
	GOV OF AUSTRALIA	1,860,000.00	1,944,729.51
	GOV OF AUSTRALIA	1,430,000.00	1,544,120.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,270,000.00	2,536,702.75
	GOV OF AUSTRALIA	2,290,000.00	2,486,043.92
	GOV OF AUSTRALIA	3,000,000.00	3,207,168.30
	GOV OF AUSTRALIA	3,240,000.00	3,062,743.48
	GOV OF AUSTRALIA	2,860,000.00	2,817,930.24
	GOV OF AUSTRALIA	3,680,000.00	3,452,618.32
	GOV OF AUSTRALIA	2,670,000.00	2,555,756.83
	GOV OF AUSTRALIA	2,440,000.00	2,446,799.79
	GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	2,535,140.79
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,102,329.80
	GOV OF AUSTRALIA	1,370,000.00	1,678,981.99
	GOV OF AUSTRALIA	1,230,000.00	1,423,149.84
GOV OF AUSTRALIA	1,690,000.00	1,816,967.32	
GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,800,083.04	
GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	1,771,567.80	
	オーストラリアドル 小計	57,470,000.00	60,017,258.68 (4,861,998,125)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,113,750.99
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	937,954.19
	GOV OF SINGAPORE	710,000.00	726,617.55

	GOV OF SINGAPORE	1,090,000.00	1,148,849.53
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	906,279.00
	GOV OF SINGAPORE	700,000.00	680,890.00
	GOV OF SINGAPORE	820,000.00	848,536.00
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	958,740.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	660,362.00
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	857,229.00
	GOV OF SINGAPORE	1,200,000.00	1,309,200.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	327,965.64
	GOV OF SINGAPORE	710,000.00	819,837.00
	GOV OF SINGAPORE	930,000.00	965,381.85
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	403,750.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	697,286.10
	GOV OF SINGAPORE	890,000.00	1,007,925.00
	GOV OF SINGAPORE	890,000.00	857,070.00
	GOV OF SINGAPORE	280,000.00	273,093.80
	シンガポールドル 小計	14,710,000.00	15,500,717.65 (1,288,574,658)
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,640,883.70
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	837,335.04
	GOV OF MALAYSIA	1,530,000.00	1,568,831.09
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,590,222.34
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,523,323.95
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,305,238.78
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	754,819.70
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,147,204.03
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,592,958.34
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,231,229.33
	GOV OF MALAYSIA	2,960,000.00	3,064,178.97
	GOV OF MALAYSIA	700,000.00	724,257.66
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,815,989.18
	GOV OF MALAYSIA	1,890,000.00	1,956,623.63
	GOV OF MALAYSIA	3,130,000.00	3,181,280.35
	GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,523,161.97
	GOV OF MALAYSIA	1,690,000.00	1,803,424.00

	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,716,570.04
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,810,535.47
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,422,094.83
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,184,690.87
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,091,248.03
	GOV OF MALAYSIA	2,360,000.00	2,455,690.68
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,749,498.45
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	972,848.40
	GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,602,765.62
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	934,147.30
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,242,189.42
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,389,910.27
	GOV OF MALAYSIA	2,270,000.00	2,232,314.59
	マレーシアリングgit 小計	51,690,000.00	53,065,466.03 (1,427,068,351)
中国元	GOV OF CHINA	7,000,000.00	7,009,487.80
	GOV OF CHINA	3,820,000.00	3,812,458.17
	GOV OF CHINA	8,600,000.00	8,661,756.60
	GOV OF CHINA	4,300,000.00	4,286,046.50
	GOV OF CHINA	7,800,000.00	7,628,497.50
	GOV OF CHINA	8,300,000.00	8,293,028.00
	GOV OF CHINA	8,200,000.00	8,215,662.00
	GOV OF CHINA	5,470,000.00	5,612,175.14
	GOV OF CHINA	5,200,000.00	5,088,028.92
	GOV OF CHINA	5,500,000.00	5,653,642.50
	GOV OF CHINA	4,220,000.00	4,491,524.92
	GOV OF CHINA	3,600,000.00	3,788,602.20
	中国元 小計	72,010,000.00	72,540,910.25 (1,290,626,112)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,720,000.00	1,741,242.00
	GOV OF ISRAEL	2,150,000.00	2,332,642.50
	GOV OF ISRAEL	2,310,000.00	2,314,851.00
	GOV OF ISRAEL	2,470,000.00	2,541,753.50
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,628,685.50
	GOV OF ISRAEL	900,000.00	905,625.00
	GOV OF ISRAEL	3,390,000.00	3,425,425.50



	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,946,260.00	
	GOV OF ISRAEL	860,000.00	870,578.00	
	GOV OF ISRAEL	1,970,000.00	2,538,640.50	
	GOV OF ISRAEL	2,350,000.00	2,568,667.50	
	GOV OF ISRAEL	2,190,000.00	2,442,945.00	
	GOV OF ISRAEL	3,290,000.00	3,334,579.50	
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,092,405.50	
	GOV OF ISRAEL	2,430,000.00	4,061,137.50	
	GOV OF ISRAEL	3,070,000.00	4,148,337.50	
	イスラエルシュケル 小計	35,440,000.00	39,893,776.00 (1,460,267,787)	
合計			300,496,162,992 (300,496,162,992)	

(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 253銘柄	100.0%	47.7%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 342銘柄	100.0%	38.8%
英ポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	6.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
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 30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 12銘柄	100.0%	0.4%
イスラエルシュケル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.5%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2021年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	14,769,483
コール・ローン	52,768,026
投資信託受益証券	7,055,924,470
流動資産合計	7,123,461,979
<b>資産合計</b>	<b>7,123,461,979</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	104,387
未払金	41,021,274
未払解約金	1,020,000
未払利息	143
流動負債合計	42,145,804
<b>負債合計</b>	<b>42,145,804</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	6,641,823,507
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	439,492,668
元本等合計	7,081,316,175
純資産合計	7,081,316,175
<b>負債純資産合計</b>	<b>7,123,461,979</b>

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	4,438,908,043円
期中追加設定元本額	4,374,881,002円
期中一部解約元本額	2,171,965,538円
期末元本額	6,641,823,507円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,022,596,196円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	789,732,568円
りそなラップ型ファンド（成長型）	472,171,777円
DCりそな グローバルバランス	17,710,542円
つみたてバランスファンド	864,464,653円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	252,335,789円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	146,524,902円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	97,778,535円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	32,168,214円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	19,985,004円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,623,151円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	19,079,322円
リスクコントロール・オープン	3,482,129円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	121,678,978円
九州SDGs・グローバルバランス	44,163,397円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	97,810,785円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,337,326,732円
Smart-i 8資産バランス 安定型	48,143,705円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	134,543,868円
Smart-i 8資産バランス 成長型	155,730,205円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	162,027,857円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	302,432,169円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	181,899,203円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	131,256,692円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	149,314,514円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	25,598,615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)	1,081,653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)	55,338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)	54,083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)	52,931円
2. 計算日における受益権の総数	6,641,823,507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	1.0662円
(10,000口当たり純資産額)	(10,662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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		745,463,980
合計		745,463,980

(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12月10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	41,144,460	-	41,040,073	104,387
	米ドル	41,144,460	-	41,040,073	104,387
合計		41,144,460	-	41,040,073	104,387

(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	848,347	43,655,936.62	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	648,032	18,527,234.88	
		米ドル 小計	1,496,379	62,183,171.50	(7,055,924,470)
合計				7,055,924,470	(7,055,924,470)

(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先進国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年12月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	8,676,672,029
コール・ローン	586,490,416
株式	111,593,132,310
投資証券	2,654,014,069
派生商品評価勘定	390,132,705
未収入金	2,314,986
未収配当金	128,473,149
差入委託証拠金	3,380,443,944
流動資産合計	127,411,673,608
資産合計	127,411,673,608
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,149,468
未払解約金	941,449,000
未払利息	1,590

2021年12月10日現在

流動負債合計	957,600,058
負債合計	957,600,058
純資産の部	
元本等	
元本	61,910,099,032
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	64,543,974,518
元本等合計	126,454,073,550
純資産合計	126,454,073,550
負債純資産合計	127,411,673,608

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)



2021年12月10日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	49,679,839,868円
期中追加設定元本額	58,916,524,548円
期中一部解約元本額	46,686,265,384円
期末元本額	61,910,099,032円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,391,284,001円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,615,939,537円
りそなラップ型ファンド(成長型)	6,237,916,362円
DCりそな グローバルバランス	23,643,788円
つみたてバランスファンド	1,860,335,490円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,635,134,652円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	923,944,216円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	622,209,190円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	207,082,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	128,407,588円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	68,166,171円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	119,986,571円
リスクコントロール・オープン	47,283,125円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	119,629,324円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	394,633,469円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	25,275,239,710円
Smart-i 先進国株式インデックス	7,425,398,040円
Smart-i 8資産バランス 安定型	309,698,732円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	848,686,922円
Smart-i 8資産バランス 成長型	975,565,986円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,032,036,365円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,910,035,155円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,127,569,872円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	830,871,122円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	943,482,020円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	159,058,215円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,178,678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)	283,265,003円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	588,547,688円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	798,556,327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)	146,303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)	485,740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)	681,234円
2. 計算日における受益権の総数	61,910,099,032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	2.0425円

(10,000口当たり純資産額)

(20,425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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		13,633,270,034
投資証券		455,145,029
合計		14,088,415,063

（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12月10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	11,914,799,543	-	12,286,821,621	372,022,078
	合計	11,914,799,543	-	12,286,821,621	372,022,078

（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12月10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	337,952,508	-	337,700,732	251,776	
	米ドル	247,488,526	-	247,349,732	138,794	
	カナダドル	13,022,841	-	12,939,394	83,447	
	ユーロ	5,124,388	-	5,125,112	724	
	英ポンド	24,806,380	-	24,742,789	63,591	
	スイスフラン	18,185,047	-	18,181,266	3,781	
	スウェーデンクローナ	7,846,228	-	7,869,432	23,204	
	デンマーククローネ	6,905,592	-	6,909,230	3,638	
	オーストラリアドル	10,680,388	-	10,693,003	12,615	
	香港ドル	2,562,912	-	2,560,800	2,112	
	シンガポールドル	1,330,206	-	1,329,974	232	
	売建	601,229,830	-	599,016,895	2,212,935	
	米ドル	455,240,000	-	453,857,600	1,382,400	
	カナダドル	17,084,230	-	16,955,068	129,162	
	ユーロ	49,034,060	-	48,687,386	346,674	
	英ポンド	27,045,180	-	26,992,134	53,046	
	スイスフラン	22,245,300	-	22,112,208	133,092	
	スウェーデンクローナ	7,305,680	-	7,267,922	37,758	
	デンマーククローネ	4,164,480	-	4,135,200	29,280	
	オーストラリアドル	13,856,700	-	13,771,377	85,323	
	香港ドル	5,254,200	-	5,238,000	16,200	
	合計		939,182,338	-	936,717,627	1,961,159

(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	15,178	24.87	377,476.86	
	CHENIERE ENERGY INC	4,215	102.17	430,646.55	
	CHEVRON CORP	34,119	118.14	4,030,818.66	
	CONOCOPHILLIPS	23,383	72.55	1,696,436.65	
	COTERRA ENERGY INC	14,095	20.82	293,457.90	
	DEVON ENERGY CORP	11,449	42.32	484,521.68	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,151	110.33	347,649.83	
	EOG RESOURCES INC	10,144	88.88	901,598.72	
	EXXON MOBIL CORP	74,640	62.61	4,673,210.40	
	HALLIBURTON CO	15,912	23.49	373,772.88	
	HESS CORP	5,183	78.75	408,161.25	
	KINDER MORGAN INC	35,520	16.01	568,675.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,357	63.34	719,352.38	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	30.24	499,746.24	
	ONEOK INC	7,921	61.73	488,963.33	
	PHILLIPS 66	7,637	72.30	552,155.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,195	183.09	768,062.55	
	SCHLUMBERGER LTD	24,328	30.62	744,923.36	
	VALERO ENERGY CORP	6,797	70.31	477,897.07	
	WILLIAMS COS INC	21,953	26.62	584,388.86	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,913	293.18	1,147,213.34		
ALBEMARLE CORP	2,101	257.47	540,944.47		

AMCOR PLC	30,404	11.56	351,470.24
AVERY DENNISON CORP	1,524	211.55	322,402.20
BALL CORP	5,635	92.62	521,913.70
CELANESE CORP	1,759	158.62	279,012.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,978	58.52	232,792.56
CORTEVA INC	12,364	48.03	593,842.92
CROWN HOLDINGS INC	2,078	103.84	215,779.52
DOW INC	12,848	54.39	698,802.72
DUPONT DE NEMOURS INC	9,146	78.64	719,241.44
EASTMAN CHEMICAL CO	2,692	116.25	312,945.00
ECOLAB INC	4,554	230.35	1,049,013.90
FMC CORP	2,253	107.44	242,062.32
FREEPORT-MCMORAN INC	26,009	38.47	1,000,566.23
INTERNATIONAL PAPER CO	6,946	46.17	320,696.82
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	147.48	635,786.28
LINDE PLC	8,974	332.12	2,980,444.88
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	89.95	403,065.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,158	427.29	494,801.82
MOSAIC CO/THE	5,552	35.73	198,372.96
NEWMONT CORP	13,779	56.21	774,517.59
NUCOR CORP	5,308	112.89	599,220.12
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,870	129.22	241,641.40
PPG INDUSTRIES INC	4,073	164.05	668,175.65
RPM INTERNATIONAL INC	2,344	96.43	226,031.92
SEALED AIR CORP	2,628	63.99	168,165.72
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,380	343.87	1,506,150.60
STEEL DYNAMICS INC	3,569	61.06	217,923.14
VULCAN MATERIALS CO	2,241	201.32	451,158.12
WESTROCK CO	5,361	44.04	236,098.44
3M CO	10,000	175.94	1,759,400.00
ALLEGION PLC	1,523	130.89	199,345.47
AMETEK INC	3,972	141.09	560,409.48
BOEING CO/THE	9,870	207.56	2,048,617.20
CARRIER GLOBAL CORP	14,219	55.99	796,121.81
CATERPILLAR INC	9,706	204.13	1,981,285.78

CUMMINS INC	2,516	219.58	552,463.28
DEERE & CO	5,137	361.92	1,859,183.04
DOVER CORP	2,606	171.62	447,241.72
EATON CORP PLC	7,026	168.59	1,184,513.34
EMERSON ELECTRIC CO	10,598	91.99	974,910.02
FASTENAL CO	9,880	62.81	620,562.80
FORTIVE CORP	5,995	75.14	450,464.30
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2,548	105.92	269,884.16
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	360.64	405,359.36
GENERAL DYNAMICS CORP	4,138	201.93	835,586.34
GENERAL ELECTRIC CO	19,463	97.83	1,904,065.29
HEICO CORP	647	144.17	93,277.99
HEICO CORP-CLASS A	1,342	129.55	173,856.10
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,986	206.00	2,469,116.00
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	30.85	180,595.90
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	185.95	112,313.80
IDEX CORP	1,396	235.35	328,548.60
ILLINOIS TOOL WORKS	5,557	241.61	1,342,626.77
INGERSOLL-RAND INC	6,884	59.92	412,489.28
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	55.80	228,780.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	12,349	78.98	975,324.02
KORNIT DIGITAL LTD	899	152.02	136,665.98
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,531	216.52	764,532.12
LENNOX INTERNATIONAL INC	728	327.91	238,718.48
LOCKHEED MARTIN CORP	4,314	343.60	1,482,290.40
MASCO CORP	4,315	68.44	295,318.60
NORDSON CORP	961	266.23	255,847.03
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,635	367.86	969,311.10
OTIS WORLDWIDE CORP	7,016	86.19	604,709.04
OWENS CORNING	1,611	93.25	150,225.75
PACCAR INC	5,970	88.61	529,001.70
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	318.32	715,265.04
PENTAIR PLC	2,913	73.40	213,814.20
PLUG POWER INC	8,433	34.42	290,263.86
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	26,144	86.16	2,252,567.04

ROCKWELL AUTOMATION INC	1,998	346.57	692,446.86
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,875	467.82	877,162.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	59.15	188,984.25
SMITH (A.O.) CORP	2,718	82.87	225,240.66
SNAP-ON INC	1,158	214.33	248,194.14
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	192.00	545,088.00
SUNRUN INC	2,890	42.14	121,784.60
TEXTRON INC	4,227	74.48	314,826.96
TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,119	201.65	830,596.35
TRANSDIGM GROUP INC	898	605.64	543,864.72
UNITED RENTALS INC	1,210	356.53	431,401.30
WABTEC CORP	3,299	91.58	302,122.42
WW GRAINGER INC	813	503.55	409,386.15
XYLEM INC	3,290	123.10	404,999.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	83.54	203,837.60
CINTAS CORP	1,623	449.13	728,937.99
CLARIVATE PLC	5,086	24.45	124,352.70
COPART INC	3,654	148.27	541,778.58
COSTAR GROUP INC	6,783	78.80	534,500.40
EQUIFAX INC	2,089	291.83	609,632.87
IHS MARKIT LTD	6,841	131.18	897,402.38
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,482	142.16	352,841.12
LEIDOS HOLDINGS INC	2,533	88.56	224,322.48
REPUBLIC SERVICES INC	3,830	134.50	515,135.00
ROBERT HALF INTL INC	2,316	108.03	250,197.48
ROLLINS INC	3,021	32.25	97,427.25
TRANSUNION	3,373	115.90	390,930.70
VERISK ANALYTICS INC	2,643	224.50	593,353.50
WASTE CONNECTIONS INC	4,493	132.63	595,906.59
WASTE MANAGEMENT INC	7,500	162.79	1,220,925.00
AMERCO	179	714.34	127,866.86
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	100.63	231,851.52
CSX CORP	39,064	36.61	1,430,133.04
DELTA AIR LINES INC	2,928	38.50	112,728.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	128.27	394,558.52



FEDEX CORP	4,433	245.25	1,087,193.25
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,685	198.57	334,590.45
KANSAS CITY SOUTHERN	1,637	297.13	486,401.81
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	60.07	147,772.20
LYFT INC-A	4,003	40.76	163,162.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,300	286.95	1,233,885.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,802	354.75	639,259.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	43.61	96,160.05
UBER TECHNOLOGIES INC	21,623	37.54	811,727.42
UNION PACIFIC CORP	11,446	247.25	2,830,023.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	12,875	206.54	2,659,202.50
APTIV PLC	4,894	166.80	816,319.20
BORGWARNER INC	3,548	46.12	163,633.76
FORD MOTOR CO	70,192	19.57	1,373,657.44
GENERAL MOTORS CO	23,162	59.62	1,380,918.44
LEAR CORP	1,094	183.87	201,153.78
LUCID GROUP INC	7,369	36.52	269,115.88
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	3,143	115.40	362,702.20
TESLA INC	14,795	1,003.80	14,851,221.00
DR HORTON INC	5,990	106.96	640,690.40
GARMIN LTD	2,605	135.36	352,612.80
HASBRO INC	2,664	100.41	267,492.24
LENNAR CORP-A	4,830	115.54	558,058.20
LULULEMON ATHLETICA INC	2,154	416.92	898,045.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	179.28	164,220.48
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	22.78	126,064.52
NIKE INC -CL B	22,578	168.10	3,795,361.80
NVR INC	54	5,863.52	316,630.08
PELTON INTERACTIVE INC-A	4,483	40.70	182,458.10
PULTEGROUP INC	4,833	55.37	267,603.21
VF CORP	5,597	76.03	425,539.91
WHIRLPOOL CORP	966	226.04	218,354.64
AIRBNB INC-CLASS A	4,238	181.46	769,027.48
ARAMARK	4,618	36.05	166,478.90
BOOKING HOLDINGS INC	729	2,267.61	1,653,087.69

CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,570	90.81	324,191.70
CARNIVAL CORP	14,286	19.19	274,148.34
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	484	1,722.60	833,738.40
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	149.50	356,258.50
DOMINO'S PIZZA INC	663	530.29	351,582.27
DRAFTKINGS INC - CL A	5,981	31.45	188,102.45
EXPEDIA GROUP INC	2,522	169.75	428,109.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,781	144.31	689,946.11
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	38.11	195,313.75
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,754	157.15	747,091.10
MCDONALD'S CORP	13,188	262.34	3,459,739.92
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	10.43	37,548.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	42.21	296,609.67
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,914	74.70	292,375.80
STARBUCKS CORP	20,869	115.35	2,407,239.15
VAIL RESORTS INC	810	336.12	272,257.20
WYNN RESORTS LTD	1,490	87.53	130,419.70
YUM! BRANDS INC	5,112	133.12	680,509.44
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,734	59.07	811,267.38
ALPHABET INC-CL A	5,291	2,952.77	15,623,106.07
ALPHABET INC-CL C	5,064	2,962.12	15,000,175.68
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	9,418	29.46	277,454.28
CABLE ONE INC	110	1,705.91	187,650.10
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,285	611.97	1,398,351.45
COMCAST CORP-CLASS A	80,609	47.81	3,853,916.29
DISCOVERY INC - A	1,722	23.58	40,604.76
DISCOVERY INC-C	5,617	22.69	127,449.73
DISH NETWORK CORP-A	3,674	32.16	118,155.84
ELECTRONIC ARTS INC	4,991	125.00	623,875.00
FOX CORP - CLASS A	6,194	36.54	226,328.76
FOX CORP- CLASS B	1,836	34.15	62,699.40
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	131.50	148,069.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	36.48	214,283.52
LIBERTY BROADBAND-A	223	147.91	32,983.93
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	150.37	402,841.23

