【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月13日提出
【計算期間】	第2期(自 2021年2月16日至 2022年2月15日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡　明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【事務連絡者氏名】	塚田　光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
	国　内	株　式
単位型投信		債　券
	海　外	不動産投信
追加型投信		その他資産（　　）
	内　外	
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

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

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

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

＜商品分類の定義＞

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

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

3. 投資対象資産による区分
(1)株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(2)債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)不動産投信(リート)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げ

る資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

＜補足として使用する商品分類＞

(1)インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分の定義＞

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

①ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

①日経225

②TOPIX

③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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

③　ファンドの特色

◆「保証契約」の表記について
本書において、信託期間中の基準価額が、あらかじめ定められた価格（以下、本書において『確保ライン』といいます。）を下回った場合に、株式会社りそな銀行が『確保ライン』を下回る差額を信託財産に支払うことを約束する契約について「保証契約」ということがあります。
本契約は民法上の保証契約を意味するものではなく、保証類似行為として行われるものです。
また本契約は、株式会社りそな銀行がファンドの元本を保証するものではありません。

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

投資対象

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

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

ファンドの特色

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

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

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

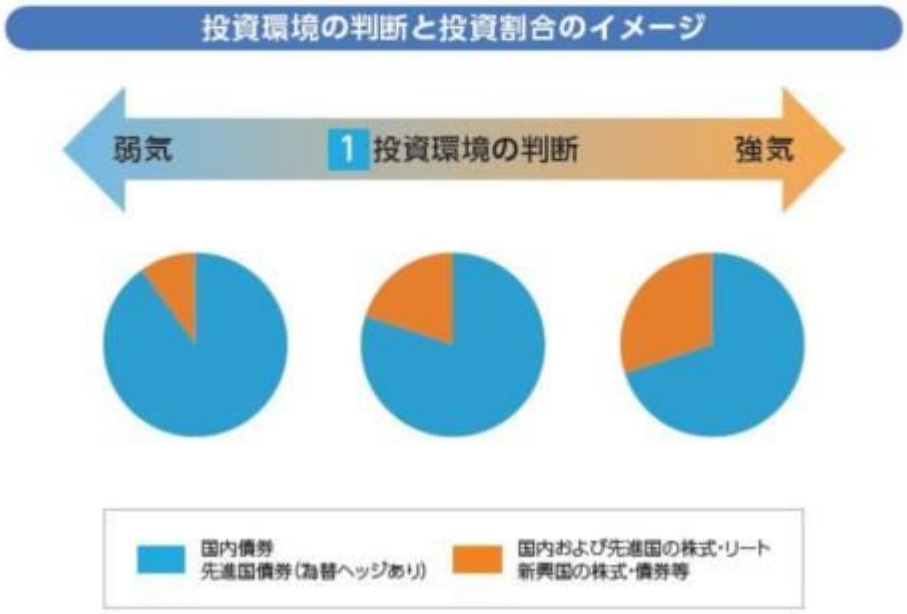
- 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
- 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。

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

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

Point

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

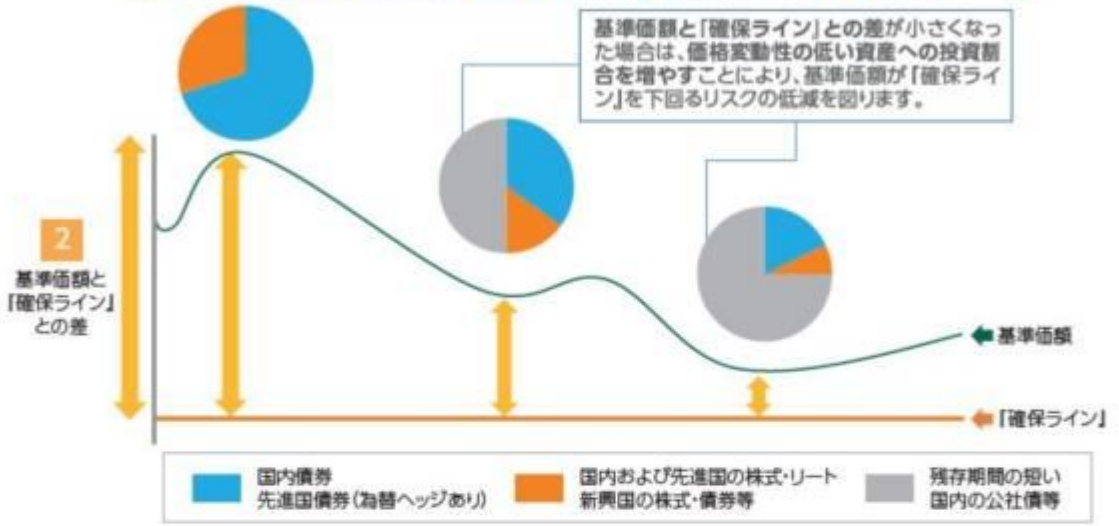


2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

Point

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

「基準価額と『確保ライン』との差」と投資割合のイメージ

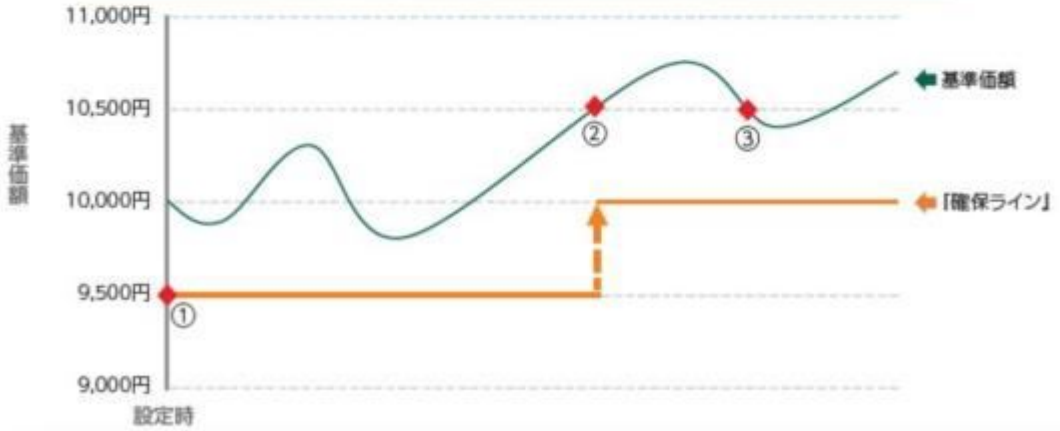


『確保ライン』は設定後に見直される場合があります。

Point

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

『確保ライン』の引き上げイメージ



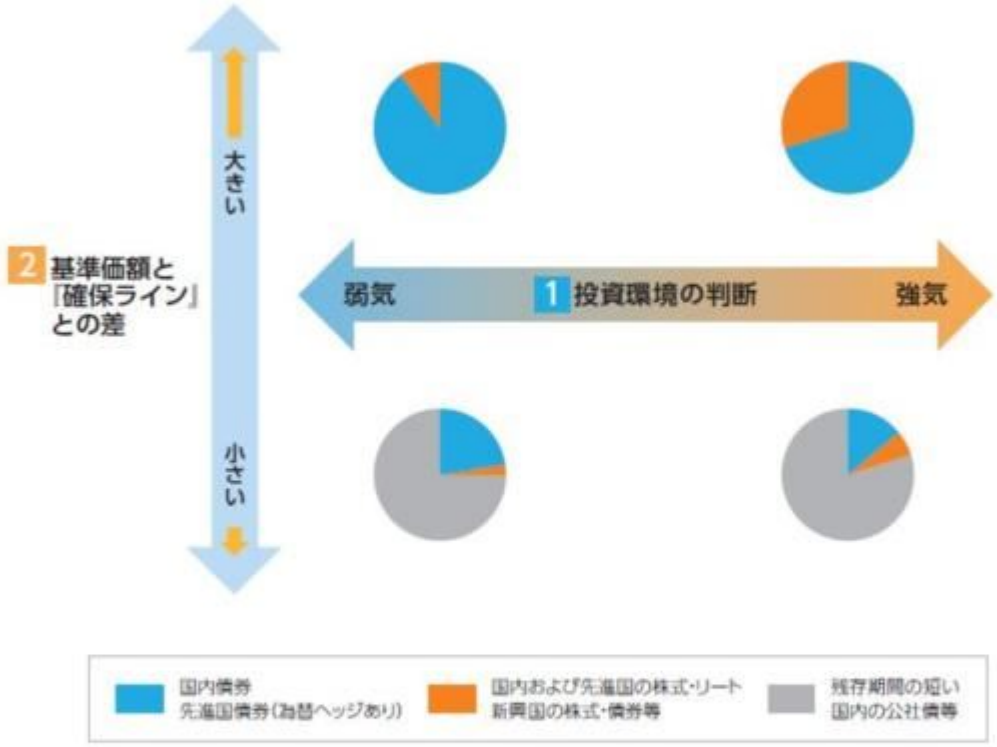
⚠ご注意ください

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

投資対象資産への投資割合のイメージ

1 投資環境の判断 と **2 基準価額と『確保ライン』との差**

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



国内債券
先進国債券（為替ヘッジあり）

国内および先進国の株式・リート
新興国の株式・債券等

残存期間の短い
国内の公社債等

⚠ご注意ください

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

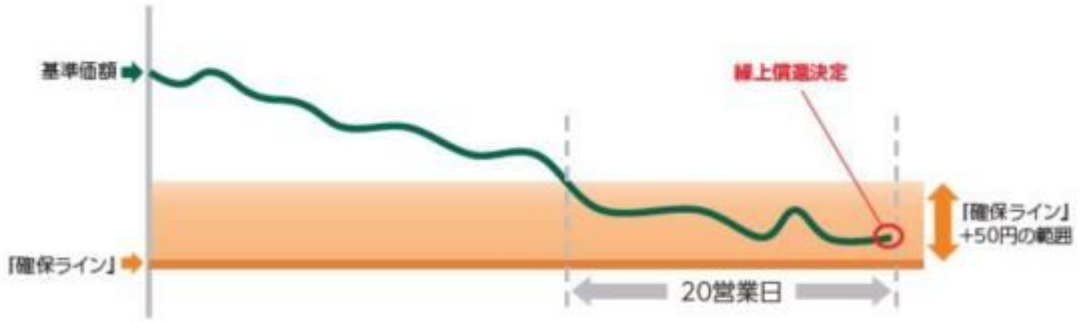
3 以下の条件に該当した場合、ファンドは繰上償還します。このとき、ファンド設定時に締結するりそな銀行との保証契約の履行により『確保ライン』を下回ることなく繰上償還します。

条件① 基準価額が「確保ライン」まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。

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

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



※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。
※保証契約には保証料がかかり、投資者に信託財産で間接的にご負担いただきます。詳しくは後述の「手続・手数料等　ファンドの費用・税金」をご確認ください。
※繰上償還について、詳しくは後述の「投資リスク　その他の留意点」をご確認ください。

運用プロセスのイメージ

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

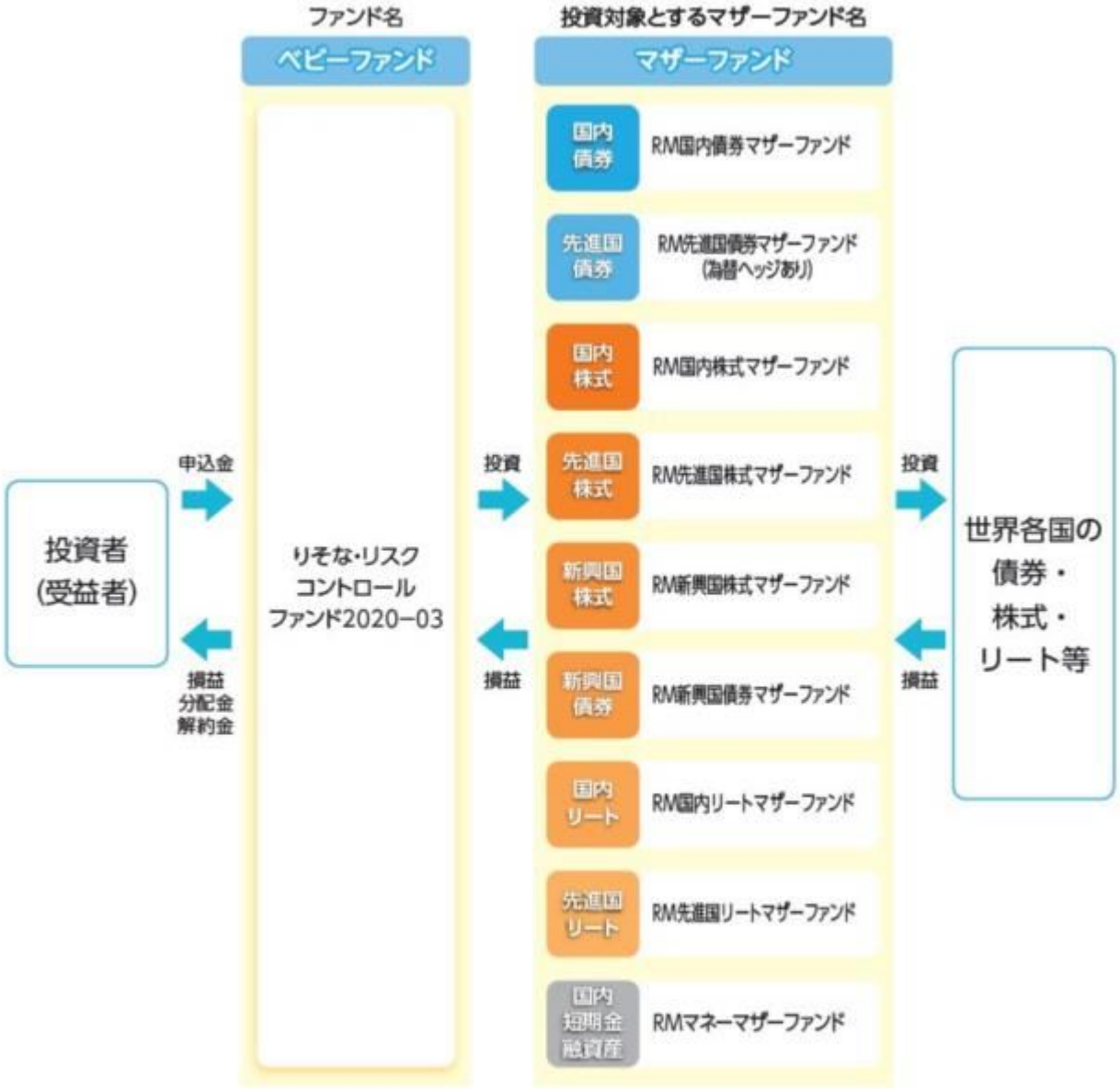
分配方針

原則、毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

インデックスの著作権等について

●RM国内債券マザーファンド

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

●RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

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

●RM国内株式マザーファンド

「東証株価指数（TOPIX、配当込み）」は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

●RM先進国株式マザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

※RMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

④　信託金限度額

1,000億円を限度とします。

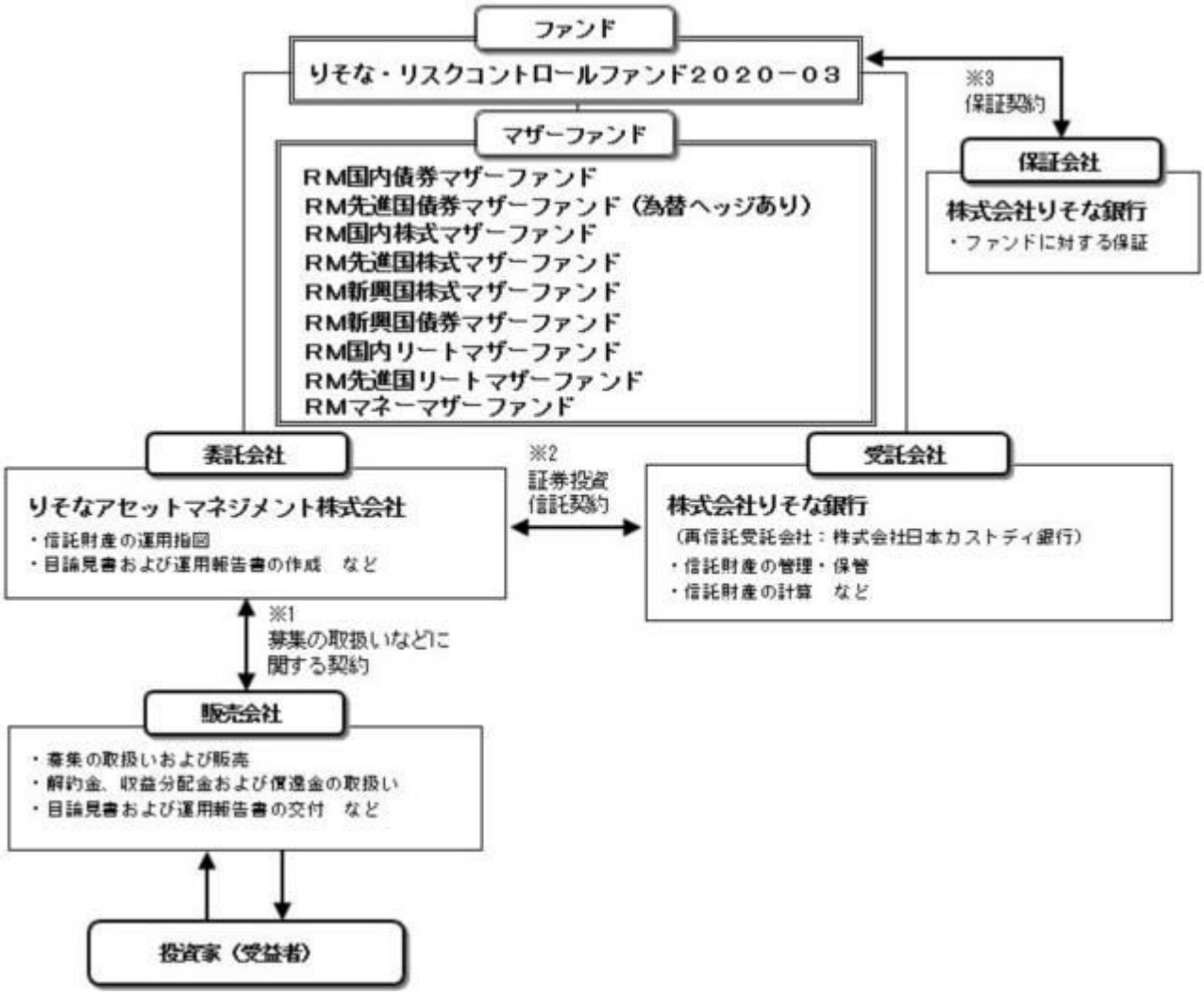
（2）【ファンドの沿革】

2020年3月31日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



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

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

※3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したもの。

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

② 委託会社の概況（2022年2月末現在）

１）資本金

1,000百万円

２）沿革

2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

３）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

RM国内債券マザーファンド、RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM国内株式マザー

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

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

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

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

① 主として、次項に掲げる各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内債券および先進国債券（為替ヘッジあり）に投資を行い、安定した収益を確保しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準に従って、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券（リート）ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。

② 各投資対象資産への投資は、各資産を投資対象とするマザーファンドを通じて行います。また、各マザーファンドは下記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

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

③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

④ 投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値（以下『確保ライン』といいます。）に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、RMマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。

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

⑤ 設定時における『確保ライン』は9,500円とします。設定後、基準価額が最初に10,500円を上回った

日の翌営業日以降は『確保ライン』を10,000円に見直すものとし、その後の信託期間においては『確保ライン』の見直しは行わないものとします。また、『確保ライン』の引き下げは行いません。

⑥ 上記の方針に関わらず、以下の場合は、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。

イ　基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

⑦ 一の会社（以下「保証会社」といいます。）との間で、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回ることがないよう保証契約を締結します。信託契約締結当初の保証会社は、株式会社りそな銀行です。保証会社は、基準価額が『確保ライン』まで下落した場合および償還時において、契約の規定に基づき基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。ただし、保証会社が破綻した場合は、保証契約の履行はありません。

⑧ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ）有価証券

ロ）デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）

ハ）約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ）金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

2）次に掲げる特定資産以外の資産

イ）為替手形

② 有価証券の指図範囲

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

1）株券または新株引受権証書

2）国債証券

3）地方債証券

4）特別の法律により法人の発行する債券

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

6）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8）協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9）特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10）コマーシャル・ペーパー

11）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12）外国または外国の者の発行する証券または証書で、1）から11）までの証券または証書の性質を有するもの

13）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいま

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

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

③　金融商品の指図範囲

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

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

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

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜RM国内債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
投資方針	①　主として、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

＜RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。

投資方針	①　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。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　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。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年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

＜RM国内株式マザーファンド＞

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

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

＜RM先進国株式マザーファンド＞

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

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

＜RM新興国株式マザーファンド＞

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

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM新興国債券マザーファンド＞

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

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

＜RM国内リートマザーファンド＞

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

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

＜RM先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

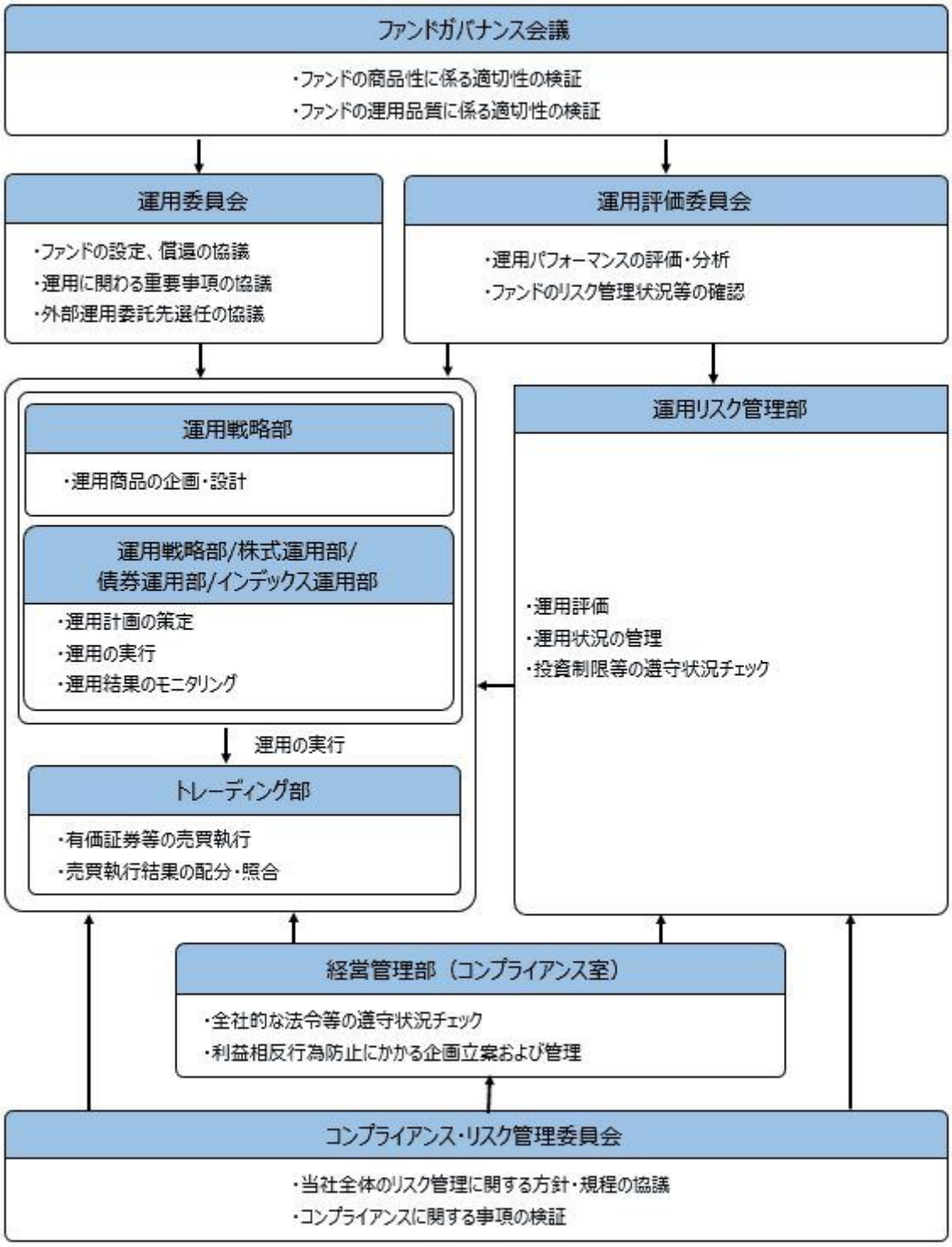
＜RMマネーマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、金融市場の短期金利水準に応じた投資成果と流動性の確保を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	① 主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。 ② 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	**① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資は行いません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**
収益分配	**収益分配は行いません。**
ファンドに係る費用	
信託報酬	**ありません。**
申込手数料	**ありません。**
信託財産留保額	**ありません。**
その他の費用など	**組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。**
その他	
決算日	**毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日）**
委託会社	**りそなアセットマネジメント株式会社**
受託会社	**株式会社りそな銀行**

（3）【運用体制】

① ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

② りそなアセットマネジメント株式会社の運用体制に関する社内規則等は次の通りです。
委託会社では、運用に関する社内規程およびリスク管理規程を定め、適切な運用を行うとともに、流動性リスクを含む運用リスクの管理を行っています。

③ ファンドの関係法人に対する管理体制
委託会社は、受託会社または再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備および運用状況の報告書を受託会社より受け取っております。

※上記の運用体制は、2022年2月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

①　収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

１）分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。

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

３）留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

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

②　収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

①　約款に定める投資制限

１）株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

８）投資する株式等の範囲

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

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

９）信用取引の指図範囲

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

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

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前

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

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け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。）ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産

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

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

11）スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

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

4．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下４．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保

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

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

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

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

13）直物為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

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

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

14）有価証券の貸付けの指図および範囲

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

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

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

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

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

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

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16）外国為替予約取引の指図および範囲

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

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

17）資金の借入れ

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

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

3．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

② 資産配分リスク

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

③ 信用リスク

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

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

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

（その他の留意点）

①当ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を割り込むことがないよう運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

②当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証会社の破綻等により保証契約が履行されない場合には、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回る可能性があります。

③次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。
・基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
・基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
・保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき。

④また次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意の上、繰上償還することができます。
・信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき。
・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
・やむを得ない事情が発生したとき。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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。
⑨ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

（２）リスク管理体制
○委託会社における投資リスクに対する管理体制
①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、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。
②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締役会等に報告します。

※上記体制は2022年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

１）当初設定日以降、2020年5月11日まで
年率1.243%（税抜1.13%）

２）2020年5月12日以降
1ヵ月に1度見直すものとし、前月末営業日における各マザーファンド（RMマネーマザーファンドを除きます。）の時価総額のうち当ファンドが保有する部分の合計が、純資産総額に占める割合（以下「リスク性資産割合」といいます。）に応じ、以下の表に掲げる率を毎月初第5営業日より適用するものとします。

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

３）２）にかかわらず、前月末営業日以降にリスク性資産割合が25%未満となった場合においては、前月

末営業日のリスク性資産割合に関わらず、委託会社の判断により信託報酬を年率0.297%（税抜0.27%）を上限として変更し、毎月初5営業日以外の営業日より適用する場合があります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
※基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。
１）当初設定日以降、2020年5月11日まで

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

２）2020年5月12日以降

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

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

④ 保証料
保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.269%を乗じて得た額とします。
信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。
※上記①の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.512%（税込）となります。
税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
※基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

（４）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

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

○上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示することができません。
○上記の手数料等の合計額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合
１）収益分配金に対する課税
収益分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。
２）解約金および償還金に対する課税
解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。
＊解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益
※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。
※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合
１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税
収益分配金ならびに解約時および償還時の元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
２）益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は2022年2月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３】

以下の運用状況は2022年 2月28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	12,347,109,767	99.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	12,089,090	0.10
合計（純資産総額）		12,359,198,857	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	8,618,909,556	1.0488	9,039,512,343	1.0025	8,640,456,829	69.91
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,079,698,024	1.0528	2,189,506,080	1.0384	2,159,558,428	17.47
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	475,514,825	1.4775	702,573,154	1.9596	931,818,851	7.54
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	110,336,776	1.0484	115,677,076	1.4275	157,505,747	1.27
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	112,377,686	1.2077	135,718,532	1.3812	155,216,059	1.26
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	94,639,434	1.3932	131,851,660	1.5809	149,615,481	1.21
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	55,896,688	1.2211	68,255,446	1.3808	77,182,146	0.62
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	69,571,335	1.0396	72,326,360	1.0889	75,756,226	0.61

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.90
合　　計	99.90

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2021年 2月15日)	16,854	16,854	1.0519	1.0519
第2計算期間末　(2022年 2月15日)	12,801	12,801	1.0377	1.0377
2021年 2月末日	16,353	—	1.0341	—
3月末日	16,243	—	1.0483	—
4月末日	15,832	—	1.0566	—
5月末日	15,546	—	1.0604	—
6月末日	15,143	—	1.0683	—
7月末日	15,034	—	1.0790	—
8月末日	14,816	—	1.0827	—
9月末日	14,222	—	1.0670	—
10月末日	14,180	—	1.0794	—
11月末日	13,834	—	1.0788	—
12月末日	13,614	—	1.0795	—
2022年 1月末日	13,058	—	1.0550	—
2月末日	12,359	—	1.0356	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 3月31日～2021年 2月15日	0.0000
第2期	2021年 2月16日～2022年 2月15日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2020年 3月31日～2021年 2月15日	5.19

第2期	2021年 2月16日～2022年 2月15日	△1.35

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2020年 3月31日～2021年 2月15日	22,473,977,738	6,451,704,901
第2期	2021年 2月16日～2022年 2月15日	0	3,686,046,024

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

ＲＭ国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28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	101,918,266,300	82.84
地方債証券	日本	6,875,214,340	5.59
特殊債券	日本	7,628,789,422	6.20
社債券	日本	5,504,257,000	4.47
	フランス	100,035,000	0.08
	オーストラリア	100,045,000	0.08
	小計	5,704,337,000	4.64
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	903,154,147	0.73
合計（純資産総額）		123,029,761,209	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	100.37	1,987,444,800	100.28	1,985,682,600	0.100	2024/3/20	1.61
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	1,710,000,000	100.40	1,716,976,800	100.29	1,715,112,900	0.100	2024/6/20	1.39