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	60.00	234,960.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,025	48.14	145,623.50
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	48.14	45,540.44
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,942	110.73	325,767.66
MATCH GROUP INC	4,456	132.21	589,127.76
META PLATFORMS INC	41,897	329.82	13,818,468.54
NETFLIX INC	7,787	611.00	4,757,857.00
NEWS CORP - CLASS A	5,861	21.77	127,593.97
OMNICOM GROUP	3,237	69.79	225,910.23
PINTEREST INC- CLASS A	9,515	38.75	368,706.25
ROKU INC	2,074	235.09	487,576.66
SEA LTD-ADR	2,474	254.80	630,375.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.16	63,983.92
SNAP INC - A	18,792	52.36	983,949.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	2,134	166.38	355,054.92
TWITTER INC	13,838	46.46	642,913.48
VIACOMCBS INC - CLASS B	10,543	31.07	327,571.01
WALT DISNEY CO/THE	31,972	152.94	4,889,797.68
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	4,026	62.91	253,275.66
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	234.62	219,838.94
AMAZON.COM INC	8,010	3,483.42	27,902,194.20
AUTOZONE INC	373	1,965.83	733,254.59
BATH & BODY WORKS INC	4,700	75.03	352,641.00
BEST BUY CO INC	3,865	104.38	403,428.70
BURLINGTON STORES INC	1,107	287.64	318,417.48
CARMAX INC	2,885	146.60	422,941.00
CARVANA CO	1,380	268.04	369,895.20
CHEWY INC - CLASS A	1,090	56.30	61,367.00
DOLLAR GENERAL CORP	4,065	222.33	903,771.45
DOLLAR TREE INC	3,916	138.44	542,131.04
DOORDASH INC - A	1,947	164.86	320,982.42
EBAY INC	11,722	66.60	780,685.20
ETSY INC	2,268	234.40	531,619.20
FIVERR INTERNATIONAL LTD	506	134.58	68,097.48
GENUINE PARTS CO	2,564	134.18	344,037.52

HOME DEPOT INC	18,570	411.34	7,638,583.80
LKQ CORP	4,394	57.26	251,600.44
LOWE'S COS INC	12,194	258.15	3,147,881.10
MERCADOLIBRE INC	773	1,131.84	874,912.32
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,200	672.00	806,400.00
POOL CORP	783	549.39	430,172.37
ROSS STORES INC	6,131	112.53	689,921.43
TARGET CORP	8,531	237.56	2,026,624.36
TJX COMPANIES INC	20,783	74.02	1,538,357.66
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,120	230.24	488,108.80
ULTA BEAUTY INC	950	404.41	384,189.50
WAYFAIR INC- CLASS A	1,439	219.13	315,328.07
COSTCO WHOLESALE CORP	7,811	524.33	4,095,541.63
KROGER CO	13,182	43.68	575,789.76
SYSCO CORP	8,818	73.87	651,385.66
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,659	49.17	622,443.03
WALMART INC	27,244	138.50	3,773,294.00
ALTRIA GROUP INC	32,118	44.59	1,432,141.62
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,767	63.28	618,055.76
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	70.58	372,803.56
BUNGE LTD	2,145	85.48	183,354.60
CAMPBELL SOUP CO	3,976	42.18	167,707.68
COCA-COLA CO/THE	72,416	54.86	3,972,741.76
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,239	52.97	224,539.83
CONAGRA BRANDS INC	8,705	31.87	277,428.35
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,972	233.50	693,962.00
GENERAL MILLS INC	10,536	63.97	673,987.92
HERSHEY CO/THE	2,482	183.50	455,447.00
HORMEL FOODS CORP	4,355	44.80	195,104.00
JM SMUCKER CO/THE	1,878	130.57	245,210.46
KELLOGG CO	4,596	62.03	285,089.88
KEURIG DR PEPPER INC	13,149	34.59	454,823.91
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	33.47	380,587.37
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	88.72	378,213.36
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	45.57	127,368.15

MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	24,384	60.99	1,487,180.16
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	88.30	601,587.90
PEPSICO INC	24,388	166.31	4,055,968.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	27,578	89.50	2,468,231.00
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	83.75	422,853.75
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	95.54	399,930.44
CLOROX COMPANY	2,061	166.92	344,022.12
COLGATE-PALMOLIVE CO	13,947	78.00	1,087,866.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,027	355.84	1,432,967.68
KIMBERLY-CLARK CORP	5,879	135.61	797,251.19
PROCTER & GAMBLE CO/THE	42,835	153.32	6,567,462.20
ABBOTT LABORATORIES	31,273	132.53	4,144,610.69
ABIOMED INC	756	312.18	236,008.08
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,331	673.59	896,548.29
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,590	121.69	315,177.10
ANTHEM INC	4,202	419.66	1,763,411.32
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,563	80.56	689,835.28
BECTON DICKINSON AND CO	5,101	245.11	1,250,306.11
BOSTON SCIENTIFIC CORP	25,011	41.28	1,032,454.08
CARDINAL HEALTH INC	4,308	48.48	208,851.84
CENTENE CORP	9,908	74.87	741,811.96
CERNER CORP	5,093	75.15	382,738.95
CIGNA CORP	5,878	211.30	1,242,021.40
COOPER COS INC/THE	912	408.43	372,488.16
CVS HEALTH CORP	23,358	97.31	2,272,966.98
DAVITA INC	1,175	105.07	123,457.25
DENTSPLY SIRONA INC	3,748	53.06	198,868.88
DEXCOM INC	1,652	560.15	925,367.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,093	120.34	1,334,931.62
HCA HEALTHCARE INC	4,736	241.44	1,143,459.84
HENRY SCHEIN INC	2,103	75.76	159,323.28
HOLOGIC INC	4,309	75.19	323,993.71
HUMANA INC	2,285	452.28	1,033,459.80
IDEXX LABORATORIES INC	1,506	607.58	915,015.48
INMODE LTD	975	69.52	67,782.00

INSULET CORP	1,229	268.50	329,986.50
INTUITIVE SURGICAL INC	6,319	340.34	2,150,608.46
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	281.97	455,381.55
MASIMO CORP	1,017	276.77	281,475.09
MCKESSON CORP	2,622	230.74	605,000.28
MEDTRONIC PLC	23,778	112.81	2,682,396.18
MOLINA HEALTHCARE INC	1,137	295.24	335,687.88
NOVOCURE LTD	1,677	87.77	147,190.29
OAK STREET HEALTH INC	1,457	31.49	45,880.93
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,197	157.72	346,510.84
RESMED INC	2,476	264.56	655,050.56
STERIS PLC	1,666	232.37	387,128.42
STRYKER CORP	6,026	260.54	1,570,014.04
TELADOC HEALTH INC	2,707	94.98	257,110.86
TELEFLEX INC	849	320.35	271,977.15
UNITEDHEALTH GROUP INC	16,600	473.32	7,857,112.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,562	129.12	201,685.44
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,458	267.33	657,097.14
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,535	125.44	443,430.40
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	143.57	187,645.99
ABBVIE INC	31,180	124.15	3,870,997.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,278	154.61	816,031.58
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,148	172.47	370,465.56
AMGEN INC	9,935	212.57	2,111,882.95
AVANTOR INC	8,797	39.69	349,152.93
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	753.79	282,671.25
BIO-TECHNE CORP	759	470.20	356,881.80
BIOGEN INC	2,609	232.43	606,409.87
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,350	85.62	286,827.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,624	57.54	2,222,424.96
CATALENT INC	2,865	123.79	354,658.35
CHARLES RIVER LABORATORIES	981	357.05	350,266.05
DANAHER CORP	11,338	319.28	3,619,996.64
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	28.49	216,182.12
ELI LILLY & CO	14,345	242.90	3,484,400.50

EXACT SCIENCES CORP	3,021	81.08	244,942.68
GILEAD SCIENCES INC	21,697	70.30	1,525,299.10
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,710	100.24	371,890.40
ILLUMINA INC	2,556	371.34	949,145.04
INCYTE CORP	3,430	66.47	227,992.10
IQVIA HOLDINGS INC	3,320	269.16	893,611.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	123.09	92,686.77
JOHNSON & JOHNSON	46,343	165.90	7,688,303.70
MERCK & CO. INC.	44,664	72.86	3,254,219.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	404	1,582.16	639,192.64
MODERNA INC	5,902	272.21	1,606,583.42
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,875	81.62	153,037.50
NOVAVAX INC	1,081	177.38	191,747.78
PERKINELMER INC	2,057	187.43	385,543.51
PFIZER INC	98,807	52.08	5,145,868.56
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,831	665.72	1,218,933.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,242	38.17	238,257.14
SEAGEN INC	2,365	144.96	342,830.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	8.29	173,609.18
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,937	637.07	4,419,354.59
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,485	208.41	934,718.85
VIATRIS INC	22,098	12.59	278,213.82
WATERS CORP	1,044	343.72	358,843.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,251	429.19	536,916.69
ZOETIS INC	8,212	230.16	1,890,073.92
BANK OF AMERICA CORP	133,213	44.49	5,926,646.37
CITIGROUP INC	35,708	62.14	2,218,895.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	47.37	355,322.37
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	43.75	544,031.25
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,042	209.77	638,120.34
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.43	401,704.62
JPMORGAN CHASE & CO	52,598	160.46	8,439,875.08
KEYCORP	17,095	22.99	393,014.05
M & T BANK CORP	2,483	152.24	378,011.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,340	200.73	1,473,358.20

REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	22.29	377,837.79
SIGNATURE BANK	1,113	315.35	350,984.55
SVB FINANCIAL GROUP	1,055	706.06	744,893.30
TRUIST FINANCIAL CORP	23,236	59.62	1,385,330.32
US BANCORP	24,451	57.21	1,398,841.71
WELLS FARGO & CO	72,485	49.69	3,601,779.65
ALLY FINANCIAL INC	6,403	48.31	309,328.93
AMERICAN EXPRESS CO	11,793	168.02	1,981,459.86
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	297.35	617,298.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,618	70.49	184,542.82
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14,390	57.08	821,381.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	23,341	284.52	6,640,981.32
BLACKROCK INC	2,692	919.08	2,474,163.36
BLACKSTONE INC	12,166	133.99	1,630,122.34
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,945	149.17	1,185,155.65
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	53.93	145,611.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	129.04	252,402.24
CME GROUP INC	6,339	227.64	1,443,009.96
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	691	263.91	182,361.81
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,266	115.29	607,117.14
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	32.53	182,102.94
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	749	462.67	346,539.83
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	33.26	151,765.38
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	45.23	36,184.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,868	396.49	2,326,603.32
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,958	134.60	1,340,346.80
INVESCO LTD	5,927	23.21	137,565.67
KKR & CO INC	9,044	75.76	685,173.44
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	379.78	263,187.54
MOODY'S CORP	2,986	393.40	1,174,692.40
MORGAN STANLEY	24,101	100.58	2,424,078.58
MSCI INC	1,424	619.94	882,794.56
NASDAQ INC	2,170	204.14	442,983.80
NORTHERN TRUST CORP	3,716	118.93	441,943.88
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,393	97.94	332,310.42



ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,321	21.91	72,763.11
S&P GLOBAL INC	4,271	467.66	1,997,375.86
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,625	80.66	2,066,912.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	60.95	105,809.20
SOFI TECHNOLOGIES INC	9,460	15.66	148,143.60
STATE STREET CORP	6,599	93.98	620,174.02
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	47.89	467,310.62
T ROWE PRICE GROUP INC	3,918	199.41	781,288.38
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	94.69	144,875.70
UPSTART HOLDINGS INC	356	179.60	63,937.60
AFLAC INC	11,207	57.37	642,945.59
ALLEGHANY CORP	197	672.96	132,573.12
ALLSTATE CORP	5,193	107.67	559,130.31
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,465	136.98	200,675.70
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,874	54.81	815,243.94
AON PLC	3,988	295.50	1,178,454.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	43.47	265,210.47
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,581	167.68	600,462.08
ASSURANT INC	896	155.72	139,525.12
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,286	80.77	184,640.22
BROWN & BROWN INC	4,086	67.06	274,007.16
CHUBB LTD	7,783	190.20	1,480,326.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,800	115.14	322,392.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	189.74	72,480.68
EVEREST RE GROUP LTD	734	271.19	199,053.46
FNF GROUP	4,754	50.43	239,744.22
GLOBE LIFE INC	1,521	91.67	139,430.07
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	68.23	446,497.12
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	68.23	227,956.43
LOEWS CORP	3,999	56.64	226,503.36
MARKEL CORP	251	1,227.67	308,145.17
MARSH & MCLENNAN COS	8,802	171.05	1,505,582.10
METLIFE INC	12,898	60.88	785,230.24
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	71.54	357,270.76
PROGRESSIVE CORP	10,386	95.25	989,266.50

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,833	106.53	727,919.49
TRAVELERS COS INC/THE	4,363	153.49	669,676.87
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	232.35	501,411.30
MR BERKLEY CORP	2,140	79.78	170,729.20
CBRE GROUP INC - A	5,718	102.70	587,238.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	5.54	111,354.00
ZILLOW GROUP INC - A	904	61.24	55,360.96
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	62.35	167,970.90
ACCENTURE PLC-CL A	11,199	371.45	4,159,868.55
ADOBE INC	8,401	632.57	5,314,220.57
AFFIRM HOLDINGS INC	1,615	119.13	192,394.95
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	111.92	324,568.00
ANSYS INC	1,507	394.27	594,164.89
ASANA INC - CL A	1,233	73.80	90,995.40
AUTODESK INC	3,802	267.67	1,017,681.34
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,352	232.74	1,711,104.48
AVALARA INC	1,520	149.92	227,878.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	47.63	123,409.33
BILL.COM HOLDINGS INC	1,382	254.52	351,746.64
BLACK KNIGHT INC	3,383	73.68	249,259.44
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,131	175.45	373,883.95
CADENCE DESIGN SYS INC	4,809	179.62	863,792.58
CERIDIAN HCM HOLDING INC	2,496	104.15	259,958.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	110.38	183,672.32
CITRIX SYSTEMS INC	2,191	81.63	178,851.33
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,172	150.20	626,634.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9,115	80.99	738,223.85
COUPA SOFTWARE INC	1,218	162.72	198,192.96
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,333	201.27	670,832.91
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	798	158.11	126,171.78
DATADOG INC - CLASS A	3,490	175.41	612,180.90
DOCUSIGN INC	3,419	149.37	510,696.03
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	24.08	128,394.56
DYNATRACE INC	3,655	62.63	228,912.65
EPAM SYSTEMS INC	975	700.01	682,509.75

FAIR ISAAC CORP	571	406.99	232,391.29
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,714	104.99	1,124,862.86
FISERV INC	10,369	103.53	1,073,502.57
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	221.95	312,949.50
FORTINET INC	2,399	316.42	759,091.58
GARTNER INC	1,494	311.16	464,873.04
GLOBAL PAYMENTS INC	5,102	127.37	649,841.74
GODADDY INC - CLASS A	3,327	70.91	235,917.57
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,578	113.94	179,797.32
HUBSPOT INC	774	738.94	571,939.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,931	123.57	1,968,593.67
INTUIT INC	4,832	665.51	3,215,744.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	156.56	201,023.04
MASTERCARD INC-CLASS A	15,539	344.52	5,353,496.28
MICROSOFT CORP	125,468	333.10	41,793,390.80
MONGODB INC	966	513.28	495,828.48
NORTONLIFELOCK INC	8,787	23.90	210,009.30
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,530	54.90	303,597.00
OKTA INC	2,109	228.16	481,189.44
ORACLE CORP	29,659	88.77	2,632,829.43
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,325	19.21	524,913.25
PALO ALTO NETWORKS INC	1,683	527.53	887,832.99
PAYCHEX INC	5,606	122.32	685,725.92
PAYCOM SOFTWARE INC	910	424.33	386,140.30
PAYPAL HOLDINGS INC	19,724	191.75	3,782,077.00
PTC INC	1,603	119.96	192,295.88
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	186.21	236,486.70
SALESFORCE.COM INC	17,272	264.32	4,565,335.04
SERVICENOW INC	3,513	642.15	2,255,872.95
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,761	361.32	1,358,924.52
SPLUNK INC	2,723	113.15	308,107.45
SQUARE INC - A	7,082	186.75	1,322,563.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	77.85	321,209.10
SYNOPSYS INC	2,636	354.48	934,409.28
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,455	94.51	704,572.05

TWILIO INC - A	2,853	268.29	765,431.37
TYLER TECHNOLOGIES INC	748	513.22	383,888.56
UNITY SOFTWARE INC	839	140.00	117,460.00
VERISIGN INC	1,710	240.56	411,357.60
VISA INC-CLASS A SHARES	29,752	211.39	6,289,275.28
VMWARE INC-CLASS A	3,863	112.78	435,669.14
WESTERN UNION CO	5,513	18.03	99,399.39
WIX.COM LTD	998	152.59	152,284.82
WORKDAY INC-CLASS A	3,335	279.35	931,632.25
ZENDESK INC	2,234	101.29	226,281.86
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,674	188.27	691,703.98
ZSCALER INC	1,359	303.04	411,831.36
AMPHENOL CORP-CL A	10,315	83.11	857,279.65
APPLE INC	290,497	174.56	50,709,156.32
ARISTA NETWORKS INC	4,084	128.66	525,447.44
ARROW ELECTRONICS INC	1,337	125.66	168,007.42
CDW CORP/DE	2,596	194.69	505,415.24
CISCO SYSTEMS INC	74,415	57.55	4,282,583.25
COGNEX CORP	2,959	75.76	224,173.84
CORNING INC	14,801	37.55	555,777.55
DELL TECHNOLOGIES -C	5,156	57.65	297,243.40
F5 INC	916	226.96	207,895.36
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	24,541	15.38	377,440.58
HP INC	22,784	36.15	823,641.60
IPG PHOTONICS CORP	558	170.62	95,205.96
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	32.74	148,410.42
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	200.63	619,144.18
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,928	259.18	758,879.04
NETAPP INC	3,840	89.31	342,950.40
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,790	102.93	390,104.70
TE CONNECTIVITY LTD	5,700	157.14	895,698.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	803	431.11	346,181.33
TRIMBLE INC	4,462	86.91	387,792.42
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	57.33	294,962.85
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	597.74	558,289.16

AT&T INC	125,744	22.94	2,884,567.36
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	27.15	35,457.90
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	27.17	169,350.61
LUMEN TECHNOLOGIES INC	16,742	12.07	202,075.94
T-MOBILE US INC	10,801	113.99	1,231,205.99
VERIZON COMMUNICATIONS INC	72,878	50.16	3,655,560.48
AES CORP	13,306	24.55	326,662.30
ALLIANT ENERGY CORP	4,611	58.14	268,083.54
AMEREN CORPORATION	4,330	86.70	375,411.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,643	83.52	721,863.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,140	175.82	552,074.80
ATMOS ENERGY CORP	2,000	95.23	190,460.00
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	27.54	273,004.02
CMS ENERGY CORP	5,193	62.15	322,744.95
CONSOLIDATED EDISON INC	6,459	81.68	527,571.12
DOMINION ENERGY INC	14,281	76.19	1,088,069.39
DTE ENERGY COMPANY	3,309	115.23	381,296.07
DUKE ENERGY CORP	13,295	100.28	1,333,222.60
EDISON INTERNATIONAL	6,481	66.51	431,051.31
ENERGY CORP	3,422	106.25	363,587.50
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	50.16	199,737.12
EVERGY INC	3,540	66.44	235,197.60
EVERSOURCE ENERGY	6,304	87.53	551,789.12
EXELON CORP	16,898	53.14	897,959.72
FIRSTENERGY CORP	10,241	39.40	403,495.40
NEXTERA ENERGY INC	34,688	89.91	3,118,798.08
NISOURCE INC	7,043	25.85	182,061.55
NRG ENERGY INC	5,306	38.47	204,121.82
P G & E CORP	27,434	12.49	342,650.66
PPL CORP	13,143	28.60	375,889.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,740	63.74	557,087.60
SEMPRA ENERGY	5,479	126.20	691,449.80
SOUTHERN CO/THE	18,300	64.57	1,181,631.00
UGI CORP	3,091	44.49	137,518.59
VISTRA CORP	9,405	20.89	196,470.45

	WEC ENERGY GROUP INC	5,459	92.80	506,595.20	
	XCEL ENERGY INC	9,302	66.80	621,373.60	
	ADVANCED MICRO DEVICES	21,400	138.10	2,955,340.00	
	ANALOG DEVICES INC	9,295	183.68	1,707,305.60	
	APPLIED MATERIALS INC	15,855	152.65	2,420,265.75	
	BROADCOM INC	7,233	583.42	4,219,876.86	
	ENPHASE ENERGY INC	2,171	216.35	469,695.85	
	ENTEGRIS INC	2,468	146.65	361,932.20	
	INTEL CORP	71,561	50.48	3,612,399.28	
	KLA CORP	2,650	409.37	1,084,830.50	
	LAM RESEARCH CORP	2,465	699.39	1,723,996.35	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	14,361	90.03	1,292,920.83	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,458	86.63	819,346.54	
	MICRON TECHNOLOGY INC	19,379	84.93	1,645,858.47	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	786	515.59	405,253.74	
	NVIDIA CORP	43,959	304.90	13,403,099.10	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	4,766	225.16	1,073,112.56	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	7,719	63.30	488,612.70	
	QORVO INC	2,035	159.56	324,704.60	
	QUALCOMM INC	19,896	182.26	3,626,244.96	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	161.02	435,237.06	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	952	313.38	298,337.76	
	TERADYNE INC	2,952	156.57	462,194.64	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	16,293	193.40	3,151,066.20	
	XILINX INC	4,251	215.02	914,050.02	
	米ドル 小計	5,543,147		724,757,193.16 (82,238,198,707)	
カナダドル	CAMECO CORP	8,016	28.72	230,219.52	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	20,529	52.82	1,084,341.78	
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	15.64	344,674.32	
	ENBRIDGE INC	35,044	48.04	1,683,513.76	
	IMPERIAL OIL LTD	4,737	44.24	209,564.88	
	KEYERA CORP	5,630	28.57	160,849.10	
	PARKLAND CORP	1,790	33.56	60,072.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,270	37.70	387,179.00	

SUNCOR ENERGY INC	25,615	31.12	797,138.80
TC ENERGY CORP	17,347	58.06	1,007,166.82
TOURMALINE OIL CORP	6,019	40.92	246,297.48
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,733	61.42	290,700.86
BARRICK GOLD CORP	29,830	23.09	688,774.70
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	64.73	200,921.92
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,217	29.70	303,444.90
FRANCO-NEVADA CORP	3,254	166.72	542,506.88
IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	10.16	105,247.44
KINROSS GOLD CORP	19,092	6.69	127,725.48
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,057	48.67	246,124.19
LUNDIN MINING CORP	16,915	11.08	187,418.20
NUTRIEN LTD	9,609	88.31	848,570.79
PAN AMERICAN SILVER CORP	5,353	30.37	162,570.61
TECK RESOURCES LTD-CLS B	8,203	35.21	288,827.63
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,663	112.78	187,553.14
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	51.81	408,573.66
BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	17.10	45,725.40
CAE INC	5,971	30.77	183,727.67
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	108.56	153,720.96
WSP GLOBAL INC	1,908	179.70	342,867.60
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	47.47	148,818.45
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	86.65	156,749.85
THOMSON REUTERS CORP	2,939	153.15	450,107.85
AIR CANADA	840	22.00	18,480.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,196	163.66	1,995,997.36
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,385	91.61	1,042,979.85
TFI INTERNATIONAL INC	1,624	137.72	223,657.28
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	100.86	545,551.74
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	52.43	198,604.84
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	75.50	400,074.50
QUEBECOR INC -CL B	4,598	28.13	129,341.74
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	37.39	325,367.78
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	179.79	167,744.07
DOLLARAMA INC	5,287	58.48	309,183.76

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	14,242	52.45	746,992.90
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	37.75	99,207.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	98.47	319,338.21
METRO INC	4,307	62.82	270,565.74
WESTON (GEORGE) LTD	1,578	138.09	217,906.02
SAPUTO INC	3,667	28.86	105,829.62
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	31.46	193,101.48
CANOPY GROWTH CORP	3,659	12.96	47,420.64
BANK OF MONTREAL	11,149	137.83	1,536,666.67
BANK OF NOVA SCOTIA	20,901	85.80	1,793,305.80
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,713	141.79	1,093,626.27
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	96.69	545,911.74
ROYAL BANK OF CANADA	25,220	129.73	3,271,790.60
TORONTO-DOMINION BANK	32,272	95.44	3,080,039.68
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	25,108	73.62	1,848,450.96
IGM FINANCIAL INC	1,623	46.65	75,712.95
ONEX CORPORATION	908	96.23	87,376.84
TMX GROUP LTD	1,457	124.39	181,236.23
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	581.81	265,305.36
GREAT-WEST LIFE CO INC	4,328	37.94	164,204.32
IA FINANCIAL CORP INC	2,752	70.94	195,226.88
INTACT FINANCIAL CORP	3,041	161.28	490,452.48
MANULIFE FINANCIAL CORP	33,538	23.87	800,552.06
POWER CORP OF CANADA	10,869	42.04	456,932.76
SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	69.46	693,905.40
FIRSTSERVICE CORP	671	245.75	164,898.25
BLACKBERRY LTD	7,347	11.45	84,123.15
CGI INC	3,796	107.29	407,272.84
CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,178.34	742,813.94
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	58.27	92,824.11
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	77.59	64,322.11
OPEN TEXT CORP	4,289	60.49	259,441.61
SHOPIFY INC - CLASS A	2,003	1,899.12	3,803,937.36
BCE INC	1,259	65.51	82,477.09
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6,149	57.63	354,366.87



	TELUS CORP	8,222	29.06	238,931.32	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,058	17.65	248,123.70	
	ALTAGAS LTD	7,212	24.77	178,641.24	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	43.91	90,278.96	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	34.91	34,456.17	
	EMERA INC	4,505	59.74	269,128.70	
	FORTIS INC	8,232	57.74	475,315.68	
	HYDRO ONE LTD	4,991	31.05	154,970.55	
	NORTHLAND POWER INC	3,252	37.54	122,080.08	
	カナダドル 小計	690,448		44,088,141.30 (3,934,425,729)	
ユーロ	ENI SPA	42,914	12.26	526,383.12	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.39	62,229.18	
	NESTE OYJ	7,057	43.29	305,497.53	
	OMV AG	2,574	49.86	128,339.64	
	REPSOL SA	24,986	10.13	253,258.09	
	TENARIS SA	5,062	8.99	45,537.75	
	TOTALENERGIES SE	44,618	43.95	1,961,184.19	
	AIR LIQUIDE SA	8,488	154.88	1,314,621.44	
	AKZO NOBEL	3,222	95.38	307,314.36	
	ARCELORMITTAL	12,348	25.83	318,948.84	
	ARKEMA	1,076	121.20	130,411.20	
	BASF SE	16,548	59.95	992,052.60	
	COVESTRO AG	3,382	52.02	175,931.64	
	CRH PLC	13,641	44.55	607,706.55	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	27.73	108,757.06	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,085	39.98	43,378.30	
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	59.66	129,104.24	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,952	197.05	581,691.60	
	LANXESS AG	1,915	52.68	100,882.20	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	46.48	184,804.48	
	SOLVAY SA	1,489	101.20	150,686.80	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	11,685	15.84	185,148.82	
	SYMRISE AG	2,370	129.10	305,967.00	
	UMICORE	3,883	38.50	149,495.50	

UPM-KYMMENE OYJ	9,909	33.27	329,672.43
VOESTALPINE AG	2,425	30.70	74,447.50
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,217	21.41	90,285.97
AIRBUS SE	10,578	105.50	1,115,979.00
ALSTOM	5,811	31.42	182,581.62
BOUYGUES SA	3,499	30.28	105,949.72
BRENTAG SE	2,419	77.28	186,940.32
CNH INDUSTRIAL NV	19,340	15.83	306,152.20
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8,682	61.21	531,425.22
DASSAULT AVIATION SA	110	92.60	10,186.00
EIFFAGE	1,503	84.72	127,334.16
FERROVIAL SA	7,014	25.72	180,400.08
GEA GROUP AG	3,473	47.18	163,856.14
IMCD NV	1,073	208.10	223,291.30
KINGSPAN GROUP PLC	2,977	104.15	310,054.55
KION GROUP AG	1,385	97.88	135,563.80
KNORR-BREMSE AG	1,136	89.52	101,694.72
KONE OYJ-B	5,617	61.44	345,108.48
LEGRAND SA	4,583	101.20	463,799.60
MTU AERO ENGINES AG	938	170.80	160,210.40
PRYSMIAN SPA	4,594	32.63	149,902.22
RATIONAL AG	80	853.40	68,272.00
SAFRAN SA	5,873	105.96	622,303.08
SCHNEIDER ELECTRIC SE	9,655	167.82	1,620,302.10
SIEMENS AG-REG	13,602	150.84	2,051,725.68
SIEMENS ENERGY AG	7,711	23.11	178,201.21
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	21.66	89,412.48
THALES SA	1,768	73.84	130,549.12
VINCI SA	9,484	86.29	818,374.36
WARTSILA OYJ ABP	8,128	12.09	98,308.16
BUREAU VERITAS SA	4,564	29.01	132,401.64
RANDSTAD NV	1,871	58.16	108,817.36
TELEPERFORMANCE	1,061	377.30	400,315.30
WOLTERS KLUWER	4,948	103.55	512,365.40
ADP	314	106.40	33,409.60

AENA SME SA	1,497	130.65	195,583.05
ATLANTIA SPA	8,066	16.99	137,081.67
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10,938	6.07	66,459.28
DEUTSCHE POST AG-REG	17,844	53.57	955,903.08
GETLINK	9,276	13.64	126,571.02
INPOST SA	3,195	9.31	29,758.23
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,866	90.38	530,169.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	74.85	46,332.15
CONTINENTAL AG	2,088	94.40	197,107.20
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	14,942	86.50	1,292,483.00
FAURECIA	2,333	39.50	92,153.50
FERRARI NV	2,202	232.80	512,625.60
MICHELIN (CGDE)	3,012	141.40	425,896.80
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	84.30	202,235.70
RENAULT SA	3,099	29.92	92,737.57
STELLANTIS NV	35,353	16.44	581,486.14
VALEO SA	3,692	27.48	101,456.16
VOLKSWAGEN AG	462	276.00	127,512.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,269	182.78	597,507.82
ADIDAS AG	3,306	259.85	859,064.10
ESSILORLUXOTTICA	5,113	185.78	949,893.14
HERMES INTERNATIONAL	550	1,592.50	875,875.00
KERING	1,339	708.70	948,949.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,915	715.00	3,514,225.00
MONCLER SPA	3,302	66.82	220,639.64
PUMA SE	2,047	108.05	221,178.35
SEB SA	609	134.50	81,910.50
ACCOR SA	2,330	27.01	62,933.30
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	129.50	362,341.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,369	39.42	93,385.98
SODEXO	1,542	76.56	118,055.52
BOLLORE	14,850	4.70	69,913.80
PUBLICIS GROUPE	3,613	58.10	209,915.30
SCOUT24 SE	1,621	58.72	95,185.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,377	43.61	103,660.97

UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	14,144	25.05	354,377.92
VIVENDI	14,144	11.29	159,685.76
DELIVERY HERO SE	2,979	108.50	323,221.50
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,585	28.28	525,583.80
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	50.91	179,050.47
PROSUS NV	16,565	73.29	1,214,048.85
ZALANDO SE	3,789	77.52	293,723.28
CARREFOUR SA	10,978	15.14	166,261.81
COLRUYT SA	290	40.01	11,602.90
HELLOFRESH SE	3,031	77.76	235,690.56
JERONIMO MARTINS	5,217	20.26	105,696.42
KESKO OYJ-B SHS	4,478	29.37	131,518.86
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,708	30.04	532,036.86
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,146	50.96	720,880.16
DANONE	11,362	53.00	602,186.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	12.98	117,046.79
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	75.55	137,501.00
HEINEKEN NV	4,447	90.22	401,208.34
JDE PEET'S BV	1,184	25.63	30,345.92
KERRY GROUP PLC-A	2,701	113.15	305,618.15
PERNOD RICARD SA	3,643	210.20	765,758.60
REMY COINTREAU	264	205.00	54,120.00
BEIERSDORF AG	1,716	91.12	156,361.92
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	67.10	104,810.20
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,219	71.30	229,514.70
L'OREAL	4,486	419.10	1,880,082.60
AMPLIFON SPA	2,059	41.64	85,736.76
BIOMERIEUX	820	122.00	100,040.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	173.95	109,588.50
DIASORIN SPA	629	178.00	111,962.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	54.42	211,040.76
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	34.27	244,312.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,274	30.64	468,071.73
ORPEA	1,093	82.48	90,150.64
SARTORIUS AG-VORZUG	502	579.20	290,758.40

SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	67.36	314,369.12
ARGENX SE	902	270.70	244,171.40
BAYER AG-REG	17,000	45.88	779,960.00
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	107.24	230,458.76
GRIFOLS SA	3,329	15.39	51,249.95
IPSEN	158	92.00	14,536.00
MERCK KGAA	2,192	225.40	494,076.80
ORION OYJ-CLASS B	2,696	34.53	93,092.88
QIAGEN N.V.	4,271	48.55	207,357.05
RECORDATI SPA	1,969	53.92	106,168.48
SANOFI	20,239	84.09	1,701,897.51
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	484.00	214,896.00
UCB SA	2,214	99.84	221,045.76
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,957	12.61	100,385.51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	114,269	5.15	589,056.69
BANCO SANTANDER SA	302,871	2.71	823,051.94
BNP PARIBAS	19,707	57.42	1,131,575.94
CAIXABANK S.A	78,740	2.32	183,070.50
COMMERZBANK AG	13,866	6.52	90,517.24
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	12.31	270,895.68
ERSTE GROUP BANK AG	5,946	40.09	238,375.14
FINECOBANK SPA	11,008	15.71	172,935.68
ING GROEP NV-CVA	69,555	12.31	856,639.38
INTESA SANPAOLO	281,987	2.22	627,421.07
KBC GROEP NV	4,507	75.48	340,188.36
MEDIOBANCA SPA	10,633	10.06	106,967.98
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,444	25.32	61,882.08
SOCIETE GENERALE SA	14,646	29.23	428,102.58
UNICREDIT SPA	35,836	12.80	458,700.80
AMUNDI SA	618	71.05	43,908.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	11.01	388,549.77
DEUTSCHE BOERSE AG	3,278	138.65	454,494.70
EURAZEO	403	74.55	30,043.65
EURONEXT NV	1,722	86.90	149,641.80
EXOR NV	2,224	79.54	176,896.96

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	98.00	193,942.00
SOFINA	168	431.00	72,408.00
WENDEL	294	99.60	29,282.40
AEGON NV	35,058	4.03	141,529.14
AGEAS	3,211	45.43	145,875.73
ALLIANZ SE-REG	7,359	203.10	1,494,612.90
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	18.58	379,487.11
AXA SA	33,466	25.53	854,386.98
CNP ASSURANCES	3,403	21.72	73,913.16
HANNOVER RUECK SE	1,152	161.40	185,932.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,428	248.65	603,722.20
NN GROUP NV	4,060	45.04	182,862.40
POSTE ITALIANE SPA	11,160	11.10	123,876.00
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	43.58	366,987.18
AROUNDTOWN SA	20,993	5.43	114,033.97
LEG IMMOBILIEN SE	1,515	121.05	183,390.75
VONOVIA SE	12,977	50.34	653,262.18
ADYEN NV	351	2,470.50	867,145.50
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	57.62	440,677.76
BECHTLE AG	1,242	62.98	78,221.16
CAPGEMINI SA	2,763	208.10	574,980.30
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	53.74	624,566.28
EDENRED	4,235	39.20	166,012.00
NEMETSCHKE SE	1,322	113.45	149,980.90
NEXI SPA	7,091	14.44	102,429.49
SAP SE	18,577	117.86	2,189,485.22
WORLDLINE SA	4,054	48.99	198,605.46
NOKIA OYJ	92,708	5.36	497,749.25
CELLNEX TELECOM SA	8,821	52.56	463,631.76
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	57,744	15.98	922,749.12
ELISA OYJ	2,589	53.38	138,200.82
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	10.07	24,905.40
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.61	153,966.95
ORANGE	34,597	9.17	317,254.49
PROXIMUS	918	16.09	14,775.21

	TELECOM ITALIA SPA	242,872	0.44	107,227.98
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.37	29,925.15
	TELEFONICA SA	91,673	3.69	338,777.57
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	33.64	25,768.24
	E.ON SE	38,444	11.29	434,186.53
	EDF	10,409	12.54	130,528.86
	EDP RENOVAVEIS SA	4,503	22.18	99,876.54
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.83	239,211.79
	ELIA GROUP SA/NV	345	112.30	38,743.50
	ENAGAS SA	6,522	20.57	134,157.54
	ENDESA SA	4,803	19.76	94,931.29
	ENEL SPA	146,107	6.70	979,209.11
	ENGIE	31,335	13.16	412,556.61
	FORTUM OYJ	7,645	27.15	207,561.75
	IBERDROLA SA	101,726	9.86	1,003,628.71
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	25.26	117,408.48
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	18.82	162,491.88
	RWE AG	11,090	34.96	387,706.40
	SNAM SPA	32,585	5.12	167,095.88
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	19.78	114,644.88
	TERNA SPA	25,545	6.79	173,501.64
	UNIPER SE	1,582	39.60	62,647.20
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,301	30.76	347,618.76
	VERBUND AG	1,068	99.85	106,639.80
	ASM INTERNATIONAL NV	888	380.00	337,440.00
	ASML HOLDING NV	7,232	691.00	4,997,312.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,556	40.06	903,593.36
	STMICROELECTRONICS NV	12,491	42.86	535,426.71
	ユーロ 小計	3,275,244		86,587,946.67 (11,093,647,727)
英債券	BP PLC	349,095	3.43	1,199,315.87
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	70,726	16.69	1,180,558.39
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	63,903	16.65	1,064,496.17
	ANGLO AMERICAN PLC	22,057	29.73	655,754.61
	ANTOFAGASTA PLC	7,429	14.03	104,228.87

BHP GROUP PLC	37,095	21.32	791,050.87
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,620	103.10	270,122.00
EVRAZ PLC	3,072	6.01	18,462.72
GLENCORE PLC	170,301	3.68	628,240.38
JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	20.63	64,757.57
MONDI PLC	7,876	18.40	144,918.40
RIO TINTO PLC	20,084	47.75	959,011.00
ASHTED GROUP PLC	7,622	63.28	482,320.16
BAE SYSTEMS PLC	55,064	5.50	302,852.00
BUNZL PLC	7,087	29.68	210,342.16
DCC PLC	1,401	57.12	80,025.12
FERGUSON PLC	3,775	124.35	469,421.25
MELROSE INDUSTRIES PLC	68,951	1.50	103,702.30
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.24	204,472.25
SMITHS GROUP PLC	6,986	15.04	105,104.37
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	160.90	193,723.60
EXPERIAN PLC	16,860	36.49	615,221.40
INTERTEK GROUP PLC	2,573	57.42	147,741.66
RELX PLC	34,385	24.16	830,741.60
RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	6.35	187,856.01
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	7.40	151,693.15
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,383	47.38	65,526.54
BURBERRY GROUP PLC	7,146	18.26	130,485.96
PERSIMMON PLC	5,194	28.38	147,405.72
TAYLOR WIMPEY PLC	77,500	1.69	131,013.75
COMPASS GROUP PLC	30,179	15.47	467,020.02
ENTAIN PLC	10,699	16.83	180,117.66
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,117	46.77	145,782.09
WHITBREAD PLC	2,921	29.37	85,789.77
AUTO TRADER GROUP PLC	20,378	7.37	150,226.61
INFORMA PLC	30,041	5.06	152,067.54
PEARSON PLC	13,772	5.91	81,502.69
WPP PLC	19,572	11.02	215,781.30
JD SPORTS FASHION PLC	24,800	2.25	55,800.00
KINGFISHER PLC	46,444	3.41	158,559.81