日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	1,490,000,000	100.33	1,494,946,800	100.26	1,493,903,800	0.100	2023/12/20	1.21
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	1,360,000,000	100.57	1,367,860,800	100.38	1,365,168,000	0.100	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	1,310,000,000	100.69	1,319,104,500	100.45	1,315,947,400	0.100	2027/3/20	1.07
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	1,310,000,000	100.62	1,318,122,000	100.41	1,315,475,800	0.100	2025/12/20	1.07
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	1,280,000,000	100.24	1,283,097,600	100.04	1,280,550,400	0.005	2026/6/20	1.04
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	1,220,000,000	100.60	1,227,356,600	100.39	1,224,770,200	0.100	2025/9/20	1.00
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	1,180,000,000	100.66	1,187,843,400	100.42	1,184,979,600	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	1,180,000,000	100.25	1,182,961,800	100.20	1,182,454,400	0.100	2023/6/20	0.96
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	1,180,000,000	99.95	1,179,445,400	99.54	1,174,583,800	0.100	2031/6/20	0.95
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	1,170,000,000	100.45	1,175,270,700	100.31	1,173,732,300	0.100	2024/9/20	0.95
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	1,150,000,000	100.61	1,157,017,300	100.22	1,152,587,500	0.100	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	1,070,000,000	100.66	1,077,083,400	100.45	1,074,879,200	0.100	2026/12/20	0.87
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	1,070,000,000	100.29	1,073,177,900	100.24	1,072,578,700	0.100	2023/9/20	0.87
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	1,030,000,000	100.49	1,035,053,900	100.33	1,033,460,800	0.100	2024/12/20	0.84
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	1,020,000,000	100.53	1,025,420,000	100.35	1,023,580,200	0.100	2025/3/20	0.83
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	1,010,000,000	100.55	1,015,565,100	100.15	1,011,565,500	0.100	2029/12/20	0.82
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	1,000,000,000	100.21	1,002,120,000	100.17	1,001,730,000	0.100	2023/3/20	0.81
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	980,000,000	100.73	987,203,000	100.44	984,341,400	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	980,000,000	100.24	982,440,200	100.06	980,588,000	0.005	2026/3/20	0.80
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	980,000,000	100.22	982,156,000	99.82	978,285,000	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	960,000,000	100.65	966,259,200	100.45	964,368,000	0.100	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	960,000,000	98.98	950,260,200	99.22	952,598,400	0.100	2031/12/20	0.77
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	934,000,000	101.70	949,878,000	101.45	947,617,720	0.400	2025/9/20	0.77
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	950,000,000	100.09	950,855,000	99.68	947,026,500	0.100	2031/3/20	0.77
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	950,000,000	99.80	948,185,500	99.38	944,186,000	0.100	2031/9/20	0.77
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	890,000,000	100.73	896,568,200	100.43	893,862,600	0.100	2027/12/20	0.73
日本	国債証券	第４２７回利付国債（２年）	840,000,000	100.12	841,075,200	100.09	840,772,800	0.005	2023/8/1	0.68
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	840,000,000	100.37	843,158,400	100.00	840,000,000	0.100	2030/6/20	0.68

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.84

地方債証券	5.59
特殊債券	6.20
社債券	4.64
合　　計	99.27

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2022年 2月28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	133,998,627,519	47.87
	カナダ	5,660,333,054	2.02
	メキシコ	2,004,397,738	0.72
	ドイツ	20,146,937,160	7.20
	イタリア	23,969,673,830	8.56
	フランス	27,297,752,730	9.75
	オランダ	5,068,217,251	1.81
	スペイン	15,894,575,404	5.68
	ベルギー	6,113,283,974	2.18
	オーストリア	3,874,816,247	1.38
	フィンランド	1,604,577,247	0.57
	アイルランド	2,139,020,715	0.76
	イギリス	15,953,717,035	5.70
	スウェーデン	762,721,676	0.27
	ノルウェー	673,602,370	0.24
	デンマーク	1,178,728,729	0.42
	ポーランド	1,240,625,123	0.44
	オーストラリア	4,434,956,776	1.58
	シンガポール	1,222,052,626	0.44
	マレーシア	1,444,250,416	0.52
	中国	2,495,794,767	0.89
	イスラエル	1,187,281,103	0.42

	小計	278,365,943,490	99.43
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	1,583,599,082	0.57
合計（純資産総額）		279,949,542,572	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	—	7,569,779,477	2.70
	売建	—	285,449,270,352	△101.96

(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	13,510,000	11,335.59	1,531,438,788	10,826.49	1,462,659,214	1.250	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,870,000	11,268.38	1,450,241,313	10,931.21	1,406,846,760	1.375	2031/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,950,000	11,729.48	1,401,672,919	11,210.15	1,339,613,509	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,660,000	11,008.44	1,283,585,095	10,544.61	1,229,501,930	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,420,000	11,410.92	1,189,018,443	11,385.96	1,186,417,230	0.750	2023/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,740,000	11,240.91	1,207,274,520	10,751.79	1,154,742,369	1.125	2031/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,070,000	10,730.10	1,187,822,765	10,344.65	1,145,153,729	0.625	2030/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,940,000	11,098.96	1,103,237,163	10,878.85	1,081,357,798	1.000	2028/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,809.79	1,093,951,013	10,380.99	1,050,556,542	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,647.75	1,061,147,048	12,188.71	1,022,633,520	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,415.07	1,027,356,830	11,239.49	1,011,554,477	0.250	2024/3/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,560,000	15,363.53	1,007,848,143	14,788.47	970,124,086	2.750	2027/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,140,000	12,889.64	1,049,216,889	11,726.29	954,520,301	2.375	2051/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,040,000	12,016.74	966,146,555	11,767.59	946,114,518	2.500	2024/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	11,269.78	935,391,974	11,211.50	930,555,259	1.250	2026/12/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	11,315.32	950,487,206	11,017.87	925,501,312	0.750	2026/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,133.96	983,128,792	10,475.32	924,971,611	1.875	2051/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,408.74	924,108,370	11,348.27	919,210,109	1.125	2025/1/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,484.51	918,761,160	11,386.86	910,949,240	0.125	2023/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	11,224.59	983,274,769	10,374.22	908,781,973	1.750	2041/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,517.87	921,429,975	11,347.37	907,789,641	0.500	2023/11/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,960,000	11,467.88	912,843,701	11,347.37	903,250,693	0.125	2023/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,910,000	11,496.36	909,362,657	11,337.44	896,791,514	0.375	2023/10/31	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	22,917.15	980,854,100	20,916.11	895,209,707	4.500	2041/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	11,893.34	987,147,994	10,778.64	894,627,820	2.000	2051/8/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,930,000	15,903.03	943,049,798	15,072.76	893,815,037	2.500	2030/5/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,277.46	902,197,243	11,113.56	889,084,962	1.375	2028/12/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,920,000	11,395.66	902,536,822	11,187.81	886,074,722	0.375	2024/8/15	0.32

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,460,000	11,542.32	976,480,309	10,460.65	884,971,790	1.875	2051/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	11,294.56	900,176,486	10,986.72	875,642,266	0.750	2026/8/31	0.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	99.43
合　　計	99.43

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	31,976,900.00	3,667,715,255	3,694,815,678	1.32
	カナダドル	買建	2,008,200.00	180,505,651	181,777,243	0.06
	ユーロ	買建	23,183,900.00	2,992,842,803	2,998,614,899	1.07
	英ポンド	買建	3,031,700.00	470,436,892	468,627,149	0.17
	オーストラリアドル	買建	2,723,900.00	224,606,801	225,944,508	0.08
	米ドル	売建	1,186,279,000.00	136,717,563,274	136,931,473,202	△48.91
	カナダドル	売建	63,562,000.00	5,725,939,764	5,748,032,427	△2.05
	メキシコペソ	売建	369,400,000.00	2,061,331,421	2,057,927,400	△0.74
	ユーロ	売建	846,139,000.00	109,401,824,304	109,452,479,572	△39.10
	英ポンド	売建	105,832,000.00	16,338,159,184	16,343,529,928	△5.84
	スウェーデンクローナ	売建	64,281,000.00	780,429,192	777,157,290	△0.28
	ノルウェークローネ	売建	53,358,000.00	686,383,438	687,507,158	△0.25
	デンマーククローネ	売建	70,146,000.00	1,218,863,910	1,219,319,859	△0.44
	ポーランドズロチ	売建	45,601,000.00	1,270,357,218	1,250,443,261	△0.45
	オーストラリアドル	売建	55,156,000.00	4,560,190,606	4,573,248,708	△1.63
	シンガポールドル	売建	14,547,000.00	1,237,775,136	1,239,432,039	△0.44
	マレーシアリンギット	売建	51,690,000.00	1,413,757,683	1,421,537,028	△0.51
	中国元	売建	139,206,000.00	2,531,753,442	2,536,040,987	△0.91
	イスラエルシュケル	売建	33,867,000.00	1,203,656,886	1,211,141,493	△0.43

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28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	65,582,363,320	98.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	725,683,684	1.09
合計（純資産総額）		66,308,047,004	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	680,760,000	1.03

(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	1,288,100	2,236.32	2,880,612,964	2,138.50	2,754,601,850	4.15
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	159,300	12,483.78	1,988,667,508	11,810.00	1,881,333,000	2.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	23,000	58,811.98	1,352,675,540	53,780.00	1,236,940,000	1.87
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,573,000	674.40	1,060,842,710	712.80	1,121,234,400	1.69
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	187,500	5,506.86	1,032,537,513	4,819.00	903,562,500	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	16,100	56,838.51	915,100,011	55,770.00	897,897,000	1.35
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	261,100	3,283.94	857,438,606	3,293.00	859,802,300	1.30
日本	株式	任天堂	その他製品	14,400	54,041.98	778,204,600	58,020.00	835,488,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	149,600	5,070.33	758,522,328	5,125.00	766,700,000	1.16
日本	株式	信越化学工業	化学	42,800	18,151.68	776,892,274	17,670.00	756,276,000	1.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	49,600	14,256.18	707,106,975	14,855.00	736,808,000	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	187,700	3,814.24	715,933,393	3,871.00	726,586,700	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	173,600	4,101.16	711,962,603	4,121.00	715,405,600	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	200,200	3,399.27	680,535,648	3,525.00	705,705,000	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	199,900	3,283.68	656,409,272	3,501.00	699,849,900	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	122,300	6,166.19	754,125,315	5,650.00	690,995,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	32,400	24,268.14	786,288,019	21,205.00	687,042,000	1.04
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	181,900	3,653.37	664,548,825	3,756.00	683,216,400	1.03
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	175,200	3,675.70	643,983,678	3,743.00	655,773,600	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	65,900	10,536.17	694,333,942	9,883.00	651,289,700	0.98
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	28,700	18,489.32	530,643,526	21,130.00	606,431,000	0.91

日本	株式	村田製作所	電気機器	74,700	8,550.45	638,719,220	7,787.00	581,688,900	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	199,800	2,603.88	520,255,884	2,793.50	558,141,300	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	194,500	2,801.24	544,842,735	2,865.50	557,339,750	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	378,000	1,449.83	548,038,295	1,450.50	548,289,000	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	98,000	5,290.75	518,493,970	5,591.00	547,918,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	82,600	6,691.56	552,723,046	6,574.00	543,012,400	0.82
日本	株式	ＳＭＣ	機械	7,400	63,669.20	471,152,080	68,050.00	503,570,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	320,800	1,546.13	495,999,255	1,525.00	489,220,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	22,300	22,910.74	510,909,522	21,155.00	471,756,500	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	0.28
		建設業	2.30
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.55
		医薬品	4.99
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.60
		機械	5.17
		電気機器	17.45
		輸送用機器	8.41
		精密機器	2.62
		その他製品	2.37
		電気・ガス業	1.16
		陸運業	3.04
		海運業	0.63
		空運業	0.43
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	7.98
		卸売業	5.66
		小売業	4.32
		銀行業	5.37
		証券、商品先物取引業	0.77

		保険業	2.16
		その他金融業	1.13
		不動産業	1.96
		サービス業	5.66
合　　計			98.91

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	36	日本円	682,383,300	680,760,000	1.03

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

ＲＭ先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	75,065,163,734	62.51
	カナダ	4,122,193,177	3.43
	パナマ	34,830,768	0.03
	ドイツ	2,765,393,623	2.30
	イタリア	605,659,606	0.50
	フランス	3,432,680,057	2.86
	オランダ	2,046,938,399	1.70
	スペイン	766,111,573	0.64
	ベルギー	269,681,782	0.22
	オーストリア	71,146,431	0.06
	ルクセンブルク	92,856,025	0.08
	フィンランド	390,382,042	0.33
	アイルランド	1,931,745,232	1.61
	ポルトガル	49,386,539	0.04
	イギリス	4,738,390,082	3.95
	スイス	3,654,823,672	3.04
	スウェーデン	1,065,406,267	0.89
	ノルウェー	231,383,156	0.19

	デンマーク	829,736,654	0.69
	ケイマン	206,200,630	0.17
	リベリア	37,881,524	0.03
	オーストラリア	2,179,979,716	1.82
	バミューダ	230,352,715	0.19
	ニュージーランド	88,406,950	0.07
	香港	712,348,390	0.59
	シンガポール	334,519,790	0.28
	イスラエル	232,000,806	0.19
	キュラソー	110,897,911	0.09
	ジャージー	433,212,499	0.36
	マン島	27,412,587	0.02
	小計	106,757,122,337	88.90
投資証券	アメリカ	2,178,306,923	1.81
	カナダ	8,079,788	0.01
	フランス	53,039,470	0.04
	イギリス	74,031,935	0.06
	オーストラリア	148,509,491	0.12
	香港	36,345,685	0.03
	シンガポール	43,309,290	0.04
	小計	2,541,622,582	2.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	10,790,116,903	8.99
合計（純資産総額）		120,088,861,822	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	8,578,547,550	7.14
	買建	ドイツ	2,011,081,792	1.67

(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	—	97,485,998	0.08
	売建	—	187,351,142	△0.16

(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	18,675.19	5,425,086,959	19,048.41	5,533,508,138	4.61
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	125,468	34,245.55	4,296,721,106	34,354.17	4,310,349,064	3.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,010	334,041.18	2,675,669,884	355,405.22	2,846,795,840	2.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	5,291	302,288.04	1,599,406,041	310,735.90	1,644,103,671	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	5,064	301,289.69	1,525,731,001	310,874.56	1,574,268,795	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	14,795	107,461.49	1,589,892,892	93,580.47	1,384,523,179	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	43,959	27,006.34	1,187,171,964	27,913.41	1,227,045,744	1.02
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	メディア・娯楽	41,897	35,671.44	1,494,526,343	24,320.96	1,018,975,429	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	16,600	53,415.29	886,693,955	54,972.91	912,550,347	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	52,598	16,748.97	880,962,455	17,097.93	899,317,106	0.75
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	18,831.18	872,693,537	19,181.30	888,918,986	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	23,341	35,096.00	819,175,771	36,888.18	861,007,056	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	42,835	18,638.21	798,367,940	18,284.63	783,222,212	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	29,752	23,323.76	693,928,730	25,336.64	753,815,966	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	49,856	14,733.48	734,552,379	14,795.91	737,664,889	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	133,213	5,147.75	685,747,554	5,202.06	692,982,152	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	18,570	42,038.24	780,650,219	36,588.90	679,456,012	0.57
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	74,640	8,410.88	627,788,419	8,994.41	671,342,912	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	15,539	40,375.48	627,394,599	42,648.34	662,712,703	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	34,119	14,695.64	501,400,848	16,220.90	553,441,194	0.46
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	31,972	15,883.50	507,827,358	17,278.19	552,418,339	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	7,232	75,663.90	547,201,325	76,194.19	551,036,411	0.46
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	5,955.44	588,439,852	5,514.04	544,826,343	0.45
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	43,045.48	533,161,377	43,626.08	540,352,676	0.45
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,180	15,271.08	476,152,523	17,279.34	538,770,039	0.45

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	72,416	6,928.37	501,725,421	7,262.31	525,907,984	0.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	7,233	62,579.56	452,638,023	67,944.55	491,442,970	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	74,415	6,574.79	489,263,370	6,475.42	481,868,528	0.40
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	24,388	20,028.28	488,449,729	19,456.30	474,500,464	0.40
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	7,811	56,492.39	441,262,098	59,795.96	467,066,318	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	3.87
		素材	3.94
		資本財	5.55
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	2.03
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.67
		メディア・娯楽	5.83
		小売	4.73
		食品・生活必需品小売り	1.34
		食品・飲料・タバコ	3.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.59
		ヘルスケア機器・サービス	4.41
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.31
		銀行	5.88
		各種金融	4.41
		保険	2.84
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	10.30
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.02
		電気通信サービス	1.44
		公益事業	2.66
		半導体・半導体製造装置	4.57
投資証券	―	―	2.12
合　　計			91.01

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	339	米ドル	74,724,075	8,634,366,879	74,241,000	8,578,547,550	7.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002203	買建	688	ユーロ	15,705,450	2,031,342,908	15,548,800	2,011,081,792	1.67

(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	ユーロ	買建	665,000.00	86,071,349	86,011,565	0.07
	英ポンド	買建	50,000.00	7,732,075	7,728,570	0.01
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,750,420	3,745,863	0.00
	米ドル	売建	100,000.00	11,553,000	11,554,290	△0.01
	ユーロ	売建	600,000.00	77,587,200	77,604,420	△0.06
	英ポンド	売建	382,000.00	59,040,392	59,046,274	△0.05
	スウェーデンクローナ	売建	250,000.00	3,024,250	3,024,825	△0.00
	デンマーククローネ	売建	150,000.00	2,606,850	2,607,000	△0.00
	オーストラリアドル	売建	280,000.00	23,226,000	23,225,412	△0.02
	ニュージーランドドル	売建	70,000.00	5,407,780	5,408,452	△0.00
	香港ドル	売建	330,000.00	4,881,360	4,880,469	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28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	56,764,080	0.32
	メキシコ	312,715,588	1.77
	ブラジル	765,570,057	4.33
	チリ	67,506,202	0.38
	コロンビア	29,280,166	0.17
	ペルー	5,512,488	0.03
	オランダ	14,919,525	0.08
	ルクセンブルク	10,835,582	0.06

	ギリシャ	36,600,611	0.21
	トルコ	37,727,915	0.21
	チェコ	22,006,674	0.12
	キプロス	10,334,792	0.06
	ハンガリー	33,103,222	0.19
	ポーランド	99,544,081	0.56
	ロシア	283,611,396	1.60
	ケイマン	2,776,092,718	15.71
	バミューダ	79,810,001	0.45
	香港	186,110,512	1.05
	シンガポール	3,659,785	0.02
	マレーシア	223,805,501	1.27
	タイ	283,319,691	1.60
	フィリピン	116,380,217	0.66
	インドネシア	258,727,942	1.46
	韓国	1,866,870,353	10.56
	台湾	2,411,659,707	13.65
	中国	1,868,919,888	10.57
	インド	1,897,851,065	10.74
	カタール	135,883,537	0.77
	エジプト	11,308,293	0.06
	南アフリカ	537,983,557	3.04
	ジャージー	7,340,823	0.04
	英ヴァージン諸島	932,506	0.01
	アラブ首長国連邦	194,708,160	1.10
	マン島	5,755,514	0.03
	クウェート	105,877,946	0.60
	サウジアラビア	596,966,051	3.38
	小計	15,355,996,146	86.89
投資証券	メキシコ	7,442,210	0.04
	南アフリカ	6,413,716	0.04
	小計	13,855,926	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	2,303,722,448	13.03
合計（純資産総額）		17,673,574,520	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	2,269,205,511	12.84

(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	―	104,405	0.00
	売建	―	28,528,209	△0.16

(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	437,000	2,694.86	1,177,656,311	2,492.64	1,089,287,001	6.16
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	102,400	6,945.38	711,207,322	6,270.96	642,146,304	3.63
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	84,863	7,209.60	611,828,285	6,902.39	585,758,371	3.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	269,640	1,761.48	474,967,894	1,557.38	419,933,831	2.38
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	72,600	3,443.11	249,969,931	2,517.25	182,752,931	1.03
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	50,611	3,685.74	186,539,240	3,540.12	179,169,140	1.01
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	60,457	2,692.03	162,752,662	2,626.63	158,798,170	0.90
ブラジル	株式	VALE SA	素材	72,804	1,880.47	136,906,061	2,069.03	150,634,211	0.85
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	35,810	4,277.26	153,168,967	4,079.08	146,071,926	0.83
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,709,000	87.85	150,140,093	85.04	145,337,632	0.82
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	26,800	4,498.32	120,555,003	4,477.68	120,001,998	0.68
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	9,673	11,424.00	110,504,352	11,808.00	114,218,784	0.65
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	30,413	3,936.69	119,726,553	3,722.09	113,199,999	0.64
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	21,662	4,547.29	98,503,396	4,787.91	103,715,923	0.59
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	90,857	1,237.59	112,444,396	1,131.57	102,811,737	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	112,500	968.00	108,900,619	896.27	100,830,825	0.57
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	221,800	425.07	94,280,681	425.07	94,280,681	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	14,570	6,547.20	95,392,704	6,345.60	92,455,392	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	16,384	5,845.59	95,774,187	5,457.16	89,410,150	0.51
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,935	17,222.72	84,994,161	17,691.86	87,309,332	0.49
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	38,769	2,208.86	85,635,294	2,094.71	81,210,006	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	35,700	2,221.45	79,306,051	2,163.77	77,246,839	0.44

中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,002,000	69.80	69,948,417	67.73	67,873,676	0.38
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	104,736	848.13	88,830,477	644.76	67,530,526	0.38
中国	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	69,500	1,002.02	69,640,564	958.39	66,608,244	0.38
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	2,175	31,536.00	68,590,800	30,192.00	65,667,600	0.37
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	84,200	716.36	60,317,557	762.32	64,187,698	0.36
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	982,100	63.17	62,049,077	65.20	64,037,830	0.36
アラブ首長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM GROUP CO	電気通信サービス	60,264	1,010.84	60,917,310	1,048.65	63,196,012	0.36
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,410,000	44.81	63,187,317	44.66	62,978,778	0.36

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	4.70
		素材	8.07
		資本財	2.79
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.68
		自動車・自動車部品	2.92
		耐久消費財・アパレル	1.41
		消費者サービス	0.86
		メディア・娯楽	6.19
		小売	5.82
		食品・生活必需品小売り	1.08
		食品・飲料・タバコ	3.33
		家庭用品・パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・サービス	0.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.47
		銀行	13.61
		各種金融	2.19
		保険	2.42
		不動産	1.77
		ソフトウェア・サービス	2.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.52
		電気通信サービス	2.81
		公益事業	2.11
		半導体・半導体製造装置	9.00
投資証券	—	—	0.08
合　　計			86.97

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	330	米ドル	19,995,360	2,310,463,857	19,638,300	2,269,205,511	12.84

(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	903.64	105,374	104,405	0.00
	米ドル	売建	246,000.00	28,420,380	28,423,553	△0.16
	ブラジルレアル	売建	4,667.72	105,374	104,656	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	1,978,254,658	29.22
	アイルランド	4,776,396,318	70.56
	小計	6,754,650,976	99.78
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	14,834,459	0.22
合計（純資産総額）		6,769,485,435	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	—	22,068,693	△0.33

(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(%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	822,447	5,828.34	4,793,502,393	5,807.54	4,776,396,318	70.56
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	599,032	3,310.50	1,983,099,928	3,302.41	1,978,254,658	29.22

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.78
合　　計	99.78

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	191,000.00	22,066,230	22,068,693	△0.33

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28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	27,916,688,300	98.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	419,712,323	1.48
合計（純資産総額）		28,336,400,623	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	388,642,500	1.37

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	3,137	643,028.92	2,017,181,722	658,000	2,064,146,000	7.28
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,690	610,043.51	1,641,017,041	613,000	1,648,970,000	5.82
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	8,713	185,098.44	1,612,762,707	171,600	1,495,150,800	5.28
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,402	352,905.22	1,553,488,778	337,500	1,485,675,000	5.24
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,700	148,301.1	1,290,219,570	151,800	1,320,660,000	4.66
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,574	90,734.12	1,231,624,944	93,100	1,263,739,400	4.46
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,040	329,884.57	1,332,733,662	311,500	1,258,460,000	4.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,690	339,859.56	914,222,216	322,000	866,180,000	3.06
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,361	158,968.02	852,227,555	160,900	862,584,900	3.04
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,056	129,623.45	784,999,613	131,500	796,364,000	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,838	358,660.81	659,218,568	374,000	687,412,000	2.43
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,819	189,808.3	724,877,897	172,300	658,013,700	2.32
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,166	76,302.47	623,085,970	76,400	623,882,400	2.20
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	832	654,283.94	544,364,238	679,000	564,928,000	1.99
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	929	597,140.01	554,743,069	605,000	562,045,000	1.98
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,434	371,652.48	532,949,656	388,500	557,109,000	1.97
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,060	570,871.36	605,123,641	525,000	556,500,000	1.96
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,814	310,189.33	562,683,444	300,500	545,107,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,294	177,089.52	583,332,878	164,900	543,180,600	1.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,242	54,440	448,694,480	58,700	483,805,400	1.71
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	11,841	34,837.68	412,512,968	39,300	465,351,300	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,164	142,037.54	449,406,776	143,100	452,768,400	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	943	462,109.46	435,769,220	473,000	446,039,000	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,164	139,405.24	441,078,179	138,000	436,632,000	1.54
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	569	672,177.53	382,469,014	708,000	402,852,000	1.42
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,510	162,190.04	407,097,000	156,400	392,564,000	1.39
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,251	305,514.39	382,198,501	310,500	388,435,500	1.37
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,579	144,969.37	373,876,005	150,400	387,881,600	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,635	106,612.25	387,535,528	104,600	380,221,000	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	1,925	197,557.69	380,298,554	188,700	363,247,500	1.28

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.52
合　　計	98.52

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	207	日本円	389,820,440	388,642,500	1.37

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

ＲＭ先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 2月28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	61,771,598	0.23
	オーストラリア	22,062,350	0.08
	小計	83,833,948	0.31
投資証券	アメリカ	20,568,891,054	75.82
	カナダ	530,691,634	1.96
	ドイツ	17,586,383	0.06
	イタリア	7,713,500	0.03
	フランス	517,605,616	1.91
	オランダ	51,435,046	0.19
	スペイン	112,398,298	0.41
	ベルギー	338,891,308	1.25
	アイルランド	27,017,558	0.10
	イギリス	1,461,864,330	5.39
	オーストラリア	1,777,309,810	6.55
	ニュージーランド	102,413,032	0.38
	香港	343,401,910	1.27
	シンガポール	916,617,295	3.38
	韓国	45,950,920	0.17
	イスラエル	20,511,455	0.08
	ガーンジー	68,794,781	0.25
	小計	26,909,093,930	99.19
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	135,510,907	0.50
合計（純資産総額）		27,128,438,785	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	―	26,921,580	△0.10

(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	111,001	17,714.97	1,966,379,441	17,153.39	1,904,044,276	7.02
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,517	84,420.82	1,141,116,359	82,703.75	1,117,906,683	4.12
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	22,900	40,697.86	931,981,120	41,909.98	959,738,657	3.54
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	49,371	16,880.69	833,417,015	16,142.33	796,963,221	2.94
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,638	17,775.05	757,892,859	15,934.34	679,408,602	2.50
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	84,992	7,903.61	671,744,471	7,788.06	661,923,645	2.44
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	65,400	9,933.83	649,672,711	9,742.02	637,128,141	2.35
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,999	27,781.68	583,387,635	28,199.97	592,171,328	2.18
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	51,279	10,208.84	523,499,234	10,082.89	517,040,670	1.91
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,182	22,556.51	477,792,112	22,379.72	474,047,314	1.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	255,440	1,942.68	496,240,478	1,842.31	470,602,093	1.73
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,116	22,539.18	453,398,205	22,437.49	451,352,730	1.66
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,300	23,443.93	405,580,154	24,255.10	419,613,239	1.55
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	89,665	4,817.27	431,941,367	4,511.07	404,485,271	1.49
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	59,958	5,973.93	358,185,195	6,262.81	375,505,562	1.38
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,424	21,585.89	376,112,643	21,337.46	371,783,955	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,779	38,458.50	376,085,735	37,509.84	366,808,735	1.35
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	180,495	1,978.62	357,131,738	1,984.80	358,247,775	1.32
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	57,211	6,589.81	377,009,992	6,228.14	356,318,404	1.31
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	94,450	3,177.62	300,126,681	3,243.48	306,347,489	1.13
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	21,344	13,288.25	283,624,408	14,265.80	304,489,299	1.12
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	15,353	18,264.98	280,422,369	19,422.79	298,198,241	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	80,958	4,025.76	325,917,640	3,656.00	295,982,610	1.09
香港	投資証券	LINK REIT	314,100	1,016.51	319,287,895	939.16	294,991,726	1.09
アメリカ	投資証券	UDR INC	43,660	6,492.75	283,473,662	6,475.42	282,716,925	1.04
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	92,520	2,746.62	254,117,606	2,821.73	261,066,552	0.96
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	27,960	8,767.93	245,151,434	8,973.61	250,902,219	0.92
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	43,466	5,126.95	222,848,161	5,623.81	244,444,895	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	106,988	1,964.35	210,161,878	2,166.56	231,796,189	0.85
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,678	8,825.70	226,626,556	8,791.04	225,736,428	0.83

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	0.31

投資証券	―	―	99.19
合　　計			99.50

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	180,000.00	20,795,400	20,797,722	△0.08
	カナダドル	売建	22,000.00	1,991,220	1,991,330	△0.01
	ユーロ	売建	20,000.00	2,586,240	2,586,814	△0.01
	英ポンド	売建	10,000.00	1,545,560	1,545,714	△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。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

（３）解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

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

（５）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

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

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

（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

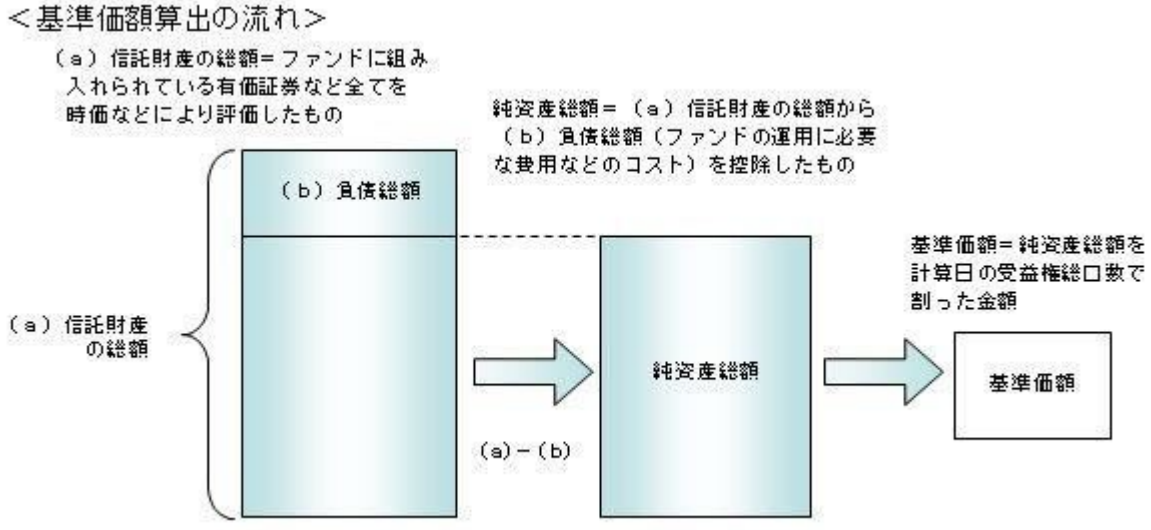
・委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。
・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③　基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2030年2月15日までとします（2020年3月31日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年2月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

①　信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

イ）基準価額が『確保ライン』まで下落した場合
ロ）基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して 50円未満となった場合
ハ）保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき
ニ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
ホ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ヘ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
ト）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