NEXT PLC	2,522	84.26	212,503.72
OCADO GROUP PLC	9,232	16.33	150,758.56
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.75	76,704.71
TESCO PLC	131,492	2.83	372,122.36
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	19.34	96,197.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	37,631	26.91	1,012,650.21
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	24.63	94,037.34
DIAGEO PLC	41,407	39.49	1,635,369.46
IMPERIAL BRANDS PLC	16,315	15.82	258,184.87
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,307	61.69	759,218.83
UNILEVER PLC	45,230	39.82	1,801,058.60
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	12.36	208,105.32
ASTRAZENECA PLC	27,384	83.62	2,289,850.08
GLAXOSMITHKLINE PLC	89,341	15.97	1,426,954.45
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,811	22.41	85,404.51
BARCLAYS PLC	290,654	1.82	531,431.77
HSBC HOLDINGS PLC	362,413	4.40	1,596,248.05
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,213,798	0.46	566,782.97
NATWEST GROUP PLC	106,419	2.19	233,164.02
STANDARD CHARTERED PLC	49,470	4.30	212,918.88
3I GROUP PLC	18,949	13.99	265,191.25
ABRDN PLC	32,937	2.38	78,554.74
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	13.36	74,749.20
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,605	66.42	372,284.10
M&G PLC	41,949	1.95	82,073.21
SCHRODERS PLC	2,782	34.44	95,812.08
ST JAMES'S PLACE PLC	11,459	16.11	184,661.78
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	30.88	84,765.60
AVIVA PLC	74,601	3.93	293,554.93
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.94	306,729.97
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.50	56,927.50
PRUDENTIAL PLC	44,928	13.15	590,803.20
AVEVA GROUP PLC	2,041	33.11	67,577.51
SAGE GROUP PLC/THE	18,579	8.18	152,087.69

	HALMA PLC	6,704	31.52	211,310.08
	BT GROUP PLC	161,710	1.76	285,660.71
	VODAFONE GROUP PLC	498,320	1.13	564,098.24
	NATIONAL GRID PLC	65,257	10.49	684,545.93
	SEVERN TRENT PLC	5,286	29.20	154,351.20
	SSE PLC	18,204	16.49	300,274.98
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	11.21	147,232.14
	英ポンド 小計	5,108,132		32,006,125.25 (4,799,638,542)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.10	54,430.14
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	928.50	72,423.00
	GIVAUDAN-REG	160	4,794.00	767,040.00
	HOLCIM LTD	9,074	45.17	409,872.58
	SIKA AG-REG	2,454	376.00	922,704.00
	ABB LTD-REG	29,408	33.93	997,813.44
	GEBERIT AG-REG	643	739.40	475,434.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	243.80	52,417.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	249.10	176,113.70
	VAT GROUP AG	505	459.80	232,199.00
	ADECCO SA-REG	2,354	45.76	107,719.04
	SGS SA-REG	121	2,982.00	360,822.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	936	277.50	259,740.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	9,372	142.20	1,332,698.40
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	279.20	114,472.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	53.50	13,428.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	76	2,204.00	167,504.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	11,810.00	283,440.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	116,600.00	116,600.00
	NESTLE SA-REG	49,856	124.40	6,202,086.40
	ALCON INC	8,564	79.00	676,556.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	344.00	353,976.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	176	2,045.00	359,920.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	116	636.00	73,776.00
	LONZA GROUP AG-REG	1,318	754.80	994,826.40
	NOVARTIS AG-REG	38,435	74.64	2,868,788.40

	ROCHE HOLDING AG-BR	604	405.00	244,620.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12,386	374.10	4,633,602.60	
	VIFOR PHARMA AG	638	122.45	78,123.10	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	44,532	8.93	397,670.76	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	59.70	213,069.30	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,518.50	608,918.50	
	UBS GROUP AG-REG	65,676	16.56	1,087,594.56	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	142.20	93,567.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	568	548.20	311,377.60	
	SWISS RE AG	5,123	88.88	455,332.24	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,680	387.70	1,039,036.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	88.80	99,189.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	124.00	144,956.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	76.12	224,477.88	
	SWISSCOM AG-REG	414	508.60	210,560.40	
	スイスフラン 小計	301,616		28,288,896.34 (3,475,008,026)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	368.70	1,190,901.00	
	BOLIDEN AB	4,039	345.70	1,396,282.30	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	10,612	153.95	1,633,717.40	
	ALFA LAVAL AB	6,477	357.40	2,314,879.80	
	ASSA ABLOY AB-B	17,222	269.50	4,641,329.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,365	592.40	7,325,026.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	499.50	3,435,561.00	
	EPIROC AB-A	11,278	229.10	2,583,789.80	
	EPIROC AB-B	4,649	190.35	884,937.15	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	140.65	1,139,124.35	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	343.30	502,591.20	
	LIFCO AB-B SHS	4,582	260.90	1,195,443.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	130.35	3,512,020.05	
	SANDVIK AB	19,332	236.40	4,570,084.80	
	SKANSKA AB-B SHS	7,676	225.60	1,731,705.60	
	SKF AB-B SHARES	7,216	206.20	1,487,939.20	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	204.00	672,792.00	
	VOLVO AB-B SHS	25,143	203.15	5,107,800.45	

	SECURITAS AB-B SHS	3,833	130.40	499,823.20	
	ELECTROLUX AB-B	3,653	210.90	770,417.70	
	EVOLUTION AB	3,009	1,114.00	3,352,026.00	
	EMBRACER GROUP AB	8,396	95.25	799,719.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	165.88	2,167,056.32	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	534.00	780,708.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,306	66.06	1,737,774.36	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,023	286.30	3,442,184.90	
	GETINGE AB-B SHS	4,502	389.90	1,755,329.80	
	NORDEA BANK ABP	55,961	107.60	6,021,403.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,381	129.55	4,065,408.55	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	28,629	95.18	2,724,908.22	
	SWEDBANK AB - A SHARES	17,971	183.22	3,292,646.62	
	EQT AB	5,102	524.40	2,675,488.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	282.60	584,134.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	278.50	655,310.50	
	INVESTOR AB-A SHS	9,765	229.00	2,236,185.00	
	INVESTOR AB-B SHS	31,447	219.80	6,912,050.60	
	KINNEVIK AB - B	3,881	318.00	1,234,158.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	496.00	456,320.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	653.80	1,034,965.40	
	SAGAX AB-B	3,246	326.00	1,058,196.00	
	SINCH AB	7,260	110.55	802,593.00	
	ERICSSON LM-B SHS	50,322	94.22	4,741,338.84	
	HEXAGON AB-B SHS	33,961	139.85	4,749,445.85	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	127.45	946,188.80	
	TELIA CO AB	49,229	34.75	1,710,707.75	
	スウェーデンクローナ 小計	599,253		106,532,413.91 (1,334,851,146)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	2,452	315.10	772,625.20	
	EQUINOR ASA	17,989	236.40	4,252,599.60	
	NORSK HYDRO ASA	21,082	63.50	1,338,707.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	450.80	1,249,617.60	
	ADEVINTA ASA	3,943	121.35	478,483.05	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,287	315.00	720,405.00	

	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	362.10	421,846.50	
	MOWI ASA	8,760	210.20	1,841,352.00	
	ORKLA ASA	11,182	85.90	960,533.80	
	DNB BANK ASA	15,146	199.15	3,016,325.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	210.70	563,411.80	
	TELENOR ASA	13,825	134.20	1,855,315.00	
	ノルウェークローネ 小計	103,277		17,471,222.45 (220,486,827)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	508.80	1,039,987.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	519.20	1,731,012.80	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,887.00	372,423.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,442	211.90	3,695,959.80	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	67	19,940.00	1,335,980.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	21,520.00	2,130,480.00	
	DSV A/S	3,468	1,444.50	5,009,526.00	
	PANDORA A/S	1,826	865.00	1,579,490.00	
	CARLSBERG AS-B	2,072	1,039.00	2,152,808.00	
	AMBU A/S-B	1,526	179.90	274,527.40	
	COLOPLAST-B	2,245	1,077.50	2,418,987.50	
	DEMANT A/S	1,941	318.20	617,626.20	
	GN STORE NORD A/S	1,892	382.50	723,690.00	
	GENMAB A/S	1,125	2,641.00	2,971,125.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	29,811	750.80	22,382,098.80	
DANSKE BANK A/S	13,184	113.20	1,492,428.80		
TRYG A/S	4,694	166.50	781,551.00		
ORSTED A/S	3,278	835.60	2,739,096.80		
	デンマーククローネ 小計	90,177		53,448,798.30 (920,922,794)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	28.62	86,203.44	
	OIL SEARCH LTD	32,812	4.14	135,841.68	
	SANTOS LTD	26,550	6.62	175,761.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,985	32.43	129,233.55	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	22.19	414,442.63	
	BHP GROUP LTD	52,531	40.20	2,111,746.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	21.47	227,345.83	

EVOLUTION MINING LTD	46,650	3.95	184,267.50
FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	18.25	533,666.50
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	7,431	56.87	422,600.97
NEWCREST MINING LTD	15,067	23.58	355,279.86
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.23	137,314.71
ORICA LTD	6,263	14.08	88,183.04
RIO TINTO LTD	6,335	95.80	606,893.00
SOUTH32 LTD	81,080	3.80	308,104.00
REECE LTD	5,105	24.44	124,766.20
BRAMBLES LTD	27,700	10.58	293,066.00
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.39	78,092.04
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.08	44,196.00
SYDNEY AIRPORT	22,505	8.59	193,317.95
TRANSURBAN GROUP	55,676	13.70	762,761.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,150	44.87	500,300.50
CROWN RESORTS LTD	773	11.44	8,843.12
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	120.88	125,110.80
IDP EDUCATION LTD	4,049	35.69	144,508.81
TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	5.11	193,684.33
REA GROUP LTD	563	167.75	94,443.25
SEEK LTD	6,794	35.12	238,605.28
WESFARMERS LTD	19,365	59.54	1,152,992.10
COLES GROUP LTD	24,160	17.85	431,256.00
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.88	116,691.68
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	40.61	869,500.71
TREASURY WINE ESTATES LTD	16,613	12.01	199,522.13
COCHLEAR LTD	1,060	217.92	230,995.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	70.03	192,582.50
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	44.35	322,424.50
CSL LTD	8,070	304.68	2,458,767.60
AUST AND NZ BANKING GROUP	48,894	27.61	1,349,963.34
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	31,437	98.16	3,085,855.92
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,718	28.69	1,627,239.42
WESTPAC BANKING CORP	63,088	21.02	1,326,109.76
ASX LTD	3,380	89.58	302,780.40

	MACQUARIE GROUP LTD	6,279	201.92	1,267,855.68	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	28.87	44,950.59	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	43,709	4.50	196,690.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	63,743	3.35	213,539.05	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	26,086	12.09	315,379.74	
	SUNCORP GROUP LTD	27,697	10.87	301,066.39	
	LENLEASE GROUP	17,548	10.84	190,220.32	
	AFTERPAY LTD	3,885	100.27	389,548.95	
	COMPUTERSHARE LTD	12,120	19.74	239,248.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	51.58	82,528.00	
	XERO LTD	2,603	140.99	366,996.97	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	4.05	293,062.05	
	APA GROUP	24,697	9.61	237,338.17	
	AUSNET SERVICES	37,470	2.52	94,424.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	5.03	132,832.24	
	オーストラリアドル 小計	1,249,030		26,750,942.50 (2,167,093,851)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.84	174,753.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,319	32.10	363,339.90	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	12.08	66,512.48	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.43	191,929.75	
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.92	42,624.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	4.80	110,203.20	
	ニュージーランドドル 小計	112,599		949,362.93 (73,224,362)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	50.40	2,444,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25,000	170.50	4,262,500.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	20.40	612,000.00	
	MTR CORP	32,000	41.60	1,331,200.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	31,000	31.10	964,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	43.10	1,767,100.00	
	SANDS CHINA LTD	50,200	19.54	980,908.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	14.42	487,396.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	20.55	452,100.00	
	WH GROUP LTD	152,000	5.00	760,000.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	24.90	1,718,100.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	144.90	1,724,310.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20,700	471.20	9,753,840.00	
	AIA GROUP LTD	213,800	82.90	17,724,020.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	32,000	46.55	1,489,600.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	26.00	759,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	15.98	431,460.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	34.10	1,020,135.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	31.45	817,700.00	
	SINO LAND CO	58,000	9.70	562,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	96.80	2,390,960.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	44.65	187,530.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	19.70	98,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	41.40	1,324,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	101,000	10.66	1,076,660.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	45.70	201,080.00	
	CLP HOLDINGS LTD	27,500	74.75	2,055,625.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.62	236,220.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	208,717	11.78	2,458,686.26	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,000	46.85	1,077,550.00	
	香港ドル 小計	1,444,533		61,170,280.86 (890,027,586)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	25,600	5.22	133,632.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	3.79	139,093.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	5.07	133,341.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.78	63,428.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	41,900	4.22	176,818.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	31,100	31.95	993,645.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	11.34	642,978.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	26.87	545,461.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,400	9.45	136,080.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	49,800	3.44	171,312.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.03	21,090.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.14	14,994.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.82	77,162.00	



	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	169,000	2.45	414,050.00	
シンガポールドル 小計		561,800		3,663,084.00	(304,512,172)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	12,922	29.86	385,850.92	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	497.00	189,357.00	
	BANK HAPOALIM BM	18,231	30.79	561,332.49	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,954	31.08	930,970.32	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	19.75	467,502.25	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	115.00	162,610.00	
	AZRIELI GROUP	234	289.60	67,766.40	
	NICE SYSTEMS LTD	1,161	938.20	1,089,250.20	
イスラエルシュケル 小計		87,968		3,854,639.58	(141,094,841)
合 計		19,167,224		111,593,132,310	(111,593,132,310)

(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	133,726.45	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,660	561,233.40	
		AMERICAN TOWER CORP	8,088	2,192,333.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,521	216,162.87	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	574,529.88	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,764	317,334.84	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	291,273.08	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,724	1,464,624.88	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,809	799,832.88	
		DUKE REALTY CORP	6,340	386,993.60	
		EQUINIX INC	1,607	1,283,671.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,451	292,989.90	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,281	544,123.03	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,187	409,040.20	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,391	491,398.32	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,835	335,766.90	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	176,702.12	
	INVITATION HOMES INC	9,853	420,920.16	
	IRON MOUNTAIN INC	5,780	273,278.40	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	196,450.76	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,088	451,112.40	
	PROLOGIS INC	13,145	2,071,126.20	
	PUBLIC STORAGE	2,693	921,813.90	
	REALTY INCOME CORP	9,338	629,007.68	
	REGENCY CENTERS CORP	2,658	194,352.96	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,865	658,345.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	5,918	900,956.32	
	SUN COMMUNITIES INC	2,159	433,116.99	
	UDR INC	5,162	300,996.22	
	VENTAS INC	6,823	339,444.25	
	VICI PROPERTIES INC	10,702	304,899.98	
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	120,119.34	
	WELLTOWER INC	7,706	648,459.90	
	WEYERHAEUSER CO	12,823	509,714.25	
	WP CAREY INC	3,546	279,992.16	
	米ドル 小計	219,696	20,125,844.10 (2,283,679,530)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	53,922.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	33,629.40	
	カナダドル 小計	2,480	87,551.40 (7,813,086)	
ユーロ	COVIVIO	522	37,093.32	
	GECINA SA	1,073	125,487.35	
	KLEPIERRE	3,496	67,560.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	137,932.07	
	ユーロ 小計	7,372	368,072.94 (47,157,505)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	72,338.29	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,632	109,886.32	
	SEGRO PLC	22,581	320,650.20	

		英ポンド 小計	51,055	502,874.81 (75,411,106)
オーストラリアドル		DEXUS/AU	23,352	260,141.28
		GOODMAN GROUP	29,600	749,768.00
		GPT GROUP	32,860	172,186.40
		MIRVAC GROUP	63,099	186,773.04
		SCENTRE GROUP	86,904	271,140.48
		STOCKLAND	54,131	234,387.23
		VICINITY CENTRES	42,168	74,004.84
		オーストラリアドル 小計	332,114	1,948,401.27 (157,839,986)
香港ドル		LINK REIT	38,700	2,633,535.00
		香港ドル 小計	38,700	2,633,535.00 (38,317,934)
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	218,889.00
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	81,863	167,000.52
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	47,380.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	49,500	93,555.00
		シンガポールドル 小計	228,063	526,824.52 (43,794,922)
		合計		2,654,014,069 (2,654,014,069)

(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 607銘柄	97.3%		72.1%
	投資証券 35銘柄		2.7%	2.0%
カナダドル	株式 87銘柄	99.8%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	99.6%		9.7%
	投資証券 4銘柄		0.4%	0.0%

英ポンド	株式	82銘柄	98.5%		4.2%
	投資証券	3銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式	41銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	45銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式	12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	93.2%		1.9%
	投資証券	7銘柄		6.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	30銘柄	95.9%		0.8%
	投資証券	1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.4%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.6%	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12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	994,647,283
コール・ローン	114,430,710
株式	16,545,131,315
投資証券	12,976,352
派生商品評価勘定	10,169,780
未収入金	139,523

2021年12月10日現在

未収配当金	14,197,172
差入委託証拠金	952,269,629
流動資産合計	18,643,961,764
資産合計	18,643,961,764
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,445,812
未払金	56,537,866
未払解約金	17,212,000
未払利息	310
流動負債合計	107,195,988
負債合計	107,195,988
純資産の部	
元本等	
元本	11,234,901,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,301,864,385
元本等合計	18,536,765,776
純資産合計	18,536,765,776
負債純資産合計	18,643,961,764

## 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> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎と	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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	8,208,572,255円
期中追加設定元本額	7,218,981,646円
期中一部解約元本額	4,192,652,510円
期末元本額	11,234,901,391円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	664,903,679円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,343,728,066円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,617,509,825円
DCりそな グローバルバランス	11,325,555円
つみたてバランスファンド	567,978,549円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	334,702,545円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	190,660,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	125,495,640円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	42,277,819円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	26,316,515円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	13,989,808円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	24,922,555円
リスクコントロール・オープン	9,105,697円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	154,840,783円
九州SDGs・グローバルバランス	74,735,193円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	339,192,641円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,462,556,105円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,555,065,121円
Smart-i 8資産バランス 安定型	63,569,373円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	174,556,659円
Smart-i 8資産バランス 成長型	199,504,716円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	211,289,588円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	394,117,746円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	232,915,397円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	171,225,721円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	193,903,612円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	32,751,489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)	1,410,023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)	36,308円
りそなVII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)	124,313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)	189,814円
2. 計算日における受益権の総数	11,234,901,391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	1.6499円
(10,000口当たり純資産額)	(16,499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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,156,110,935
投資証券		217,334
合計		1,155,893,601

(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12月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,008,703,242	-	1,985,669,399	23,033,843
	合計	2,008,703,242	-	1,985,669,399	23,033,843



## (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12月10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	100,789,982	-	100,529,607	260,375
	米ドル	94,971,760	-	94,742,594	229,166
	フィリピンペソ	5,818,222	-	5,787,013	31,209
	売建	5,819,182	-	5,800,996	18,186
	米ドル	5,818,222	-	5,800,044	18,178
	オフショア人民元	960	-	952	8
	合計	106,609,164	-	106,330,603	242,189

## (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	GAZPROM PAO -SPON ADR	109,797	9.12	1,001,787.82	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	7,685	89.84	690,420.40	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,671	228.10	381,155.10	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	21,841	7.81	170,709.25	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	5.21	71,805.33	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,156	40.13	166,780.28	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,898	7.34	35,951.32	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,684	29.86	348,884.24	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	28.78	79,806.94	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	21.20	49,735.20	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	89.05	114,696.40	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	21.80	84,191.60	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,502	61.12	91,802.24	
	51JOB INC-ADR	500	50.00	25,000.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	6.66	31,302.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	8,061	31.40	253,115.40	
	LI AUTO INC - ADR	10,167	31.09	316,092.03	
	NIO INC - ADR	25,014	34.05	851,726.70	
	XPENG INC - ADR	7,156	46.13	330,106.28	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,157	39.44	124,512.08	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	29,310	2.21	64,775.10	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	5.08	43,047.92	
	TRIP.COM GROUP LTD	9,438	26.09	246,237.42	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	7,761	51.34	398,449.74	
	AUTOHOME INC-ADR	1,495	32.78	49,006.10	
	BAIDU INC - SPON ADR	5,113	148.69	760,251.97	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	3,057	59.45	181,738.65	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	10.04	26,606.00	
	IQIYI INC-ADR	4,500	4.97	22,365.00	
	JOYY INC	920	49.59	45,622.80	
KANZHUN LTD	1,293	36.51	47,207.43		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	6.65	79,959.60		
VK CO LTD	2,211	13.73	30,357.03		

	WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	31.52	36,689.28	
	YANDEX NV-A	5,654	65.65	371,185.10	
	DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	16.93	16,930.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	35.53	32,687.60	
	PINDUODUO INC-ADR	8,070	62.18	501,792.60	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	9.42	78,157.74	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,671	15.92	106,235.67	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	28.89	66,331.44	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	12,431	4.49	55,815.19	
	BEIGENE LTD-ADR	863	305.60	263,732.80	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	32.87	54,827.16	
	I-MAB-SPONSORED ADR	761	54.77	41,679.97	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	714	51.26	36,599.64	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,341	67.78	90,892.98	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	3.24	108,386.24	
	CREDICORP LTD	1,206	114.57	138,171.42	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	49,784	16.26	809,487.84	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	85.86	187,861.68	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	32,868	1.23	40,559.11	
	360 DIGITECH INC	1,829	22.52	41,189.08	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	780	34.98	27,284.40	
	KE HOLDINGS INC	6,406	22.45	143,814.70	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.91	9,223.20	
	AGORA INC-ADR	800	18.18	14,544.00	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	7.49	11,235.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,653	53.83	88,989.25	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	15.89	14,301.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	7,300	4.90	35,770.00	
	VNET GROUP INC	1,400	9.15	12,810.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	8,384	7.94	66,568.96	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,000	44.07	44,070.00	
	米ドル 小計	547,602		10,763,028.42	(1,221,280,834)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	278,900	12.64	3,525,296.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	57,000	92.86	5,293,020.00	

	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	243.10	644,215.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	53.31	1,055,538.00	
	ALFA S.A.B.-A	56,600	15.64	885,224.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	60.35	446,590.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,700	262.44	1,758,348.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	417.93	1,600,671.90	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	153.16	674,669.80	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	40.23	1,782,189.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	6,500	63.71	414,115.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	95,900	72.69	6,970,971.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	130.68	1,006,236.00	
	BEACLE SAB DE CV	11,400	50.58	576,612.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	107.90	1,026,129.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	35,600	148.87	5,299,772.00	
	GRUMA S.A.B.-B	4,125	259.80	1,071,675.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	56.28	1,502,676.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	24,500	31.26	765,870.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	47,500	135.42	6,432,450.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	45,800	21.73	995,234.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	627,800	20.08	12,606,224.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	18.75	369,375.00	
	メキシコペソ 小計	1,444,320		56,703,100.70 (306,877,180)	
ブラジルリアル	COSAN SA	19,300	22.02	424,986.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	68,200	31.08	2,119,656.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	87,300	29.29	2,557,017.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	15.03	211,923.00	
	BRADSPAR SA -PREF	5,127	53.34	273,474.18	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	54.00	156,600.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	24.46	303,304.00	
	GERDAU SA-PREF	21,400	28.95	619,530.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,600	25.12	341,632.00	
	SUZANO SA	13,207	57.91	764,817.37	
	VALE SA	72,700	75.18	5,465,586.00	
	WEG SA	29,300	36.50	1,069,450.00	

CCR SA	23,400	12.31	288,054.00	
LOCALIZA RENT A CAR	11,510	55.24	635,812.40	
RUMO SA	24,400	17.45	425,780.00	
ALPARGATAS SA - PEF	2,700	39.84	107,568.00	
AMERICANAS SA	8,400	27.97	234,948.00	
LOJAS RENNER S.A.	17,820	28.25	503,415.00	
MAGAZINE LUIZA SA	51,000	6.28	320,280.00	
VIA S/A	21,100	5.36	113,096.00	
VIBRA ENERGIA SA	21,700	22.29	483,693.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	14.81	118,480.00	
RAIA DROGASIL SA	20,200	23.49	474,498.00	
AMBEV SA	86,700	15.81	1,370,727.00	
BRF SA	12,600	19.69	248,094.00	
JBS SA	16,900	34.72	586,768.00	
NATURA &CO HOLDING SA	15,700	26.56	416,992.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	22,700	11.21	254,467.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	9,200	63.69	585,948.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	48.73	350,856.00	
HYPERA SA	6,400	29.09	186,176.00	
BANCO BRADESCO S.A.	26,832	17.20	461,510.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	88,879	20.29	1,803,354.91	
BANCO DO BRASIL S.A.	15,800	32.02	505,916.00	
BANCO INTER SA-UNITS	6,100	35.26	215,086.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	32.01	259,281.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	88,900	22.13	1,967,357.00	
ITAUSA SA	77,100	9.68	746,328.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	112,800	11.71	1,320,888.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	21.32	445,588.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	21.11	289,207.00	
TOTVS SA	9,200	31.54	290,168.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	48.12	466,764.00	
TIM SA	17,100	13.07	223,497.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	33.61	161,328.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	34.30	168,070.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	21,742	13.83	300,691.86	

	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	38.29	252,714.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,200	45.84	192,528.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,775	38.99	186,177.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,100	23.90	360,890.00	
	ブラジルリアル 小計	1,304,392		32,630,972.37	(663,355,037)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	6,200.00	45,576,200.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,385.00	31,960,260.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,511	49,500.00	124,294,500.00	
	FALABELLA SA	14,299	2,700.00	38,607,300.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,340.00	34,707,340.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	7,000.00	23,044,000.00	
	BANCO DE CHILE	766,095	77.00	58,989,315.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	27,500.00	27,225,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	37.80	45,488,028.60	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	103.11	39,550,624.47	
	ENEL CHILE SA	369,172	34.00	12,551,848.00	
	チリペソ 小計	2,799,651		481,994,416.07	(64,460,969)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,710.00	242,065,330.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	32,600.00	151,166,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,902	32,500.00	256,815,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	5,442	25,150.00	136,866,300.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	21,820.00	178,662,160.00	
	コロンビアペソ 小計	115,492		965,574,990.00	(28,066,368)
ユーロ	OPAP SA	3,467	12.65	43,857.55	
	JUMBO SA	2,215	12.99	28,772.85	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	36,613	1.08	39,725.10	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	0.92	46,939.32	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	16.10	70,373.10	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	9.72	34,982.28	
	ユーロ 小計	101,286		264,650.20	(33,906,983)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	6,269	13.17	82,594.07	

	英ポンド 小計	6,269		82,594.07 (12,385,806)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,516	164.80	414,636.80
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	26.40	600,362.40
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	25.04	382,811.52
	KOC HOLDING AS	14,295	33.44	478,024.80
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	29,869	15.40	459,982.60
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	262.70	286,868.40
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	74.85	619,458.60
	AKBANK T.A.S.	62,081	7.42	460,641.02
	TURKIYE GARANTI BANKASI	44,864	11.86	532,087.04
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	7.79	195,053.81
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	20.28	387,165.48
	トルコリラ 小計	245,152		4,817,092.47 (39,632,146)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,233	888.50	1,095,520.50
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	95.00	669,275.00
	CEZ AS	2,959	807.00	2,387,913.00
	チェココルナ 小計	11,237		4,152,708.50 (20,927,989)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,456.00	17,953,360.00
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	8,575.00	21,240,275.00
	OTP BANK PLC	4,168	17,465.00	72,794,120.00
	ハンガリーフォリント 小計	13,955		111,987,755.00 (39,263,578)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,618	73.72	414,158.96
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	33,451	5.77	193,279.87
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,547	141.55	360,527.85
	LPP SA	19	15,700.00	298,300.00
	CD PROJEKT SA	1,166	180.14	210,043.24
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	34.78	169,587.28
	ALLEGRO.EU SA	5,718	39.16	223,916.88
	DINO POLSKA SA	930	338.20	314,526.00
	BANK PEKAO SA	3,378	116.30	392,861.40
	MBANK SA	290	449.00	130,210.00

	PKO BANK POLSKI SA	16,136	44.00	709,984.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	341.60	228,188.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	10,836	37.08	401,798.88	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	7.82	91,486.18	
	PGE SA	17,929	7.83	140,419.92	
	ポーランドズロチ 小計	115,261		4,279,289.26 (119,045,975)	
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	38.19	5,026,462.00	
	ALROSA PJSC	46,260	126.78	5,864,842.80	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	71.85	3,951,750.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	24,440	154.50	3,775,980.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	4.42	3,205,950.00	
	ロシアルーブル 小計	982,300		21,824,984.80 (33,610,476)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	45,000	4.63	208,350.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	6.56	183,680.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	450,000	3.73	1,678,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	61,500	18.18	1,118,070.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	6.27	238,260.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	376,000	3.58	1,346,080.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	26,000	14.08	366,080.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	4.24	279,840.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	39.40	866,800.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	44,500	7.86	349,770.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	66,000	4.60	303,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	9.33	709,080.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	50,000	6.18	309,000.00	
	DONGYUE GROUP	28,000	12.76	357,280.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,600	139.00	639,400.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	19,000	18.56	352,640.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	13.12	236,160.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	5.61	123,420.00	
	MMG LTD	68,000	2.78	189,040.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	9.47	312,510.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	13.36	126,920.00	



ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	102,000	10.42	1,062,840.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.34	234,960.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	58.65	205,275.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	58,000	3.92	227,360.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	29,500	38.10	1,123,950.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	17,000	12.88	218,960.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	4.05	263,250.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	8.81	352,400.00	
CITIC LTD	104,000	7.58	788,320.00	
CRRC CORP LTD - H	81,000	3.59	290,790.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	8.89	431,165.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	20.50	205,000.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.18	155,420.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	11.26	129,490.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	36,000	16.26	585,360.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	17.68	226,304.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	46.30	476,890.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	5.32	104,272.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	75,000	5.64	423,000.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	5.44	163,200.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.90	147,000.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	30,000	14.30	429,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.63	120,380.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	60,200	14.86	894,572.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.79	217,280.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	7.97	159,400.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	8.34	162,630.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	7.06	225,920.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	14,500	291.60	4,228,200.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.30	321,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	43.60	505,760.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	109,000	24.25	2,643,250.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	57,500	30.90	1,776,750.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	8.62	482,720.00	

MINIH GROUP LTD	14,000	37.10	519,400.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	14.34	286,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	20,000	129.70	2,594,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	5.32	287,280.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	39,800	33.15	1,319,370.00	
LI NING CO LTD	41,500	94.20	3,909,300.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	15,200	159.90	2,430,480.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	13.74	178,620.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	3.34	80,160.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	18.84	395,640.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	12,000	15.88	190,560.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	20,800	17.66	367,328.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.78	156,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	7,800	56.90	443,820.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	36.05	641,690.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	8,600	85.75	737,450.00	
NETEASE INC	37,000	166.70	6,167,900.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	105,600	472.60	49,906,560.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	278,340	123.40	34,347,156.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	36.85	368,500.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	275,000	0.72	198,000.00	
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	3.14	138,160.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,500	71.90	467,350.00	
JD.COM INC - CL A	31,894	311.00	9,919,034.00	
MEITUAN	75,000	247.00	18,525,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	8.92	214,080.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	64.00	704,000.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	3.20	100,800.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	116.18	255,596.00	
CHINA FEIHE LTD	64,000	11.02	705,280.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	45.15	2,618,700.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	26,000	65.85	1,712,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.13	125,965.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	31,800	47.35	1,505,730.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	45.65	1,460,800.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	15.22	578,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	68.50	685,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.86	165,060.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	93,000	6.97	648,210.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	46.35	417,150.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	13,000	39.80	517,400.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	21.00	126,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	74,000	7.68	568,320.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	59.90	383,360.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	9.53	190,600.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	34.00	408,000.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	9,700	30.35	294,395.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	11.18	545,584.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	14.26	233,864.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	17.08	450,912.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	31.75	111,125.00
3SBIO INC	20,500	6.97	142,885.00
AKESO INC	5,000	44.00	220,000.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	154.80	247,680.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	13.28	371,840.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	46,000	3.75	172,500.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	168,000	8.66	1,454,880.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	22,000	41.80	919,600.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	129.20	245,480.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	18.10	434,400.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	21,500	67.85	1,458,775.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,600	151.50	393,900.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	8,000	38.70	309,600.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	184,250	5.77	1,063,122.50
WUXI APPTec CO LTD-H	6,168	171.90	1,060,279.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	66,500	105.00	6,982,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	461,000	2.67	1,230,870.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,463,000	2.76	4,037,880.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	4.69	755,090.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	69,000	1.93	133,170.00

CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.47	579,490.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,766,000	5.33	9,412,780.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.79	131,130.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	72,000	66.50	4,788,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	3.11	343,966.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,038,000	4.33	4,494,540.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	5.71	845,080.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	149,000	1.33	198,170.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.57	255,920.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	22.35	607,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	43,500	21.20	922,200.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.89	199,810.00
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	15.84	342,144.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	6.97	373,592.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	12.52	323,016.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	138,000	13.52	1,865,760.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	47,000	23.40	1,099,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	32,800	11.08	363,424.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	21.65	374,545.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.36	384,680.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	124,000	6.87	851,880.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	116,500	58.90	6,861,850.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,900	28.00	221,200.00
(Right)CIFI HOLDINGS GROUP C-RTS	2,700	0.62	1,674.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	18.70	168,300.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	5.26	94,680.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.58	247,680.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	68,000	19.60	1,332,800.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	7.93	237,900.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	60,000	35.00	2,100,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,800	41.50	448,200.00
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	19.62	629,802.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	18,000	15.58	280,440.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	70,000	4.69	328,300.00

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	148,000	7.55	1,117,400.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	33,000	54.30	1,791,900.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	13.08	196,200.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	32,000	7.97	255,040.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,770	16.64	195,852.80	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	6.28	135,020.00	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	7.12	163,760.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	32,500	40.75	1,324,375.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	4.70	117,500.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	5.77	207,720.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	8.52	170,400.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	8.45	84,500.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	57,000	15.72	896,040.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	22,000	12.32	271,040.00	
WHARF HOLDINGS LTD	26,000	26.10	678,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	30,800	7.08	218,064.00	
CHINA YOUZAN LTD	220,000	0.76	167,200.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	12.56	602,880.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	23.85	1,097,100.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	22.65	271,800.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	13.94	278,800.00	
WEIMOB INC	38,000	8.91	338,580.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	33.45	468,300.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,500	31.85	429,975.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	39.35	511,550.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	13.78	227,370.00	
LENOVO GROUP LTD	130,000	8.55	1,111,500.00	
SUNNY OPTICAL TECH	13,100	246.20	3,225,220.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	262,800	19.40	5,098,320.00	
ZTE CORP-H	12,200	22.00	268,400.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	748,000	0.92	688,160.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	26.15	222,275.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	2.91	221,160.00	
CGN POWER CO LTD-H	202,000	2.22	448,440.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,800	15.06	825,288.00	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	60,000	17.88	1,072,800.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	78,000	4.97	387,660.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,000	41.40	662,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	24.75	891,000.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	14,600	140.10	2,045,460.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	10.08	564,480.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	4.44	230,880.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	76,000	7.54	573,040.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	35.05	245,350.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	47.50	475,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	86,000	14.56	1,252,160.00	
	香港ドル 小計	15,717,122		277,003,041.50 (4,030,394,253)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.47	172,406.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	20.30	119,770.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	8.46	375,624.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	56,700	5.52	312,984.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.50	92,250.00	
	SIME DARBY BERHAD	58,700	2.18	127,966.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,700	5.77	130,979.00	
	MISC BHD	26,800	6.52	174,736.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	4.10	80,360.00	
	GENTING BHD	41,300	4.52	186,676.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.82	157,074.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	24.20	50,820.00	
	IOI CORP BHD	49,600	3.69	183,024.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	20.80	172,640.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	132.30	171,990.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	17.20	191,264.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	4.66	79,919.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	3.85	117,040.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	5.52	184,920.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.57	208,926.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	99,500	2.41	239,795.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.22	117,852.00	

	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	114,200	5.24	598,408.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	18.00	221,400.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	17.10	90,630.00	
	MALAYAN BANKING BHD	83,500	8.11	677,185.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	267,300	3.99	1,066,527.00	
	RHB BANK BHD	28,700	5.42	155,554.00	
	INARI AMERTRON BHD	53,900	3.98	214,522.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.84	183,552.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	4.12	217,948.00	
	MAXIS BHD	45,700	4.42	201,994.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.29	97,336.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	16.50	231,000.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	42,100	9.11	383,531.00	
	マレーシアリングット 小計	1,521,370		7,988,602.00 (214,834,278)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	118.50	2,808,450.00	
	PTT PCL-NVDR	183,700	37.50	6,888,750.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,000	48.25	1,158,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	26,800	40.00	1,072,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	58.25	2,452,325.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	20,500	63.00	1,291,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,600	375.00	5,100,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	79,100	61.75	4,884,425.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.60	1,332,140.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	9.35	1,471,690.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.38	834,828.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	29.00	1,719,700.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	34.25	1,137,956.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.40	1,601,280.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	25.50	1,389,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	33.50	552,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	107,600	58.50	6,294,600.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	116.00	568,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	23.70	1,741,950.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	33.25	648,375.00	

	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	20.10	976,860.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	176,000	22.70	3,995,200.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	143.00	1,415,700.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	28.75	385,250.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	76,200	12.40	944,880.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	125.00	1,925,000.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	20.60	768,380.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	56.50	830,550.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	58.25	949,475.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	61.25	992,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	55.00	2,117,500.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	8.65	1,351,130.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,200	428.00	2,225,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	21,800	216.00	4,708,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	75.25	1,595,300.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	260,800	4.60	1,199,680.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	39.25	372,875.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	171.50	686,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	82.50	2,310,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	74.50	990,850.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	40.75	2,204,575.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	44.00	492,800.00	
	タイパーツ 小計	2,444,425		78,387,524.25 (265,733,707)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,460	55.40	2,352,284.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	876.00	4,161,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	570.00	889,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	56.80	2,924,688.80	
	SM INVESTMENTS CORP	4,030	950.00	3,828,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	17,520	200.00	3,504,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	239.40	1,663,830.00	
	MONDE NISSIN CORP	90,200	15.96	1,439,592.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	129.50	2,254,595.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	92.90	3,221,772.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	124.90	4,422,709.00	



	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	52.00	1,914,224.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.93	1,112,190.00	
	AYALA LAND INC	152,200	35.50	5,403,100.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	179,600	36.00	6,465,600.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	3,422.00	1,539,900.00	
	PLDT INC	1,555	1,720.00	2,674,600.00	
	AC ENERGY CORP	154,600	10.56	1,632,576.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	297.00	1,381,050.00	
	フィリピンペソ 小計	1,119,328		52,785,410.80 (119,083,886)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	323,600	1,935.00	626,166,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	22,325.00	754,585,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	2,330.00	409,148,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	895.00	500,842,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,750.00	417,725,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	12,000.00	278,400,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	209,100	3,870.00	809,217,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	8,025.00	443,782,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	354,700	6,000.00	2,128,200,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	5,925.00	823,575,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	32,075.00	211,695,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	8,950.00	420,650,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,550.00	531,860,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	4,370.00	614,859,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,610.00	557,865,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,019,100	7,350.00	7,490,385,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	332,200	7,350.00	2,441,670,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	6,825.00	931,612,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,255,645	4,190.00	5,261,152,550.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,135.00	394,185,500.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	910,400	4,150.00	3,778,160,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	3,180.00	448,062,000.00		
	インドネシアルピア 小計	6,691,845		30,273,797,050.00 (239,162,996)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	40,150.00	34,047,200.00	

S-OIL CORP	847	89,600.00	75,891,200.00	
SK INNOVATION CO LTD	887	208,000.00	184,496,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	37,100.00	86,999,500.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,620	41,800.00	67,716,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	158	504,000.00	79,632,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	179,000.00	54,953,000.00	
LG CHEM LTD	845	747,000.00	631,215,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	344,000.00	45,752,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	320	227,000.00	72,640,000.00	
POSCO	1,361	295,000.00	401,495,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	576	149,500.00	86,112,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	165	146,500.00	24,172,500.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	361	172,500.00	62,272,500.00	
SKC CO LTD	401	185,500.00	74,385,500.00	
CJ CORP	193	85,200.00	16,443,600.00	
DOOSAN BOBCAT INC	883	43,400.00	38,322,200.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	5,646	21,650.00	122,235,900.00	
ECOPRO BM CO LTD	207	545,100.00	112,835,700.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	40,800.00	51,163,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	49,750.00	73,082,750.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	57,600.00	46,828,800.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	29,850.00	42,058,650.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	98,800.00	71,037,200.00	
LG CORP	1,582	84,000.00	132,888,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,526	117,500.00	179,305,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	22,850.00	67,658,850.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,660.00	68,525,620.00	
SK	768	265,000.00	203,520,000.00	
S-1 CORPORATION	228	75,800.00	17,282,400.00	
CJ LOGISTICS	135	134,500.00	18,157,500.00	
HMM CO LTD	4,920	27,650.00	136,038,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	314	158,500.00	49,769,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	29,650.00	94,464,900.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	5,680.00	30,422,080.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	42,400.00	59,063,200.00	

HANON SYSTEMS	3,541	14,000.00	49,574,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,216	241,500.00	293,664,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,545	207,000.00	526,815,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	99,500.00	60,695,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	96,400.00	32,390,400.00	
KIA CORP	4,828	84,100.00	406,034,800.00	
COWAY CO LTD	1,045	77,600.00	81,092,000.00	
F&F CO LTD / NEW	65	879,000.00	57,135,000.00	
HLB INC	1,659	37,500.00	62,212,500.00	
LG ELECTRONICS INC	1,950	123,000.00	239,850,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	24,750.00	46,505,250.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,800.00	23,940,000.00	
HYBE CO LTD	292	354,500.00	103,514,000.00	
KAKAO CORP	5,709	122,500.00	699,352,500.00	
KAKAO GAMES CORP	600	94,700.00	56,820,000.00	
KRAFTON INC	400	479,000.00	191,600,000.00	
NAVER CORP	2,259	399,500.00	902,470,500.00	
NCSOFT CORP	302	737,000.00	222,574,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	121,500.00	47,628,000.00	
PEARL ABYSS CORP	597	131,200.00	78,326,400.00	
CJ ENM CO LTD	195	141,000.00	27,495,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	78,100.00	47,016,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	92,200.00	20,468,400.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	150,500.00	20,769,000.00	
E-MART INC	374	150,500.00	56,287,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	372,500.00	59,600,000.00	
KT&G CORP	2,071	85,700.00	177,484,700.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	102,500.00	42,230,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	177,500.00	108,452,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	45,700.00	19,605,300.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	176	1,172,000.00	206,272,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	618,000.00	19,158,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,493	83,900.00	125,262,700.00	
SD BIOSENSOR INC	691	53,400.00	36,899,400.00	
ALTEOGEN INC	544	87,100.00	47,382,400.00	

CELLTRION INC	1,775	211,000.00	374,525,000.00	
CELLTRION PHARM INC	330	125,300.00	41,349,000.00	
GREEN CROSS CORP	90	235,000.00	21,150,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	135	280,500.00	37,867,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	304	916,000.00	278,464,000.00	
SEEGENE INC	734	64,700.00	47,489,800.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	652	34,900.00	22,754,800.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	101,500.00	53,693,500.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	249,500.00	104,041,500.00	
YUHAN CORP	839	63,900.00	53,612,100.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,515	43,300.00	238,799,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	11,000.00	49,005,000.00	
KAKAObANK CORP	1,800	64,200.00	115,560,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,249	57,600.00	417,542,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,061	37,650.00	303,496,650.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,157	13,050.00	119,498,850.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	715	83,400.00	59,631,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	5,150.00	31,312,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	9,190.00	51,951,070.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	13,400.00	39,717,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	49,250.00	60,183,500.00	
SK SQUARE CO LTD	308	65,100.00	20,050,800.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	57,300.00	52,200,300.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	578	210,500.00	121,669,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,244	67,200.00	83,596,800.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	357	77,300.00	27,596,100.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	154,500.00	99,961,500.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	128,000.00	56,320,000.00	
L&F CO LTD	420	216,100.00	90,762,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,329	21,650.00	93,722,850.00	
LG INNOTEK CO LTD	243	300,000.00	72,900,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	989	177,000.00	175,053,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	87,532	78,200.00	6,845,002,400.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,085	70,600.00	1,065,001,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,009	708,000.00	714,372,000.00	

	LG UPLUS CORP	3,613	14,000.00	50,582,000.00	
	SK TELECOM	476	55,900.00	26,608,400.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	22,350.00	105,603,750.00	
	SK HYNIX INC	10,009	123,500.00	1,236,111,500.00	
	韓国ウォン 小計	289,258		22,268,216,070.00 (2,148,882,850)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	97.50	1,852,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	43.50	1,783,500.00	
	CHINA STEEL CORP	217,000	34.35	7,453,950.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	65,000	80.70	5,245,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	70,000	105.00	7,350,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	95,000	84.80	8,056,000.00	
	TAIWAN CEMENT	95,477	47.40	4,525,609.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	897.00	2,332,200.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	28.85	1,586,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,299	293.50	1,555,256.50	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,530.00	1,530,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	46,550	146.00	6,796,300.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.90	1,136,200.00	
	WAN HAI LINES LTD	11,000	208.00	2,288,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	31,000	128.50	3,983,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	36.55	1,096,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,020	629.00	2,528,580.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	229.50	1,854,360.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	322.00	1,932,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	399.00	1,197,000.00	
	POU CHEN	45,000	34.00	1,530,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	626.00	3,756,000.00	
	MOMO.COM INC	1,000	1,655.00	1,655,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	277.00	2,770,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	89,000	68.90	6,132,100.00		
ONENESS BIOTECH CO LTD	4,000	297.50	1,190,000.00		
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	72,332	16.90	1,222,410.80		
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	340,000	25.90	8,806,000.00		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	220,900	28.00	6,185,200.00		

FIRST FINANCIAL HOLDING CO	187,263	24.00	4,494,312.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	159,991	21.00	3,359,811.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	200,000	35.30	7,060,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	15.70	2,857,321.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	182,708	19.00	3,471,452.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	170,361	25.20	4,293,097.20	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	47.70	3,195,900.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	23,996	259.50	6,226,962.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	176,920	25.00	4,423,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	145,000	60.70	8,801,500.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	242,000	16.65	4,029,300.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	29,014	30.80	893,631.20	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	139,500	76.00	10,602,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	10.85	2,341,809.75	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	64.00	1,476,608.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	9,000	302.50	2,722,500.00	
ACER INC	56,000	30.00	1,680,000.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	392.00	2,861,208.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	367.00	4,771,000.00	
AU OPTRONICS CORP	149,000	22.20	3,307,800.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	157.00	2,041,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	24.00	1,872,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	36,000	269.00	9,684,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	18,000	65.20	1,173,600.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	228,800	106.00	24,252,800.00	
INNOLUX CORP	167,000	19.05	3,181,350.00	
INVENTEC CORP	52,000	25.65	1,333,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,030.00	3,857,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	62.60	2,441,400.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	12,000	169.00	2,028,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	586.00	2,344,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	68.00	2,516,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	89.00	4,272,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	62.60	1,627,600.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	22,000	218.00	4,796,000.00	

	WISTRON CORP	52,951	29.15	1,543,521.65	
	WIWYNN CORP	1,500	1,080.00	1,620,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	26,960	50.20	1,353,392.00	
	YAGEO CORPORATION	7,198	453.50	3,264,293.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	99.10	1,288,300.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	70,000	114.50	8,015,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	63.20	1,896,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	98.80	2,964,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	60,000	104.50	6,270,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,865.00	932,500.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	2,000.00	2,000,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	809.00	3,236,000.00	
	MEDIATEK INC	28,000	1,085.00	30,380,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	77.50	1,627,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	512.00	5,632,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	1,920.00	2,688,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	558.00	4,464,000.00	
	SILERGY CORP	1,410	4,490.00	6,330,900.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	451,200	608.00	274,329,600.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	216,000	64.00	13,824,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	16,000	153.50	2,456,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	377.00	2,262,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	51,000	31.40	1,601,400.00	
	新台湾ドル 小計	5,902,031		629,598,586.40 (2,578,143,251)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	393.75	6,356,306.25	
	COAL INDIA LTD	25,983	152.65	3,966,304.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	13,029	305.45	3,979,708.05	
	INDIAN OIL CORP LTD	35,280	119.70	4,223,016.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,969	147.35	6,478,832.15	
	PETRONET LNG LTD	12,992	227.85	2,960,227.20	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	52,322	2,456.45	128,526,376.90	
	ACC LTD	1,469	2,320.00	3,408,080.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,501	377.55	4,342,202.55	
	ASIAN PAINTS LTD	7,069	3,178.70	22,470,230.30	

BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	742.45	3,026,226.20
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,722.75	8,427,693.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	27,638	455.65	12,593,254.70
JSW STEEL LTD	14,917	674.10	10,055,549.70
PI INDUSTRIES LTD	1,583	2,936.15	4,647,925.45
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,262.75	6,208,986.00
SHREE CEMENT LTD	197	26,416.50	5,204,050.50
SRF LTD	2,655	2,133.45	5,664,309.75
TATA STEEL LTD	13,336	1,176.85	15,694,471.60
ULTRATECH CEMENT LTD	1,867	7,433.85	13,878,997.95
UPL LTD	9,171	742.20	6,806,716.20
VEDANTA LTD	20,779	348.45	7,240,442.55
ADANI ENTERPRISES LTD	4,905	1,722.25	8,447,636.25
BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	207.75	4,771,602.00
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,389.00	6,268,557.00
LARSEN & TOUBRO LTD	12,636	1,879.80	23,753,152.80
SIEMENS LTD	1,348	2,271.60	3,062,116.80
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	856.85	3,788,990.70
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	769.75	7,325,710.75
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	639.45	2,626,860.60
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	2,019.50	3,893,596.00
BAJAJ AUTO LTD	1,141	3,341.00	3,812,081.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,243.40	3,609,630.60
BHARAT FORGE LTD	4,571	724.85	3,313,289.35
EICHER MOTORS LTD	2,527	2,542.95	6,426,034.65
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,520.95	5,687,263.20
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,012	851.10	13,627,813.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,499	7,421.75	18,546,953.25
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	23,659	225.20	5,328,006.80
MRF LTD	38	74,668.55	2,837,404.90
TATA MOTORS LTD	30,537	493.95	15,083,751.15
PAGE INDUSTRIES LTD	97	39,468.55	3,828,449.35
TITAN CO LTD	6,533	2,373.15	15,503,788.95
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,498	3,825.80	5,731,048.40
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	5,736.00	8,196,744.00



TRENT LTD	3,269	1,037.45	3,391,424.05
ZOMATO LTD	27,665	146.25	4,046,006.25
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,911	4,821.20	14,034,513.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,925	3,623.90	6,976,007.50
ITC LTD	54,609	235.40	12,854,958.60
NESTLE INDIA LTD	623	19,284.75	12,014,399.25
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	777.50	8,624,030.00
UNITED SPIRITS LTD	4,926	929.95	4,580,933.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,443.85	3,456,576.90
DABUR INDIA LTD	11,099	579.75	6,434,645.25
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,424	927.70	5,959,544.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	15,155	2,339.75	35,458,911.25
MARICO LTD	9,787	529.65	5,183,684.55
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,882	5,232.80	9,848,129.60
AUROBINDO PHARMA LTD	4,816	705.25	3,396,484.00
BIOCON LTD	8,322	372.95	3,103,689.90
CIPLA LTD	9,018	894.50	8,066,601.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,342	4,576.95	10,719,216.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,154	4,594.25	9,896,014.50
LUPIN LTD	4,421	887.55	3,923,858.55
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,813	759.75	11,254,176.75
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	3,112.80	2,714,361.60
AXIS BANK LTD	41,715	693.95	28,948,124.25
BANDHAN BANK LTD	12,468	281.80	3,513,482.40
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	31,489	2,842.05	89,493,312.45
ICICI BANK LTD	94,119	755.00	71,059,845.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,223	1,916.35	19,590,846.05
STATE BANK OF INDIA	32,901	488.65	16,077,073.65
YES BANK LTD	214,143	14.00	2,998,002.00
BAJAJ FINANCE LTD	5,000	7,440.30	37,201,500.00
BAJAJ FINSERV LTD	689	17,596.60	12,124,057.40
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,200	577.60	4,736,320.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,091	2,577.95	2,812,543.45
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,509.50	3,579,024.50
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	2,635.70	5,442,720.50

	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	955.75	4,157,512.50	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,494.05	5,749,104.40	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	683.15	11,548,650.75	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,437.60	6,020,668.80	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	580.00	3,497,980.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	7,961	1,161.35	9,245,507.35	
	DLF LTD	11,721	398.60	4,671,990.60	
	GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	2,044.35	4,906,440.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,017	1,168.55	23,390,865.35	
	INFOSYS LTD	62,530	1,763.45	110,268,528.50	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	916	6,606.10	6,051,187.60	
	MINDTREE LTD	1,148	4,612.10	5,294,690.80	
	MPHASIS LTD	1,512	3,132.95	4,737,020.40	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	16,988	3,601.75	61,186,529.00	
	TECH MAHINDRA LTD	11,637	1,611.20	18,749,534.40	
	WIPRO LTD	25,331	643.20	16,292,899.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	45,342	713.95	32,371,920.90	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	275.10	3,725,129.10	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,171	1,390.10	9,968,407.10	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	1,763.90	8,907,695.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	1,880.55	9,496,777.50	
	GAIL INDIA LTD	29,821	134.25	4,003,469.25	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	500.60	2,360,829.60	
	NTPC LTD	89,517	126.05	11,283,617.85	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	57,784	203.20	11,741,708.80	
	TATA POWER CO LTD	25,134	227.70	5,723,011.80	
	インドルピー 小計	1,621,965		1,340,497,085.95 (2,024,150,599)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	17.90	176,046.50	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	3.28	159,895.23	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.16	164,100.44	
	INDUSTRIES QATAR	27,513	15.05	414,070.65	
	COMMERCIAL BANK PQSC	33,159	6.62	219,777.85	
	MASRAF AL RAYAN	79,417	4.85	385,172.45	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	9.40	141,404.20	

	QATAR ISLAMIC BANK	21,511	17.98	386,767.78	
	QATAR NATIONAL BANK	83,202	20.02	1,665,704.04	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.16	128,602.12	
	COOREDOO QPSC	12,412	6.85	85,121.49	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	16.80	136,046.40	
	カタールリアル 小計	455,410		4,062,709.15	(126,147,119)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	153.57	646,068.99	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	219.88	503,525.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,849.70	1,818,255.10	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,542	314.42	2,371,355.64	
	GOLD FIELDS LTD	16,491	165.09	2,722,499.19	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	62.00	667,058.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,065	214.43	3,230,387.95	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	453.32	483,692.44	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	6,120	202.76	1,240,891.20	
	SASOL LTD	9,989	283.63	2,833,180.07	
	SIBANYE STILLWATER LTD	48,590	49.13	2,387,226.70	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	188.51	997,217.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	126.79	918,213.18	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	210.33	978,244.83	
	NASPERS LTD-N SHS	3,992	2,499.52	9,978,083.84	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	24,000	22.37	536,880.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	53.19	1,005,610.14	
	BID CORP LTD	6,193	319.36	1,977,796.48	
	CLICKS GROUP LTD	4,471	302.28	1,351,493.88	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,412	204.93	1,928,801.16	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	163.62	602,121.60	
	TIGER BRANDS LTD	3,270	179.14	585,787.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	215.75	1,573,680.50	
ABSA GROUP LTD	13,383	151.47	2,027,123.01		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,491	1,909.64	2,847,273.24		
NEDBANK GROUP LTD	8,655	172.00	1,488,660.00		
STANDARD BANK GROUP LTD	23,854	135.11	3,222,913.94		
FIRSTRAND LTD	92,997	58.76	5,464,503.72		

	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	278.32	759,535.28	
	REMGRO LTD	10,067	129.53	1,303,978.51	
	DISCOVERY LTD	8,270	139.14	1,150,687.80	
	OLD MUTUAL LTD	90,974	12.17	1,107,153.58	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	15,014	46.56	699,051.84	
	SANLAM LTD	33,503	59.90	2,006,829.70	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,950	103.81	825,289.50	
	MTN GROUP LTD	31,115	158.55	4,933,283.25	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	133.02	1,484,636.22	
	南アフリカランド 小計	572,667		70,658,991.38	(502,385,428)
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	48,436	4.25	205,853.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	8.74	443,546.26	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	6.62	179,315.94	
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.40	295,941.60	
	EMIRATES NBD PJSC	44,336	13.90	616,270.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	79,972	20.22	1,617,033.84	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.10	295,376.30	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	4.89	365,214.54	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	63,651	34.98	2,226,511.98	
	アラブディルハム 小計	515,764		6,245,063.86	(193,222,275)
クウェートディナール	AGILITY	23,191	0.94	21,938.68	
	BOUBYAN BANK K.S.C	21,129	0.79	16,734.16	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	84,904	0.83	70,894.84	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	125,080	0.99	123,829.20	
	MABANEE CO KPSC	11,548	0.81	9,388.52	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,345	0.59	21,171.65	
	クウェートディナール 小計	301,197		263,957.05	(99,110,593)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,400	4.54	10,896.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.27	138,775.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	21.80	194,020.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.96	20,264.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	6.83	7,513.00	

OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.44	2,220.00
PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.08	110,236.00
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	12.84	121,980.00
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	8.46	72,079.20
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,300	11.40	71,820.00
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	991	22.96	22,753.36
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	39.00	35,100.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	6.30	80,010.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	40.18	156,702.00
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	53.18	26,590.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	30,600	7.11	217,566.00
BBMG CORPORATION-A	900	2.78	2,502.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	97.51	68,257.00
CHEGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	11.60	51,040.00
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	57.12	79,968.00
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	16.30	39,120.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	17.82	59,055.48
CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	48.35	91,865.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	5.97	102,684.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	52.30	183,050.00
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	3,300	12.93	42,669.00
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	47.15	70,725.00
GEM CO LTD-A	3,500	11.08	38,780.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	127.51	151,736.90
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	29.39	58,780.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	21.45	122,694.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.46	20,397.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.43	3,645.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	137.59	96,313.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	10.67	49,082.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	19.28	21,208.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	38.70	73,530.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.39	18,865.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	3.04	134,672.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.75	20,125.00

INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	7.40	43,660.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	23.63	75,616.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	130.42	39,126.00	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	75.00	37,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	23.52	47,040.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	156.36	171,996.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	13.61	43,552.00	
LB GROUP CO LTD-A	1,700	29.47	50,099.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	15.75	29,925.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	16.56	101,016.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.86	27,792.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	17.31	173,965.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	1,680	37.70	63,336.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	19.31	66,967.08	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	30.77	56,001.40	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	4.69	46,900.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.72	25,784.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	178.73	128,685.60	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	15.79	58,423.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	7.39	35,472.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	21.41	36,397.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	121.23	72,738.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,200	44.02	52,824.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.51	49,842.00	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	26.41	63,384.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	28.62	54,378.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	36.77	80,894.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	4.25	2,550.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	132.25	74,060.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	11.84	13,024.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	33.89	50,835.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	21.22	31,830.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	23,500	3.68	86,480.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	8.76	11,388.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	102.85	390,830.00	

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	82.10	32,840.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	88.10	88,100.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	24.50	29,400.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	10.02	41,082.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.13	21,729.40
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	134.25	93,975.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	11.57	35,867.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	900	266.16	239,544.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	18.60	65,100.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	126.00	146,160.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	12.67	29,141.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.87	41,184.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	58.38	87,570.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4,700	8.41	39,527.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	9.86	44,370.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,500	10.36	274,540.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	29.53	29,530.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	62.76	156,900.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	16.95	50,850.00
AVICOPTER PLC-A	500	71.36	35,680.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	30.98	43,372.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	113.47	45,388.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	16.67	75,015.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	25.09	110,396.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	11.97	116,109.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.70	121,980.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	56,800	4.88	277,184.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,600	633.80	1,647,880.00
CRRC CORP LTD-A	35,700	6.19	220,983.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	21.45	94,380.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,820	135.47	246,555.40
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	12.12	5,054.04
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	400	258.13	103,252.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	56.95	56,950.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	179.00	71,600.00

HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	39.99	23,994.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	74.29	22,287.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,036	85.95	174,994.20
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	16.63	43,238.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	4.09	89,162.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	28.20	112,800.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,646	41.03	313,715.38
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	27.26	65,424.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	7.53	173,190.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	34.55	69,100.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8,200	23.81	195,242.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.32	18,592.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.73	49,192.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	70.41	190,107.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	12.09	108,810.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	49.81	74,715.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	148.03	222,045.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	46.20	60,060.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	688.50	110,160.00
TBEA CO LTD-A	5,500	22.48	123,640.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.36	62,700.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	19.55	54,740.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	19.44	17,496.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	18.23	107,557.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	196.94	98,470.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	6.16	47,432.00
XIAMEN C & D INC-A	300	9.00	2,700.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	18.06	61,404.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	32.13	31,487.40
YOUNGY CO LTD-A	400	125.94	50,376.00
YUTONG BUS CO LTD-A	200	11.24	2,248.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.76	35,828.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	51.41	102,820.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	82.20	34,524.00
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	122.08	97,664.00



ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	23.33	69,756.70
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.57	26,741.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	18.97	75,880.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	7.55	48,320.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.23	18,798.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	62.73	50,184.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	1,800	32.25	58,050.00
AIR CHINA LTD-A	6,400	8.59	54,976.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	40,800	4.70	191,760.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.85	52,380.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.50	59,150.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	18.75	241,312.50
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	65.74	368,144.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	47.03	47,030.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.82	51,798.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.54	9,080.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	900	55.73	50,157.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	17.90	71,600.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	21.04	102,464.80
AUTEL INTELLIGENT TECHNOLO-A	1,000	72.99	72,990.00
BYD CO LTD -A	2,100	299.50	628,950.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	222.99	44,598.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	17.86	107,517.20
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	10.61	33,952.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	46.86	89,034.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	56.61	186,813.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	28.50	85,500.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	132.74	66,370.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	23.79	52,338.00
MIANYANG FULIN PRECISION C-A	1,100	33.16	36,476.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	22.46	26,952.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	52.16	41,728.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	21.79	150,568.90
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	13.98	43,338.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	41.05	53,365.00

SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	166.20	66,480.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	827.50	165,500.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	175.26	105,156.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	30.47	173,679.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	33.20	36,520.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	36.27	36,270.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	74.51	59,608.00
NAVINFO CO LTD-A	900	14.95	13,455.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	141.81	76,577.40
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	4.96	22,320.00
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	95.38	76,304.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	6.48	91,368.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	33.13	16,896.30
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.46	2,984.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	66.40	19,920.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	56.37	33,822.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	6.56	54,448.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	14.00	15,120.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	10.52	13,676.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.73	93,533.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	370.18	37,018.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	10.23	2,046.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	20.77	16,616.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	46.78	145,485.80
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	20.83	28,120.50
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	24.96	22,464.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	7.61	22,830.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,300	228.38	525,274.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	19.27	3,854.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.17	50,850.00
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	4.07	37,037.00
WANGFUJING GROUP CO LTD-A	800	28.57	22,856.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	6.09	36,540.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	38.03	27,381.60
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	45.39	12,709.20

SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	1,700	13.21	22,457.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	51.32	28,020.72
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	3.95	12,245.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	59.17	41,419.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	268.55	161,130.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	76.95	38,475.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,300	73.36	95,368.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.61	4,805.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	39.80	23,880.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	57.72	23,088.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	164.85	65,940.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	36.77	25,739.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,190	116.90	489,811.00
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	196.88	78,752.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	22.72	20,448.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,600	69.61	180,986.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.50	36,250.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	31.64	75,936.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5,900	41.41	244,319.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	58.72	58,720.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,900	186.40	354,160.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	9.79	19,580.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	241.10	96,440.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	38.26	11,478.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	68.15	20,445.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,400	2,086.55	2,921,170.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,800	253.30	455,940.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	6,516	51.22	333,749.52
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	14.75	38,350.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	68.22	66,855.60
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,520	334.00	507,680.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	139.99	55,996.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	32.64	22,848.00
TONGWEI CO LTD-A	4,400	46.56	204,864.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	105.87	95,283.00

WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	17.45	98,767.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,300	251.00	1,079,300.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	64.75	142,450.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	24.09	26,499.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	26.00	33,800.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	17.36	17,360.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	208.17	20,817.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	44.25	26,550.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	45.72	254,431.80
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	55.45	34,933.50
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	30.41	12,164.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	105.49	73,843.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	36.25	63,075.00
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	450	59.92	26,964.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	52.28	61,690.40
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	34.70	17,350.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	13.90	2,780.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	22.38	15,666.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.71	3,700.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	62.99	57,950.80
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	18.70	37,400.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,500	371.00	556,500.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	213.08	63,924.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	14.84	15,433.60
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	39.04	35,136.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	475.64	95,128.00
BEIJING Tiantan Biological-A	1,080	29.34	31,687.20
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	700	244.50	171,150.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	82.40	24,720.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	92.25	27,675.00
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	267.45	53,490.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	303.20	121,280.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	25.82	2,582.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	130.04	260,080.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	19.62	18,835.20

DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	44.52	4,452.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	30.30	42,420.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	142.62	42,786.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	29.11	51,815.80
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	20.94	29,316.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	593.90	178,170.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	8,016	51.39	411,942.24
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.14	19,424.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	133.05	74,508.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	37.01	18,505.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	42.52	35,929.40
PHARMABLOCK SCIENCES NANJI-A	400	154.28	61,712.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	178.39	124,873.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	18.75	4,875.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	52.75	100,225.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	59.89	50,008.15
SHANGHAI MEDICILON INC-A	200	546.14	109,228.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	6.43	18,647.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	113.10	67,860.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	46.02	46,020.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	28.34	2,834.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,400	16.67	23,338.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	19.01	3,802.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	10.94	2,188.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	63.11	94,665.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	3,128	141.41	442,330.48
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	93.20	102,520.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	465.98	279,588.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	21.09	25,518.90
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	61.41	79,833.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	28.91	61,751.76
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	60.15	24,060.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.95	209,155.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.47	83,589.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	7.96	59,700.00

BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	11.65	17,475.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.07	103,152.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.63	173,625.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.30	82,940.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.09	90,741.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.35	83,215.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	39.71	313,709.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.22	98,264.20
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.91	54,372.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	3.41	191,983.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	22,300	53.13	1,184,799.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	3.93	117,114.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.48	58,812.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.88	32,980.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.69	69,987.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.66	360,684.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	24,500	19.43	476,035.00
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	18.70	430,100.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	39,000	5.35	208,650.00
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.90	20,670.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	8.75	320,250.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.95	3,555.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	14.42	43,260.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	11.22	16,830.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.53	51,204.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	11.10	31,080.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	13.85	41,550.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	52.32	62,784.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	18.25	122,275.00
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	26.88	298,368.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	30.52	152,600.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	12.41	76,942.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	12,604	37.23	469,246.92
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	15.34	49,088.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.33	3,665.00

FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.01	57,672.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	25.73	151,807.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	3,240	9.13	29,581.20	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	13.52	29,744.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.43	52,578.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	17.62	121,578.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.73	3,865.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.32	109,648.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	132.19	66,095.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.37	2,148.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	11,600	17.28	200,448.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.69	2,907.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	10.28	68,876.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	10.02	16,032.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.27	27,810.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	16.27	84,604.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.28	10,496.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	8.43	46,128.96	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.06	10,150.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.55	2,620.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	5.29	143,888.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	11.29	48,547.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.41	2,823.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.24	19,912.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.08	17,544.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.11	4,055.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	13.38	17,394.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	10.75	112,875.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	30.47	76,175.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	28.23	189,141.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	39.62	75,278.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.79	16,765.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,400	51.31	636,244.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	13.07	104,560.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	20.40	261,120.00	

FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	32.88	78,912.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.47	37,851.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.27	63,665.70
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.61	3,227.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	15.24	195,072.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.39	2,634.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	14.54	24,427.20
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	15.35	13,815.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.76	20,956.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.76	61,880.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	12,200	12.32	150,304.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	31.02	14,889.60
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	269.82	161,892.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	29.85	4,179.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.35	10,045.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	51.33	10,266.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	15.16	10,612.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.46	2,984.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	2,364	62.75	148,341.00
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	54.08	135,200.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	26.73	21,384.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	205.10	82,040.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,920	66.29	127,276.80
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	148.50	44,550.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	4,908	36.38	178,553.04
ADDSINO CO LTD -A	1,700	16.23	27,591.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	42.52	97,796.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	39.42	19,710.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	179.68	35,936.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	50,500	5.09	257,045.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	45.90	82,620.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	14.18	36,868.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.00	55,000.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	900	117.87	106,083.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	2,500	28.50	71,250.00



FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	17.81	19,591.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.77	83,567.00	
GOERTEK INC -A	3,300	55.73	183,909.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.50	25,300.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	7.54	52,026.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.53	3,159.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	77.54	38,770.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	15.14	56,018.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	28.73	28,730.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	35.20	21,120.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	22.92	105,432.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	10.18	23,414.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	8,633	45.61	393,751.13	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	363.10	130,716.00	
NINESTAR CORP-A	1,800	48.15	86,670.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	9.25	3,700.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	80.08	56,056.00	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	200	399.50	79,900.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,600	23.32	107,272.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	109.35	30,618.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	16.16	16,160.00	
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	38.69	30,952.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	25.64	23,076.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	159.08	159,080.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	25.90	18,130.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	39.99	27,993.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	12.83	30,792.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	25.95	48,682.20	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	16.38	21,294.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	54.89	71,357.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	135.39	162,468.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	26.30	50,075.20	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	11.83	29,575.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	15.77	27,755.20	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	79.40	50,816.00	

XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	224.57	89,828.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	82.60	74,340.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	25.98	62,352.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	38.14	19,070.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	89.98	62,986.00
ZTE CORP-A	3,800	31.93	121,334.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.94	183,210.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	11.14	72,410.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	6.69	52,851.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	26,400	7.08	186,912.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,900	19.53	447,237.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	18.78	35,682.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	2.95	91,450.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.86	6,318.00
HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	8.47	95,711.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	10.47	69,102.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	6.68	4,676.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	8.46	5,076.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	12.03	62,556.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	152.00	143,336.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	47.88	52,668.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.07	17,501.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	180.11	136,163.16
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	126.46	151,752.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	62.85	125,700.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	141.50	56,600.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	2,200	88.10	193,820.00
JCET GROUP CO LTD-A	1,900	32.77	62,263.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,240	85.00	530,400.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	76.24	54,435.36
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	27.34	98,424.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	374.20	187,100.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	38.06	167,464.00
SG MICRO CORP-A	450	319.05	143,572.50
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	109.42	27,355.00

	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	114.28	34,284.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	300	416.50	124,950.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	4,300	41.44	178,192.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	13.48	25,612.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	20.30	16,240.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	220.00	176,000.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,100	309.20	340,120.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	70.80	63,720.00	
	オフショア人民元 小計	2,418,613		50,465,489.48 (897,619,568)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	21.54	84,673.74	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	40,366	34.75	1,402,718.50	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	68.00	127,772.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	6,762	20.48	138,485.76	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	38.00	76,000.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,847	169.40	651,681.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	40.60	270,964.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	7,799	70.50	549,829.50	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	16,520	108.40	1,790,768.00	
	SAUDI CEMENT	1,265	56.00	70,840.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	4,366	29.95	130,761.70	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	17.00	235,110.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	64.00	290,176.00	
	JARIR MARKETING CO	1,096	192.00	210,432.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	973	110.40	107,419.20	
	ALMARAI CO	4,232	48.65	205,886.80	
	SAVOLA	4,558	33.35	152,009.30	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	162.00	127,332.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	165.00	157,575.00	
	AL RAJHI BANK	22,462	134.80	3,027,877.60	
	ALINMA BANK	18,025	22.98	414,214.50	
ARAB NATIONAL BANK	11,172	22.40	250,252.80		
BANK AL-JAZIRA	7,856	18.98	149,106.88		
BANK ALBILAD	6,762	42.45	287,046.90		
BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	41.50	450,441.00		

RIYAD BANK	24,195	27.00	653,265.00	
SAUDI BRITISH BANK	14,383	29.50	424,298.50	
THE SAUDI NATIONAL BANK	40,237	62.20	2,502,741.40	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	133.40	155,811.20	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,298	75.30	97,739.40	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	8,367	9.56	79,988.52	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	11.16	92,572.20	
ETIHAD ETISALAT CO	7,054	31.00	218,674.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	12.10	109,928.50	
SAUDI TELECOM CO	10,993	110.00	1,209,230.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	23.90	371,860.10	
サウジアラビアリアル 小計	344,138		17,275,484.20 (523,447,171)	
合 計	47,602,050		16,545,131,315 (16,545,131,315)	

(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	1,190,958.00	
	メキシコペソ 小計		58,900	1,190,958.00 (6,445,464)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	918,549.72	
	南アフリカランド 小計		63,261	918,549.72 (6,530,888)	
合 計				12,976,352 (12,976,352)	

(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 64銘柄	100.0%		7.4%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.9%		1.9%
	投資証券 1銘柄		2.1%	0.0%
ブラジルリアル	株式 51銘柄	100.0%		4.0%
チリペソ	株式 11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 6銘柄	100.0%		0.2%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%		0.7%
ロシアルーブル	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%		24.4%
マレーシアリングット	株式 35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 19銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.4%
韓国ウォン	株式 110銘柄	100.0%		13.0%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		15.6%
インドルピー	株式 106銘柄	100.0%		12.2%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式 37銘柄	98.7%		3.0%
	投資証券 1銘柄		1.3%	0.0%
アラブディルハム	株式 9銘柄	100.0%		1.2%
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 503銘柄	100.0%		5.4%
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国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2021年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,953,504,629
投資証券	27,669,916,400
派生商品評価勘定	9,207,400
未収入金	1,589,234,590
未収配当金	180,648,387
差入委託証拠金	21,546,000
流動資産合計	31,424,057,406
資産合計	31,424,057,406
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	9,010,900
未払金	48,699,000
未払解約金	3,266,091,000
未払利息	5,298
流動負債合計	3,323,806,198
負債合計	3,323,806,198
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,682,018,215
剰余金	9,418,232,993
剰余金又は欠損金（ ）	9,418,232,993
元本等合計	28,100,251,208
純資産合計	28,100,251,208
負債純資産合計	31,424,057,406

## 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	先物取引

法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	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。 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	16,063,275,610円
期中追加設定元本額	21,828,079,192円
期中一部解約元本額	19,209,336,587円
期末元本額	18,682,018,215円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	901,959,448円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	809,472,227円
りそなラップ型ファンド(成長型)	738,435,913円
DCりそな グローバルバランス	18,736,003円
つみたてバランスファンド	1,260,280,230円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	180,858,795円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	104,652,999円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	69,779,797円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	23,056,191円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	14,321,368円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,584,172円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,622,702円
リスクコントロール・オープン	2,510,170円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	87,434,222円
九州SDGs・グローバルバランス	37,563,148円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	667,246円
FWりそな国内リートインデックスオープン	4,033,412,597円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,329,850,374円
Smart-i リートインデックス	2,460,397,453円
Smart-i 8資産バランス 安定型	34,352,812円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	96,051,021円
Smart-i 8資産バランス 成長型	111,177,924円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	116,933,102円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	217,366,041円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	130,899,386円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	94,235,813円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	107,209,651円

りそな・リスクコントロールファンド2020-06	18,498,714円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,770,899,247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)	1,705,652円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	743,047,588円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	49,688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)	75,156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)	122,802円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	144,798,563円
2. 計算日における受益権の総数	18,682,018,215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	1.5041円
(10,000口当たり純資産額)	(15,041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12月10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12月10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12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,840,275,063
合計		1,840,275,063

(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12月10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	420,767,600	-	429,975,000	9,207,400
	合計	420,767,600	-	429,975,000	9,207,400

(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	490	68,551,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	771	96,220,800	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,132	191,308,000	
	東海道リート投資法人	186	20,236,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	840	535,080,000	
	森ヒルズリート投資法人	2,862	446,472,000	
	産業ファンド投資法人	3,455	742,825,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,433	873,447,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,662	367,468,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,297	560,952,500	
	G L P 投資法人	7,881	1,544,676,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,096	360,584,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,981	1,538,656,500	
	星野リゾート・リート投資法人	408	269,280,000	
O n e リート投資法人	422	128,710,000		

イオンリート投資法人	2,862	449,047,800	
ヒューリックリート投資法人	2,270	389,986,000	
日本リート投資法人	751	322,554,500	
積水ハウス・リート投資法人	7,387	624,940,200	
トーセイ・リート投資法人	508	66,497,200	
ケネディクス商業リート投資法人	972	276,728,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	519	80,808,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	551	67,993,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	7,869	1,313,336,100	
いちごホテルリート投資法人	403	33,892,300	
ラサールロジポート投資法人	2,979	589,842,000	
スターアジア不動産投資法人	2,515	161,211,500	
マリモ地方創生リート投資法人	228	31,669,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	905	561,100,000	
大江戸温泉リート投資法人	393	29,592,900	
投資法人みらい	2,774	148,963,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	571	73,316,400	
三菱地所物流リート投資法人	618	310,236,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	942	210,066,000	
ザイマックス・リート投資法人	353	41,089,200	
タカラレーベン不動産投資法人	960	109,056,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	949	166,834,200	
日本ビルファンド投資法人	2,758	1,969,212,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,433	1,642,275,000	
日本都市ファンド投資法人	12,278	1,225,344,400	
オリックス不動産投資法人	4,849	896,095,200	
日本プライムリアルティ投資法人	1,599	665,983,500	
N T T 都市開発リート投資法人	2,333	350,183,300	
東急リアル・エステート投資法人	1,632	321,667,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,690	205,673,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	5,478	778,971,600	
森トラスト総合リート投資法人	1,739	254,241,800	
インヴィンシブル投資法人	10,710	415,548,000	
フロンティア不動産投資法人	853	432,471,000	
平和不動産リート投資法人	1,576	244,437,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,590	539,010,000	

福岡リート投資法人	1,259	212,267,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	753	527,853,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,994	174,873,800	
大和証券オフィス投資法人	514	368,538,000	
阪急阪神リート投資法人	1,099	176,499,400	
スタートアップリート投資法人	379	89,444,000	
大和ハウスリート投資法人	3,654	1,246,014,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,455	439,845,000	
大和証券リビング投資法人	3,288	379,764,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,258	310,475,000	
合計	141,366	27,669,916,400	

(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12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	221,774,320
コール・ローン	60,717,266
株式	90,705,205
投資証券	26,572,616,924
派生商品評価勘定	285,373
未収入金	22,984,964
未収配当金	41,043,312
流動資産合計	27,010,127,364
<b>資産合計</b>	<b>27,010,127,364</b>
<b>負債の部</b>	

2021年12月10日現在

<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	8,683
未払解約金	134,719,000
未払利息	164
<b>流動負債合計</b>	<b>134,727,847</b>
<b>負債合計</b>	<b>134,727,847</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,523,702,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,351,697,040
<b>元本等合計</b>	<b>26,875,399,517</b>
<b>純資産合計</b>	<b>26,875,399,517</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>27,010,127,364</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>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>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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日

期首元本額	21,475,319,855円
期中追加設定元本額	19,236,498,997円
期中一部解約元本額	22,188,116,375円
期末元本額	18,523,702,477円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,334,825,469円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,303,509,808円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,075,839,642円
DCりそな グローバルバランス	20,609,277円
つみたてバランスファンド	651,128,956円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	378,666,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	216,129,514円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	143,642,359円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	47,743,203円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	29,757,632円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,751,882円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	28,026,029円
リスクコントロール・オープン	10,222,100円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	186,599,924円
九州SDGs・グローバルバランス	79,630,454円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	4,679,513,118円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,730,109,761円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,972,188,802円
Smart-i 8資産バランス 安定型	71,498,094円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	196,304,825円
Smart-i 8資産バランス 成長型	225,198,391円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	241,874,098円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	446,980,904円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	265,531,306円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	194,230,671円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	221,439,159円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	37,704,668円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,061,144円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	715,602,679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)	32,513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)	129,722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)	220,068円
2. 計算日における受益権の総数	18,523,702,477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	1.4509円
(10,000口当たり純資産額)	(14,509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12月10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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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>

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年12月10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
2. 時価の算定方法	<p>株式、投資証券</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>デリバティブ取引</p> <p>（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</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>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価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>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。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年12月10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12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	8,992,733	
投資証券	4,444,015,657	
合計	4,453,008,390	

(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12月10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	24,032,919	-	24,024,934	7,985
	米ドル	14,758,663	-	14,750,220	8,443
	ユーロ	2,305,974	-	2,306,300	326
	英ポンド	2,998,748	-	2,999,076	328
	オーストラリアドル	3,969,534	-	3,969,338	196
	売建	86,191,455	-	85,906,780	284,675
	米ドル	73,976,500	-	73,751,860	224,640
	ユーロ	2,709,777	-	2,690,618	19,159
	英ポンド	4,207,028	-	4,198,776	8,252
オーストラリアドル	5,298,150	-	5,265,526	32,624	
合計		110,224,374	-	109,931,714	276,690

(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	BROADSTONE NET LEASE INC-A	22,946	25.34	581,451.64	
米ドル 小計		22,946		581,451.64 (65,977,317)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	92,219	3.31	305,244.89	
オーストラリアドル 小計		92,219		305,244.89 (24,727,888)	
合計		115,165		90,705,205 (90,705,205)	

(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	12,827	277,191.47	
		AGREE REALTY CORP	10,081	686,012.05	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,459	252,375.67	

ALEXANDER'S INC	312	81,088.80	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,176	4,256,934.24	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	30,097.26	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,569	271,500.03	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,097	1,097,095.23	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,753	150,367.91	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,916	1,662,501.40	
AMERICOLD REALTY TRUST	38,084	1,234,302.44	
APARTMENT INCOME REIT CO	22,897	1,186,522.54	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	21,783	172,739.19	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,701	488,452.91	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,843	131,318.55	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,318	45,339.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,315	4,926,793.80	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	47,880.00	
BOSTON PROPERTIES INC	20,695	2,375,992.95	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,084	38,884.04	
BRANDYWINE REALTY TRUST	24,473	334,301.18	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	42,901	1,028,765.98	
BRT APARTMENTS CORP	1,668	32,492.64	
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,646	2,513,839.44	
CARETRUST REIT INC	14,051	315,585.46	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	44,112.11	
CENTERSPACE	2,032	220,980.00	
CHATHAM LODGING TRUST	7,087	92,131.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	14,620.00	
CITY OFFICE REIT INC	6,494	118,775.26	
CLIPPER REALTY INC	1,350	12,582.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,398	152,196.42	
COREPOINT LODGING INC	5,514	85,522.14	
CORESITE REALTY CORP	6,381	1,084,770.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,473	451,854.39	
COUSINS PROPERTIES INC	21,729	853,080.54	
CTO REALTY GROWTH INC	900	49,212.00	
CUBESMART	31,354	1,708,165.92	