② 償還金について

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

③ 信託約款の変更など

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

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

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

④ 書面決議

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

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

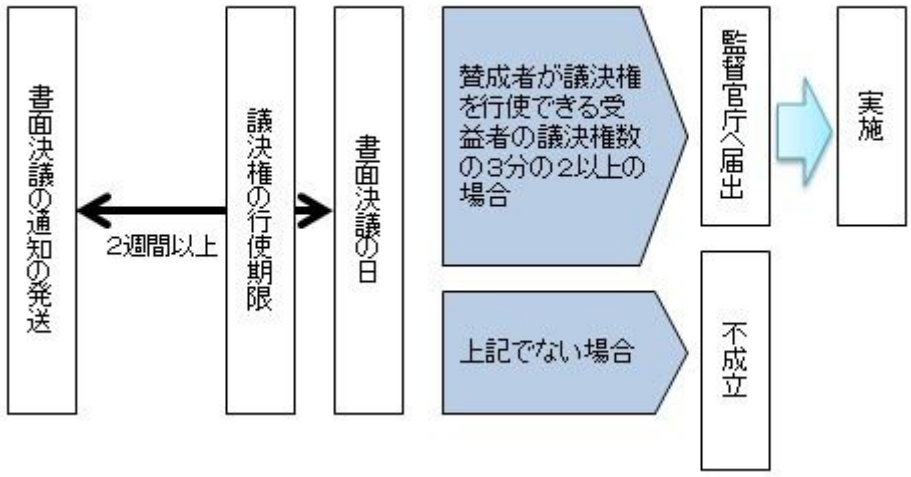
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

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

＜書面決議の主な流れ＞



⑤　公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥　運用報告書の作成

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

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

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

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

⑦　関係法人との契約について

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

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

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

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

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2021年 2月16日から2022年 2月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2021年 2月15日現在	第2期 2022年 2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	108,709,515	110,461,306
親投資信託受益証券	16,841,247,278	12,791,317,807
未収入金	47,781,000	6,289,000
流動資産合計	16,997,737,793	12,908,068,113
資産合計	16,997,737,793	12,908,068,113
負債の部		
流動負債		
未払解約金	46,367,226	4,393,560
未払受託者報酬	2,077,994	2,194,562
未払委託者報酬	76,191,718	80,465,435
未払利息	294	299
その他未払費用	18,579,252	19,430,138
流動負債合計	143,216,484	106,483,994
負債合計	143,216,484	106,483,994
純資産の部		
元本等		
元本	16,022,272,837	12,336,226,813
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	832,248,472	465,357,306
元本等合計	16,854,521,309	12,801,584,119
純資産合計	16,854,521,309	12,801,584,119
負債純資産合計	16,997,737,793	12,908,068,113

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2020年 3月31日 至　2021年 2月15日	第2期 自　2021年 2月16日 至　2022年 2月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,222,067,306	99,346,529
営業収益合計	1,222,067,306	99,346,529
営業費用		
支払利息	704,833	117,723
受託者報酬	5,673,289	4,895,349
委託者報酬	198,155,940	179,495,904
その他費用	48,364,296	41,176,989
営業費用合計	252,898,358	225,685,965
営業利益又は営業損失（△）	969,168,948	△126,339,436
経常利益又は経常損失（△）	969,168,948	△126,339,436
当期純利益又は当期純損失（△）	969,168,948	△126,339,436
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	832,248,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	136,920,476	240,551,730
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	136,920,476	240,551,730
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	832,248,472	465,357,306

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

第1期 2021年 2月15日現在		第2期 2022年 2月15日現在	
１．投資信託財産に係る元本の状況		１．投資信託財産に係る元本の状況	
設定年月日	2020年 3月31日	設定年月日	2020年 3月31日
設定元本額	22,473,977,738円	設定元本額	22,473,977,738円
期首元本額	22,473,977,738円	期首元本額	16,022,272,837円
元本残存率	71.2%	元本残存率	54.8%
２．計算期間の末日における受益権の総数	16,022,272,837口	２．計算期間の末日における受益権の総数	12,336,226,813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	1.0519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	1.0377円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(10,519円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,377円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日		第2期 自 2021年 2月16日 至 2022年 2月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	△704,833円	A 当ファンドの配当等収益額	△117,723円
B 親ファンドの配当等収益額	246,763,002円	B 親ファンドの配当等収益額	228,724,967円
ＲＡＭ国内株式マザーファンド	4,835,151円	ＲＭ国内株式マザーファンド	8,112,139円
ＲＡＭ国内リートマザーファンド	6,460,962円	ＲＭ国内リートマザーファンド	6,576,079円
ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	22,877,411円	ＲＭ先進国株式マザーファンド	31,017,210円
ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	4,395,726円	ＲＭ新興国株式マザーファンド	6,907,149円
ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	10,486,123円	ＲＭ先進国リートマザーファンド	10,549,617円
ＲＡＭ国内債券マザーファンド	17,861,763円	ＲＭ国内債券マザーファンド	14,619,869円
ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	8,384,846円	ＲＭ新興国債券マザーファンド	8,026,176円

	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	171,702,820円		ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	142,916,728円
	ＲＡＭマネーマザーファンド	△241,800円		ＲＭマネーマザーファンド	0円
C	配当等収益額合計(A+B)	246,058,169円	C	配当等収益額合計(A+B)	228,607,244円
D	経費	252,193,525円	D	経費	225,568,242円
E	差引配当等収益額(C-D)	△6,135,356円	E	差引配当等収益額(C-D)	3,039,002円
F	当ファンドの当期末残存受益権口数	16,022,272,837口	F	当ファンドの当期末残存受益権口数	12,336,226,813口
G	当ファンドの期中平均残存受益権口数	19,216,383,576口	G	当ファンドの期中平均残存受益権口数	13,841,730,911口
H	分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円	H	分配対象配当等収益額(E×F/G)	2,708,463円
I	元本超過額	832,248,472円	I	元本超過額	465,357,306円
J	分配可能額(H<I)	832,248,472円	J	分配可能額(H<I)	465,357,306円
K	10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	519円	K	10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	377円
L	10,000口当たりの分配額	0円	L	10,000口当たりの分配額	0円
M	収益分配金金額(L×F/10,000)	0円	M	収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日	第2期 自 2021年 2月16日 至 2022年 2月15日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1期 2021年 2月15日現在	第2期 2022年 2月15日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2 .時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2 .時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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。	3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日	第2期 自 2021年 2月16日 至 2022年 2月15日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日	第2期 自 2021年 2月16日 至 2022年 2月15日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	879,405,870	△743,469,038
合計	879,405,870	△743,469,038

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	1,940,842,329	2,009,548,147	
	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	7,949,310,734	7,946,925,940	
	RM国内株式マザーファンド	203,787,508	285,506,298	
	RM先進国株式マザーファンド	859,341,759	1,697,199,974	
	RM新興国株式マザーファンド	174,677,341	286,925,000	
	RM新興国債券マザーファンド	131,592,926	145,160,156	
	RM国内リートマザーファンド	102,736,911	140,092,051	
	RM先進国リートマザーファンド	200,085,936	279,960,241	
合計		11,562,375,444	12,791,317,807	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	672,338
コール・ローン	851,981,944
国債証券	100,324,584,100
地方債証券	6,860,673,745
特殊債券	7,617,673,008
社債券	5,696,959,000
未収利息	220,332,063
前払費用	9,300,346
流動資産合計	121,582,176,544
資産合計	121,582,176,544
負債の部	
流動負債	
未払金	118,782,000
未払解約金	326,896,000
未払利息	2,310
流動負債合計	445,680,310
負債合計	445,680,310
純資産の部	
元本等	
元本	116,992,911,884
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,143,584,350
元本等合計	121,136,496,234
純資産合計	121,136,496,234
負債純資産合計	121,582,176,544

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	79,895,842,435円
期中追加設定元本額	58,026,482,757円
期中一部解約元本額	20,929,413,308円
期末元本額	116,992,911,884円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	7,427,663,724円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,602,656,234円
りそなラップ型ファンド（成長型）	248,943,469円
ＤＣりそな　グローバルバランス	619,065,501円
つみたてバランスファンド	3,880,125,976円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	3,227,935,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	806,997,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	248,805,524円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	279,721,006円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	83,061,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	17,843,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	15,715,956円
リスクコントロール・オープン	95,476,474円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	276,373,660円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	72,325,869,080円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	1,459,655,278円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,095,858,553円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	812,486,650円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	328,305,231円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	1,052,681,489円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,578,109,364円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	963,359,060円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	600,469,106円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	1,940,842,329円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	329,904,495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）	16,026,647円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	8,937,557,160円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	3,804,685,425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）	2,593,927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）	5,420,553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）	493,773円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	908,207,709円
２．　計算日における受益権の総数	
	116,992,911,884口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0354円
(10,000口当たり純資産額)	(10,354円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,345,157,730
地方債証券	△38,926,370
特殊債券	△50,349,055
社債券	△27,733,000
合計	△1,462,166,155

(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４２３回利付国債（２年）	860,000,000	860,765,400	
	第４２４回利付国債（２年）	600,000,000	600,576,000	
	第４２５回利付国債（２年）	350,000,000	350,360,500	
	第４２６回利付国債（２年）	650,000,000	650,663,000	
	第４２７回利付国債（２年）	840,000,000	840,848,400	
	第４２８回利付国債（２年）	420,000,000	420,420,000	
	第４２９回利付国債（２年）	350,000,000	350,367,500	
	第４３０回利付国債（２年）	630,000,000	630,642,600	
	第４３２回利付国債（２年）	40,000,000	40,030,000	
	第１３５回利付国債（５年）	1,000,000,000	1,001,900,000	
	第１３６回利付国債（５年）	1,180,000,000	1,182,678,600	
	第１３７回利付国債（５年）	1,070,000,000	1,072,717,800	
	第１３８回利付国債（５年）	1,490,000,000	1,493,978,300	
	第１３９回利付国債（５年）	1,980,000,000	1,985,583,600	
	第１４０回利付国債（５年）	1,710,000,000	1,714,993,200	
	第１４１回利付国債（５年）	1,170,000,000	1,173,486,600	
	第１４２回利付国債（５年）	1,030,000,000	1,033,213,600	
	第１４３回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,023,304,800	
	第１４４回利付国債（５年）	1,360,000,000	1,364,528,800	
	第１４５回利付国債（５年）	1,220,000,000	1,224,160,200	
	第１４６回利付国債（５年）	1,460,000,000	1,465,037,000	
	第１４７回利付国債（５年）	980,000,000	979,598,200	
	第１４８回利付国債（５年）	1,280,000,000	1,279,155,200	
	第１４９回利付国債（５年）	560,000,000	559,356,000	
	第１回利付国債（４０年）	100,000,000	136,896,000	
	第２回利付国債（４０年）	180,000,000	238,224,600	
	第３回利付国債（４０年）	110,000,000	146,325,300	
	第４回利付国債（４０年）	170,000,000	227,771,100	
	第５回利付国債（４０年）	240,000,000	310,970,400	
	第６回利付国債（４０年）	240,000,000	306,105,600	
	第７回利付国債（４０年）	220,000,000	269,865,200	
	第８回利付国債（４０年）	290,000,000	332,476,300	
	第９回利付国債（４０年）	480,000,000	411,489,600	
	第１０回利付国債（４０年）	420,000,000	421,121,400	
	第１１回利付国債（４０年）	340,000,000	330,286,200	
	第１２回利付国債（４０年）	360,000,000	315,136,800	
	第１３回利付国債（４０年）	430,000,000	374,831,000	
	第１４回利付国債（４０年）	360,000,000	334,821,600	
	第３２８回利付国債（１０年）	411,000,000	414,016,740	
	第３２９回利付国債（１０年）	297,000,000	300,442,230	
	第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	260,500,340	
	第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	90,938,700	

第３３２回利付国債（１０年）	652,000,000	659,687,080	
第３３３回利付国債（１０年）	225,000,000	227,961,000	
第３３４回利付国債（１０年）	261,000,000	264,818,430	
第３３５回利付国債（１０年）	345,000,000	349,605,750	
第３３６回利付国債（１０年）	210,000,000	213,042,900	
第３３７回利付国債（１０年）	170,000,000	171,496,000	
第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	638,887,500	
第３３９回利付国債（１０年）	385,000,000	390,139,750	
第３４０回利付国債（１０年）	934,000,000	947,244,120	
第３４１回利付国債（１０年）	440,000,000	444,897,200	
第３４２回利付国債（１０年）	380,000,000	381,318,600	
第３４３回利付国債（１０年）	780,000,000	782,698,800	
第３４４回利付国債（１０年）	960,000,000	963,072,000	
第３４５回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,073,359,800	
第３４６回利付国債（１０年）	1,310,000,000	1,313,654,900	
第３４７回利付国債（１０年）	590,000,000	591,569,400	
第３４８回利付国債（１０年）	980,000,000	982,450,000	
第３４９回利付国債（１０年）	890,000,000	892,064,800	
第３５０回利付国債（１０年）	980,000,000	982,077,600	
第３５１回利付国債（１０年）	710,000,000	711,341,900	
第３５２回利付国債（１０年）	800,000,000	801,304,000	
第３５３回利付国債（１０年）	840,000,000	841,142,400	
第３５４回利付国債（１０年）	720,000,000	720,756,000	
第３５５回利付国債（１０年）	800,000,000	800,288,000	
第３５６回利付国債（１０年）	1,150,000,000	1,149,126,000	
第３５７回利付国債（１０年）	1,010,000,000	1,008,424,400	
第３５８回利付国債（１０年）	820,000,000	818,023,800	
第３５９回利付国債（１０年）	840,000,000	837,228,000	
第３６０回利付国債（１０年）	440,000,000	438,130,000	
第３６１回利付国債（１０年）	980,000,000	974,443,400	
第３６２回利付国債（１０年）	950,000,000	943,198,000	
第３６３回利付国債（１０年）	1,180,000,000	1,170,253,200	
第３６４回利付国債（１０年）	950,000,000	941,051,000	
第３６５回利付国債（１０年）	520,000,000	514,482,800	
第１回利付国債（３０年）	60,000,000	72,151,200	
第７回利付国債（３０年）	40,000,000	48,343,600	
第１０回利付国債（３０年）	30,000,000	32,645,400	
第１１回利付国債（３０年）	80,000,000	92,434,400	
第１２回利付国債（３０年）	80,000,000	96,238,400	
第１３回利付国債（３０年）	200,000,000	238,742,000	
第１４回利付国債（３０年）	60,000,000	74,610,000	
第１５回利付国債（３０年）	200,000,000	251,756,000	
第１６回利付国債（３０年）	140,000,000	176,727,600	

第１７回利付国債（３０年）	160,000,000	200,428,800	
第１８回利付国債（３０年）	60,000,000	74,595,000	
第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	124,613,000	
第２０回利付国債（３０年）	100,000,000	127,481,000	
第２１回利付国債（３０年）	180,000,000	225,147,600	
第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	64,045,500	
第２３回利付国債（３０年）	220,000,000	282,462,400	
第２４回利付国債（３０年）	170,000,000	218,766,200	
第２５回利付国債（３０年）	200,000,000	252,174,000	
第２６回利付国債（３０年）	205,000,000	261,846,500	
第２７回利付国債（３０年）	295,000,000	382,550,100	
第２８回利付国債（３０年）	290,000,000	377,484,300	
第２９回利付国債（３０年）	150,000,000	193,663,500	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	243,072,700	
第３１回利付国債（３０年）	170,000,000	215,163,900	
第３２回利付国債（３０年）	335,000,000	430,732,950	
第３３回利付国債（３０年）	290,000,000	358,805,400	
第３４回利付国債（３０年）	335,000,000	427,161,850	
第３５回利付国債（３０年）	406,000,000	504,759,500	
第３６回利付国債（３０年）	375,000,000	467,437,500	
第３７回利付国債（３０年）	450,000,000	553,662,000	
第３８回利付国債（３０年）	290,000,000	351,848,300	
第３９回利付国債（３０年）	300,000,000	370,275,000	
第４０回利付国債（３０年）	215,000,000	261,319,600	
第４１回利付国債（３０年）	255,000,000	305,041,200	
第４２回利付国債（３０年）	190,000,000	227,433,800	
第４３回利付国債（３０年）	180,000,000	215,605,800	
第４４回利付国債（３０年）	260,000,000	311,628,200	
第４５回利付国債（３０年）	290,000,000	335,686,600	
第４６回利付国債（３０年）	320,000,000	370,512,000	
第４７回利付国債（３０年）	320,000,000	377,398,400	
第４８回利付国債（３０年）	353,000,000	401,406,890	
第４９回利付国債（３０年）	290,000,000	329,790,900	
第５０回利付国債（３０年）	320,000,000	321,622,400	
第５１回利付国債（３０年）	350,000,000	312,753,000	
第５２回利付国債（３０年）	310,000,000	289,992,600	
第５３回利付国債（３０年）	310,000,000	296,536,700	
第５４回利付国債（３０年）	360,000,000	360,000,000	
第５５回利付国債（３０年）	100,000,000	99,894,000	
第５６回利付国債（３０年）	300,000,000	299,046,000	
第５７回利付国債（３０年）	330,000,000	328,590,900	
第５８回利付国債（３０年）	490,000,000	486,844,400	

	第５９回利付国債（３０年）	280,000,000	271,252,800	
	第６０回利付国債（３０年）	280,000,000	283,959,200	
	第６１回利付国債（３０年）	260,000,000	250,653,000	
	第６２回利付国債（３０年）	230,000,000	210,192,400	
	第６３回利付国債（３０年）	300,000,000	266,211,000	
	第６４回利付国債（３０年）	260,000,000	230,248,200	
	第６５回利付国債（３０年）	300,000,000	265,128,000	
	第６６回利付国債（３０年）	340,000,000	300,203,000	
	第６７回利付国債（３０年）	250,000,000	232,800,000	
	第６８回利付国債（３０年）	360,000,000	335,059,200	
	第６９回利付国債（３０年）	340,000,000	324,798,600	
	第７０回利付国債（３０年）	390,000,000	372,446,100	
	第７１回利付国債（３０年）	360,000,000	343,684,800	
	第７２回利付国債（３０年）	180,000,000	171,786,600	
	第７３回利付国債（３０年）	10,000,000	9,540,700	
	第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	50,585,000	
	第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	80,927,200	
	第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	61,500,000	
	第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	123,736,800	
	第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	393,581,200	
	第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	20,806,200	
	第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	94,192,200	
	第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	62,669,400	
	第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	116,230,400	
	第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	105,196,000	
	第７２回利付国債（２０年）	210,000,000	221,514,300	
	第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	190,254,600	
	第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	106,484,000	
	第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	105,866,000	
	第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,235,000	
	第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	53,154,500	
	第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	21,328,600	
	第８０回利付国債（２０年）	90,000,000	96,279,300	
	第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	32,143,500	
	第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	182,756,800	
	第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	10,800,400	
	第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	129,144,000	
	第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	162,775,500	
	第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	109,334,000	
	第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	98,033,400	
	第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	203,287,250	
	第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	131,342,400	
	第９０回利付国債（２０年）	170,000,000	186,915,000	

第９１回利付国債（２０年）	80,000,000	88,327,200	
第９２回利付国債（２０年）	255,000,000	280,380,150	
第９３回利付国債（２０年）	80,000,000	87,938,400	
第９４回利付国債（２０年）	140,000,000	154,603,400	
第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	207,166,700	
第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	77,641,900	
第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	145,544,100	
第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	77,980,000	
第９９回利付国債（２０年）	85,000,000	95,092,900	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	170,599,800	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	22,838,600	
第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	166,375,900	
第１０３回利付国債（２０年）	100,000,000	114,111,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	11,284,800	
第１０５回利付国債（２０年）	12,000,000	13,598,280	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	45,590,400	
第１０７回利付国債（２０年）	80,000,000	91,025,600	
第１０８回利付国債（２０年）	220,000,000	247,326,200	
第１０９回利付国債（２０年）	80,000,000	90,260,800	
第１１０回利付国債（２０年）	195,000,000	222,760,200	
第１１１回利付国債（２０年）	50,000,000	57,692,500	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	235,044,800	
第１１３回利付国債（２０年）	85,000,000	97,771,250	
第１１４回利付国債（２０年）	160,000,000	184,752,000	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	116,247,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	163,324,000	
第１１７回利付国債（２０年）	225,000,000	260,682,750	
第１１８回利付国債（２０年）	131,000,000	151,210,680	
第１１９回利付国債（２０年）	150,000,000	170,665,500	
第１２０回利付国債（２０年）	240,000,000	269,104,800	
第１２１回利付国債（２０年）	205,000,000	235,629,050	
第１２２回利付国債（２０年）	190,000,000	216,774,800	
第１２３回利付国債（２０年）	265,000,000	309,951,950	
第１２４回利付国債（２０年）	200,000,000	232,182,000	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	141,864,000	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	116,429,000	
第１２７回利付国債（２０年）	130,000,000	150,194,200	
第１２８回利付国債（２０年）	225,000,000	260,664,750	
第１２９回利付国債（２０年）	240,000,000	275,836,800	
第１３０回利付国債（２０年）	220,000,000	253,484,000	
第１３１回利付国債（２０年）	30,000,000	34,283,400	
第１３２回利付国債（２０年）	80,000,000	91,624,800	

第１３３回利付国債（２０年）	355,000,000	410,014,350	
第１３４回利付国債（２０年）	45,000,000	52,042,050	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	45,864,800	
第１３６回利付国債（２０年）	50,000,000	56,837,000	
第１３７回利付国債（２０年）	170,000,000	195,238,200	
第１３８回利付国債（２０年）	90,000,000	101,543,400	
第１３９回利付国債（２０年）	370,000,000	421,193,200	
第１４０回利付国債（２０年）	420,000,000	483,088,200	
第１４１回利付国債（２０年）	185,000,000	213,088,550	
第１４２回利付国債（２０年）	390,000,000	453,324,300	
第１４３回利付国債（２０年）	335,000,000	382,757,600	
第１４４回利付国債（２０年）	270,000,000	305,586,000	
第１４５回利付国債（２０年）	545,000,000	629,709,350	
第１４６回利付国債（２０年）	560,000,000	648,183,200	
第１４７回利付国債（２０年）	385,000,000	441,725,900	
第１４８回利付国債（２０年）	545,000,000	619,479,700	
第１４９回利付国債（２０年）	540,000,000	614,547,000	
第１５０回利付国債（２０年）	590,000,000	664,711,700	
第１５１回利付国債（２０年）	515,000,000	567,746,300	
第１５２回利付国債（２０年）	660,000,000	727,927,200	
第１５３回利付国債（２０年）	440,000,000	491,079,600	
第１５４回利付国債（２０年）	358,000,000	394,916,960	
第１５５回利付国債（２０年）	490,000,000	527,519,300	
第１５６回利付国債（２０年）	630,000,000	626,654,700	
第１５７回利付国債（２０年）	480,000,000	463,209,600	
第１５８回利付国債（２０年）	270,000,000	271,290,600	
第１５９回利付国債（２０年）	370,000,000	376,408,400	
第１６０回利付国債（２０年）	510,000,000	525,412,200	
第１６１回利付国債（２０年）	480,000,000	486,835,200	
第１６２回利付国債（２０年）	290,000,000	293,767,100	
第１６３回利付国債（２０年）	420,000,000	424,914,000	
第１６４回利付国債（２０年）	460,000,000	457,272,200	
第１６５回利付国債（２０年）	430,000,000	426,775,000	
第１６６回利付国債（２０年）	610,000,000	623,432,200	
第１６７回利付国債（２０年）	440,000,000	434,931,200	
第１６８回利付国債（２０年）	530,000,000	514,365,000	
第１６９回利付国債（２０年）	410,000,000	390,065,800	
第１７０回利付国債（２０年）	540,000,000	512,184,600	
第１７１回利付国債（２０年）	400,000,000	378,524,000	
第１７２回利付国債（２０年）	360,000,000	345,992,400	
第１７３回利付国債（２０年）	510,000,000	489,105,300	
第１７４回利付国債（２０年）	550,000,000	526,317,000	
第１７５回利付国債（２０年）	450,000,000	437,566,500	

	第１７６回利付国債（２０年）	530,000,000	514,312,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	490,000,000	466,146,800	
	第１７８回利付国債（２０年）	240,000,000	232,329,600	
	国債証券合計	96,414,000,000	100,324,584,100	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	112,983,000	
	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	101,196,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	101,518,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	99,977,000	
	第７８９回東京都公募公債	100,000,000	99,391,000	
	第８０８回東京都公募公債	100,000,000	98,863,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	99,892,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,503,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,129,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,061,000	
	第１６４回大阪府公募公債	100,000,000	99,930,000	
	第１７０回大阪府公募公債	100,000,000	99,844,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	111,437,700	
	第４４４回大阪府公募公債	100,000,000	99,224,000	
	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	98,710,000	
	第４７１回大阪府公募公債	140,000,000	137,424,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	100,183,000	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	100,371,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	100,350,000	
	令和元年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	99,390,000	
	平成２５年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	101,317,000	
	平成２６年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	101,340,000	
	平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	99,830,000	
	平成２２年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	113,920,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	99,932,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	100,451,000	
	令和３年度第１２回愛知県公募公債	100,000,000	96,139,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	100,027,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,279,000	
	第８回埼玉県公募公債	100,000,000	114,886,000	
	第１６回埼玉県公募公債	100,000,000	109,605,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	101,340,000	
	令和３年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	97,262,000	
	平成２４年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	113,414,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	101,773,000	
	第１１回千葉県公募公債	100,000,000	115,361,000	
	第１９回千葉県公募公債	100,000,000	108,936,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	100,571,000	

	第１５回千葉県公募公債	100,000,000	98,498,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,160,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,454,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,122,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,411,000	
	第１７４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,972,000	
	第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,153,000	
	第１８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,516,000	
	第１８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,654,000	
	第１９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,722,000	
	第２０７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,303,000	
	第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,039,000	
	第２１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,501,000	
	第２１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,407,000	
	令和３年度第２回堺市公募公債	100,000,000	98,733,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,567,000	
	第１１回大阪市公募公債	100,000,000	116,168,000	
	第１７回名古屋市公募公債	100,000,000	109,436,000	
	令和元年度第４回京都市公募公債	114,500,000	113,837,045	
	平成２２年度第９回神戸市公募公債	100,000,000	116,140,000	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	115,160,000	
	第２１回横浜市公募公債	100,000,000	114,367,000	
	第３７回川崎市公募公債	100,000,000	98,511,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	101,344,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,554,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	120,456,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	100,214,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	100,515,000	
	地方債証券合計	6,684,500,000	6,860,673,745	
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	100,740,000	
	第２８回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,335,000	
	第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,483,000	
	第８９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,596,000	
	第１３１回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	93,366,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,724,000	
	第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	129,758,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	105,018,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	171,123,000	
	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	100,744,000	

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	115,751,040	
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	128,776,730	
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	101,289,000	
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	101,565,000	
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	104,910,650	
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	134,497,580	
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	100,285,000	
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	100,258,000	
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	100,442,000	
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	99,969,000	
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	99,547,000	
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	98,755,000	
第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	120,418,000	
第１３回公営企業債券	100,000,000	107,062,000	
第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,511,300	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,316,000	
Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,698,000	
第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,191,400	
第９７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,798,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	214,013,880	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,586,000	
Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,912,000	
Ｆ３０５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,230,000	
Ｆ１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,025,000	
Ｆ１５１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,416,000	
第１０回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	115,242,000	
第９７回都市再生債券	100,000,000	105,834,000	
第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	110,687,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	68,088,000	67,589,595	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	72,883,000	72,541,178	
第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,389,000	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,195,000	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,597,000	79,708,435	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,704,000	79,590,820	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,358,000	81,094,400	

	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,334,000	80,201,448	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,633,000	83,321,048	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,866,000	84,972,931	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,383,000	88,728,087	
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,053,000	90,964,013	
	第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,916,000	94,111,112	
	第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,969,000	96,447,306	
	第１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,890,000	97,007,032	
	第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,400,000	97,072,584	
	第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,555,000	97,208,738	
	第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,783,000	97,565,005	
	第１７４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,128,000	98,352,819	
	第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,477,000	98,509,088	
	第２２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,134,000	
	第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	46,566,000	46,325,719	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	47,730,000	47,514,260	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	50,984,000	50,792,810	
	第３３４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,975,000	
	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,071,000	
	第３５８回信金中金債（５年）	100,000,000	99,830,000	
	第３７２回信金中金債	100,000,000	99,886,000	
	第３７６回信金中金債	100,000,000	99,836,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	101,684,000	
	第７９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,762,000	
	第８７回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,857,000	
	第８８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,789,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,855,000	
	第５２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,870,000	
	第１１６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,048,000	
	特殊債券合計	7,454,297,000	7,617,673,008	
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	99,973,000	
	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	100,029,000	
	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	98,470,000	
	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	99,759,000	
	第２７回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	98,887,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,930,000	
	第１８回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	98,443,000	
	第５４回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	98,627,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,005,000	

第２０回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,336,000	
第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,422,000	
第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,909,000	
第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第１２回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第１８回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第１７回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第５回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,697,000	
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	100,255,000	
第１９回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,989,000	
第２１回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第１４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,889,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,028,000	
第２１回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,556,000	
第７１回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,307,000	
第７３回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,293,000	
第９６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,545,000	
第８１アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,204,000	
第２０５回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,900,000	
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	100,157,000	
第７５回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第５回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,405,000	
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	99,987,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,748,000	
第１３４回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,047,000	
第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,204,000	
第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,763,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,181,000	
第３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,253,000	
第２６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,184,000	
第１０回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,199,000	
第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第５４３回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,677,000	

	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,576,000	
	第５４１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,037,000	
	第４１３回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,068,000	
	第３３８回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,769,000	
	第３４３回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,620,000	
	第５３１回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,754,000	
	第５４０回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,697,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,875,000	
	第４６２回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,345,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,992,000	
	第４７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,368,000	
	第７０回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,389,000	
	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	100,475,000	
	社債券合計	5,700,000,000	5,696,959,000	
合計			120,499,889,853	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	22,532,199
コール・ローン	1,030,902,711
国債証券	274,843,497,132
派生商品評価勘定	29,872,123
未収入金	423,617,629
未収利息	1,590,224,802
前払費用	131,710,116
流動資産合計	278,072,356,712
資産合計	278,072,356,712
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,837,766,698
未払金	25,197,015
未払解約金	1,298,108,000

	2022年 2月15日現在
未払利息	2,796
流動負債合計	3,161,074,509
負債合計	3,161,074,509
純資産の部	
元本等	
元本	274,982,026,704
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△70,744,501
元本等合計	274,911,282,203
純資産合計	274,911,282,203
負債純資産合計	278,072,356,712

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	196,943,946,160円
期中追加設定元本額	157,331,246,446円
期中一部解約元本額	79,293,165,902円
期末元本額	274,982,026,704円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	28,760,828,458円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	18,098,428,870円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,795,867,899円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	3,338,217,664円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	823,700,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	256,177,062円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	289,287,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	85,899,790円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	18,241,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	16,252,273円
リスクコントロール・オープン	393,559,188円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	2,650,868,763円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	373,850,366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）	170,812,959,352円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	1,054,884,984円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,123,769,818円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	840,251,156円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	338,003,455円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	4,333,307,042円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	6,493,922,987円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	3,964,201,136円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	2,471,331,049円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	7,949,310,734円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	1,352,421,763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）	7,670,920,283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）	16,384,005円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	2,875,085,180円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	2,011,231,309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）	10,162,450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）	42,145,535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）	1,230,898円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	3,719,323,075円
２．　計算日における受益権の総数	
	274,982,026,704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	70,744,501円
４．　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	0.9997円
(10,000口当たり純資産額)	(9,997円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

国債証券

（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）

2022年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△13,889,458,371
合計	△13,889,458,371