CYRUSONE INC	18,065	1,613,204.50	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	30,051	280,075.32	
DIGITAL REALTY TRUST INC	41,104	6,836,417.28	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	71,146	575,571.14	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	34,590	97,197.90	
DOUGLAS EMMETT INC	25,622	863,973.84	
DUKE REALTY CORP	55,076	3,361,839.04	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,052	264,902.96	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,895	1,231,288.65	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20,497	188,777.37	
EPR PROPERTIES	10,808	505,165.92	
EQUINIX INC	13,052	10,425,937.60	
EQUITY COMMONWEALTH	17,586	445,629.24	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,895	2,113,585.50	
EQUITY RESIDENTIAL	49,587	4,295,721.81	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,088	474,533.76	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,467	3,262,328.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,469	4,001,268.88	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	38,553.97	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,209	1,325,128.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,657	1,171,286.46	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,867	307,862.11	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,910	89,302.20	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32,429	1,508,272.79	
GEO GROUP INC/THE	18,320	133,919.20	
GETTY REALTY CORP	5,766	182,724.54	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,761	132,272.56	
GLADSTONE LAND CORP	4,296	128,020.80	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,379	140,096.88	
GLOBAL NET LEASE INC	14,573	220,780.95	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,292	684,324.88	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	31,941	1,086,313.41	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,487	2,679,546.18	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	55,018.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,033	665,210.25	
HOST HOTELS & RESORTS INC	104,101	1,753,060.84	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,994	561,726.76	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,075	376,573.50	
INDUS REALTY TRUST INC	665	50,792.70	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,414	213,415.38	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,458	887,461.12	
INVITATION HOMES INC	83,910	3,584,635.20	
IRON MOUNTAIN INC	42,151	1,992,899.28	
JBG SMITH PROPERTIES	17,011	482,261.85	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	111,100	88,324.50	
KILROY REALTY CORP	15,122	1,026,783.80	
KIMCO REALTY CORP	89,381	2,072,745.39	
KITE REALTY GROUP TRUST	31,952	686,009.44	
LEXINGTON REALTY TRUST	40,114	610,535.08	
LIFE STORAGE INC	11,409	1,592,696.40	
LTC PROPERTIES INC	5,856	196,117.44	
MACERICH CO/THE	30,624	544,188.48	
MACK-CALI REALTY CORP	11,530	211,575.50	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	142,978.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86,804	1,904,479.76	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,887	3,648,436.35	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,218	297,440.56	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	25,365	1,156,644.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,907	750,021.93	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,629	368,373.53	
NETSTREIT CORP	5,746	124,285.98	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,271	254,778.19	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	174,211.06	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,879	989,517.23	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	74,344.65	
ORION OFFICE REIT INC	7,881	148,950.90	
PARAMOUNT GROUP INC	23,659	208,435.79	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34,004	637,575.00	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18,997	419,073.82
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	10,830.04
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,412	572,326.64
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,783	326,673.71
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,644	139,320.00
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,959	34,928.97
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,141	98,331.57
PRIME US REIT	91,500	75,487.50
PROLOGIS INC	107,505	16,938,487.80
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,905	513,313.50
PUBLIC STORAGE	22,173	7,589,817.90
REALTY INCOME CORP	80,160	5,399,577.60
REGENCY CENTERS CORP	22,287	1,629,625.44
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,449	324,551.40
RETAIL VALUE INC	2,135	13,151.60
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,084	1,500,676.48
RLJ LODGING TRUST	24,107	325,926.64
RPT REALTY	11,786	155,810.92
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,066	677,463.34
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31,915	434,682.30
SAFEHOLD INC	1,972	143,857.40
SAUL CENTERS INC	1,782	92,664.00
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,971	68,599.80
SERVICE PROPERTIES TRUST	23,523	219,234.36
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,803	7,277,528.72
SITE CENTERS CORP	25,949	395,722.25
SL GREEN REALTY CORP	9,816	729,230.64
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,409	814,393.02
STAG INDUSTRIAL INC	23,415	1,028,620.95
STORE CAPITAL CORP	35,678	1,209,840.98
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,091	143,666.32
SUN COMMUNITIES INC	16,872	3,384,691.92
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,277	377,963.67
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,043	300,860.00
TERRENO REALTY CORP	10,307	813,737.65

	UDR INC	40,637	2,369,543.47
	UMH PROPERTIES INC	6,220	153,074.20
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,860	110,316.60
	URBAN EDGE PROPERTIES	15,841	287,989.38
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,380	86,986.80
	VENTAS INC	57,296	2,850,476.00
	VICI PROPERTIES INC	89,372	2,546,208.28
	VORNADO REALTY TRUST	22,940	974,032.40
	WASHINGTON REIT	12,167	309,285.14
	WELLTOWER INC	61,488	5,174,215.20
	WHITESTONE REIT	6,335	61,639.55
	WP CAREY INC	26,846	2,119,760.16
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,293	280,891.32
	米ドル 小計	3,697,127	179,229,791.27 (20,337,204,415)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,186	400,325.88
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,169	103,151.25
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	47,425.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,332	182,160.44
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	23,046.24
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,156	689,974.56
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,687	343,698.37
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,409	142,455.32
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,887	122,588.60
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,649	129,650.55
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16,048	267,199.20
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	88,160.22
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	30,876.30
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15,479	271,966.03
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,653	474,140.70
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,906	331,778.22
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	23,573.61
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	172,471.20
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	178,694.40
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	49,202.60

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	41,672.51
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,635	33,227.35
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,384	207,837.84
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	45,400.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,455	493,560.90
	SLATE GROCERY REIT	3,324	44,541.60
	SLATE OFFICE REIT	4,169	20,511.48
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,003	309,692.88
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11,932	272,407.56
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	38,842.60
	カナダドル 小計	272,509	5,580,233.41 (497,980,029)
ユーロ	AEDIFICA	5,283	596,450.70
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	25,704	501,228.00
	ALTAREA	616	96,958.40
	BEFIMMO	3,572	116,804.40
	CARE PROPERTY INVEST	3,794	96,936.70
	CARMILA	6,580	82,776.40
	COFINIMMO	4,022	553,829.40
	COIMA RES SPA	3,638	26,884.82
	COVIVIO	6,822	484,771.32
	CROMWELL REIT EUR	43,440	110,772.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,323	94,674.87
	GECINA SA	7,932	927,647.40
	HAMBORNER REIT AG	10,354	99,232.73
	HIBERNIA REIT PLC	99,216	125,607.45
	ICADE	4,616	286,653.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	24,710.80
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	38,596	307,417.14
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,446	95,971.10
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	57,208	91,532.80
	KLEPIERRE	28,418	549,177.85
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	40,245.34
	MERCIALYS	7,890	65,723.70
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	48,447	473,617.87

	MONTEA NV	1,451	185,147.60
	NSI NV	2,616	90,252.00
	RETAIL ESTATES	1,608	112,077.60
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,991	1,027,445.77
	VASTNED RETAIL NV	2,828	64,902.60
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,442	827,901.00
	WERELDHAVE NV	5,774	69,057.04
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,776	132,137.60
	ユーロ 小計	484,371	8,358,546.00 (1,070,896,913)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	22,680.00
	ASSURA PLC	386,562	269,820.27
	BIG YELLOW GROUP PLC	24,957	418,029.75
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	116,925	118,795.80
	BRITISH LAND CO PLC	136,841	715,131.06
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	122,992	202,075.85
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	89,588.37
	CUSTODIAN REIT PLC	60,787	62,853.75
	DERWENT LONDON PLC	16,366	553,825.44
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	87,550	73,016.70
	GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	144,249.25
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,564	270,573.60
	HAMMERSON PLC	612,635	202,292.07
	HOME REIT PLC	35,027	42,207.53
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,357	65,874.83
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	109,562	822,810.62
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	131,424	364,307.32
	LXI REIT PLC	101,727	149,538.69
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	33,579.25
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	79,142	79,142.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	192,084	294,080.60
	PRS REIT PLC/THE	64,685	68,889.52
	REGIONAL REIT LTD	63,471	57,949.02
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	30,449	416,846.81
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	68,450	35,183.30



	SEGRO PLC	174,666	2,480,257.20
	SHAFTESBURY PLC	41,472	252,149.76
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	52,095.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	117,941	143,298.31
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	56,815.79
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	251,147	607,775.74
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	123,935	95,429.95
	UNITE GROUP PLC	58,212	648,772.74
	WORKSPACE GROUP PLC	18,568	157,178.12
	英債券 小計	3,785,062	10,067,114.01 (1,509,664,416)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	55,047	194,866.38
	ARENA REIT	48,279	212,427.60
	AVENTUS GROUP	60,193	204,656.20
	BWP TRUST	69,723	290,744.91
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	78,439	306,696.49
	CENTURIA OFFICE REIT	63,819	146,145.51
	CHARTER HALL GROUP	68,106	1,344,412.44
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	82,250	416,185.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	320,743.94
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	48,631	186,743.04
	CROMWELL PROPERTY GROUP	219,914	193,524.32
	DEXUS INDUSTRIA REIT	27,219	92,816.79
	DEXUS/AU	156,968	1,748,623.52
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	71,973.47
	GOODMAN GROUP	244,717	6,198,681.61
	GPT GROUP	276,947	1,451,202.28
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	42,930	177,730.20
	HOME CONSORTIUM	26,532	203,235.12
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	68,755	99,350.97
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	24,654	84,809.76
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	51,894	321,742.80
	IRONGATE GROUP	69,568	115,135.04
	MIRVAC GROUP	575,834	1,704,468.64
	NATIONAL STORAGE REIT	154,855	388,686.05

	RURAL FUNDS GROUP	55,568	168,926.72
	SCENTRE GROUP	756,992	2,361,815.04
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	159,662	456,633.32
	STOCKLAND	345,085	1,494,218.05
	VICINITY CENTRES	566,898	994,905.99
	WAYPOINT REIT	105,365	285,539.15
	オーストラリアドル 小計	4,647,912	22,237,640.35 (1,801,471,244)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	123,086	182,782.71
	GOODMAN PROPERTY TRUST	157,824	402,451.20
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	261,743.79
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	176,010	281,616.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49,534	149,097.34
	ニュージーランドドル 小計	733,072	1,277,691.04 (98,548,309)
香港ドル	CHAMPION REIT	276,000	1,117,800.00
	FORTUNE REIT	207,000	1,643,580.00
	LINK REIT	304,900	20,748,445.00
	PROSPERITY REIT	165,000	501,600.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	141,000	607,710.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	247,000	824,980.00
	香港ドル 小計	1,340,900	25,444,115.00 (370,211,873)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	82,485.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	184,100	162,928.50
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	489,700	1,454,409.00
	ASCOTT TRUST	264,096	266,736.96
	CAPITALAND CHINA TRUST	151,000	176,670.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	727,732	1,484,573.28
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,100	133,399.00
	EC WORLD REIT	50,000	40,750.00
	ESR REIT	392,600	190,411.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	97,722.00
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	167,300	51,026.50
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	151,800	344,586.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	418,879	636,696.08

	IREIT GLOBAL	95,000	60,325.00	
	KEPPEL DC REIT	184,400	446,248.00	
	KEPPEL REIT	281,200	323,380.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	121,712.50	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	316,000	650,960.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	280,000	758,800.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	436,800	825,552.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	312,600	321,978.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	159,819.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	56,800	286,272.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	57,227.00	
	SPH REIT	135,800	133,084.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	186,200	118,237.00	
	SUNTEC REIT	318,300	477,450.00	
	シンガポールドドル 小計	6,501,907	9,863,437.82 (819,947,585)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,100	133,985,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,960,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	97,020,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	26,747,630.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,693	114,846,150.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	47,825,030.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	39,560,460.00	
	韓国ウォン 小計	83,117	482,944,270.00 (46,604,122)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	25,765	548,794.50	
	イスラエルシェケル 小計	25,765	548,794.50 (20,088,018)	
合計			26,572,616,924 (26,572,616,924)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 1銘柄	0.3%		0.2%
	投資証券 155銘柄		99.7%	76.2%
カナダドル	投資証券 30銘柄		100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄		100.0%	4.0%
英ポンド	投資証券 35銘柄		100.0%	5.7%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	1.4%		0.1%
	投資証券 30銘柄		98.6%	6.7%
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%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 27銘柄		100.0%	3.1%
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12月30日現在です。

## 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	75,973,996,173円
負債総額	53,731,504円
純資産総額（ - ）	75,920,264,669円
発行済口数	75,611,611,767口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0041円

## 【FWりそな国内株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	32,669,611,036円
負債総額	26,289,803円
純資産総額（ - ）	32,643,321,233円
発行済口数	23,198,617,600口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4071円

## 【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	33,970,801,087円
負債総額	7,262,011円
純資産総額（ - ）	33,963,539,076円
発行済口数	29,706,081,289口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1433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）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	175,149,620,682円
負債総額	37,866,756円

純資産総額（ - ）	175,111,753,926円
発行済口数	166,443,341,344口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0521円

## 【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,468,724,807円
負債総額	484,808円
純資産総額（ - ）	1,468,239,999円
発行済口数	1,485,581,733口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9883円

## 【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	54,478,250,605円
負債総額	12,885,560円
純資産総額（ - ）	54,465,365,045円
発行済口数	27,497,714,576口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9807円

## 【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	4,081,361,986円
負債総額	1,477,915円
純資産総額（ - ）	4,079,884,071円
発行済口数	2,844,455,186口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4343円

## 【FWりそな国内リートインデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	5,121,853,733円
------	----------------

負債総額	4,898,080円
純資産総額（ - ）	5,116,955,653円
発行済口数	3,871,536,535口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3217円

## 【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	5,797,518,144円
負債総額	1,358,883円
純資産総額（ - ）	5,796,159,261円
発行済口数	3,998,855,154口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4495円

（参考）

## RM国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	129,354,207,756円
負債総額	902,355円
純資産総額（ - ）	129,353,305,401円
発行済口数	123,075,609,645口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0510円

## RM国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	66,124,146,705円
負債総額	585,667,875円
純資産総額（ - ）	65,538,478,830円
発行済口数	44,965,623,780口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4575円

## RM先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	44,958,691,102円
負債総額	242円
純資産総額（ - ）	44,958,690,860円
発行済口数	40,543,243,266口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1089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	310,056,570,817円
負債総額	4,862,852,751円
純資産総額（ - ）	305,193,718,066円
発行済口数	294,440,797,411口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0365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	7,255,327,769円
負債総額	41円
純資産総額（ - ）	7,255,327,728円
発行済口数	6,685,862,548口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0852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	132,337,230,860円
負債総額	24,490円
純資産総額（ - ）	132,337,206,370円
発行済口数	62,344,260,617口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1227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	18,829,503,629円
負債総額	2,057,991円
純資産総額（ - ）	18,827,445,638円
発行済口数	11,505,490,459口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6364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	28,352,156,245円
負債総額	84,076,125円
純資産総額（ - ）	28,268,080,120円
発行済口数	18,787,227,108口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5046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	28,225,280,927円
負債総額	2,874円
純資産総額（ - ）	28,225,278,053円
発行済口数	18,382,313,675口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5355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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2021年12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12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12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	109	1,230,918
単位型株式投資信託	8	92,046
合計	117	1,322,965

## 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。

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

- (2) 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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、第7期事業年度に係る中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

### (1)【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （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	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
法人税等調整額	38,032	57,337
法人税等計	731,672	1,224,226
当期純利益	1,785,287	2,770,298

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金	利益剰余金 合計	株主資本 合計
				繰越利益 剰余金		
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	
							支払手数料(注3)	746,352	未払手数料	

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。

(1)中間貸借対照表

(単位:千円)

第7期中間会計期間 (2021年9月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	4,945,303
前払費用	174,912
未収入金	247
未収委託者報酬	930,833
未収運用受託報酬	2,912,072
未収投資助言報酬	486,805
流動資産計	9,450,176
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 8,043
器具備品	1 15,483
有形固定資産計	23,526
無形固定資産	
ソフトウェア	5,470
無形固定資産計	5,470
投資その他の資産	
投資有価証券	34,513
繰延税金資産	104,468
投資その他の資産計	138,982
固定資産計	167,979
資産合計	9,618,155

(単位:千円)

第7期中間会計期間 (2021年9月30日現在)	
負債の部	

流動負債		
未払金		
未払手数料		291,230
その他未払金		887,740
未払費用		110,090
未払法人税等		201,586
未払消費税等	2	175,117
賞与引当金		191,651
預り金		1,431
流動負債計		1,858,848
負債合計		1,858,848
純資産の部		
株主資本		
資本金		1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		490,000
資本剰余金計		490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,267,354
利益剰余金計		6,267,354
株主資本計		7,757,354
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,952
評価・換算差額等計		1,952
純資産合計		7,759,307
負債・純資産合計		9,618,155

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第7期中間会計期間
	(自 2021年4月1日
	至 2021年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	2,259,321
運用受託報酬	2,677,522
投資助言報酬	483,723
営業収益計	5,420,567
営業費用	
支払手数料	705,906
広告宣伝費	30,034
調査費	
調査費	737,068
委託調査費	72,531
委託計算費	126,468
事務委託費	11,871
営業雑経費	
印刷費	42,328
協会費	10,425
販売促進費	1,998
その他	32,395



営業費用計		1,771,030
一般管理費		
給料		
役員報酬		60,377
給料・手当		623,676
賞与		9,550
賞与引当金繰入額		191,651
旅費交通費		2,122
租税公課		44,957
不動産賃借料		50,181
固定資産減価償却費	1	7,896
諸経費		123,089
一般管理費計		1,113,502
営業利益		2,536,034
営業外収益		
受取配当金		352
投資有価証券売却益		827
雑収入		1,478
営業外収益計		2,658
営業外費用		
為替差損		170
営業外費用計		170
経常利益		2,538,522
税引前中間純利益		2,538,522
法人税、住民税及び事業税		795,396
法人税等調整額		24,121
法人税等計		819,517
中間純利益		1,719,004

## (3)中間株主資本等変動計算書

第7期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当中間期変動額						
当中間純利益				1,719,004	1,719,004	1,719,004
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						
当中間期変動額合計	-	-	-	1,719,004	1,719,004	1,719,004
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	6,267,354	6,267,354	7,757,354

	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	1,804	1,804	6,040,155

当中間期変動額			
当中間純利益			1,719,004
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	147	147	147
当中間期変動額合計	147	147	1,719,152
当中間期末残高	1,952	1,952	7,759,307

(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

市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

当該業務より発生する委託者報酬は、信託期間にわたり収益として認識しております。

投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

当該業務より発生する運用受託報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 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。

(会計方針の変更)

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「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。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。この結果、当中間財務諸表に与える影響はありません。

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第7期中間会計期間 (2021年9月30日)
建物	1,670千円
器具備品	26,901千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	第7期中間会計期間 (2021年9月30日)
有形固定資産	4,778千円
無形固定資産	3,118千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第7期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、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、未払手数料、その他未払金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

第7期中間会計期間（2021年9月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	34,513	34,513	-
資産計	34,513	34,513	-

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

当社が保有する投資信託については注記を省略しております。当該投資信託の中間貸借対照表計上額は34,513千円であります。

（有価証券関係）

## 1. その他有価証券

第7期中間会計期間（2021年9月30日現在）

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	(3)その他	21,221	18,100	3,121
	小計	21,221	18,100	3,121
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	(3)その他	13,292	13,600	307
	小計	13,292	13,600	307
合計		34,513	31,700	2,813

（収益認識関係）

収益認識に関する注記における開示目的に照らし、定量面・定性面の両面において収益の分解情報を記載する重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

第7期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,952,705

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

	第7期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1株当たり純資産額	1,959円42銭
1株当たり中間純利益金額	434円09銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第7期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益(千円)	1,719,004
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	1,719,004
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000

## (重要な後発事象)

第7期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30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) 通常の見積り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つて、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
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

#### (2) 販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

## 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

2022年1月31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FWRりそな国内債券インデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな国内債券インデックスファンドの2021年12月10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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな国内株式インデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな国内株式インデックスファンドの2021年12月10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。

## 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2021年12月10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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWR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）の2020年12月11日から2021年12月10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、FWR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）の2021年12月10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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2021年12月10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。

## 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2021年12月10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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2021年12月10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。

# 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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F Wりそな国内リートインデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、F Wりそな国内リートインデックスファンドの2021年12月10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。

## 独立監査人の監査報告書

2022年1月31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FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2020年12月11日から2021年12月10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、FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2021年12月10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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年12月3日

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第7期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。