(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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	281,219,954,279	－	283,027,848,854	△1,807,894,575
	米ドル	135,080,023,711	－	135,087,752,968	△7,729,257
	カナダドル	5,685,100,552	－	5,680,152,522	4,948,030
	メキシコペソ	2,042,906,995	－	2,083,011,611	△40,104,616
	ユーロ	107,521,621,406	－	109,004,839,332	△1,483,217,926
	英ポンド	16,099,241,519	－	16,261,080,543	△161,839,024
	スウェーデンクローナ	791,089,555	－	790,742,400	347,155
	ノルウェークローネ	688,369,612	－	693,680,000	△5,310,388
	デンマーククローネ	1,213,259,893	－	1,230,830,855	△17,570,962
	ポーランドズロチ	1,283,352,915	－	1,307,559,204	△24,206,289
	オーストラリアドル	4,365,858,755	－	4,426,819,114	△60,960,359
	シンガポールドル	1,266,162,445	－	1,272,239,451	△6,077,006
	マレーシアリンギット	1,413,757,683	－	1,423,299,657	△9,541,974
	中国元	2,504,169,030	－	2,523,749,097	△19,580,067
	イスラエルシュケル	1,265,040,208	－	1,242,092,100	22,948,108

合計	281,219,954,279	－	283,027,848,854	△1,807,894,575

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,372,998.40	
		US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,873,270.95	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,667,487.72	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,504,713.75	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,306,019.33	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,521,581.70	
		US TREASURY N/B	3,680,000.00	3,638,212.12	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,472,109.20	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,144,931.84	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,381,761.66	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,875,359.28	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,457,070.05	

		US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,655,542.84	
		US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,802,674.17	
		US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,547,968.64	
		US TREASURY N/B	6,410,000.00	6,442,926.24	
		US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,841,804.59	
		US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,067,081.25	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,831,921.74	
		US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,872,656.00	
		US TREASURY N/B	6,250,000.00	6,157,714.37	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,158,518.59	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,257,028.71	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,982,711.25	
		US TREASURY N/B	8,650,000.00	8,492,880.53	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,094,462.72	
		US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,963,697.21	
		US TREASURY N/B	7,960,000.00	7,806,085.44	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,554,345.55	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,880,234.00	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,315,876.43	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,170,603.12	
		US TREASURY N/B	6,850,000.00	6,708,450.91	
		US TREASURY N/B	6,940,000.00	6,792,795.66	
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,323,105.56	
		US TREASURY N/B	7,130,000.00	6,986,006.79	
		US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,956,818.00	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,804,601.42	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,840,148.28	
		US TREASURY N/B	7,910,000.00	7,752,108.49	
		US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,593,238.72	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,888,867.00	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,444,105.37	
		US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,253,661.52	
		US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,848,436.80	
		US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,428,554.44	
		US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,943,624.83	

		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,751,574.05	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,268,773.39	
		US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,319,361.12	
		US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,453,290.97	
		US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,049,494.38	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,873,986.15	
		US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,989,800.00	
		US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,777,774.87	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,818,421.74	
		US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,411,450.00	
		US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,746,875.00	
		US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,404,126.48	
		US TREASURY N/B	6,080,000.00	5,915,649.69	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,337,309.28	
		US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,977,324.18	
		US TREASURY N/B	8,040,000.00	8,186,666.48	
		US TREASURY N/B	6,060,000.00	5,870,861.34	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,162,936.44	
		US TREASURY N/B	5,980,000.00	5,783,313.61	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,397,292.12	
		US TREASURY N/B	6,540,000.00	6,549,963.03	
		US TREASURY N/B	4,990,000.00	4,834,646.82	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,495,204.63	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,004,374.80	
		US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,207,855.31	
		US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,661,362.10	
		US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,649,693.55	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,450,550.00	
		US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,532,788.38	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,545,101.46	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,736,059.32	
		US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,795,194.70	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,451,856.88	
		US TREASURY N/B	3,990,000.00	3,962,724.36	
		US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,530,595.61	

		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,836,875.00	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,312,644.45	
		US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,844,543.38	
		US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,842,437.81	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,431,500.00	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,796,437.50	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,924,062.40	
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,672,706.80	
		US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,250,417.02	
		US TREASURY N/B	9,550,000.00	9,604,091.20	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,364,058.45	
		US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,056,391.04	
		US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,591,866.34	
		US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,166,060.61	
		US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,622,152.99	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,813,333.12	
		US TREASURY N/B	5,950,000.00	6,005,315.96	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,550,564.23	
		US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,047,972.97	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,181,695.18	
		US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,968,879.03	
		US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,325,585.82	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,099,460.88	
		US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,327,316.17	
		US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,945,666.35	
		US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,607,617.10	
		US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,524,542.06	
		US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,675,731.25	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,287,312.50	
		US TREASURY N/B	7,180,000.00	6,757,613.52	
		US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,641,147.83	
		US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,781,275.00	
		US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,475,788.70	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,745,953.04	
		US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,073,144.25	

		US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,896,558.48	
		US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,827,062.34	
		US TREASURY N/B	6,860,000.00	6,785,236.29	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,738,050.76	
		US TREASURY N/B	7,720,000.00	7,295,098.14	
		US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,704,939.35	
		US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,641,346.24	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,545,117.00	
		US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,335,151.67	
		US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,355,002.27	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,721,409.92	
		US TREASURY N/B	8,400,000.00	7,993,125.00	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,694,937.50	
		US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,919,823.86	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,595,328.06	
		US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,422,812.16	
		US TREASURY N/B	5,830,000.00	5,725,925.17	
		US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,202,868.50	
		US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,563,404.87	
		US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,329,117.04	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,769,128.64	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,486,925.00	
		US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,430,211.03	
		US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,761,973.29	
		US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,516,730.40	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,815,546.80	
		US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,699,493.64	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,293,750.00	
		US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,225,309.37	
		US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,617,486.25	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	961,953.10	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,623,906.04	
		US TREASURY N/B	4,180,000.00	3,886,093.75	
		US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,721,784.14	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,341,109.24	

		US TREASURY N/B	4,280,000.00	3,966,021.76	
		US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,487,969.06	
		US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,638,236.12	
		US TREASURY N/B	4,290,000.00	3,963,389.85	
		US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,294,100.26	
		US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,615,070.71	
		US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,320,441.86	
		US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,649,410.08	
		US TREASURY N/B	6,680,000.00	6,181,348.02	
		US TREASURY N/B	6,990,000.00	6,506,706.50	
		US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,106,851.27	
		US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,659,569.70	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,830,223.13	
		US TREASURY N/B	7,730,000.00	7,393,322.16	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,404,966.88	
		US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,212,577.80	
		US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,877,406.16	
		US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,445,882.74	
		US TREASURY N/B	8,390,000.00	8,837,029.26	
		US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,188,827.84	
		US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,195,867.07	
		US TREASURY N/B	6,080,000.00	5,836,324.54	
		US TREASURY N/B	6,480,000.00	6,937,396.63	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,483,819.81	
		US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,679,374.40	
		US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,882,920.29	
		US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,167,292.51	
		US TREASURY N/B	4,900,000.00	4,779,413.93	
		US TREASURY N/B	3,990,000.00	3,927,032.61	
		US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,077,038.59	
		US TREASURY N/B	780,000.00	1,033,987.50	
		US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,075,979.30	
		US TREASURY N/B	9,650,000.00	8,620,917.24	
		US TREASURY N/B	13,620,000.00	12,401,116.23	
		US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,117,200.89	

		US TREASURY N/B	10,740,000.00	9,974,775.00	
		US TREASURY N/B	11,950,000.00	11,577,495.79	
		US TREASURY N/B	13,510,000.00	12,635,015.38	
		US TREASURY N/B	9,370,000.00	8,848,061.01	
		US TREASURY N/B	540,000.00	701,894.48	
		US TREASURY N/B	130,000.00	178,678.90	
		US TREASURY N/B	690,000.00	895,841.00	
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,451,645.11	
		US TREASURY N/B	960,000.00	1,131,900.00	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,663,797.62	
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,780,001.46	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,096,000.00	
		US TREASURY N/B	780,000.00	1,052,603.83	
		US TREASURY N/B	950,000.00	1,248,693.30	
		US TREASURY N/B	4,640,000.00	3,795,737.15	
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,743,277.61	
		US TREASURY N/B	7,060,000.00	5,753,347.90	
		US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,579,947.58	
		US TREASURY N/B	7,710,000.00	6,551,090.62	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,479,289.04	
		US TREASURY N/B	7,360,000.00	6,807,712.21	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,490,275.75	
		US TREASURY N/B	7,140,000.00	7,011,702.76	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,319,118.69	
		US TREASURY N/B	8,760,000.00	7,914,112.50	
		US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,167,603.11	
		US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,950,384.36	
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,507,604.65	
		US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,181,973.78	
		US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,741,603.08	
		US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,973,416.29	
		US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,514,487.36	
		US TREASURY N/B	3,710,000.00	4,007,524.56	
		US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,936,408.11	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,783,154.51	

	US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,803,447.46	
	US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,169,535.51	
	US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,427,697.55	
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,093,452.88	
	US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,434,264.54	
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,767,285.00	
	US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,813,994.33	
	US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,021,408.48	
	US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,127,802.26	
	US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,147,816.68	
	US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,133,788.85	
	US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,423,442.13	
	US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,283,956.77	
	US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,570,307.65	
	US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,679,746.87	
	US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,346,314.20	
	US TREASURY N/B	4,650,000.00	5,236,517.52	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,189,413.95	
	US TREASURY N/B	5,090,000.00	5,744,541.93	
	US TREASURY N/B	5,530,000.00	6,678,770.67	
	US TREASURY N/B	5,280,000.00	5,985,787.10	
	US TREASURY N/B	5,190,000.00	5,759,885.87	
	US TREASURY N/B	5,670,000.00	5,576,533.45	
	US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,384,925.51	
	US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,771,932.97	
	US TREASURY N/B	6,760,000.00	5,242,960.67	
	US TREASURY N/B	7,700,000.00	6,163,608.99	
	US TREASURY N/B	7,270,000.00	6,191,994.94	
	US TREASURY N/B	8,460,000.00	7,652,333.95	
	US TREASURY N/B	8,140,000.00	8,244,929.48	
	US TREASURY N/B	8,300,000.00	7,731,968.75	
	US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,100,428.12	
	米ドル 小計	**1,155,290,000.00**	**1,140,318,902.91** **(131,615,607,773)**	
カナダドル	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,229,651.00	

		GOV OF CANADA	2,160,000.00	2,171,255.76	
		GOV OF CANADA	1,700,000.00	1,678,984.60	
		GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,332,896.74	
		GOV OF CANADA	1,550,000.00	1,524,972.15	
		GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,604,153.96	
		GOV OF CANADA	1,350,000.00	1,328,699.70	
		GOV OF CANADA	1,140,000.00	1,123,406.16	
		GOV OF CANADA	840,000.00	852,389.16	
		GOV OF CANADA	2,310,000.00	2,248,886.64	
		GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,205,155.24	
		GOV OF CANADA	810,000.00	808,395.39	
		GOV OF CANADA	1,460,000.00	1,428,767.68	
		GOV OF CANADA	840,000.00	830,298.84	
		GOV OF CANADA	560,000.00	557,154.08	
		GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,274,070.00	
		GOV OF CANADA	3,290,000.00	3,155,764.71	
		GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,129,875.98	
		GOV OF CANADA	850,000.00	842,111.15	
		GOV OF CANADA	2,190,000.00	2,116,232.04	
		GOV OF CANADA	910,000.00	885,364.48	
		GOV OF CANADA	920,000.00	884,479.72	
		GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,012,714.00	
		GOV OF CANADA	670,000.00	850,301.69	
		GOV OF CANADA	920,000.00	948,780.36	
		GOV OF CANADA	3,850,000.00	3,678,051.30	
		GOV OF CANADA	3,120,000.00	2,774,625.36	
		GOV OF CANADA	4,140,000.00	3,996,085.32	
		GOV OF CANADA	2,080,000.00	1,996,404.80	
		GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,399,034.04	
		GOV OF CANADA	690,000.00	942,747.69	
		GOV OF CANADA	960,000.00	1,229,497.92	
		GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,424,761.45	
		GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,388,996.25	
		GOV OF CANADA	4,620,000.00	4,425,502.62	
		GOV OF CANADA	1,580,000.00	1,409,036.10	

	GOV OF CANADA	620,000.00	701,555.42	
	カナダドル 小計	61,400,000.00	61,391,059.50 (5,566,941,275)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	16,030,000.00	15,918,110.60	
	UNITED MEXICAN STATE	25,090,000.00	25,168,283.30	
	UNITED MEXICAN STATE	36,900,000.00	37,067,157.00	
	UNITED MEXICAN STATE	28,720,000.00	30,302,721.86	
	UNITED MEXICAN STATE	50,780,000.00	47,231,351.41	
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	796,426.40	
	UNITED MEXICAN STATE	42,840,000.00	42,362,715.27	
	UNITED MEXICAN STATE	32,190,000.00	33,525,820.62	
	UNITED MEXICAN STATE	33,576,000.00	33,452,440.32	
	UNITED MEXICAN STATE	10,100,000.00	10,017,079.00	
	UNITED MEXICAN STATE	8,200,000.00	9,698,632.00	
	UNITED MEXICAN STATE	24,800,000.00	25,860,182.64	
	UNITED MEXICAN STATE	23,470,000.00	22,600,436.50	
	UNITED MEXICAN STATE	24,210,000.00	23,914,625.89	
	メキシコペソ 小計	357,786,000.00	357,915,982.81 (2,024,480,173)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	610,000.00	613,581.92	
	GOV OF AUSTRIA	1,160,000.00	1,167,458.80	
	GOV OF AUSTRIA	1,390,000.00	1,439,607.71	
	GOV OF AUSTRIA	1,230,000.00	1,235,795.76	
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,269,774.00	
	GOV OF AUSTRIA	600,000.00	600,448.80	
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,398,926.50	
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,234,575.51	
	GOV OF AUSTRIA	1,840,000.00	1,890,956.96	
	GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,370,622.60	
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,622,719.56	
	GOV OF AUSTRIA	1,120,000.00	1,149,308.16	
	GOV OF AUSTRIA	1,380,000.00	1,388,914.80	
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,276,173.57	
	GOV OF AUSTRIA	1,370,000.00	1,298,205.53	
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,238,512.17	

		GOV OF AUSTRIA	730,000.00	669,607.10	
		GOV OF AUSTRIA	1,620,000.00	2,413,829.16	
		GOV OF AUSTRIA	420,000.00	355,616.10	
		GOV OF AUSTRIA	870,000.00	1,282,797.60	
		GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,112,349.00	
		GOV OF AUSTRIA	710,000.00	669,420.66	
		GOV OF AUSTRIA	410,000.00	773,794.23	
		GOV OF AUSTRIA	350,000.00	282,233.35	
		GOV OF AUSTRIA	440,000.00	317,856.20	
		GOV OF AUSTRIA	690,000.00	917,858.70	
		GOV OF AUSTRIA	310,000.00	342,504.12	
		GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,596,153.02	
		GOV OF BELGIUM	1,160,000.00	1,171,232.28	
		GOV OF BELGIUM	1,710,000.00	1,824,352.83	
		GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,446,275.68	
		GOV OF BELGIUM	2,490,000.00	2,558,056.68	
		GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,420,831.20	
		GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,094,756.16	
		GOV OF BELGIUM	1,660,000.00	1,707,484.30	
		GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,130,684.60	
		GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,338,223.10	
		GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,295,298.86	
		GOV OF BELGIUM	2,030,000.00	2,098,356.19	
		GOV OF BELGIUM	1,510,000.00	1,456,919.87	
		GOV OF BELGIUM	2,100,000.00	2,174,760.00	
		GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	1,357,658.20	
		GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,505,057.17	
		GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,222,920.45	
		GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,173,916.68	
		GOV OF BELGIUM	2,270,000.00	3,463,323.11	
		GOV OF BELGIUM	450,000.00	484,249.50	
		GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,124,501.00	
		GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,100,412.73	
		GOV OF BELGIUM	1,970,000.00	3,069,061.03	
		GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,944,893.16	

		GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,385,462.05	
		GOV OF BELGIUM	1,280,000.00	1,421,644.80	
		GOV OF BELGIUM	700,000.00	885,503.50	
		GOV OF BELGIUM	800,000.00	1,011,768.00	
		GOV OF BELGIUM	590,000.00	428,105.70	
		GOV OF FINLAND	530,000.00	542,330.45	
		GOV OF FINLAND	660,000.00	664,583.04	
		GOV OF FINLAND	610,000.00	640,823.91	
		GOV OF FINLAND	460,000.00	462,325.76	
		GOV OF FINLAND	520,000.00	591,972.16	
		GOV OF FINLAND	670,000.00	691,421.24	
		GOV OF FINLAND	840,000.00	854,709.24	
		GOV OF FINLAND	500,000.00	496,464.50	
		GOV OF FINLAND	910,000.00	924,762.02	
		GOV OF FINLAND	470,000.00	544,087.51	
		GOV OF FINLAND	510,000.00	515,004.63	
		GOV OF FINLAND	920,000.00	926,409.36	
		GOV OF FINLAND	360,000.00	344,214.97	
		GOV OF FINLAND	490,000.00	499,388.40	
		GOV OF FINLAND	690,000.00	660,085.74	
		GOV OF FINLAND	390,000.00	410,072.91	
		GOV OF FINLAND	580,000.00	528,685.08	
		GOV OF FINLAND	470,000.00	422,149.77	
		GOV OF FINLAND	600,000.00	808,989.00	
		GOV OF FINLAND	470,000.00	531,200.11	
		GOV OF FINLAND	410,000.00	328,532.50	
		GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,132,175.16	
		GOV OF FRANCE	5,110,000.00	5,140,711.10	
		GOV OF FRANCE	6,280,000.00	6,460,330.20	
		GOV OF FRANCE	4,330,000.00	4,671,896.80	
		GOV OF FRANCE	3,880,000.00	3,903,640.84	
		GOV OF FRANCE	4,450,000.00	4,474,906.65	
		GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,164,162.36	
		GOV OF FRANCE	4,620,000.00	4,864,236.30	
		GOV OF FRANCE	4,650,000.00	4,656,384.45	

		GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,340,877.50	
		GOV OF FRANCE	3,250,000.00	3,973,329.75	
		GOV OF FRANCE	5,060,000.00	5,237,287.22	
		GOV OF FRANCE	4,610,000.00	4,586,470.56	
		GOV OF FRANCE	5,800,000.00	6,624,539.60	
		GOV OF FRANCE	5,000,000.00	5,073,480.00	
		GOV OF FRANCE	4,410,000.00	4,417,130.97	
		GOV OF FRANCE	1,830,000.00	1,806,502.80	
		GOV OF FRANCE	4,430,000.00	4,602,061.20	
		GOV OF FRANCE	6,560,000.00	7,483,516.80	
		GOV OF FRANCE	5,660,000.00	5,800,549.12	
		GOV OF FRANCE	5,920,000.00	6,056,811.20	
		GOV OF FRANCE	4,750,000.00	6,467,144.00	
		GOV OF FRANCE	4,350,000.00	4,364,885.70	
		GOV OF FRANCE	5,340,000.00	5,134,084.26	
		GOV OF FRANCE	5,930,000.00	6,889,592.60	
		GOV OF FRANCE	5,970,000.00	5,660,551.02	
		GOV OF FRANCE	6,120,000.00	6,602,684.40	
		GOV OF FRANCE	4,640,000.00	4,335,903.68	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	111,197.40	
		GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,310,817.28	
		GOV OF FRANCE	4,110,000.00	4,312,906.59	
		GOV OF FRANCE	3,510,000.00	5,247,148.14	
		GOV OF FRANCE	4,660,000.00	4,885,078.00	
		GOV OF FRANCE	3,480,000.00	5,161,772.64	
		GOV OF FRANCE	3,730,000.00	4,249,715.82	
		GOV OF FRANCE	1,930,000.00	1,769,707.71	
		GOV OF FRANCE	4,280,000.00	6,926,221.28	
		GOV OF FRANCE	1,200,000.00	1,063,927.20	
		GOV OF FRANCE	3,150,000.00	4,556,821.50	
		GOV OF FRANCE	2,980,000.00	3,573,878.24	
		GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,244,963.88	
		GOV OF FRANCE	3,580,000.00	3,151,073.04	
		GOV OF FRANCE	900,000.00	781,892.10	
		GOV OF FRANCE	2,370,000.00	4,163,253.39	

		GOV OF FRANCE	2,040,000.00	3,731,576.16	
		GOV OF FRANCE	1,590,000.00	1,814,003.97	
		GOV OF FRANCE	1,110,000.00	758,083.38	
		GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,390,204.70	
		GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,143,688.65	
		GOV OF GERMANY	1,710,000.00	1,722,071.91	
		GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,575,736.90	
		GOV OF GERMANY	1,940,000.00	1,954,129.02	
		GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,752,433.10	
		GOV OF GERMANY	1,660,000.00	1,672,592.42	
		GOV OF GERMANY	2,500,000.00	2,521,902.50	
		GOV OF GERMANY	1,690,000.00	1,703,182.00	
		GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,641,097.36	
		GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,154,695.70	
		GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,063,315.36	
		GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,901,479.55	
		GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,779,165.44	
		GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,006,620.40	
		GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,465,356.60	
		GOV OF GERMANY	3,190,000.00	3,318,289.04	
		GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,336,455.57	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	352,518.67	
		GOV OF GERMANY	3,660,000.00	3,746,551.68	
		GOV OF GERMANY	1,640,000.00	1,645,592.40	
		GOV OF GERMANY	3,670,000.00	3,679,266.75	
		GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,944,398.24	
		GOV OF GERMANY	3,450,000.00	3,493,539.00	
		GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,271,862.32	
		GOV OF GERMANY	3,050,000.00	3,126,869.15	
		GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,801,749.84	
		GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,304,962.04	
		GOV OF GERMANY	3,640,000.00	3,733,537.08	
		GOV OF GERMANY	1,630,000.00	2,122,494.72	
		GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,971,684.38	
		GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,503,403.76	

		GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,445,242.35	
		GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,190,385.66	
		GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,710,752.65	
		GOV OF GERMANY	3,040,000.00	3,003,906.08	
		GOV OF GERMANY	2,870,000.00	2,827,658.89	
		GOV OF GERMANY	700,000.00	692,727.00	
		GOV OF GERMANY	2,370,000.00	3,504,722.82	
		GOV OF GERMANY	3,090,000.00	3,034,392.36	
		GOV OF GERMANY	3,170,000.00	3,099,321.68	
		GOV OF GERMANY	750,000.00	735,266.25	
		GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,437,535.50	
		GOV OF GERMANY	2,260,000.00	2,158,424.30	
		GOV OF GERMANY	2,440,000.00	2,312,063.20	
		GOV OF GERMANY	3,160,000.00	4,887,884.84	
		GOV OF GERMANY	2,230,000.00	3,725,440.23	
		GOV OF GERMANY	2,430,000.00	4,365,232.56	
		GOV OF GERMANY	2,450,000.00	3,866,908.50	
		GOV OF GERMANY	3,050,000.00	4,476,054.95	
		GOV OF GERMANY	3,560,000.00	5,342,388.76	
		GOV OF GERMANY	3,470,000.00	4,190,989.66	
		GOV OF GERMANY	4,030,000.00	3,543,635.42	
		GOV OF GERMANY	780,000.00	674,212.50	
		GOV OF IRELAND	830,000.00	869,333.70	
		GOV OF IRELAND	920,000.00	989,682.44	
		GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,575,765.90	
		GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,366,679.16	
		GOV OF IRELAND	770,000.00	766,735.20	
		GOV OF IRELAND	890,000.00	920,170.11	
		GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,312,676.82	
		GOV OF IRELAND	1,160,000.00	1,336,470.80	
		GOV OF IRELAND	740,000.00	714,344.20	
		GOV OF IRELAND	760,000.00	810,166.84	
		GOV OF IRELAND	1,150,000.00	1,070,905.30	
		GOV OF IRELAND	180,000.00	171,014.76	
		GOV OF IRELAND	500,000.00	524,513.00	

		GOV OF IRELAND	720,000.00	672,449.76	
		GOV OF IRELAND	730,000.00	803,620.50	
		GOV OF IRELAND	460,000.00	418,291.80	
		GOV OF IRELAND	1,130,000.00	1,341,401.53	
		GOV OF IRELAND	820,000.00	868,645.68	
		GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,852,992.12	
		GOV OF ITALY	2,290,000.00	2,319,055.52	
		GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,049,687.60	
		GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,342,889.12	
		GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,684,903.07	
		GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,270,357.58	
		GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,274,771.17	
		GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,341,659.52	
		GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,730,916.50	
		GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,511,374.00	
		GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,147,508.00	
		GOV OF ITALY	2,070,000.00	2,051,285.13	
		GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,961,233.20	
		GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,079,115.30	
		GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,332,363.73	
		GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,368,485.00	
		GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,096,711.91	
		GOV OF ITALY	2,420,000.00	2,547,370.15	
		GOV OF ITALY	600,000.00	588,723.00	
		GOV OF ITALY	2,410,000.00	2,388,447.37	
		GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,655,746.04	
		GOV OF ITALY	2,160,000.00	2,209,410.00	
		GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,315,709.00	
		GOV OF ITALY	2,460,000.00	2,547,175.02	
		GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,163,199.68	
		GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,407,597.50	
		GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,358,864.00	
		GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,037,485.92	
		GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,216,380.78	
		GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,285,192.50	

		GOV OF ITALY	2,170,000.00	2,269,689.80	
		GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,715,059.80	
		GOV OF ITALY	3,120,000.00	3,142,214.40	
		GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,246,479.44	
		GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,710,839.54	
		GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,083,628.00	
		GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,613,315.40	
		GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,322,740.72	
		GOV OF ITALY	3,190,000.00	3,311,258.28	
		GOV OF ITALY	2,110,000.00	1,969,066.34	
		GOV OF ITALY	1,450,000.00	1,365,834.75	
		GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,210,276.86	
		GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,769,810.00	
		GOV OF ITALY	730,000.00	676,688.10	
		GOV OF ITALY	2,640,000.00	2,907,498.00	
		GOV OF ITALY	3,280,000.00	4,165,695.12	
		GOV OF ITALY	2,930,000.00	3,344,331.30	
		GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,700,978.24	
		GOV OF ITALY	2,010,000.00	1,884,244.35	
		GOV OF ITALY	2,620,000.00	2,588,303.24	
		GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,137,065.68	
		GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,239,957.80	
		GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,049,537.13	
		GOV OF ITALY	2,180,000.00	1,997,311.64	
		GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,136,683.40	
		GOV OF ITALY	400,000.00	362,762.40	
		GOV OF ITALY	2,530,000.00	3,496,138.69	
		GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,678,382.30	
		GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,645,452.18	
		GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,143,603.44	
		GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,531,286.92	
		GOV OF ITALY	1,810,000.00	1,842,335.65	
		GOV OF ITALY	3,360,000.00	4,159,441.44	
		GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,501,614.90	
		GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,065,714.20	

		GOV OF ITALY	2,270,000.00	3,183,173.33	
		GOV OF ITALY	1,470,000.00	1,652,838.60	
		GOV OF ITALY	2,430,000.00	3,441,730.50	
		GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,517,736.00	
		GOV OF ITALY	2,070,000.00	2,935,705.05	
		GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,218,692.16	
		GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,344,014.61	
		GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,138,818.15	
		GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,229,443.92	
		GOV OF ITALY	1,590,000.00	2,025,068.52	
		GOV OF ITALY	1,870,000.00	1,848,186.45	
		GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,254,820.50	
		GOV OF ITALY	620,000.00	569,154.42	
		GOV OF ITALY	1,130,000.00	1,135,801.42	
		GOV OF ITALY	560,000.00	472,245.20	
		GOV OF NETHERLANDS	2,140,000.00	2,209,603.50	
		GOV OF NETHERLANDS	1,830,000.00	1,843,219.92	
		GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,035,910.68	
		GOV OF NETHERLANDS	2,290,000.00	2,314,434.30	
		GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	299,329.80	
		GOV OF NETHERLANDS	2,090,000.00	2,130,378.80	
		GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,896,475.29	
		GOV OF NETHERLANDS	1,840,000.00	1,899,577.36	
		GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,956,781.24	
		GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,694,718.60	
		GOV OF NETHERLANDS	840,000.00	821,239.44	
		GOV OF NETHERLANDS	1,400,000.00	1,393,918.40	
		GOV OF NETHERLANDS	1,610,000.00	1,560,840.26	
		GOV OF NETHERLANDS	1,460,000.00	1,400,890.44	
		GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,352,348.94	
		GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,896,885.60	
		GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	790,127.04	
		GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,189,008.00	
		GOV OF NETHERLANDS	2,080,000.00	3,332,114.24	
		GOV OF NETHERLANDS	2,360,000.00	3,565,783.00	

		GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	992,278.80	
		GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,397,096.39	
		GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,450,217.48	
		GOV OF SPAIN	2,560,000.00	2,581,713.92	
		GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,791,177.47	
		GOV OF SPAIN	1,790,000.00	1,959,763.60	
		GOV OF SPAIN	2,750,000.00	2,982,100.00	
		GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,217,058.50	
		GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,080,281.69	
		GOV OF SPAIN	2,310,000.00	2,476,852.68	
		GOV OF SPAIN	2,540,000.00	2,526,608.09	
		GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,548,397.00	
		GOV OF SPAIN	2,610,000.00	2,997,650.25	
		GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,060,499.12	
		GOV OF SPAIN	2,170,000.00	2,132,391.73	
		GOV OF SPAIN	2,540,000.00	2,698,444.68	
		GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,087,196.62	
		GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,171,991.41	
		GOV OF SPAIN	620,000.00	600,404.28	
		GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,790,630.60	
		GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,504,915.10	
		GOV OF SPAIN	2,760,000.00	2,876,781.12	
		GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,121,183.79	
		GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,308,908.78	
		GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,104,959.52	
		GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,615,698.20	
		GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,568,171.20	
		GOV OF SPAIN	2,730,000.00	2,838,503.85	
		GOV OF SPAIN	2,820,000.00	2,753,039.10	
		GOV OF SPAIN	2,120,000.00	2,040,500.00	
		GOV OF SPAIN	2,890,000.00	3,109,680.46	
		GOV OF SPAIN	2,870,000.00	2,915,498.11	
		GOV OF SPAIN	2,280,000.00	2,075,985.60	
		GOV OF SPAIN	2,640,000.00	2,469,583.77	
		GOV OF SPAIN	1,120,000.00	1,057,882.56	

		GOV OF SPAIN	2,650,000.00	3,836,020.75	
		GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,555,750.80	
		GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,381,384.36	
		GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,575,008.35	
		GOV OF SPAIN	820,000.00	737,276.76	
		GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,182,475.96	
		GOV OF SPAIN	2,340,000.00	2,162,178.72	
		GOV OF SPAIN	2,470,000.00	3,744,986.83	
		GOV OF SPAIN	410,000.00	362,186.62	
		GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,876,672.40	
		GOV OF SPAIN	2,110,000.00	2,590,674.88	
		GOV OF SPAIN	1,750,000.00	2,076,093.25	
		GOV OF SPAIN	2,290,000.00	1,847,022.40	
		GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,320,759.80	
		GOV OF SPAIN	530,000.00	399,016.86	
	ユーロ 小計		733,850,000.00	806,136,683.36 (105,249,205,379)	
	英ポンド	UK TREASURY	3,920,000.00	3,875,573.85	
		UK TREASURY	2,250,000.00	2,230,503.07	
		UK TREASURY	1,760,000.00	1,782,066.88	
		UK TREASURY	3,730,000.00	3,632,629.09	
		UK TREASURY	1,260,000.00	1,247,990.43	
		UK TREASURY	1,330,000.00	1,372,206.75	
		UK TREASURY	1,420,000.00	1,369,235.00	
		UK TREASURY	1,040,000.00	1,149,307.74	
		UK TREASURY	1,300,000.00	1,266,265.00	
		UK TREASURY	1,810,000.00	1,843,988.18	
		UK TREASURY	1,560,000.00	1,482,680.16	
		UK TREASURY	1,470,000.00	1,475,356.68	
		UK TREASURY	1,770,000.00	1,681,473.09	
		UK TREASURY	1,610,000.00	1,595,542.20	
		UK TREASURY	1,480,000.00	1,710,504.08	
		UK TREASURY	1,270,000.00	1,175,092.90	
		UK TREASURY	1,360,000.00	1,376,360.80	
		UK TREASURY	1,210,000.00	1,565,295.20	

		UK TREASURY	1,080,000.00	1,008,355.17	
		UK TREASURY	1,590,000.00	1,521,884.40	
		UK TREASURY	2,110,000.00	1,915,940.34	
		UK TREASURY	1,430,000.00	1,812,610.80	
		UK TREASURY	2,780,000.00	2,459,327.00	
		UK TREASURY	2,060,000.00	2,577,369.00	
		UK TREASURY	1,010,000.00	931,386.85	
		UK TREASURY	1,350,000.00	1,782,472.50	
		UK TREASURY	2,010,000.00	1,749,185.61	
		UK TREASURY	1,900,000.00	2,512,035.60	
		UK TREASURY	2,180,000.00	2,190,267.80	
		UK TREASURY	1,710,000.00	2,479,500.00	
		UK TREASURY	530,000.00	483,354.70	
		UK TREASURY	1,680,000.00	2,333,501.18	
		UK TREASURY	1,520,000.00	2,142,485.60	
		UK TREASURY	2,440,000.00	2,246,142.00	
		UK TREASURY	2,170,000.00	3,230,565.80	
		UK TREASURY	2,180,000.00	2,791,880.65	
		UK TREASURY	1,970,000.00	2,638,275.61	
		UK TREASURY	1,020,000.00	852,899.52	
		UK TREASURY	1,990,000.00	3,012,263.00	
		UK TREASURY	2,110,000.00	2,030,368.60	
		UK TREASURY	1,190,000.00	1,212,514.80	
		UK TREASURY	1,410,000.00	2,219,763.00	
		UK TREASURY	870,000.00	670,169.70	
		UK TREASURY	1,040,000.00	940,368.00	
		UK TREASURY	1,450,000.00	2,179,437.00	
		UK TREASURY	570,000.00	554,895.00	
		UK TREASURY	1,290,000.00	1,291,728.60	
		UK TREASURY	1,860,000.00	3,135,402.00	
		UK TREASURY	2,020,000.00	2,114,111.80	
		UK TREASURY	1,410,000.00	2,406,554.72	
		UK TREASURY	1,580,000.00	1,110,740.00	
		UK TREASURY	1,620,000.00	2,146,014.00	
		UK TREASURY	1,630,000.00	2,734,585.80	

	UK TREASURY	1,450,000.00	1,562,114.00	
英ポンド 小計		89,760,000.00	100,812,541.25 (15,750,951,444)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,580,000.00	10,859,489.74	
	GOV OF SWEDEN	9,680,000.00	10,367,414.54	
	GOV OF SWEDEN	9,470,000.00	9,707,034.10	
	GOV OF SWEDEN	7,110,000.00	7,198,057.35	
	GOV OF SWEDEN	6,740,000.00	6,826,272.00	
	GOV OF SWEDEN	6,300,000.00	6,033,022.37	
	GOV OF SWEDEN	4,350,000.00	5,050,371.75	
	GOV OF SWEDEN	4,860,000.00	7,000,649.20	
スウェーデンクローナ 小計		59,090,000.00	63,042,311.05 (775,420,425)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	9,520,000.00	9,594,256.00	
	GOV OF NORWAY	7,500,000.00	7,689,050.99	
	GOV OF NORWAY	6,490,000.00	6,452,552.70	
	GOV OF NORWAY	4,380,000.00	4,293,495.00	
	GOV OF NORWAY	5,870,000.00	5,785,589.40	
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,317,179.50	
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,286,559.60	
	GOV OF NORWAY	6,950,000.00	6,554,440.75	
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,248,856.00	
ノルウェークローネ 小計		52,970,000.00	52,221,979.94 (678,885,739)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,840,000.00	6,025,980.64	
	GOV OF DENMARK	4,310,000.00	4,316,292.60	
	GOV OF DENMARK	6,170,000.00	6,546,867.30	
	GOV OF DENMARK	8,370,000.00	8,462,296.82	
	GOV OF DENMARK	10,150,000.00	10,226,835.50	
	GOV OF DENMARK	5,860,000.00	5,550,037.05	
	GOV OF DENMARK	13,030,000.00	21,711,477.24	
	GOV OF DENMARK	5,550,000.00	4,987,174.50	
デンマーククローネ 小計		59,280,000.00	67,826,961.65 (1,189,684,907)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,162,563.00	
	GOV OF POLAND	3,910,000.00	3,813,926.60	

		GOV OF POLAND	1,980,000.00	1,828,907.38	
		GOV OF POLAND	4,480,000.00	4,315,181.24	
		GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,139,444.80	
		GOV OF POLAND	4,450,000.00	4,358,366.48	
		GOV OF POLAND	5,820,000.00	5,485,195.18	
		GOV OF POLAND	2,380,000.00	2,006,127.22	
		GOV OF POLAND	3,590,000.00	3,320,453.82	
		GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,113,473.00	
		GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,244,399.73	
		GOV OF POLAND	4,550,000.00	4,165,980.00	
		GOV OF POLAND	4,000,000.00	3,211,533.19	
		ポーランドズロチ 小計	48,290,000.00	45,165,551.64 (1,296,273,914)	
	オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	2,500,000.00	2,640,564.50	
		GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,665,926.57	
		GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	2,661,310.29	
		GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,175,766.85	
		GOV OF AUSTRALIA	1,640,000.00	1,552,165.03	
		GOV OF AUSTRALIA	2,200,000.00	2,419,170.16	
		GOV OF AUSTRALIA	1,890,000.00	1,780,010.87	
		GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,604,598.58	
		GOV OF AUSTRALIA	1,870,000.00	1,954,581.97	
		GOV OF AUSTRALIA	1,560,000.00	1,585,740.62	
		GOV OF AUSTRALIA	1,460,000.00	1,529,405.62	
		GOV OF AUSTRALIA	2,270,000.00	2,456,120.93	
		GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	1,837,565.80	
		GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,798,010.50	
		GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,078,567.01	
		GOV OF AUSTRALIA	2,860,000.00	2,713,554.84	
		GOV OF AUSTRALIA	2,880,000.00	2,596,404.67	
		GOV OF AUSTRALIA	2,670,000.00	2,453,200.53	
		GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	1,893,758.04	
		GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	2,428,639.64	
		GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,052,414.10	
		GOV OF AUSTRALIA	1,390,000.00	1,630,305.84	

	GOV OF AUSTRALIA	1,230,000.00	1,355,262.95	
	GOV OF AUSTRALIA	1,370,000.00	1,400,656.89	
	GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,699,587.64	
	GOV OF AUSTRALIA	1,770,000.00	1,431,862.20	
オーストラリアドル 小計		51,560,000.00	52,395,152.64 (4,312,645,013)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,108,419.29	
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	930,821.89	
	GOV OF SINGAPORE	710,000.00	721,253.50	
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	947,037.00	
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	391,362.00	
	GOV OF SINGAPORE	700,000.00	674,100.00	
	GOV OF SINGAPORE	820,000.00	836,236.00	
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	362,085.70	
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	942,732.00	
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	648,396.00	
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	843,720.00	
	GOV OF SINGAPORE	970,000.00	1,042,071.00	
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	321,403.56	
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	693,265.00	
	GOV OF SINGAPORE	930,000.00	947,614.20	
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	394,440.00	
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	686,398.90	
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	876,900.00	
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	712,880.00	
	GOV OF SINGAPORE	280,000.00	265,858.60	
シンガポールドル 小計		13,850,000.00	14,346,994.64 (1,229,393,970)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,640,400.88	
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	835,932.76	
	GOV OF MALAYSIA	1,530,000.00	1,563,023.21	
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,582,924.98	
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,513,870.53	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,295,829.86	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	748,963.28	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,119,034.73	

		GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,578,920.77	
		GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,219,846.15	
		GOV OF MALAYSIA	2,960,000.00	3,034,667.48	
		GOV OF MALAYSIA	700,000.00	715,706.88	
		GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,791,820.07	
		GOV OF MALAYSIA	1,890,000.00	1,926,548.63	
		GOV OF MALAYSIA	3,130,000.00	3,153,267.16	
		GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,491,567.21	
		GOV OF MALAYSIA	1,690,000.00	1,778,076.53	
		GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,690,862.81	
		GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,791,153.77	
		GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,395,303.99	
		GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,168,681.69	
		GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,052,875.37	
		GOV OF MALAYSIA	2,360,000.00	2,401,673.34	
		GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,733,123.14	
		GOV OF MALAYSIA	890,000.00	961,142.59	
		GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,555,136.40	
		GOV OF MALAYSIA	860,000.00	921,615.47	
		GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,220,646.51	
		GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,356,791.04	
		GOV OF MALAYSIA	2,270,000.00	2,123,001.61	
		マレーシアリンギット 小計	51,690,000.00	52,362,408.84 (1,443,160,350)	
中国元		GOV OF CHINA	7,000,000.00	7,036,781.50	
		GOV OF CHINA	3,820,000.00	3,830,099.31	
		GOV OF CHINA	8,080,000.00	8,125,935.60	
		GOV OF CHINA	8,600,000.00	8,694,987.00	
		GOV OF CHINA	10,250,000.00	10,371,513.75	
		GOV OF CHINA	4,300,000.00	4,315,723.38	
		GOV OF CHINA	7,800,000.00	7,697,937.00	
		GOV OF CHINA	3,600,000.00	3,668,292.00	
		GOV OF CHINA	11,540,000.00	11,767,857.30	
		GOV OF CHINA	11,000,000.00	11,076,395.00	
		GOV OF CHINA	8,200,000.00	8,305,012.48	

		GOV OF CHINA	5,470,000.00	5,666,011.98	
		GOV OF CHINA	4,000,000.00	4,064,752.00	
		GOV OF CHINA	5,000,000.00	5,040,850.00	
		GOV OF CHINA	11,350,000.00	11,176,685.50	
		GOV OF CHINA	5,500,000.00	5,697,176.65	
		GOV OF CHINA	4,110,000.00	4,166,944.05	
		GOV OF CHINA	8,670,000.00	9,370,570.68	
		GOV OF CHINA	3,600,000.00	3,811,897.80	
		GOV OF CHINA	2,650,000.00	2,737,901.03	
	中国元 小計		134,540,000.00	136,623,324.01 (2,480,328,135)	
	イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	2,150,000.00	2,326,622.50	
		GOV OF ISRAEL	2,310,000.00	2,303,532.00	
		GOV OF ISRAEL	2,020,000.00	2,062,218.00	
		GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,605,578.00	
		GOV OF ISRAEL	900,000.00	892,485.00	
		GOV OF ISRAEL	2,840,000.00	2,820,546.00	
		GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,908,172.00	
		GOV OF ISRAEL	860,000.00	851,658.00	
		GOV OF ISRAEL	1,970,000.00	2,477,373.50	
		GOV OF ISRAEL	2,350,000.00	2,491,352.50	
		GOV OF ISRAEL	2,190,000.00	2,348,775.00	
		GOV OF ISRAEL	2,740,000.00	2,651,087.00	
		GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	1,945,009.50	
		GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	3,164,008.50	
		GOV OF ISRAEL	3,150,000.00	3,860,325.00	
	イスラエルシュケル 小計		31,950,000.00	34,708,742.50 (1,230,518,635)	
合計				274,843,497,132 (274,843,497,132)	

(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	254銘柄	100.0%	48.0%
カナダドル	国債証券	37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	346銘柄	100.0%	38.4%
英ポンド	国債証券	54銘柄	100.0%	5.7%
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	20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	20銘柄	100.0%	0.9%
イスラエルシュケル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	614,831,758
株式	66,768,676,480
未収配当金	96,280,092

	2022年 2月15日現在
前払金	14,895,000
差入委託証拠金	26,235,000
流動資産合計	67,520,918,330
資産合計	67,520,918,330
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,381,450
未払解約金	60,048,000
未払利息	1,667
流動負債合計	81,431,117
負債合計	81,431,117
純資産の部	
元本等	
元本	48,136,209,431
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,303,277,782
元本等合計	67,439,487,213
純資産合計	67,439,487,213
負債純資産合計	67,520,918,330

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）

2022年 2月15日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	34,885,495,332円
期中追加設定元本額	44,296,695,518円
期中一部解約元本額	31,045,981,419円
期末元本額	48,136,209,431円
期末元本の内訳※	

りそなラップ型ファンド（安定型）	4,265,982,166円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,957,298,501円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,506,204,074円
ＤＣりそな　グローバルバランス	77,325,043円
つみたてバランスファンド	4,260,942,297円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	407,560,356円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	243,611,838円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	162,000,937円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	57,148,801円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	35,839,672円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	19,061,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	33,584,286円
リスクコントロール・オープン	10,031,382円
ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	480,744,964円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	25,406,659,097円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	1,854,963,960円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	81,328,277円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	218,162,822円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	256,467,235円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	110,102,376円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	161,858,380円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	98,804,963円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	62,822,415円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	203,787,508円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	34,609,164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）	5,845,899円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	519,963,732円
りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	943,025,990円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	676,460,355円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	875,630,730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）	1,635,577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）	13,037,222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）	12,030,539円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	81,677,055円
２．　計算日における受益権の総数	
	48,136,209,431口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4010円
(10,000口当たり純資産額)	(14,010円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2 .金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3 .金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	618,024,828
合計	618,024,828

(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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	767,256,450	－	745,875,000	△21,381,450
合計		767,256,450	－	745,875,000	△21,381,450

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,200	3,215.00	3,858,000	
日本水産	34,600	558.00	19,306,800	

マルハニチロ	5,400	2,630.00	14,202,000	
雪国まいたけ	2,500	1,236.00	3,090,000	
カネコ種苗	1,000	1,563.00	1,563,000	
サカタのタネ	4,100	3,450.00	14,145,000	
ホクト	2,900	1,968.00	5,707,200	
ホクリヨウ	500	687.00	343,500	
住石ホールディングス	6,100	136.00	829,600	
日鉄鉱業	800	6,460.00	5,168,000	
三井松島ホールディングス	1,400	1,710.00	2,394,000	
ＩＮＰＥＸ	139,000	1,178.00	163,742,000	
石油資源開発	4,100	2,833.00	11,615,300	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,600	1,566.00	2,505,600	
ヒノキヤグループ	800	2,362.00	1,889,600	
ショーボンドホールディングス	4,900	5,140.00	25,186,000	
ミライト・ホールディングス	11,200	1,951.00	21,851,200	
タマホーム	2,100	2,397.00	5,033,700	
サンヨーホームズ	400	745.00	298,000	
日本アクア	1,400	580.00	812,000	
ファーストコーポレーション	800	705.00	564,000	
ベステラ	700	1,288.00	901,600	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	5,700	218.00	1,242,600	
キャンディル	600	490.00	294,000	
スペースバリューホールディングス	800	1,145.00	916,000	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,105.00	773,500	
第一カッター興業	900	1,378.00	1,240,200	
安藤・間	17,200	910.00	15,652,000	
東急建設	10,100	711.00	7,181,100	
コムシスホールディングス	11,200	2,758.00	30,889,600	
ビーアールホールディングス	4,700	346.00	1,626,200	
高松コンストラクショングループ	2,200	2,002.00	4,404,400	
東建コーポレーション	1,000	9,260.00	9,260,000	
ソネック	400	1,015.00	406,000	
ヤマウラ	1,700	999.00	1,698,300	
オリエンタル白石	11,600	243.00	2,818,800	
大成建設	23,100	3,795.00	87,664,500	
大林組	80,000	975.00	78,000,000	
清水建設	74,900	788.00	59,021,200	
飛島建設	2,100	1,091.00	2,291,100	
長谷工コーポレーション	23,800	1,513.00	36,009,400	
松井建設	3,100	751.00	2,328,100	
錢高組	300	4,040.00	1,212,000	
鹿島建設	58,600	1,534.00	89,892,400	

不動テトラ	1,700	1,540.00	2,618,000	
大末建設	800	1,333.00	1,066,400	
鉄建建設	1,700	1,883.00	3,201,100	
西松建設	4,800	3,790.00	18,192,000	
三井住友建設	18,000	438.00	7,884,000	
大豊建設	1,200	3,640.00	4,368,000	
佐田建設	1,700	469.00	797,300	
ナカノフドー建設	1,900	346.00	657,400	
奥村組	4,700	3,255.00	15,298,500	
東鉄工業	3,700	2,466.00	9,124,200	
イチケン	600	1,927.00	1,156,200	
富士ピー・エス	1,000	496.00	496,000	
淺沼組	900	5,330.00	4,797,000	
戸田建設	33,200	770.00	25,564,000	
熊谷組	4,100	2,967.00	12,164,700	
北野建設	500	2,173.00	1,086,500	
植木組	700	1,528.00	1,069,600	
矢作建設工業	3,500	787.00	2,754,500	
ピーエス三菱	2,600	606.00	1,575,600	
日本ハウスホールディングス	5,500	461.00	2,535,500	
大東建託	8,200	12,910.00	105,862,000	
新日本建設	3,400	755.00	2,567,000	
ＮＩＰＰＯ	1,900	3,990.00	7,581,000	
東亜道路工業	400	4,975.00	1,990,000	
日本道路	800	9,800.00	7,840,000	
東亜建設工業	2,000	2,667.00	5,334,000	
日本国土開発	7,800	531.00	4,141,800	
若築建設	1,300	1,901.00	2,471,300	
東洋建設	9,000	578.00	5,202,000	
五洋建設	31,700	636.00	20,161,200	
世紀東急工業	3,800	804.00	3,055,200	
福田組	900	4,515.00	4,063,500	
住友林業	20,500	2,281.00	46,760,500	
日本基礎技術	2,200	674.00	1,482,800	
巴コーポレーション	3,600	515.00	1,854,000	
大和ハウス工業	73,900	3,391.00	250,594,900	
ライト工業	5,000	1,908.00	9,540,000	
積水ハウス	86,800	2,393.50	207,755,800	
日特建設	1,700	724.00	1,230,800	
北陸電気工事	1,700	792.00	1,346,400	
ユアテック	4,600	711.00	3,270,600	
日本リーテック	1,700	1,497.00	2,544,900	

四電工	900	1,590.00	1,431,000	
中電工	3,700	2,173.00	8,040,100	
関電工	13,000	871.00	11,323,000	
きんでん	17,900	1,650.00	29,535,000	
東京エネシス	2,700	964.00	2,602,800	
トーエネック	800	3,255.00	2,604,000	
住友電設	2,000	2,205.00	4,410,000	
日本電設工業	4,400	1,550.00	6,820,000	
エクシオグループ	12,000	2,409.00	28,908,000	
新日本空調	2,100	2,040.00	4,284,000	
九電工	6,200	3,145.00	19,499,000	
三機工業	5,200	1,462.00	7,602,400	
日揮ホールディングス	24,600	1,123.00	27,625,800	
中外炉工業	800	1,560.00	1,248,000	
ヤマト	2,300	710.00	1,633,000	
太平電業	1,800	2,721.00	4,897,800	
高砂熱学工業	7,200	1,979.00	14,248,800	
三晃金属工業	300	2,490.00	747,000	
朝日工業社	500	3,070.00	1,535,000	
明星工業	5,200	725.00	3,770,000	
大氣社	3,900	3,035.00	11,836,500	
ダイダン	1,800	2,312.00	4,161,600	
日比谷総合設備	2,600	1,902.00	4,945,200	
フィル・カンパニー	500	1,119.00	559,500	
テスホールディングス	1,700	1,284.00	2,182,800	
インフロニア・ホールディングス	34,100	1,057.00	36,043,700	
東洋エンジニアリング	3,400	602.00	2,046,800	
レイズネクスト	3,900	1,138.00	4,438,200	
ニップン	7,500	1,706.00	12,795,000	
日清製粉グループ本社	28,900	1,702.00	49,187,800	
日東富士製粉	400	4,220.00	1,688,000	
昭和産業	2,400	2,729.00	6,549,600	
鳥越製粉	2,300	664.00	1,527,200	
中部飼料	2,900	1,068.00	3,097,200	
フィード・ワン	3,400	692.00	2,352,800	
東洋精糖	400	1,107.00	442,800	
日本甜菜製糖	1,300	1,716.00	2,230,800	
DM三井製糖ホールディングス	2,300	2,003.00	4,606,900	
塩水港精糖	3,000	215.00	645,000	
日新製糖	1,200	1,762.00	2,114,400	
森永製菓	6,000	3,700.00	22,200,000	
中村屋	600	3,385.00	2,031,000	

江崎グリコ	7,000	3,910.00	27,370,000	
名糖産業	1,100	1,675.00	1,842,500	
井村屋グループ	1,500	2,333.00	3,499,500	
不二家	1,400	2,428.00	3,399,200	
山崎製パン	19,200	1,684.00	32,332,800	
第一屋製パン	500	561.00	280,500	
モロゾフ	800	2,682.00	2,145,600	
亀田製菓	1,500	4,155.00	6,232,500	
寿スピリッツ	2,500	6,020.00	15,050,000	
カルビー	11,700	2,555.00	29,893,500	
森永乳業	4,700	5,700.00	26,790,000	
六甲バター	1,900	1,579.00	3,000,100	
ヤクルト本社	19,000	6,170.00	117,230,000	
明治ホールディングス	16,900	6,860.00	115,934,000	
雪印メグミルク	6,200	2,038.00	12,635,600	
プリマハム	3,200	2,405.00	7,696,000	
日本ハム	9,800	4,375.00	42,875,000	
林兼産業	800	514.00	411,200	
丸大食品	2,500	1,568.00	3,920,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	2,300	3,270.00	7,521,000	
柿安本店	900	2,572.00	2,314,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	16,500	683.00	11,269,500	
サッポロホールディングス	8,700	2,337.00	20,331,900	
アサヒグループホールディングス	60,200	4,873.00	293,354,600	
キリンホールディングス	94,100	1,978.00	186,129,800	
宝ホールディングス	17,400	1,155.00	20,097,000	
オエノンホールディングス	7,300	339.00	2,474,700	
養命酒製造	800	1,762.00	1,409,600	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	18,000	1,505.00	27,090,000	
サントリー食品インターナショナル	17,100	4,440.00	75,924,000	
ダイドーグループホールディングス	1,300	5,030.00	6,539,000	
伊藤園	7,800	6,710.00	52,338,000	
キーコーヒー	2,500	2,072.00	5,180,000	
ユニカフェ	800	983.00	786,400	
ジャパンフーズ	400	1,227.00	490,800	
日清オイリオグループ	3,200	2,995.00	9,584,000	
不二製油グループ本社	5,500	2,265.00	12,457,500	
かどや製油	300	3,790.00	1,137,000	
Ｊ－オイルミルズ	2,400	1,701.00	4,082,400	
キッコーマン	18,400	8,800.00	161,920,000	
味の素	56,500	3,263.00	184,359,500	
ブルドックソース	1,100	1,992.00	2,191,200	

キユーピー	13,400	2,473.00	33,138,200	
ハウス食品グループ本社	9,600	3,030.00	29,088,000	
カゴメ	9,700	3,020.00	29,294,000	
焼津水産化学工業	1,200	919.00	1,102,800	
アリアケジャパン	2,300	5,700.00	13,110,000	
ピエトロ	300	1,799.00	539,700	
エバラ食品工業	600	2,803.00	1,681,800	
やまみ	200	1,870.00	374,000	
ニチレイ	11,700	2,653.00	31,040,100	
東洋水産	12,300	4,960.00	61,008,000	
イートアンドホールディングス	1,000	2,317.00	2,317,000	
大冷	300	1,897.00	569,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,300	533.00	692,900	
日清食品ホールディングス	10,000	9,040.00	90,400,000	
永谷園ホールディングス	1,100	1,976.00	2,173,600	
一正蒲鉾	1,100	785.00	863,500	
フジッコ	2,400	1,967.00	4,720,800	
ロック・フィールド	2,800	1,580.00	4,424,000	
日本たばこ産業	137,300	2,312.00	317,437,600	
ケンコーマヨネーズ	1,400	1,425.00	1,995,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,700	1,858.00	3,158,600	
なとり	1,400	2,051.00	2,871,400	
イフジ産業	400	926.00	370,400	
ピックルスコーポレーション	1,200	1,528.00	1,833,600	
ファーマフーズ	2,400	1,668.00	4,003,200	
ユーグレナ	13,000	770.00	10,010,000	
紀文食品	1,500	1,054.00	1,581,000	
ミヨシ油脂	1,000	1,143.00	1,143,000	
理研ビタミン	2,700	1,773.00	4,787,100	
片倉工業	2,800	2,318.00	6,490,400	
グンゼ	1,700	3,885.00	6,604,500	
東洋紡	9,900	1,269.00	12,563,100	
ユニチカ	6,800	308.00	2,094,400	
富士紡ホールディングス	1,100	3,750.00	4,125,000	
倉敷紡績	2,100	1,953.00	4,101,300	
シキボウ	1,300	911.00	1,184,300	
日本毛織	7,500	913.00	6,847,500	
ダイトウボウ	3,900	90.00	351,000	
トーア紡コーポレーション	900	425.00	382,500	
ダイドーリミテッド	3,200	147.00	470,400	
帝国繊維	2,800	1,995.00	5,586,000	
帝人	23,500	1,410.00	33,135,000	

東レ	180,900	673.80	121,890,420	
住江織物	500	1,920.00	960,000	
日本フエルト	1,400	448.00	627,200	
イチカワ	300	1,393.00	417,900	
日東製網	300	1,465.00	439,500	
アツギ	1,900	596.00	1,132,400	
ダイニック	900	738.00	664,200	
セーレン	5,100	2,164.00	11,036,400	
ソトー	900	853.00	767,700	
東海染工	300	1,157.00	347,100	
小松マテーレ	4,100	1,257.00	5,153,700	
ワコールホールディングス	6,200	2,064.00	12,796,800	
ホギメディカル	3,400	3,255.00	11,067,000	
クラウディアホールディングス	600	234.00	140,400	
ＴＳＩホールディングス	8,300	327.00	2,714,100	
マツオカコーポレーション	800	1,171.00	936,800	
ワールド	3,300	1,246.00	4,111,800	
三陽商会	1,200	887.00	1,064,400	
ナイガイ	800	282.00	225,600	
オンワードホールディングス	15,000	297.00	4,455,000	
ルックホールディングス	800	1,532.00	1,225,600	
キムラタン	14,000	18.00	252,000	
ゴールドウイン	4,500	6,350.00	28,575,000	
デサント	4,900	3,295.00	16,145,500	
キング	1,200	533.00	639,600	
ヤマトインターナショナル	2,200	289.00	635,800	
特種東海製紙	1,500	4,220.00	6,330,000	
王子ホールディングス	104,400	612.00	63,892,800	
日本製紙	12,000	1,167.00	14,004,000	
三菱製紙	3,500	320.00	1,120,000	
北越コーポレーション	16,400	724.00	11,873,600	
中越パルプ工業	1,000	994.00	994,000	
巴川製紙所	700	862.00	603,400	
大王製紙	12,000	1,834.00	22,008,000	
阿波製紙	600	333.00	199,800	
レンゴー	23,600	872.00	20,579,200	
トーモク	1,500	1,757.00	2,635,500	
ザ・パック	1,900	2,744.00	5,213,600	
北の達人コーポレーション	8,900	229.00	2,038,100	
クラレ	36,500	1,100.00	40,150,000	
旭化成	165,600	1,122.00	185,803,200	
共和レザー	1,600	661.00	1,057,600	

昭和電工	21,700	2,270.00	49,259,000	
住友化学	183,600	562.00	103,183,200	
住友精化	1,100	3,300.00	3,630,000	
日産化学	13,600	6,470.00	87,992,000	
ラサ工業	900	1,631.00	1,467,900	
クレハ	2,000	9,180.00	18,360,000	
多木化学	1,000	4,755.00	4,755,000	
テイカ	1,800	1,347.00	2,424,600	
石原産業	4,200	1,085.00	4,557,000	
片倉コープアグリ	600	1,166.00	699,600	
日本曹達	3,200	3,465.00	11,088,000	
東ソー	36,000	1,845.00	66,420,000	
トクヤマ	8,000	1,914.00	15,312,000	
セントラル硝子	4,100	2,111.00	8,655,100	
東亞合成	13,900	1,098.00	15,262,200	
大阪ソーダ	2,300	3,155.00	7,256,500	
関東電化工業	5,500	1,129.00	6,209,500	
デンカ	9,100	3,685.00	33,533,500	
信越化学工業	42,900	18,000.00	772,200,000	
日本カーバイド工業	900	1,395.00	1,255,500	
堺化学工業	1,800	2,021.00	3,637,800	
第一稀元素化学工業	2,300	1,008.00	2,318,400	
エア・ウォーター	23,700	1,701.00	40,313,700	
日本酸素ホールディングス	24,000	2,249.00	53,976,000	
日本化学工業	800	2,512.00	2,009,600	
東邦アセチレン	400	1,209.00	483,600	
日本パーカライジング	12,600	992.00	12,499,200	
高圧ガス工業	4,000	738.00	2,952,000	
チタン工業	300	1,633.00	489,900	
四国化成工業	3,300	1,432.00	4,725,600	
戸田工業	500	2,780.00	1,390,000	
ステラ　ケミファ	1,300	2,410.00	3,133,000	
保土谷化学工業	800	4,455.00	3,564,000	
日本触媒	4,200	5,750.00	24,150,000	
大日精化工業	2,100	2,218.00	4,657,800	
カネカ	6,500	3,825.00	24,862,500	
三菱瓦斯化学	23,200	2,074.00	48,116,800	
三井化学	22,700	2,952.00	67,010,400	
ＪＳＲ	23,300	3,585.00	83,530,500	
東京応化工業	4,000	6,740.00	26,960,000	
大阪有機化学工業	2,100	3,135.00	6,583,500	
三菱ケミカルホールディングス	167,000	815.30	136,155,100	

ＫＨネオケム	4,100	2,884.00	11,824,400	
ダイセル	36,000	884.00	31,824,000	
住友ベークライト	3,900	5,050.00	19,695,000	
積水化学工業	52,300	1,999.00	104,547,700	
日本ゼオン	22,500	1,371.00	30,847,500	
アイカ工業	7,000	3,245.00	22,715,000	
宇部興産	11,800	2,155.00	25,429,000	
積水樹脂	3,800	1,976.00	7,508,800	
タキロンシーアイ	5,400	562.00	3,034,800	
旭有機材	1,400	2,098.00	2,937,200	
ニチバン	1,500	1,753.00	2,629,500	
リケンテクノス	6,100	465.00	2,836,500	
大倉工業	1,300	1,923.00	2,499,900	
積水化成品工業	3,300	460.00	1,518,000	
群栄化学工業	600	3,415.00	2,049,000	
タイガースポリマー	1,300	448.00	582,400	
ミライアル	800	1,518.00	1,214,400	
ダイキアクシス	1,000	722.00	722,000	
ダイキョーニシカワ	5,300	584.00	3,095,200	
竹本容器	900	785.00	706,500	
森六ホールディングス	1,300	1,967.00	2,557,100	
恵和	700	4,510.00	3,157,000	
日本化薬	19,700	1,163.00	22,911,100	
カーリットホールディングス	2,500	712.00	1,780,000	
日本精化	2,000	1,979.00	3,958,000	
扶桑化学工業	2,200	4,645.00	10,219,000	
トリケミカル研究所	2,600	2,893.00	7,521,800	
ＡＤＥＫＡ	11,500	2,640.00	30,360,000	
日油	8,500	5,170.00	43,945,000	
新日本理化	4,100	243.00	996,300	
ハリマ化成グループ	1,900	817.00	1,552,300	
花王	56,400	5,157.00	290,854,800	
第一工業製薬	900	2,750.00	2,475,000	
石原ケミカル	1,300	1,334.00	1,734,200	
日華化学	800	776.00	620,800	
ニイタカ	500	2,283.00	1,141,500	
三洋化成工業	1,500	5,110.00	7,665,000	
有機合成薬品工業	1,700	269.00	457,300	
大日本塗料	3,100	813.00	2,520,300	
日本ペイントホールディングス	93,900	961.00	90,237,900	
関西ペイント	25,900	2,352.00	60,916,800	
神東塗料	1,900	153.00	290,700	

中国塗料	5,900	899.00	5,304,100	
日本特殊塗料	1,900	868.00	1,649,200	
藤倉化成	3,100	455.00	1,410,500	
太陽ホールディングス	3,700	3,215.00	11,895,500	
ＤＩＣ	10,600	2,719.00	28,821,400	
サカタインクス	5,000	972.00	4,860,000	
東洋インキＳＣホールディングス	5,300	1,915.00	10,149,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	2,000	887.00	1,774,000	
富士フイルムホールディングス	44,800	7,542.00	337,881,600	
資生堂	47,500	6,431.00	305,472,500	
ライオン	30,800	1,498.00	46,138,400	
高砂香料工業	1,800	2,750.00	4,950,000	
マンダム	5,400	1,334.00	7,203,600	
ミルボン	3,100	5,780.00	17,918,000	
ファンケル	10,300	3,185.00	32,805,500	
コーセー	4,800	12,560.00	60,288,000	
コタ	1,600	1,550.00	2,480,000	
シーボン	300	1,814.00	544,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	10,900	1,748.00	19,053,200	
ノエビアホールディングス	2,200	5,210.00	11,462,000	
アジュバンホールディングス	600	1,147.00	688,200	
新日本製薬	700	1,365.00	955,500	
エステー	1,600	1,561.00	2,497,600	
アグロ　カネショウ	800	1,248.00	998,400	
コニシ	4,200	1,628.00	6,837,600	
長谷川香料	4,400	2,376.00	10,454,400	
星光ＰＭＣ	1,400	610.00	854,000	
小林製薬	7,100	9,620.00	68,302,000	
荒川化学工業	2,100	1,123.00	2,358,300	
メック	1,900	2,897.00	5,504,300	
日本高純度化学	700	2,517.00	1,761,900	
タカラバイオ	6,700	2,326.00	15,584,200	
ＪＣＵ	2,900	4,550.00	13,195,000	
新田ゼラチン	1,600	664.00	1,062,400	
ＯＡＴアグリオ	500	1,848.00	924,000	
デクセリアルズ	6,600	3,080.00	20,328,000	
アース製薬	2,100	5,660.00	11,886,000	
北興化学工業	2,400	836.00	2,006,400	
大成ラミック	800	2,763.00	2,210,400	
クミアイ化学工業	9,500	805.00	7,647,500	
日本農薬	4,500	536.00	2,412,000	
アキレス	1,600	1,275.00	2,040,000	

有沢製作所	3,700	1,006.00	3,722,200	
日東電工	15,400	8,520.00	131,208,000	
レック	3,300	960.00	3,168,000	
三光合成	2,900	361.00	1,046,900	
きもと	3,900	207.00	807,300	
藤森工業	2,300	4,100.00	9,430,000	
前澤化成工業	1,600	1,272.00	2,035,200	
未来工業	900	1,510.00	1,359,000	
ウェーブロックホールディングス	1,000	711.00	711,000	
ＪＳＰ	1,500	1,593.00	2,389,500	
エフピコ	4,700	3,365.00	15,815,500	
天馬	2,000	2,550.00	5,100,000	
信越ポリマー	4,600	1,082.00	4,977,200	
東リ	6,300	228.00	1,436,400	
ニフコ	8,500	3,525.00	29,962,500	
バルカー	2,100	2,500.00	5,250,000	
ユニ・チャーム	49,200	4,281.00	210,625,200	
ショーエイコーポレーション	700	634.00	443,800	
協和キリン	29,900	2,937.00	87,816,300	
武田薬品工業	200,500	3,485.00	698,742,500	
アステラス製薬	221,200	1,971.50	436,095,800	
大日本住友製薬	15,800	1,244.00	19,655,200	
塩野義製薬	32,100	7,603.00	244,056,300	
わかもと製薬	3,000	298.00	894,000	
日本新薬	6,700	7,770.00	52,059,000	
中外製薬	79,800	3,961.00	316,087,800	
科研製薬	4,000	4,240.00	16,960,000	
エーザイ	30,500	5,855.00	178,577,500	
ロート製薬	13,100	3,555.00	46,570,500	
小野薬品工業	58,600	2,860.00	167,596,000	
久光製薬	6,700	3,755.00	25,158,500	
持田製薬	3,200	3,835.00	12,272,000	
参天製薬	47,600	1,304.00	62,070,400	
扶桑薬品工業	900	2,264.00	2,037,600	
日本ケミファ	300	2,203.00	660,900	
ツムラ	7,900	3,270.00	25,833,000	
日医工	7,900	811.00	6,406,900	
キッセイ薬品工業	4,500	2,419.00	10,885,500	
生化学工業	4,500	902.00	4,059,000	
栄研化学	4,500	1,756.00	7,902,000	
日水製薬	900	985.00	886,500	
鳥居薬品	1,400	2,857.00	3,999,800	

ＪＣＲファーマ	7,200	2,109.00	15,184,800	
東和薬品	3,700	3,060.00	11,322,000	
富士製薬工業	1,600	1,009.00	1,614,400	
ゼリア新薬工業	4,600	1,945.00	8,947,000	
第一三共	200,500	2,380.00	477,190,000	
キョーリン製薬ホールディングス	5,100	1,858.00	9,475,800	
大幸薬品	3,800	658.00	2,500,400	
ダイト	1,700	2,897.00	4,924,900	
大塚ホールディングス	53,000	3,998.00	211,894,000	
大正製薬ホールディングス	6,100	5,800.00	35,380,000	
ペプチドリーム	13,400	2,128.00	28,515,200	
あすか製薬ホールディングス	2,900	1,042.00	3,021,800	
サワイグループホールディングス	5,600	4,545.00	25,452,000	
日本コークス工業	21,500	138.00	2,967,000	
ニチレキ	3,300	1,304.00	4,303,200	
ユシロ化学工業	1,300	1,077.00	1,400,100	
ビーピー・カストロール	900	1,289.00	1,160,100	
富士石油	6,800	289.00	1,965,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	800	1,142.00	913,600	
出光興産	28,300	3,135.00	88,720,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	383,700	464.40	178,190,280	
コスモエネルギーホールディングス	7,400	2,492.00	18,440,800	
横浜ゴム	14,800	1,670.00	24,716,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	13,400	1,551.00	20,783,400	
ブリヂストン	73,500	4,901.00	360,223,500	
住友ゴム工業	22,900	1,151.00	26,357,900	
藤倉コンポジット	2,000	719.00	1,438,000	
オカモト	1,500	4,210.00	6,315,000	
フコク	1,100	969.00	1,065,900	
ニッタ	2,600	2,800.00	7,280,000	
住友理工	4,900	599.00	2,935,100	
三ツ星ベルト	3,100	2,105.00	6,525,500	
バンドー化学	4,100	861.00	3,530,100	
日東紡績	3,800	3,220.00	12,236,000	
ＡＧＣ	23,400	5,530.00	129,402,000	
日本板硝子	12,200	494.00	6,026,800	
石塚硝子	400	2,059.00	823,600	
日本山村硝子	1,000	811.00	811,000	
日本電気硝子	10,200	2,865.00	29,223,000	
オハラ	1,000	1,103.00	1,103,000	
住友大阪セメント	4,700	3,540.00	16,638,000	
太平洋セメント	14,500	2,333.00	33,828,500	

日本ヒューム	2,600	697.00	1,812,200	
日本コンクリート工業	5,000	294.00	1,470,000	
三谷セキサン	1,200	6,620.00	7,944,000	
アジアパイルホールディングス	3,900	445.00	1,735,500	
東海カーボン	21,400	1,176.00	25,166,400	
日本カーボン	1,300	4,145.00	5,388,500	
東洋炭素	1,700	3,030.00	5,151,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	4,495.00	6,293,000	
ＴＯＴＯ	18,200	4,950.00	90,090,000	
日本碍子	27,600	1,847.00	50,977,200	
日本特殊陶業	19,400	2,144.00	41,593,600	
ダントーホールディングス	1,700	370.00	629,000	
ＭＡＲＵＷＡ	900	14,030.00	12,627,000	
品川リフラクトリーズ	600	3,825.00	2,295,000	
黒崎播磨	400	4,335.00	1,734,000	
ヨータイ	1,600	1,248.00	1,996,800	
イソライト工業	1,000	1,194.00	1,194,000	
東京窯業	3,200	303.00	969,600	
ニッカトー	1,200	583.00	699,600	
フジミインコーポレーテッド	2,000	6,410.00	12,820,000	
クニミネ工業	800	991.00	792,800	
エーアンドエーマテリアル	400	911.00	364,400	
ニチアス	5,900	2,624.00	15,481,600	
ニチハ	3,500	2,622.00	9,177,000	
日本製鉄	112,900	1,981.00	223,654,900	
神戸製鋼所	47,100	593.00	27,930,300	
中山製鋼所	4,000	459.00	1,836,000	
合同製鐵	1,400	1,331.00	1,863,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	68,100	1,652.00	112,501,200	
東京製鐵	8,600	1,096.00	9,425,600	
共英製鋼	2,800	1,658.00	4,642,400	
大和工業	4,800	3,700.00	17,760,000	
東京鐵鋼	1,100	1,357.00	1,492,700	
大阪製鐵	1,300	1,206.00	1,567,800	
淀川製鋼所	3,300	2,731.00	9,012,300	
丸一鋼管	8,900	2,896.00	25,774,400	
モリ工業	700	2,503.00	1,752,100	
大同特殊鋼	4,100	4,260.00	17,466,000	
日本高周波鋼業	900	350.00	315,000	
日本冶金工業	1,800	2,801.00	5,041,800	
山陽特殊製鋼	2,600	2,113.00	5,493,800	
愛知製鋼	1,400	2,564.00	3,589,600	

日立金属	26,600	2,083.00	55,407,800	
日本金属	600	1,088.00	652,800	
大平洋金属	1,600	3,160.00	5,056,000	
新日本電工	16,300	355.00	5,786,500	
栗本鐵工所	1,100	1,575.00	1,732,500	
虹技	300	956.00	286,800	
日本鋳鉄管	300	1,002.00	300,600	
三菱製鋼	1,600	1,165.00	1,864,000	
日亜鋼業	3,300	280.00	924,000	
日本精線	400	4,415.00	1,766,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	1,311.00	1,048,800	
シンニッタン	3,000	229.00	687,000	
新家工業	600	1,697.00	1,018,200	
大紀アルミニウム工業所	3,800	1,624.00	6,171,200	
日本軽金属ホールディングス	6,400	1,816.00	11,622,400	
三井金属鉱業	6,800	3,330.00	22,644,000	
東邦亜鉛	1,400	2,645.00	3,703,000	
三菱マテリアル	16,700	2,089.00	34,886,300	
住友金属鉱山	32,200	5,569.00	179,321,800	
ＤＯＷＡホールディングス	6,900	4,870.00	33,603,000	
古河機械金属	4,200	1,299.00	5,455,800	
エス・サイエンス	12,200	24.00	292,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	849.00	2,462,100	
東邦チタニウム	4,500	897.00	4,036,500	
ＵＡＣＪ	3,800	2,289.00	8,698,200	
ＣＫサンエツ	500	3,995.00	1,997,500	
古河電気工業	7,800	2,330.00	18,174,000	
住友電気工業	94,300	1,580.00	148,994,000	
フジクラ	28,100	650.00	18,265,000	
昭和電線ホールディングス	2,200	1,857.00	4,085,400	
東京特殊電線	400	2,827.00	1,130,800	
タツタ電線	4,400	460.00	2,024,000	
カナレ電気	400	1,510.00	604,000	
平河ヒューテック	1,400	1,183.00	1,656,200	
リョービ	3,100	1,112.00	3,447,200	
アーレスティ	2,700	379.00	1,023,300	
アサヒホールディングス	10,100	2,223.00	22,452,300	
稲葉製作所	1,400	1,312.00	1,836,800	
宮地エンジニアリンググループ	800	3,575.00	2,860,000	
トーカロ	6,500	1,302.00	8,463,000	
アルファＣｏ	1,000	1,090.00	1,090,000	
ＳＵＭＣＯ	38,800	2,085.00	80,898,000	

川田テクノロジーズ	500	3,925.00	1,962,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	800	5,430.00	4,344,000	
ジェイテックコーポレーション	300	1,537.00	461,100	
信和	1,600	824.00	1,318,400	
東洋製罐グループホールディングス	16,100	1,590.00	25,599,000	
ホッカンホールディングス	1,400	1,403.00	1,964,200	
コロナ	1,400	892.00	1,248,800	
横河ブリッジホールディングス	4,300	2,129.00	9,154,700	
駒井ハルテック	500	2,177.00	1,088,500	
高田機工	200	2,862.00	572,400	
三和ホールディングス	23,800	1,257.00	29,916,600	
文化シヤッター	8,000	1,060.00	8,480,000	
三協立山	3,200	614.00	1,964,800	
アルインコ	1,800	909.00	1,636,200	
東洋シヤッター	600	544.00	326,400	
ＬＩＸＩＬ	39,700	2,518.00	99,964,600	
日本フイルコン	1,800	526.00	946,800	
ノーリツ	4,800	1,613.00	7,742,400	
長府製作所	2,600	1,959.00	5,093,400	
リンナイ	4,800	9,990.00	47,952,000	
ダイニチ工業	1,200	704.00	844,800	
日東精工	3,200	516.00	1,651,200	
三洋工業	300	1,845.00	553,500	
岡部	4,800	746.00	3,580,800	
ジーテクト	3,100	1,435.00	4,448,500	
東プレ	4,700	1,218.00	5,724,600	
高周波熱錬	4,500	598.00	2,691,000	
東京製綱	1,500	851.00	1,276,500	
サンコール	2,200	500.00	1,100,000	
モリテック　スチール	2,000	318.00	636,000	
パイオラックス	3,600	1,721.00	6,195,600	
エイチワン	2,500	664.00	1,660,000	
日本発條	23,200	882.00	20,462,400	
中央発條	1,200	786.00	943,200	
アドバネクス	300	1,529.00	458,700	
立川ブラインド工業	1,100	1,075.00	1,182,500	
三益半導体工業	2,000	2,374.00	4,748,000	
日本ドライケミカル	600	1,777.00	1,066,200	
日本製鋼所	7,700	3,490.00	26,873,000	
三浦工業	10,900	3,390.00	36,951,000	
タクマ	8,500	1,460.00	12,410,000	
ツガミ	5,500	1,301.00	7,155,500	

オークマ	2,900	4,765.00	13,818,500	
芝浦機械	2,800	2,979.00	8,341,200	
アマダ	39,800	1,037.00	41,272,600	
アイダエンジニアリング	6,600	979.00	6,461,400	
滝澤鉄工所	700	1,207.00	844,900	
ＦＵＪＩ	11,600	2,456.00	28,489,600	
牧野フライス製作所	2,800	3,650.00	10,220,000	
オーエスジー	11,700	1,939.00	22,686,300	
ダイジェット工業	300	1,016.00	304,800	
旭ダイヤモンド工業	6,600	582.00	3,841,200	
ＤＭＧ森精機	15,000	1,730.00	25,950,000	
ソディック	5,500	775.00	4,262,500	
ディスコ	3,700	32,850.00	121,545,000	
日東工器	1,400	1,621.00	2,269,400	
日進工具	2,000	1,389.00	2,778,000	
パンチ工業	2,100	492.00	1,033,200	
冨士ダイス	1,300	617.00	802,100	
豊和工業	1,300	855.00	1,111,500	
ＯＫＫ	900	734.00	660,600	
石川製作所	700	1,529.00	1,070,300	
東洋機械金属	1,600	563.00	900,800	
津田駒工業	500	613.00	306,500	
エンシュウ	600	659.00	395,400	
島精機製作所	3,700	1,847.00	6,833,900	
オプトラン	3,200	1,882.00	6,022,400	
ＮＣホールディングス	700	1,682.00	1,177,400	
イワキポンプ	1,600	1,024.00	1,638,400	
フリュー	2,200	1,059.00	2,329,800	
ヤマシンフィルタ	5,100	377.00	1,922,700	
日阪製作所	3,100	826.00	2,560,600	
やまびこ	4,900	1,280.00	6,272,000	
野村マイクロ・サイエンス	700	3,720.00	2,604,000	
平田機工	1,200	5,460.00	6,552,000	
ペガサスミシン製造	2,600	520.00	1,352,000	
マルマエ	1,000	2,361.00	2,361,000	
タツモ	1,200	1,463.00	1,755,600	
ナブテスコ	14,400	3,295.00	47,448,000	
三井海洋開発	2,700	1,173.00	3,167,100	
レオン自動機	2,700	1,035.00	2,794,500	
ＳＭＣ	7,500	65,420.00	490,650,000	
ホソカワミクロン	1,800	2,734.00	4,921,200	
ユニオンツール	900	3,595.00	3,235,500	

オイレス工業	3,500	1,591.00	5,568,500	
日精エー・エス・ビー機械	900	2,987.00	2,688,300	
サトーホールディングス	3,300	2,084.00	6,877,200	
技研製作所	2,200	3,720.00	8,184,000	
日本エアーテック	1,200	1,016.00	1,219,200	
カワタ	800	1,021.00	816,800	
日精樹脂工業	1,800	1,015.00	1,827,000	
オカダアイヨン	800	1,434.00	1,147,200	
ワイエイシイホールディングス	1,000	1,054.00	1,054,000	
小松製作所	115,600	2,717.00	314,085,200	
住友重機械工業	14,600	2,896.00	42,281,600	
日立建機	10,200	2,919.00	29,773,800	
日工	3,500	618.00	2,163,000	
巴工業	1,000	2,273.00	2,273,000	
井関農機	2,400	1,330.00	3,192,000	
ＴＯＷＡ	2,200	2,243.00	4,934,600	
丸山製作所	500	1,540.00	770,000	
北川鉄工所	1,100	1,363.00	1,499,300	
ローツェ	1,300	10,310.00	13,403,000	
タカキタ	900	612.00	550,800	
クボタ	123,600	2,060.50	254,677,800	
荏原実業	1,200	2,155.00	2,586,000	
三菱化工機	800	1,992.00	1,593,600	
月島機械	4,700	1,045.00	4,911,500	
帝国電機製作所	1,800	1,379.00	2,482,200	
東京機械製作所	1,000	779.00	779,000	
新東工業	5,600	701.00	3,925,600	
澁谷工業	2,200	2,545.00	5,599,000	
アイチ　コーポレーション	3,600	840.00	3,024,000	
小森コーポレーション	6,500	703.00	4,569,500	
鶴見製作所	2,000	1,821.00	3,642,000	
住友精密工業	400	1,922.00	768,800	
日本ギア工業	900	278.00	250,200	
酒井重工業	400	2,901.00	1,160,400	
荏原製作所	10,600	5,650.00	59,890,000	
石井鐵工所	400	3,000.00	1,200,000	
酉島製作所	2,300	940.00	2,162,000	
北越工業	2,400	885.00	2,124,000	
ダイキン工業	32,500	21,505.00	698,912,500	
オルガノ	700	7,700.00	5,390,000	
トーヨーカネツ	1,000	2,366.00	2,366,000	
栗田工業	13,800	4,820.00	66,516,000	

椿本チエイン	3,300	3,370.00	11,121,000	
大同工業	1,100	920.00	1,012,000	
木村化工機	2,100	772.00	1,621,200	
アネスト岩田	4,000	807.00	3,228,000	
ダイフク	14,000	8,590.00	120,260,000	
サムコ	600	2,272.00	1,363,200	
加藤製作所	1,200	809.00	970,800	
油研工業	400	1,764.00	705,600	
タダノ	13,300	977.00	12,994,100	
フジテック	9,500	2,589.00	24,595,500	
ＣＫＤ	7,500	2,050.00	15,375,000	
キトー	2,200	1,664.00	3,660,800	
平和	7,100	1,948.00	13,830,800	
理想科学工業	2,100	2,265.00	4,756,500	
ＳＡＮＫＹＯ	5,500	3,165.00	17,407,500	
日本金銭機械	2,600	673.00	1,749,800	
マースグループホールディングス	1,600	1,608.00	2,572,800	
フクシマガリレイ	1,700	4,070.00	6,919,000	
オーイズミ	900	399.00	359,100	
ダイコク電機	1,200	1,234.00	1,480,800	
竹内製作所	3,900	2,640.00	10,296,000	
アマノ	6,700	2,256.00	15,115,200	
ＪＵＫＩ	3,500	687.00	2,404,500	
サンデン	3,500	200.00	700,000	
ジャノメ	2,200	721.00	1,586,200	
マックス	3,400	1,690.00	5,746,000	
グローリー	6,600	2,133.00	14,077,800	
新晃工業	2,400	1,732.00	4,156,800	
大和冷機工業	3,700	1,127.00	4,169,900	
セガサミーホールディングス	25,300	2,137.00	54,066,100	
日本ピストンリング	900	1,362.00	1,225,800	
リケン	1,100	2,574.00	2,831,400	
ＴＰＲ	3,400	1,441.00	4,899,400	
ツバキ・ナカシマ	5,600	1,379.00	7,722,400	
ホシザキ	7,500	8,300.00	62,250,000	
大豊工業	2,100	720.00	1,512,000	
日本精工	48,000	739.00	35,472,000	
ＮＴＮ	54,800	231.00	12,658,800	
ジェイテクト	24,500	1,047.00	25,651,500	
不二越	2,200	4,225.00	9,295,000	
日本トムソン	7,000	565.00	3,955,000	
ＴＨＫ	14,400	2,755.00	39,672,000	

ユーシン精機	2,000	689.00	1,378,000	
前澤給装工業	1,900	975.00	1,852,500	
イーグル工業	3,200	1,050.00	3,360,000	
前澤工業	1,700	647.00	1,099,900	
日本ピラー工業	2,600	2,855.00	7,423,000	
キッツ	8,600	681.00	5,856,600	
マキタ	31,000	4,131.00	128,061,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	9,200	359.00	3,302,800	
日立造船	21,600	774.00	16,718,400	
三菱重工業	40,100	3,271.00	131,167,100	
ＩＨＩ	15,900	2,650.00	42,135,000	
サノヤスホールディングス	3,100	128.00	396,800	
スター精密	3,800	1,459.00	5,544,200	
日清紡ホールディングス	15,600	1,023.00	15,958,800	
イビデン	13,400	5,650.00	75,710,000	
コニカミノルタ	55,700	500.00	27,850,000	
ブラザー工業	31,200	2,148.00	67,017,600	
ミネベアミツミ	44,000	2,559.00	112,596,000	
日立製作所	122,700	5,751.00	705,647,700	
東芝	44,600	4,392.00	195,883,200	
三菱電機	255,100	1,435.00	366,068,500	
富士電機	15,400	6,010.00	92,554,000	
東洋電機製造	900	964.00	867,600	
安川電機	27,500	4,760.00	130,900,000	
シンフォニアテクノロジー	3,100	1,300.00	4,030,000	
明電舎	4,300	2,472.00	10,629,600	
オリジン	600	1,231.00	738,600	
山洋電気	1,100	4,840.00	5,324,000	
デンヨー	2,200	1,700.00	3,740,000	
ＰＨＣホールディングス	2,900	1,592.00	4,616,800	
東芝テック	2,700	5,050.00	13,635,000	
芝浦メカトロニクス	500	7,910.00	3,955,000	
マブチモーター	5,900	3,840.00	22,656,000	
日本電産	66,100	10,115.00	668,601,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	394.00	433,400	
トレックス・セミコンダクター	1,300	2,432.00	3,161,600	
東光高岳	1,400	1,441.00	2,017,400	
ダブル・スコープ	7,300	939.00	6,854,700	
ダイヘン	2,800	4,065.00	11,382,000	
ヤーマン	4,200	928.00	3,897,600	
ＪＶＣケンウッド	20,700	191.00	3,953,700	
ミマキエンジニアリング	2,300	731.00	1,681,300	

Ｉ－ＰＥＸ	1,200	1,561.00	1,873,200	
日新電機	6,000	1,466.00	8,796,000	
大崎電気工業	4,700	488.00	2,293,600	
オムロン	21,200	8,010.00	169,812,000	
日東工業	3,400	1,608.00	5,467,200	
ＩＤＥＣ	3,200	2,256.00	7,219,200	
正興電機製作所	800	1,070.00	856,000	
不二電機工業	500	1,076.00	538,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	8,300	2,363.00	19,612,900	
サクサホールディングス	600	1,377.00	826,200	
メルコホールディングス	600	3,810.00	2,286,000	
テクノメディカ	600	1,524.00	914,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	700	979.00	685,300	
日本電気	32,400	5,260.00	170,424,000	
富士通	23,000	16,035.00	368,805,000	
沖電気工業	10,400	898.00	9,339,200	
岩崎通信機	1,000	823.00	823,000	
電気興業	1,300	2,350.00	3,055,000	
サンケン電気	2,400	4,885.00	11,724,000	
ナカヨ	500	1,123.00	561,500	
アイホン	1,400	2,129.00	2,980,600	
ルネサスエレクトロニクス	138,400	1,391.00	192,514,400	
セイコーエプソン	31,700	1,817.00	57,598,900	
ワコム	19,800	873.00	17,285,400	
アルバック	5,100	5,930.00	30,243,000	
アクセル	1,100	1,090.00	1,199,000	
ＥＩＺＯ	2,000	3,745.00	7,490,000	
ジャパンディスプレイ	86,700	44.00	3,814,800	
日本信号	6,500	885.00	5,752,500	
京三製作所	5,500	426.00	2,343,000	
能美防災	3,400	2,026.00	6,888,400	
ホーチキ	1,800	1,218.00	2,192,400	
星和電機	1,200	493.00	591,600	
エレコム	5,800	1,553.00	9,007,400	
パナソニック	272,100	1,211.50	329,649,150	
シャープ	29,100	1,318.00	38,353,800	
アンリツ	16,400	1,623.00	26,617,200	
富士通ゼネラル	6,900	2,517.00	17,367,300	
ソニーグループ	159,800	12,210.00	1,951,158,000	
ＴＤＫ	36,900	4,510.00	166,419,000	
帝国通信工業	1,100	1,356.00	1,491,600	
タムラ製作所	9,800	606.00	5,938,800	

アルプスアルパイン	22,600	1,243.00	28,091,800	
池上通信機	800	662.00	529,600	
日本電波工業	2,300	1,184.00	2,723,200	
鈴木	1,300	801.00	1,041,300	
メイコー	2,100	3,925.00	8,242,500	
日本トリム	500	2,748.00	1,374,000	
ローランド　ディー．ジー．	1,500	2,789.00	4,183,500	
フォスター電機	2,600	812.00	2,111,200	
ＳＭＫ	600	2,138.00	1,282,800	
ヨコオ	1,900	2,669.00	5,071,100	
ティアック	4,000	124.00	496,000	
ホシデン	6,100	1,199.00	7,313,900	
ヒロセ電機	3,900	17,150.00	66,885,000	
日本航空電子工業	5,800	1,827.00	10,596,600	
ＴＯＡ	2,700	777.00	2,097,900	
マクセル	5,100	1,231.00	6,278,100	
古野電気	3,000	1,057.00	3,171,000	
ユニデンホールディングス	600	3,420.00	2,052,000	
スミダコーポレーション	2,400	864.00	2,073,600	
アイコム	900	2,371.00	2,133,900	
リオン	1,000	2,109.00	2,109,000	
本多通信工業	2,000	480.00	960,000	
横河電機	25,500	1,877.00	47,863,500	
新電元工業	1,000	3,005.00	3,005,000	
アズビル	14,900	4,225.00	62,952,500	
東亜ディーケーケー	1,300	901.00	1,171,300	
日本光電工業	10,500	3,170.00	33,285,000	
チノー	800	1,548.00	1,238,400	
共和電業	2,400	378.00	907,200	
日本電子材料	1,300	2,068.00	2,688,400	
堀場製作所	4,700	6,590.00	30,973,000	
アドバンテスト	19,000	9,210.00	174,990,000	
小野測器	1,100	497.00	546,700	
エスペック	2,100	2,029.00	4,260,900	
キーエンス	23,100	57,590.00	1,330,329,000	
日置電機	1,200	6,400.00	7,680,000	
シスメックス	21,600	8,868.00	191,548,800	
日本マイクロニクス	4,400	1,592.00	7,004,800	
メガチップス	2,400	3,890.00	9,336,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,200	3,020.00	3,624,000	
澤藤電機	300	1,463.00	438,900	
原田工業	1,200	977.00	1,172,400	

コーセル	2,800	809.00	2,265,200	
イリソ電子工業	2,100	4,580.00	9,618,000	
オプテックスグループ	4,200	1,489.00	6,253,800	
千代田インテグレ	1,100	1,923.00	2,115,300	
アイ・オー・データ機器	800	1,299.00	1,039,200	
レーザーテック	11,200	21,995.00	246,344,000	
スタンレー電気	17,800	2,759.00	49,110,200	
岩崎電気	900	2,289.00	2,060,100	
ウシオ電機	13,100	1,828.00	23,946,800	
岡谷電機産業	1,800	310.00	558,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	2,200	292.00	642,400	
エノモト	700	1,542.00	1,079,400	
日本セラミック	2,400	2,480.00	5,952,000	
遠藤照明	1,200	1,003.00	1,203,600	
古河電池	1,800	1,217.00	2,190,600	
双信電機	1,200	562.00	674,400	
山一電機	1,800	2,007.00	3,612,600	
図研	1,700	2,965.00	5,040,500	
日本電子	5,300	6,720.00	35,616,000	
カシオ計算機	18,500	1,407.00	26,029,500	
ファナック	22,400	22,865.00	512,176,000	
日本シイエムケイ	5,000	625.00	3,125,000	
エンプラス	600	2,594.00	1,556,400	
大真空	3,400	1,136.00	3,862,400	
ローム	11,400	9,310.00	106,134,000	
浜松ホトニクス	18,300	5,830.00	106,689,000	
三井ハイテック	2,500	8,100.00	20,250,000	
新光電気工業	7,500	4,895.00	36,712,500	
京セラ	35,900	6,655.00	238,914,500	
太陽誘電	12,400	5,050.00	62,620,000	
村田製作所	74,900	7,996.00	598,900,400	
双葉電子工業	4,400	667.00	2,934,800	
北陸電気工業	1,000	1,275.00	1,275,000	
ニチコン	8,000	1,264.00	10,112,000	
日本ケミコン	2,400	1,950.00	4,680,000	
ＫＯＡ	3,800	1,465.00	5,567,000	
市光工業	3,100	497.00	1,540,700	
小糸製作所	14,000	5,780.00	80,920,000	
ミツバ	4,700	389.00	1,828,300	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	4,400	11,210.00	49,324,000	
キヤノン電子	2,300	1,592.00	3,661,600	
キヤノン	126,800	2,819.50	357,512,600	

リコー	70,800	1,034.00	73,207,200	
象印マホービン	6,900	1,460.00	10,074,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	300	2,051.00	615,300	
東京エレクトロン	16,200	55,220.00	894,564,000	
トヨタ紡織	10,400	2,180.00	22,672,000	
芦森工業	500	904.00	452,000	
ユニプレス	3,800	823.00	3,127,400	
豊田自動織機	20,600	9,110.00	187,666,000	
モリタホールディングス	4,100	1,256.00	5,149,600	
三櫻工業	3,500	716.00	2,506,000	
デンソー	56,200	8,409.00	472,585,800	
東海理化電機製作所	6,700	1,561.00	10,458,700	
川崎重工業	18,600	2,133.00	39,673,800	
名村造船所	7,600	217.00	1,649,200	
日本車輌製造	900	2,090.00	1,881,000	
三菱ロジスネクスト	3,400	956.00	3,250,400	
近畿車輛	400	1,038.00	415,200	
日産自動車	300,800	606.40	182,405,120	
いすゞ自動車	80,000	1,576.00	126,080,000	
トヨタ自動車	1,292,100	2,153.50	2,782,537,350	
日野自動車	31,900	1,072.00	34,196,800	
三菱自動車工業	94,400	324.00	30,585,600	
エフテック	1,800	546.00	982,800	
レシップホールディングス	1,000	547.00	547,000	
ＧＭＢ	500	793.00	396,500	
ファルテック	400	696.00	278,400	
武蔵精密工業	5,700	1,861.00	10,607,700	
日産車体	3,700	682.00	2,523,400	
新明和工業	7,200	926.00	6,667,200	
極東開発工業	4,700	1,460.00	6,862,000	
トピー工業	2,100	1,107.00	2,324,700	
ティラド	700	2,542.00	1,779,400	
曙ブレーキ工業	13,900	168.00	2,335,200	
タチエス	4,500	1,143.00	5,143,500	
ＮＯＫ	12,300	1,218.00	14,981,400	
フタバ産業	6,400	406.00	2,598,400	
ＫＹＢ	2,700	3,015.00	8,140,500	
大同メタル工業	4,900	644.00	3,155,600	
プレス工業	12,600	384.00	4,838,400	
ミクニ	3,200	418.00	1,337,600	
太平洋工業	5,300	1,049.00	5,559,700	
河西工業	3,100	306.00	948,600	

アイシン	18,700	4,375.00	81,812,500	
マツダ	80,100	910.00	72,891,000	
今仙電機製作所	1,700	588.00	999,600	
本田技研工業	200,800	3,601.00	723,080,800	
スズキ	58,300	4,842.00	282,288,600	
ＳＵＢＡＲＵ	73,100	1,970.50	144,043,550	
安永	1,200	867.00	1,040,400	
ヤマハ発動機	33,300	2,728.00	90,842,400	
ＴＢＫ	2,800	409.00	1,145,200	
エクセディ	3,800	1,683.00	6,395,400	
豊田合成	8,200	2,263.00	18,556,600	
愛三工業	4,000	728.00	2,912,000	
盟和産業	400	1,004.00	401,600	
日本プラスト	2,000	560.00	1,120,000	
ヨロズ	2,400	975.00	2,340,000	
エフ・シー・シー	4,200	1,436.00	6,031,200	
シマノ	10,200	28,250.00	288,150,000	
テイ・エス　テック	10,800	1,573.00	16,988,400	
ジャムコ	1,500	820.00	1,230,000	
テルモ	72,200	3,761.00	271,544,200	
クリエートメディック	800	960.00	768,000	
日機装	7,600	824.00	6,262,400	
日本エム・ディ・エム	1,500	1,594.00	2,391,000	
島津製作所	32,800	4,175.00	136,940,000	
ＪＭＳ	2,200	602.00	1,324,400	
クボテック	500	278.00	139,000	
長野計器	1,800	1,267.00	2,280,600	
ブイ・テクノロジー	1,100	3,420.00	3,762,000	
東京計器	1,600	1,041.00	1,665,600	
愛知時計電機	1,200	1,861.00	2,233,200	
インターアクション	1,300	1,965.00	2,554,500	
オーバル	2,300	267.00	614,100	
東京精密	4,300	4,710.00	20,253,000	
マニー	10,200	1,623.00	16,554,600	
ニコン	39,000	1,329.00	51,831,000	
トプコン	12,000	1,521.00	18,252,000	
オリンパス	133,800	2,169.50	290,279,100	
理研計器	2,100	5,000.00	10,500,000	
タムロン	2,000	2,390.00	4,780,000	
ＨＯＹＡ	49,800	15,300.00	761,940,000	
シード	1,200	508.00	609,600	
ノーリツ鋼機	2,300	1,867.00	4,294,100	

エー・アンド・デイ	2,300	915.00	2,104,500	
朝日インテック	28,000	2,238.00	62,664,000	
シチズン時計	29,900	504.00	15,069,600	
リズム	800	1,376.00	1,100,800	
大研医器	2,000	522.00	1,044,000	
メニコン	8,500	3,095.00	26,307,500	
シンシア	300	526.00	157,800	
松風	1,100	1,884.00	2,072,400	
セイコーホールディングス	3,600	2,320.00	8,352,000	
ニプロ	19,000	1,102.00	20,938,000	
中本パックス	700	1,718.00	1,202,600	
スノーピーク	3,300	2,791.00	9,210,300	
パラマウントベッドホールディングス	4,900	1,944.00	9,525,600	
トランザクション	1,400	1,022.00	1,430,800	
粧美堂	700	433.00	303,100	
ニホンフラッシュ	2,200	1,061.00	2,334,200	
前田工繊	2,800	3,215.00	9,002,000	
永大産業	3,300	313.00	1,032,900	
アートネイチャー	2,200	713.00	1,568,600	
バンダイナムコホールディングス	22,900	8,000.00	183,200,000	
アイフィスジャパン	600	690.00	414,000	
共立印刷	4,200	145.00	609,000	
ＳＨＯＥＩ	2,400	4,470.00	10,728,000	
フランスベッドホールディングス	3,300	914.00	3,016,200	
パイロットコーポレーション	4,300	4,605.00	19,801,500	
萩原工業	1,700	1,217.00	2,068,900	
フジシールインターナショナル	6,200	1,872.00	11,606,400	
タカラトミー	10,700	1,288.00	13,781,600	
広済堂ホールディングス	1,600	831.00	1,329,600	
エステールホールディングス	600	655.00	393,000	
タカノ	900	715.00	643,500	
プロネクサス	2,000	1,075.00	2,150,000	
ホクシン	1,800	153.00	275,400	
ウッドワン	800	1,012.00	809,600	
大建工業	1,500	2,325.00	3,487,500	
凸版印刷	38,800	2,297.00	89,123,600	
大日本印刷	30,100	2,925.00	88,042,500	
共同印刷	700	2,752.00	1,926,400	
ＮＩＳＳＨＡ	5,200	1,414.00	7,352,800	
光村印刷	200	1,468.00	293,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,600	1,811.00	2,897,600	
アシックス	22,600	2,322.00	52,477,200	

ツツミ	600	1,802.00	1,081,200	
ローランド	1,800	4,115.00	7,407,000	
小松ウオール工業	800	1,865.00	1,492,000	
ヤマハ	14,800	5,500.00	81,400,000	
河合楽器製作所	700	3,020.00	2,114,000	
クリナップ	2,400	542.00	1,300,800	
ピジョン	15,400	2,286.00	35,204,400	
兼松サステック	200	1,669.00	333,800	
キングジム	2,200	879.00	1,933,800	
リンテック	5,500	2,660.00	14,630,000	
イトーキ	4,700	355.00	1,668,500	
任天堂	14,400	57,420.00	826,848,000	
三菱鉛筆	4,200	1,272.00	5,342,400	
タカラスタンダード	5,300	1,395.00	7,393,500	
コクヨ	12,200	1,672.00	20,398,400	
ナカバヤシ	2,300	516.00	1,186,800	
グローブライド	2,300	2,883.00	6,630,900	
オカムラ	8,800	1,202.00	10,577,600	
美津濃	2,500	2,347.00	5,867,500	
東京電力ホールディングス	190,900	355.00	67,769,500	
中部電力	78,000	1,131.00	88,218,000	
関西電力	96,600	1,150.00	111,090,000	
中国電力	39,900	905.00	36,109,500	
北陸電力	23,300	558.00	13,001,400	
東北電力	59,700	737.00	43,998,900	
四国電力	23,000	801.00	18,423,000	
九州電力	52,600	844.00	44,394,400	
北海道電力	22,200	507.00	11,255,400	
沖縄電力	5,400	1,412.00	7,624,800	
電源開発	21,700	1,882.00	40,839,400	
エフオン	1,500	521.00	781,500	
イーレックス	3,800	1,624.00	6,171,200	
レノバ	5,000	1,423.00	7,115,000	
東京瓦斯	48,900	2,314.00	113,154,600	
大阪瓦斯	46,200	2,093.00	96,696,600	
東邦瓦斯	11,700	3,230.00	37,791,000	
北海道瓦斯	1,300	1,521.00	1,977,300	
広島ガス	4,900	357.00	1,749,300	
西部ガスホールディングス	2,900	2,259.00	6,551,100	
静岡ガス	6,600	889.00	5,867,400	
メタウォーター	2,600	1,985.00	5,161,000	
ＳＢＳホールディングス	1,900	3,235.00	6,146,500	

東武鉄道	24,900	2,935.00	73,081,500	
相鉄ホールディングス	8,200	2,242.00	18,384,400	
東急	64,300	1,599.00	102,815,700	
京浜急行電鉄	32,800	1,268.00	41,590,400	
小田急電鉄	37,900	2,163.00	81,977,700	
京王電鉄	13,200	5,420.00	71,544,000	
京成電鉄	17,800	3,415.00	60,787,000	
富士急行	3,000	4,185.00	12,555,000	
新京成電鉄	600	2,002.00	1,201,200	
東日本旅客鉄道	44,900	7,150.00	321,035,000	
西日本旅客鉄道	30,900	5,086.00	157,157,400	
東海旅客鉄道	21,200	15,825.00	335,490,000	
西武ホールディングス	33,300	1,234.00	41,092,200	
鴻池運輸	4,100	1,191.00	4,883,100	
西日本鉄道	7,100	2,693.00	19,120,300	
ハマキョウレックス	1,800	2,897.00	5,214,600	
サカイ引越センター	1,200	4,480.00	5,376,000	
近鉄グループホールディングス	24,200	3,595.00	86,999,000	
阪急阪神ホールディングス	30,200	3,545.00	107,059,000	
南海電気鉄道	10,800	2,392.00	25,833,600	
京阪ホールディングス	10,800	2,947.00	31,827,600	
神戸電鉄	600	3,360.00	2,016,000	
名古屋鉄道	19,900	2,033.00	40,456,700	
山陽電気鉄道	1,900	1,999.00	3,798,100	
アルプス物流	1,700	1,037.00	1,762,900	
ヤマトホールディングス	33,900	2,185.00	74,071,500	
山九	6,400	4,105.00	26,272,000	
丸運	1,300	244.00	317,200	
丸全昭和運輸	2,000	3,205.00	6,410,000	
センコーグループホールディングス	12,100	924.00	11,180,400	
トナミホールディングス	600	3,815.00	2,289,000	
ニッコンホールディングス	8,100	2,178.00	17,641,800	
日本石油輸送	300	2,637.00	791,100	
福山通運	4,000	3,910.00	15,640,000	
セイノーホールディングス	16,400	1,212.00	19,876,800	
エスライン	700	910.00	637,000	
神奈川中央交通	600	3,450.00	2,070,000	
日立物流	4,700	5,830.00	27,401,000	
丸和運輸機関	5,100	1,137.00	5,798,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	2,400	1,317.00	3,160,800	
九州旅客鉄道	18,700	2,583.00	48,302,100	
ＳＧホールディングス	45,600	2,476.00	112,905,600	

ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	8,400	7,280.00	61,152,000	
日本郵船	20,200	9,660.00	195,132,000	
商船三井	13,400	8,910.00	119,394,000	
川崎汽船	7,400	7,180.00	53,132,000	
ＮＳユナイテッド海運	1,300	3,885.00	5,050,500	
明治海運	2,900	858.00	2,488,200	
飯野海運	11,200	769.00	8,612,800	
共栄タンカー	400	945.00	378,000	
乾汽船	1,700	2,782.00	4,729,400	
日本航空	55,400	2,336.00	129,414,400	
ＡＮＡホールディングス	61,400	2,577.00	158,227,800	
パスコ	500	1,303.00	651,500	
トランコム	700	7,360.00	5,152,000	
日新	1,900	1,698.00	3,226,200	
三菱倉庫	7,700	2,786.00	21,452,200	
三井倉庫ホールディングス	2,600	2,345.00	6,097,000	
住友倉庫	8,500	2,108.00	17,918,000	
澁澤倉庫	1,400	2,219.00	3,106,600	
東陽倉庫	4,000	317.00	1,268,000	
日本トランスシティ	5,300	635.00	3,365,500	
ケイヒン	400	1,383.00	553,200	
中央倉庫	1,500	982.00	1,473,000	
川西倉庫	400	1,100.00	440,000	
安田倉庫	2,000	972.00	1,944,000	
ファイズホールディングス	500	598.00	299,000	
東洋埠頭	700	1,452.00	1,016,400	
上組	13,300	2,197.00	29,220,100	
サンリツ	700	842.00	589,400	
キムラユニティー	600	1,364.00	818,400	
キユーソー流通システム	1,200	938.00	1,125,600	
近鉄エクスプレス	4,600	3,145.00	14,467,000	
東海運	1,400	306.00	428,400	
エーアイテイー	1,500	1,394.00	2,091,000	
内外トランスライン	900	1,937.00	1,743,300	
日本コンセプト	800	1,387.00	1,109,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	8,300	1,790.00	14,857,000	
クロスキャット	700	1,606.00	1,124,200	
システナ	35,700	382.00	13,637,400	
デジタルアーツ	1,300	6,270.00	8,151,000	
日鉄ソリューションズ	3,600	3,645.00	13,122,000	
キューブシステム	1,300	937.00	1,218,100	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	400	1,140.00	456,000	

コア	1,100	1,511.00	1,662,100	
ラクーンホールディングス	2,100	1,205.00	2,530,500	
ソリトンシステムズ	1,300	1,469.00	1,909,700	
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	4,055.00	4,460,500	
ＴＩＳ	23,900	2,698.00	64,482,200	
ＪＮＳホールディングス	1,200	422.00	506,400	
グリー	11,400	812.00	9,256,800	
GMOペパボ	300	2,358.00	707,400	
コーエーテクモホールディングス	8,000	4,110.00	32,880,000	
三菱総合研究所	1,100	3,720.00	4,092,000	
ボルテージ	700	349.00	244,300	
電算	300	2,270.00	681,000	
ＡＧＳ	1,300	797.00	1,036,100	
ファインデックス	2,100	703.00	1,476,300	
ブレインパッド	2,100	1,130.00	2,373,000	
ＫＬａｂ	4,600	423.00	1,945,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,600	991.00	3,567,600	
ネクソン	56,500	2,398.00	135,487,000	
アイスタイル	6,400	193.00	1,235,200	
エムアップホールディングス	2,900	798.00	2,314,200	
エイチーム	1,700	741.00	1,259,700	
エニグモ	2,700	683.00	1,844,100	
テクノスジャパン	1,900	442.00	839,800	
ｅｎｉｓｈ	1,500	336.00	504,000	
コロプラ	8,200	648.00	5,313,600	
オルトプラス	1,900	310.00	589,000	
ブロードリーフ	12,400	325.00	4,030,000	
クロス・マーケティンググループ	900	977.00	879,300	
デジタルハーツホールディングス	1,100	1,543.00	1,697,300	
システム情報	1,900	975.00	1,852,500	
メディアドゥ	900	2,519.00	2,267,100	
じげん	7,100	306.00	2,172,600	
ブイキューブ	2,500	792.00	1,980,000	
エンカレッジ・テクノロジ	500	530.00	265,000	
サイバーリンクス	800	878.00	702,400	
ディー・エル・イー	1,600	223.00	356,800	
フィックスターズ	2,700	723.00	1,952,100	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,000	2,364.00	2,364,000	
オプティム	1,700	908.00	1,543,600	
セレス	900	1,484.00	1,335,600	
ＳＨＩＦＴ	1,300	20,230.00	26,299,000	
ティーガイア	2,200	1,736.00	3,819,200	

セック	400	2,118.00	847,200	
テクマトリックス	4,200	1,619.00	6,799,800	
プロシップ	800	1,398.00	1,118,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,500	2,642.00	17,173,000	
GMOペイメントゲートウェイ	4,900	10,550.00	51,695,000	
ザッパラス	1,000	481.00	481,000	
システムリサーチ	700	1,774.00	1,241,800	
インターネットイニシアティブ	6,700	3,535.00	23,684,500	
さくらインターネット	2,700	523.00	1,412,100	
ヴィンクス	700	972.00	680,400	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	600	3,985.00	2,391,000	
ＳＲＡホールディングス	1,200	2,882.00	3,458,400	
システムインテグレータ	800	532.00	425,600	
朝日ネット	2,300	591.00	1,359,300	
ｅＢＡＳＥ	3,000	611.00	1,833,000	
アバント	2,700	1,062.00	2,867,400	
アドソル日進	900	1,611.00	1,449,900	
ＯＤＫソリューションズ	500	648.00	324,000	
フリービット	1,300	906.00	1,177,800	
コムチュア	2,800	2,757.00	7,719,600	
サイバーコム	400	1,027.00	410,800	
アステリア	1,800	760.00	1,368,000	
アイル	1,400	1,284.00	1,797,600	
マークラインズ	1,300	2,604.00	3,385,200	
メディカル・データ・ビジョン	3,200	1,038.00	3,321,600	
ｇｕｍｉ	3,500	555.00	1,942,500	
ショーケース	500	436.00	218,000	
モバイルファクトリー	600	909.00	545,400	
テラスカイ	900	1,464.00	1,317,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,279.00	1,406,900	
ＰＣＩホールディングス	1,100	955.00	1,050,500	
パイプドＨＤ	500	2,581.00	1,290,500	
アイビーシー	400	600.00	240,000	
ネオジャパン	700	1,041.00	728,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	500	2,754.00	1,377,000	
ラクス	8,600	1,870.00	16,082,000	
ランドコンピュータ	600	864.00	518,400	
ダブルスタンダード	800	1,926.00	1,540,800	
オープンドア	1,500	1,907.00	2,860,500	
マイネット	900	485.00	436,500	
アカツキ	1,100	2,880.00	3,168,000	
ベネフィットジャパン	200	1,878.00	375,600	

ＵｂｉｃｏｍホールディングＳ	700	1,922.00	1,345,400	
カナミックネットワーク	2,700	427.00	1,152,900	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	229.00	297,700	
チェンジ	4,600	1,587.00	7,300,200	
シンクロ・フード	1,300	275.00	357,500	
オークネット	1,300	1,451.00	1,886,300	
キャピタル・アセット・プランニング	500	769.00	384,500	
セグエグループ	600	545.00	327,000	
エイトレッド	400	2,047.00	818,800	
マクロミル	5,400	1,102.00	5,950,800	
ビーグリー	600	1,161.00	696,600	
オロ	800	2,472.00	1,977,600	
ユーザーローカル	800	1,550.00	1,240,000	
テモナ	500	415.00	207,500	
ニーズウェル	600	612.00	367,200	
マネーフォワード	3,800	5,040.00	19,152,000	
サインポスト	800	870.00	696,000	
電算システムホールディングス	1,000	2,699.00	2,699,000	
ソルクシーズ	2,100	404.00	848,400	
フェイス	700	675.00	472,500	
プロトコーポレーション	2,700	1,249.00	3,372,300	
ハイマックス	700	1,167.00	816,900	
野村総合研究所	48,400	3,935.00	190,454,000	
サイバネットシステム	1,800	635.00	1,143,000	
ＣＥホールディングス	1,300	472.00	613,600	
日本システム技術	500	2,101.00	1,050,500	
インテージホールディングス	2,900	1,751.00	5,077,900	
東邦システムサイエンス	700	913.00	639,100	
ソースネクスト	10,700	151.00	1,615,700	
インフォコム	2,700	2,031.00	5,483,700	
シンプレクス・ホールディングス	2,900	1,809.00	5,246,100	
ＨＥＲＯＺ	700	899.00	629,300	
ラクスル	2,700	3,535.00	9,544,500	
ＩＰＳ	700	1,970.00	1,379,000	
ＦＩＧ	2,700	284.00	766,800	
システムサポート	900	1,008.00	907,200	
イーソル	1,500	500.00	750,000	
アルテリア・ネットワークス	3,200	1,336.00	4,275,200	
東海ソフト	400	898.00	359,200	
ウイングアーク１ｓｔ	1,400	1,339.00	1,874,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	1,768.00	1,060,800	
サーバーワークス	400	2,323.00	929,200	

東名	200	964.00	192,800	
ヴィッツ	200	1,175.00	235,000	
トビラシステムズ	500	814.00	407,000	
Ｓａｎｓａｎ	8,900	1,095.00	9,745,500	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	400	757.00	302,800	
ギフティ	2,300	955.00	2,196,500	
ベース	400	4,700.00	1,880,000	
ＪＭＤＣ	2,300	5,630.00	12,949,000	
フォーカスシステムズ	1,700	917.00	1,558,900	
クレスコ	1,800	1,688.00	3,038,400	
フジ・メディア・ホールディングス	24,100	1,286.00	30,992,600	
オービック	7,900	18,720.00	147,888,000	
ジャストシステム	3,600	5,500.00	19,800,000	
ＴＤＣソフト	2,200	1,106.00	2,433,200	
Ｚホールディングス	363,800	563.80	205,110,440	
トレンドマイクロ	13,400	6,000.00	80,400,000	
ＩＤホールディングス	1,600	850.00	1,360,000	
日本オラクル	4,100	8,220.00	33,702,000	
アルファシステムズ	700	3,790.00	2,653,000	
フューチャー	5,300	1,408.00	7,462,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,500	1,328.00	1,992,000	
ＳＢテクノロジー	1,100	2,504.00	2,754,400	
トーセ	700	728.00	509,600	
オービックビジネスコンサルタント	2,400	4,290.00	10,296,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	11,400	2,963.00	33,778,200	
アイティフォー	3,000	786.00	2,358,000	
東計電算	300	4,970.00	1,491,000	
エックスネット	400	998.00	399,200	
大塚商会	13,500	4,400.00	59,400,000	
サイボウズ	3,300	1,377.00	4,544,100	
電通国際情報サービス	3,600	3,540.00	12,744,000	
ＡＣＣＥＳＳ	2,800	569.00	1,593,200	
デジタルガレージ	4,100	3,935.00	16,133,500	
ＥＭシステムズ	4,100	697.00	2,857,700	
ウェザーニューズ	800	7,770.00	6,216,000	
ＣＩＪ	1,600	804.00	1,286,400	
ビジネスエンジニアリング	300	3,570.00	1,071,000	
日本エンタープライズ	2,500	168.00	420,000	
WOWOW	1,200	1,770.00	2,124,000	
スカラ	2,100	653.00	1,371,300	
インテリジェント　ウェイブ	1,300	561.00	729,300	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	2,100	623.00	1,308,300	

ネットワンシステムズ	9,500	2,877.00	27,331,500	
システムソフト	5,300	96.00	508,800	
アルゴグラフィックス	1,900	3,070.00	5,833,000	
マーベラス	3,900	727.00	2,835,300	
エイベックス	4,300	1,336.00	5,744,800	
日本ユニシス	7,800	3,120.00	24,336,000	
兼松エレクトロニクス	1,400	3,855.00	5,397,000	
都築電気	1,300	1,387.00	1,803,100	
ＴＢＳホールディングス	15,200	1,950.00	29,640,000	
日本テレビホールディングス	20,900	1,367.00	28,570,300	
朝日放送グループホールディングス	2,500	756.00	1,890,000	
テレビ朝日ホールディングス	6,000	1,667.00	10,002,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	21,200	455.00	9,646,000	
テレビ東京ホールディングス	1,800	2,137.00	3,846,600	
日本ＢＳ放送	800	1,075.00	860,000	
ビジョン	4,300	1,037.00	4,459,100	
スマートバリュー	600	448.00	268,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,400	2,423.00	5,815,200	
ワイヤレスゲート	1,000	298.00	298,000	
コネクシオ	1,800	1,396.00	2,512,800	
日本通信	20,800	181.00	3,764,800	
クロップス	500	869.00	434,500	
日本電信電話	261,900	3,285.00	860,341,500	
ＫＤＤＩ	182,500	3,720.00	678,900,000	
ソフトバンク	379,100	1,434.00	543,629,400	
光通信	2,900	14,720.00	42,688,000	
エムティーアイ	2,400	515.00	1,236,000	
GMOインターネット	8,900	2,573.00	22,899,700	
ファイバーゲート	1,100	1,127.00	1,239,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	286.00	143,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	13,700	2,407.00	32,975,900	
学研ホールディングス	3,500	1,004.00	3,514,000	
ゼンリン	4,100	1,053.00	4,317,300	
昭文社ホールディングス	1,000	448.00	448,000	
インプレスホールディングス	2,000	207.00	414,000	
アイネット	1,300	1,279.00	1,662,700	
松竹	1,700	12,160.00	20,672,000	
東宝	14,800	4,785.00	70,818,000	
東映	800	17,300.00	13,840,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	66,600	2,107.00	140,326,200	
ピー・シー・エー	1,500	1,411.00	2,116,500	
ビジネスブレイン太田昭和	900	1,525.00	1,372,500	

ＤＴＳ	4,800	2,737.00	13,137,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,600	5,670.00	65,772,000	
シーイーシー	2,700	1,061.00	2,864,700	
カプコン	23,600	2,878.00	67,920,800	
アイ・エス・ビー	1,200	935.00	1,122,000	
ジャステック	1,400	1,044.00	1,461,600	
ＳＣＳＫ	17,300	1,939.00	33,544,700	
日本システムウエア	900	2,087.00	1,878,300	
アイネス	2,300	1,499.00	3,447,700	
ＴＫＣ	4,200	3,135.00	13,167,000	
富士ソフト	2,700	5,050.00	13,635,000	
ＮＳＤ	8,000	2,132.00	17,056,000	
コナミホールディングス	9,100	6,760.00	61,516,000	
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,110.00	3,421,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,700	1,468.00	2,495,600	
ミロク情報サービス	2,200	1,364.00	3,000,800	
ソフトバンクグループ	150,100	5,158.00	774,215,800	
ホウスイ	200	820.00	164,000	
高千穂交易	1,000	1,513.00	1,513,000	
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,493.00	597,200	
伊藤忠食品	600	5,020.00	3,012,000	
エレマテック	2,000	1,064.00	2,128,000	
ＪＡＬＵＸ	600	2,557.00	1,534,200	
あらた	2,000	3,905.00	7,810,000	
トーメンデバイス	400	6,280.00	2,512,000	
東京エレクトロン　デバイス	700	5,320.00	3,724,000	
フィールズ	2,200	572.00	1,258,400	
双日	27,800	1,919.00	53,348,200	
アルフレッサ　ホールディングス	27,900	1,737.00	48,462,300	
横浜冷凍	7,000	884.00	6,188,000	
神栄	300	845.00	253,500	
ラサ商事	1,300	1,004.00	1,305,200	
アルコニックス	3,100	1,323.00	4,101,300	
神戸物産	19,500	3,745.00	73,027,500	
ハイパー	600	480.00	288,000	
あい　ホールディングス	3,600	1,800.00	6,480,000	
ディーブイエックス	900	1,063.00	956,700	
ダイワボウホールディングス	12,200	1,746.00	21,301,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	6,000	2,616.00	15,696,000	
ラクト・ジャパン	900	2,032.00	1,828,800	
グリムス	1,100	2,090.00	2,299,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	814.00	3,581,600	

八洲電機	1,800	960.00	1,728,000	
メディアスホールディングス	1,400	886.00	1,240,400	
レスターホールディングス	2,400	1,955.00	4,692,000	
ジューテックホールディングス	600	1,217.00	730,200	
大光	1,100	695.00	764,500	
ＯＣＨＩホールディングス	700	1,335.00	934,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	12,200	906.00	11,053,200	
黒谷	700	640.00	448,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	400	734.00	293,600	
三洋貿易	2,500	1,016.00	2,540,000	
ビューティガレージ	400	3,100.00	1,240,000	
ウイン・パートナーズ	1,800	1,032.00	1,857,600	
ミタチ産業	600	860.00	516,000	
シップヘルスケアホールディングス	8,100	2,364.00	19,148,400	
明治電機工業	800	1,255.00	1,004,000	
デリカフーズホールディングス	1,000	555.00	555,000	
スターティアホールディングス	600	674.00	404,400	
コメダホールディングス	5,500	2,152.00	11,836,000	
ピーバンドットコム	300	594.00	178,200	
アセンテック	900	702.00	631,800	
富士興産	600	942.00	565,200	
協栄産業	300	1,518.00	455,400	
フルサト・マルカホールディングス	2,400	2,169.00	5,205,600	
ヤマエグループホールディングス	1,700	1,067.00	1,813,900	
小野建	2,400	1,596.00	3,830,400	
南陽	500	1,921.00	960,500	
佐鳥電機	1,600	915.00	1,464,000	
エコートレーディング	500	597.00	298,500	
伯東	1,500	2,311.00	3,466,500	
コンドーテック	1,900	1,030.00	1,957,000	
中山福	1,300	396.00	514,800	
ナガイレーベン	3,300	2,127.00	7,019,100	
三菱食品	2,400	3,225.00	7,740,000	
松田産業	1,800	2,231.00	4,015,800	
第一興商	4,800	3,555.00	17,064,000	
メディパルホールディングス	27,100	2,120.00	57,452,000	
ＳＰＫ	1,000	1,300.00	1,300,000	
萩原電気ホールディングス	900	2,042.00	1,837,800	
アズワン	3,600	6,390.00	23,004,000	
スズデン	900	2,000.00	1,800,000	
尾家産業	700	1,001.00	700,700	
シモジマ	1,500	1,011.00	1,516,500	

ドウシシャ	2,400	1,548.00	3,715,200	
小津産業	600	2,000.00	1,200,000	
高速	1,500	1,508.00	2,262,000	
たけびし	900	1,426.00	1,283,400	
リックス	600	1,575.00	945,000	
丸文	2,200	717.00	1,577,400	
ハピネット	2,100	1,588.00	3,334,800	
橋本総業ホールディングス	500	2,032.00	1,016,000	
日本ライフライン	7,400	1,037.00	7,673,800	
タカショー	1,900	660.00	1,254,000	
ＩＤＯＭ	7,600	660.00	5,016,000	
進和	1,500	2,032.00	3,048,000	
エスケイジャパン	600	421.00	252,600	
ダイトロン	1,100	1,870.00	2,057,000	
シークス	3,600	1,269.00	4,568,400	
田中商事	800	650.00	520,000	
オーハシテクニカ	1,300	1,360.00	1,768,000	
白銅	800	2,596.00	2,076,800	
ダイコー通産	300	1,185.00	355,500	
伊藤忠商事	175,700	3,794.00	666,605,800	
丸紅	247,800	1,182.50	293,023,500	
高島	400	2,424.00	969,600	
長瀬産業	13,800	1,884.00	25,999,200	
蝶理	1,400	1,789.00	2,504,600	
豊田通商	25,200	4,895.00	123,354,000	
三共生興	3,300	571.00	1,884,300	
兼松	9,400	1,370.00	12,878,000	
ツカモトコーポレーション	400	1,333.00	533,200	
三井物産	195,100	2,964.00	578,276,400	
日本紙パルプ商事	1,300	4,085.00	5,310,500	
カメイ	3,000	1,054.00	3,162,000	
東都水産	100	3,940.00	394,000	
ＯＵＧホールディングス	400	2,741.00	1,096,400	
スターゼン	1,900	2,129.00	4,045,100	
山善	10,600	1,017.00	10,780,200	
椿本興業	500	4,195.00	2,097,500	
住友商事	158,600	1,862.00	295,313,200	
内田洋行	1,100	4,665.00	5,131,500	
三菱商事	188,300	3,964.00	746,421,200	
第一実業	1,100	4,305.00	4,735,500	
キヤノンマーケティングジャパン	6,200	2,494.00	15,462,800	
西華産業	1,300	1,595.00	2,073,500	

佐藤商事	2,100	1,206.00	2,532,600	
菱洋エレクトロ	1,500	2,123.00	3,184,500	
東京産業	2,300	706.00	1,623,800	
ユアサ商事	2,400	2,964.00	7,113,600	
神鋼商事	600	3,690.00	2,214,000	
トルク	1,300	223.00	289,900	
阪和興業	5,000	3,345.00	16,725,000	
正栄食品工業	1,600	4,150.00	6,640,000	
カナデン	2,000	990.00	1,980,000	
菱電商事	2,000	1,716.00	3,432,000	
岩谷産業	6,000	5,250.00	31,500,000	
ナイス	900	1,898.00	1,708,200	
ニチモウ	400	2,678.00	1,071,200	
極東貿易	700	2,301.00	1,610,700	
アステナホールディングス	3,500	414.00	1,449,000	
三愛石油	6,200	936.00	5,803,200	
稲畑産業	5,500	2,434.00	13,387,000	
ＧＳＩクレオス	1,200	1,141.00	1,369,200	
明和産業	2,300	1,111.00	2,555,300	
クワザワホールディングス	1,000	607.00	607,000	
ワキタ	5,400	1,017.00	5,491,800	
東邦ホールディングス	8,100	1,895.00	15,349,500	
サンゲツ	6,600	1,589.00	10,487,400	
ミツウロコグループホールディングス	3,700	1,079.00	3,992,300	
シナネンホールディングス	900	3,295.00	2,965,500	
伊藤忠エネクス	5,600	1,036.00	5,801,600	
サンリオ	7,800	2,473.00	19,289,400	
サンワテクノス	1,500	1,343.00	2,014,500	
リョーサン	2,800	2,345.00	6,566,000	
新光商事	3,800	902.00	3,427,600	
トーホー	1,100	1,095.00	1,204,500	
三信電気	1,200	1,643.00	1,971,600	
東陽テクニカ	2,500	1,059.00	2,647,500	
モスフードサービス	3,300	3,065.00	10,114,500	
加賀電子	2,300	3,305.00	7,601,500	
ソーダニッカ	2,500	886.00	2,215,000	
立花エレテック	2,000	1,607.00	3,214,000	
フォーバル	1,100	907.00	997,700	
ＰＡＬＴＡＣ	3,500	4,455.00	15,592,500	
三谷産業	2,900	312.00	904,800	
太平洋興発	900	650.00	585,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	600	2,818.00	1,690,800	

ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,971.00	394,200	
コーア商事ホールディングス	1,600	641.00	1,025,600	
国際紙パルプ商事	5,200	344.00	1,788,800	
ヤマタネ	1,200	1,629.00	1,954,800	
丸紅建材リース	200	1,776.00	355,200	
日鉄物産	1,800	5,330.00	9,594,000	
泉州電業	700	6,280.00	4,396,000	
トラスコ中山	5,200	2,493.00	12,963,600	
オートバックスセブン	8,400	1,433.00	12,037,200	
モリト	1,800	731.00	1,315,800	
加藤産業	3,600	3,235.00	11,646,000	
北恵	600	895.00	537,000	
イノテック	1,500	1,399.00	2,098,500	
イエローハット	4,300	1,643.00	7,064,900	
ＪＫホールディングス	2,000	1,052.00	2,104,000	
日伝	2,100	2,259.00	4,743,900	
北沢産業	1,700	230.00	391,000	
杉本商事	1,200	2,080.00	2,496,000	
因幡電機産業	6,700	2,617.00	17,533,900	
東テク	800	2,442.00	1,953,600	
ミスミグループ本社	31,500	3,535.00	111,352,500	
アルテック	1,700	302.00	513,400	
タキヒヨー	800	1,416.00	1,132,800	
蔵王産業	500	1,899.00	949,500	
スズケン	9,800	3,585.00	35,133,000	
ジェコス	1,700	820.00	1,394,000	
グローセル	2,900	437.00	1,267,300	
ローソン	5,600	4,970.00	27,832,000	
サンエー	1,900	4,020.00	7,638,000	
カワチ薬品	1,900	2,371.00	4,504,900	
エービーシー・マート	3,900	5,280.00	20,592,000	
ハードオフコーポレーション	1,100	801.00	881,100	
アスクル	5,700	1,664.00	9,484,800	
ゲオホールディングス	3,400	1,501.00	5,103,400	
アダストリア	2,700	1,710.00	4,617,000	
ジーフット	1,500	329.00	493,500	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	400	380.00	152,000	
くら寿司	2,600	3,740.00	9,724,000	
キャンドゥ	900	2,068.00	1,861,200	
アイケイ	800	420.00	336,000	
パルグループホールディングス	2,200	1,634.00	3,594,800	
エディオン	11,500	1,190.00	13,685,000	

サーラコーポレーション	5,100	637.00	3,248,700	
ワッツ	1,200	705.00	846,000	
ハローズ	1,100	2,802.00	3,082,200	
フジオフードグループ本社	2,100	1,323.00	2,778,300	
あみやき亭	600	2,952.00	1,771,200	
ひらまつ	5,300	196.00	1,038,800	
大黒天物産	800	4,735.00	3,788,000	
ハニーズホールディングス	2,200	1,019.00	2,241,800	
ファーマライズホールディングス	600	718.00	430,800	
アルペン	1,900	2,216.00	4,210,400	
ハブ	800	622.00	497,600	
クオールホールディングス	3,100	1,308.00	4,054,800	
ジンズホールディングス	1,700	6,620.00	11,254,000	
ビックカメラ	14,900	1,040.00	15,496,000	
ＤＣＭホールディングス	15,500	1,111.00	17,220,500	
ペッパーフードサービス	3,400	350.00	1,190,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	31,800	2,034.00	64,681,200	
東京一番フーズ	600	598.00	358,800	
ＤＤホールディングス	1,300	542.00	704,600	
きちりホールディングス	700	430.00	301,000	
アークランドサービスホールディングス	1,800	2,244.00	4,039,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	30,000	1,077.00	32,310,000	
ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,644.00	7,069,200	
マツキヨココカラ＆カンパニー	15,500	4,235.00	65,642,500	
ブロンコビリー	1,400	2,273.00	3,182,200	
ＺＯＺＯ	17,300	3,185.00	55,100,500	
トレジャー・ファクトリー	700	970.00	679,000	
物語コーポレーション	1,200	6,790.00	8,148,000	
三越伊勢丹ホールディングス	44,000	954.00	41,976,000	
Ｈａｍｅｅ	900	1,070.00	963,000	
マーケットエンタープライズ	200	663.00	132,600	
ウエルシアホールディングス	13,300	3,170.00	42,161,000	
クリエイトＳＤホールディングス	3,700	3,170.00	11,729,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,900	365.00	1,058,500	
ミサワ	500	650.00	325,000	
ティーライフ	300	1,310.00	393,000	
エー・ピーホールディングス	500	450.00	225,000	
チムニー	800	1,140.00	912,000	
シュッピン	2,100	1,160.00	2,436,000	
オイシックス・ラ・大地	3,600	2,560.00	9,216,000	
ネクステージ	5,100	2,558.00	13,045,800	
ジョイフル本田	7,600	1,558.00	11,840,800	

鳥貴族ホールディングス	900	1,861.00	1,674,900	
ホットランド	1,900	1,292.00	2,454,800	
すかいらーくホールディングス	32,400	1,450.00	46,980,000	
ＳＦＰホールディングス	1,200	1,428.00	1,713,600	
綿半ホールディングス	1,900	1,313.00	2,494,700	
ヨシックスホールディングス	500	2,189.00	1,094,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,300	1,079.00	7,876,700	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,300	1,050.00	1,365,000	
ＢＥＥＮＯＳ	1,300	1,546.00	2,009,800	
あさひ	2,100	1,405.00	2,950,500	
日本調剤	1,500	1,399.00	2,098,500	
コスモス薬品	2,500	15,250.00	38,125,000	
トーエル	1,200	864.00	1,036,800	
セブン&アイ・ホールディングス	98,300	5,832.00	573,285,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	13,400	759.00	10,170,600	
ツルハホールディングス	5,500	9,400.00	51,700,000	
サンマルクホールディングス	2,000	1,616.00	3,232,000	
フェリシモ	600	1,191.00	714,600	
トリドールホールディングス	6,200	2,649.00	16,423,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	2,300	441.00	1,014,300	
ウイルプラスホールディングス	500	892.00	446,000	
ＪＭホールディングス	1,700	1,763.00	2,997,100	
サツドラホールディングス	1,100	640.00	704,000	
アレンザホールディングス	1,900	1,088.00	2,067,200	
串カツ田中ホールディングス	700	2,106.00	1,474,200	
バロックジャパンリミテッド	1,700	884.00	1,502,800	
クスリのアオキホールディングス	2,500	7,000.00	17,500,000	
力の源ホールディングス	1,300	565.00	734,500	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	14,700	3,795.00	55,786,500	
メディカルシステムネットワーク	2,400	522.00	1,252,800	
一家ホールディングス	500	531.00	265,500	
藤久ホールディングス	800	633.00	506,400	
はるやまホールディングス	1,200	534.00	640,800	
ノジマ	4,100	2,513.00	10,303,300	
カッパ・クリエイト	3,500	1,379.00	4,826,500	
ライトオン	1,900	710.00	1,349,000	
良品計画	28,900	1,739.00	50,257,100	
三城ホールディングス	3,100	248.00	768,800	
アドヴァングループ	2,600	938.00	2,438,800	
アルビス	800	2,228.00	1,782,400	

コナカ	3,000	356.00	1,068,000	
ハウス　オブ　ローゼ	300	1,699.00	509,700	
Ｇ－７ホールディングス	2,800	1,552.00	4,345,600	
イオン北海道	4,400	1,194.00	5,253,600	
コジマ	4,300	549.00	2,360,700	
ヒマラヤ	900	1,010.00	909,000	
コーナン商事	3,600	3,645.00	13,122,000	
エコス	900	2,025.00	1,822,500	
ワタミ	3,000	940.00	2,820,000	
マルシェ	600	450.00	270,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	50,200	1,905.00	95,631,000	
西松屋チェーン	5,500	1,427.00	7,848,500	
ゼンショーホールディングス	12,300	2,695.00	33,148,500	
幸楽苑ホールディングス	1,600	1,409.00	2,254,400	
ハークスレイ	1,000	489.00	489,000	
サイゼリヤ	3,700	2,933.00	10,852,100	
ＶＴホールディングス	9,500	479.00	4,550,500	
魚力	700	2,087.00	1,460,900	
ポプラ	600	141.00	84,600	
フジ・コーポレーション	1,300	1,158.00	1,505,400	
ユナイテッドアローズ	2,600	1,759.00	4,573,400	
ハイデイ日高	3,600	1,769.00	6,368,400	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,400	200.00	280,000	
コロワイド	10,300	1,708.00	17,592,400	
ピーシーデポコーポレーション	2,900	285.00	826,500	
壱番屋	1,800	4,680.00	8,424,000	
トップカルチャー	900	294.00	264,600	
ＰＬＡＮＴ	600	657.00	394,200	
スギホールディングス	5,000	6,590.00	32,950,000	
薬王堂ホールディングス	1,300	2,474.00	3,216,200	
ヴィア・ホールディングス	3,200	159.00	508,800	
スクロール	3,900	918.00	3,580,200	
ヨンドシーホールディングス	2,300	1,734.00	3,988,200	
木曽路	3,400	2,259.00	7,680,600	
ＳＲＳホールディングス	3,500	831.00	2,908,500	
千趣会	4,500	370.00	1,665,000	
タカキュー	1,800	117.00	210,600	
リテールパートナーズ	3,000	1,223.00	3,669,000	
ケーヨー	4,600	862.00	3,965,200	
上新電機	2,900	2,120.00	6,148,000	
日本瓦斯	12,200	1,725.00	21,045,000	

ロイヤルホールディングス	4,300	1,992.00	8,565,600	
東天紅	200	953.00	190,600	
いなげや	3,100	1,412.00	4,377,200	
チヨダ	2,400	750.00	1,800,000	
ライフコーポレーション	2,300	3,060.00	7,038,000	
リンガーハット	3,100	2,297.00	7,120,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	3,100	612.00	1,897,200	
テンアライド	2,400	317.00	760,800	
ＡＯＫＩホールディングス	4,900	623.00	3,052,700	
オークワ	3,900	948.00	3,697,200	
コメリ	3,900	2,769.00	10,799,100	
青山商事	5,200	745.00	3,874,000	
しまむら	2,900	10,470.00	30,363,000	
はせがわ	1,300	301.00	391,300	
高島屋	18,300	1,160.00	21,228,000	
松屋	5,100	747.00	3,809,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	11,900	894.00	10,638,600	
近鉄百貨店	1,000	2,692.00	2,692,000	
丸井グループ	19,800	2,289.00	45,322,200	
アクシアル　リテイリング	1,900	3,265.00	6,203,500	
井筒屋	1,200	374.00	448,800	
イオン	96,700	2,678.50	259,010,950	
イズミ	4,500	3,325.00	14,962,500	
平和堂	4,600	1,998.00	9,190,800	
フジ	3,000	1,903.00	5,709,000	
ヤオコー	2,900	6,640.00	19,256,000	
ゼビオホールディングス	3,400	962.00	3,270,800	
ケーズホールディングス	23,200	1,260.00	29,232,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,300	713.00	926,900	
日産東京販売ホールディングス	3,700	234.00	865,800	
シルバーライフ	500	1,108.00	554,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,100	3,605.00	3,965,500	
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,030.00	618,000	
ブックオフグループホールディングス	1,500	1,046.00	1,569,000	
ギフト	400	2,358.00	943,200	
アインホールディングス	3,400	6,370.00	21,658,000	
元気寿司	700	2,566.00	1,796,200	
ヤマダホールディングス	91,900	405.00	37,219,500	
アークランドサカモト	3,900	1,540.00	6,006,000	
ニトリホールディングス	10,000	16,670.00	166,700,000	
グルメ杵屋	2,000	1,031.00	2,062,000	
愛眼	1,800	181.00	325,800	

ケーユーホールディングス	1,300	1,085.00	1,410,500	
吉野家ホールディングス	8,800	2,435.00	21,428,000	
松屋フーズホールディングス	1,200	3,640.00	4,368,000	
サガミホールディングス	3,800	1,223.00	4,647,400	
関西フードマーケット	1,900	1,106.00	2,101,400	
王将フードサービス	1,700	6,020.00	10,234,000	
プレナス	2,800	2,055.00	5,754,000	
ミニストップ	1,900	1,483.00	2,817,700	
アークス	4,800	2,190.00	10,512,000	
バローホールディングス	5,600	2,257.00	12,639,200	
ベルク	1,100	5,340.00	5,874,000	
大庄	1,300	1,034.00	1,344,200	
ファーストリテイリング	3,400	62,970.00	214,098,000	
サンドラッグ	9,500	3,130.00	29,735,000	
サックスバー　ホールディングス	2,400	525.00	1,260,000	
ヤマザワ	600	1,620.00	972,000	
やまや	500	2,532.00	1,266,000	
ベルーナ	5,400	741.00	4,001,400	
島根銀行	800	562.00	449,600	
じもとホールディングス	1,800	686.00	1,234,800	
めぶきフィナンシャルグループ	130,700	281.00	36,726,700	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,200	1,978.00	6,329,600	
九州フィナンシャルグループ	51,400	430.00	22,102,000	
ゆうちょ銀行	59,400	1,056.00	62,726,400	
富山第一銀行	6,000	319.00	1,914,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	143,700	490.00	70,413,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	16,400	846.00	13,874,400	
三十三フィナンシャルグループ	2,300	1,537.00	3,535,100	
第四北越フィナンシャルグループ	4,100	2,756.00	11,299,600	
ひろぎんホールディングス	37,100	708.00	26,266,800	
おきなわフィナンシャルグループ	2,300	2,344.00	5,391,200	
十六フィナンシャルグループ	3,400	2,405.00	8,177,000	
北國フィナンシャルホールディングス	2,300	3,365.00	7,739,500	
新生銀行	16,400	2,200.00	36,080,000	
あおぞら銀行	14,100	2,679.00	37,773,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,577,900	734.10	1,158,336,390	
りそなホールディングス	287,500	535.20	153,870,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	47,600	4,193.00	199,586,800	
三井住友フィナンシャルグループ	174,200	4,310.00	750,802,000	
千葉銀行	84,000	775.00	65,100,000	
群馬銀行	48,300	402.00	19,416,600	
武蔵野銀行	3,700	1,928.00	7,133,600	

千葉興業銀行	5,900	284.00	1,675,600	
筑波銀行	9,800	214.00	2,097,200	
七十七銀行	7,900	1,566.00	12,371,400	
青森銀行	1,900	1,944.00	3,693,600	
秋田銀行	1,600	1,760.00	2,816,000	
山形銀行	2,800	995.00	2,786,000	
岩手銀行	1,600	1,929.00	3,086,400	
東邦銀行	21,000	223.00	4,683,000	
東北銀行	1,200	1,031.00	1,237,200	
みちのく銀行	1,600	895.00	1,432,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	21,200	2,377.00	50,392,400	
静岡銀行	61,300	907.00	55,599,100	
スルガ銀行	22,100	449.00	9,922,900	
八十二銀行	56,700	443.00	25,118,100	
山梨中央銀行	2,700	986.00	2,662,200	
大垣共立銀行	5,000	2,054.00	10,270,000	
福井銀行	2,200	1,491.00	3,280,200	
清水銀行	1,000	1,629.00	1,629,000	
富山銀行	500	2,200.00	1,100,000	
滋賀銀行	4,700	2,261.00	10,626,700	
南都銀行	3,900	2,143.00	8,357,700	
百五銀行	24,100	360.00	8,676,000	
京都銀行	9,000	5,670.00	51,030,000	
紀陽銀行	8,500	1,592.00	13,532,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	15,700	970.00	15,229,000	
山陰合同銀行	14,900	689.00	10,266,100	
中国銀行	20,100	930.00	18,693,000	
鳥取銀行	800	1,275.00	1,020,000	
伊予銀行	33,300	628.00	20,912,400	
百十四銀行	2,700	1,785.00	4,819,500	
四国銀行	3,800	811.00	3,081,800	
阿波銀行	3,900	2,344.00	9,141,600	
大分銀行	1,400	2,008.00	2,811,200	
宮崎銀行	1,600	2,252.00	3,603,200	
佐賀銀行	1,400	1,551.00	2,171,400	
琉球銀行	5,500	854.00	4,697,000	
セブン銀行	74,700	248.00	18,525,600	
みずほフィナンシャルグループ	321,800	1,605.00	516,489,000	
高知銀行	900	771.00	693,900	
山口フィナンシャルグループ	29,300	738.00	21,623,400	
長野銀行	800	1,296.00	1,036,800	
名古屋銀行	1,900	3,240.00	6,156,000	

北洋銀行	37,900	265.00	10,043,500	
愛知銀行	900	4,795.00	4,315,500	
中京銀行	900	1,692.00	1,522,800	
大光銀行	900	1,532.00	1,378,800	
愛媛銀行	3,500	993.00	3,475,500	
トマト銀行	900	1,072.00	964,800	
京葉銀行	10,700	523.00	5,596,100	
栃木銀行	12,100	239.00	2,891,900	
北日本銀行	800	1,733.00	1,386,400	
東和銀行	4,400	578.00	2,543,200	
福島銀行	2,900	246.00	713,400	
大東銀行	1,200	748.00	897,600	
トモニホールディングス	19,400	351.00	6,809,400	
フィデアホールディングス	2,300	1,404.00	3,229,200	
池田泉州ホールディングス	28,900	192.00	5,548,800	
ＦＰＧ	8,500	868.00	7,378,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,900	1,091.00	2,072,900	
マーキュリアホールディングス	1,000	545.00	545,000	
ＳＢＩホールディングス	31,000	3,085.00	95,635,000	
日本アジア投資	1,900	175.00	332,500	
ジャフコ　グループ	9,600	1,680.00	16,128,000	
大和証券グループ本社	188,400	691.00	130,184,400	
野村ホールディングス	384,100	540.30	207,529,230	
岡三証券グループ	19,800	391.00	7,741,800	
丸三証券	7,500	543.00	4,072,500	
東洋証券	8,300	153.00	1,269,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,900	409.00	11,820,100	
光世証券	500	473.00	236,500	
水戸証券	6,700	279.00	1,869,300	
いちよし証券	4,700	670.00	3,149,000	
松井証券	12,300	816.00	10,036,800	
マネックスグループ	20,500	530.00	10,865,000	
極東証券	3,400	762.00	2,590,800	
岩井コスモホールディングス	2,400	1,386.00	3,326,400	
アイザワ証券グループ	4,100	946.00	3,878,600	
マネーパートナーズグループ	2,600	226.00	587,600	
スパークス・グループ	11,600	258.00	2,992,800	
小林洋行	700	213.00	149,100	
かんぽ生命保険	25,300	2,094.00	52,978,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	41,300	5,339.00	220,500,700	
アニコム　ホールディングス	7,700	800.00	6,160,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	56,400	3,928.00	221,539,200	

第一生命ホールディングス	123,800	2,594.00	321,137,200	
東京海上ホールディングス	82,900	6,891.00	571,263,900	
Ｔ＆Ｄホールディングス	65,300	1,734.00	113,230,200	
アドバンスクリエイト	1,200	1,004.00	1,204,800	
全国保証	6,000	4,855.00	29,130,000	
あんしん保証	700	283.00	198,100	
ジェイリース	800	1,864.00	1,491,200	
イントラスト	1,100	585.00	643,500	
日本モーゲージサービス	1,400	1,012.00	1,416,800	
Ｃａｓａ	900	832.00	748,800	
アルヒ	3,700	1,040.00	3,848,000	
プレミアグループ	1,300	3,945.00	5,128,500	
ネットプロテクションズホールディングス	5,700	729.00	4,155,300	
クレディセゾン	16,200	1,365.00	22,113,000	
芙蓉総合リース	2,600	7,890.00	20,514,000	
みずほリース	3,900	3,265.00	12,733,500	
東京センチュリー	4,900	5,870.00	28,763,000	
日本証券金融	9,900	903.00	8,939,700	
アイフル	42,200	360.00	15,192,000	
リコーリース	2,200	3,800.00	8,360,000	
イオンフィナンシャルサービス	13,700	1,274.00	17,453,800	
アコム	49,600	332.00	16,467,200	
ジャックス	2,800	3,245.00	9,086,000	
オリエントコーポレーション	68,100	127.00	8,648,700	
オリックス	152,700	2,363.50	360,906,450	
三菱ＨＣキャピタル	92,900	599.00	55,647,100	
九州リースサービス	1,200	600.00	720,000	
日本取引所グループ	63,700	2,288.00	145,745,600	
イー・ギャランティ	3,700	2,061.00	7,625,700	
アサックス	1,300	686.00	891,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	1,000	2,130.00	2,130,000	
いちご	28,000	270.00	7,560,000	
日本駐車場開発	27,500	138.00	3,795,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,233.00	1,726,200	
ＳＲＥホールディングス	600	4,010.00	2,406,000	
ＡＤワークスグループ	5,200	140.00	728,000	
ヒューリック	60,100	1,082.00	65,028,200	
三栄建築設計	1,000	1,652.00	1,652,000	
野村不動産ホールディングス	13,000	2,762.00	35,906,000	
三重交通グループホールディングス	5,100	466.00	2,376,600	
サムティ	4,000	2,131.00	8,524,000	
ディア・ライフ	3,200	514.00	1,644,800	

コーセーアールイー	700	592.00	414,400	
地主	1,600	1,757.00	2,811,200	
プレサンスコーポレーション	3,300	1,840.00	6,072,000	
ＴＨＥグローバル社	1,300	180.00	234,000	
ハウスコム	400	1,255.00	502,000	
日本管理センター	1,200	1,019.00	1,222,800	
サンセイランディック	700	821.00	574,700	
エストラスト	300	587.00	176,100	
フージャースホールディングス	3,200	688.00	2,201,600	
オープンハウスグループ	8,000	5,750.00	46,000,000	
東急不動産ホールディングス	74,100	653.00	48,387,300	
飯田グループホールディングス	21,000	2,245.00	47,145,000	
イーグランド	400	1,386.00	554,400	
ムゲンエステート	1,500	481.00	721,500	
ビーロット	1,700	505.00	858,500	
ファーストブラザーズ	600	840.00	504,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	1,200	875.00	1,050,000	
シーアールイー	700	1,692.00	1,184,400	
プロパティエージェント	300	1,485.00	445,500	
ケイアイスター不動産	1,100	5,500.00	6,050,000	
アグレ都市デザイン	400	1,242.00	496,800	
グッドコムアセット	1,100	1,146.00	1,260,600	
ジェイ・エス・ビー	500	3,105.00	1,552,500	
テンポイノベーション	700	837.00	585,900	
グローバル・リンク・マネジメント	400	812.00	324,800	
フェイスネットワーク	200	1,299.00	259,800	
パーク２４	13,500	1,764.00	23,814,000	
パラカ	700	1,686.00	1,180,200	
宮越ホールディングス	1,000	899.00	899,000	
三井不動産	114,700	2,573.00	295,123,100	
三菱地所	165,300	1,773.50	293,159,550	
平和不動産	4,300	4,035.00	17,350,500	
東京建物	24,800	1,781.00	44,168,800	
ダイビル	5,800	2,195.00	12,731,000	
京阪神ビルディング	3,900	1,427.00	5,565,300	
住友不動産	52,800	3,547.00	187,281,600	
テーオーシー	4,500	715.00	3,217,500	
東京楽天地	400	3,865.00	1,546,000	
レオパレス２１	26,000	201.00	5,226,000	
スターツコーポレーション	3,400	2,546.00	8,656,400	
フジ住宅	2,900	656.00	1,902,400	
空港施設	2,500	565.00	1,412,500	

明和地所	1,200	591.00	709,200	
ゴールドクレスト	2,000	1,865.00	3,730,000	
エスリード	1,000	1,736.00	1,736,000	
日神グループホールディングス	4,100	484.00	1,984,400	
日本エスコン	4,700	764.00	3,590,800	
タカラレーベン	10,500	317.00	3,328,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	1,300	849.00	1,103,700	
イオンモール	12,600	1,680.00	21,168,000	
毎日コムネット	900	699.00	629,100	
ファースト住建	900	1,142.00	1,027,800	
ランド	136,200	11.00	1,498,200	
カチタス	6,200	3,460.00	21,452,000	
トーセイ	3,500	1,055.00	3,692,500	
穴吹興産	500	2,004.00	1,002,000	
サンフロンティア不動産	3,500	1,058.00	3,703,000	
ＦＪネクストホールディングス	2,500	985.00	2,462,500	
インテリックス	600	626.00	375,600	
ランドビジネス	1,000	245.00	245,000	
サンネクスタグループ	800	1,015.00	812,000	
グランディハウス	1,700	580.00	986,000	
日本空港ビルデング	9,600	5,440.00	52,224,000	
明豊ファシリティワークス	1,100	720.00	792,000	
日本工営	1,600	3,015.00	4,824,000	
ＬＩＦＵＬＬ	7,400	228.00	1,687,200	
ミクシィ	5,600	2,250.00	12,600,000	
ジェイエイシーリクルートメント	2,000	1,954.00	3,908,000	
日本M&Aセンターホールディングス	40,000	1,760.00	70,400,000	
メンバーズ	700	2,867.00	2,006,900	
中広	400	394.00	157,600	
ＵＴグループ	3,500	3,505.00	12,267,500	
アイティメディア	1,200	1,583.00	1,899,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,400	1,106.00	1,548,400	
夢真ビーネックスグループ	7,900	1,526.00	12,055,400	
コシダカホールディングス	6,500	653.00	4,244,500	
アルトナー	600	856.00	513,600	
パソナグループ	2,600	2,443.00	6,351,800	
ＣＤＳ	600	1,577.00	946,200	
リンクアンドモチベーション	5,400	449.00	2,424,600	
エス・エム・エス	8,300	3,230.00	26,809,000	
サニーサイドアップグループ	800	730.00	584,000	
パーソルホールディングス	24,400	2,677.00	65,318,800	
リニカル	1,400	707.00	989,800	

クックパッド	7,600	258.00	1,960,800	
エスクリ	1,100	394.00	433,400	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,200	579.00	694,800	
学情	1,000	992.00	992,000	
スタジオアリス	1,100	2,172.00	2,389,200	
シミックホールディングス	1,300	1,577.00	2,050,100	
エプコ	500	689.00	344,500	
ＮＪＳ	500	1,977.00	988,500	
綜合警備保障	9,700	4,275.00	41,467,500	
カカクコム	17,900	2,596.00	46,468,400	
アイロムグループ	900	1,948.00	1,753,200	
セントケア・ホールディング	1,600	818.00	1,308,800	
サイネックス	400	605.00	242,000	
ルネサンス	1,700	1,096.00	1,863,200	
ディップ	4,300	3,390.00	14,577,000	
デジタルホールディングス	1,700	1,480.00	2,516,000	
新日本科学	3,000	1,588.00	4,764,000	
キャリアデザインセンター	600	1,200.00	720,000	
ベネフィット・ワン	8,900	2,623.00	23,344,700	
エムスリー	43,000	4,123.00	177,289,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,500	291.00	436,500	
ブラス	300	649.00	194,700	
アウトソーシング	14,000	1,372.00	19,208,000	
ウェルネット	2,500	437.00	1,092,500	
ワールドホールディングス	1,000	2,062.00	2,062,000	
ディー・エヌ・エー	9,300	1,710.00	15,903,000	
博報堂ＤＹホールディングス	33,900	1,604.00	54,375,600	
ぐるなび	4,000	411.00	1,644,000	
タカミヤ	3,000	386.00	1,158,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,600	968.00	1,548,800	
ファンコミュニケーションズ	6,100	382.00	2,330,200	
ライク	800	1,835.00	1,468,000	
ビジネス・ブレークスルー	900	429.00	386,100	
エスプール	6,900	1,017.00	7,017,300	
ＷＤＢホールディングス	1,100	2,772.00	3,049,200	
手間いらず	400	4,730.00	1,892,000	
ティア	1,400	435.00	609,000	
ＣＤＧ	300	1,357.00	407,100	
アドウェイズ	3,600	677.00	2,437,200	
バリューコマース	1,900	3,490.00	6,631,000	
インフォマート	26,700	595.00	15,886,500	
ＪＰホールディングス	6,200	233.00	1,444,600	

エコナックホールディングス	4,300	88.00	378,400	
ＣＬホールディングス	500	1,111.00	555,500	
プレステージ・インターナショナル	9,100	717.00	6,524,700	
アミューズ	1,300	2,107.00	2,739,100	
ドリームインキュベータ	700	2,533.00	1,773,100	
クイック	1,700	1,624.00	2,760,800	
ＴＡＣ	1,300	220.00	286,000	
電通グループ	25,100	4,620.00	115,962,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,100	1,236.00	1,359,600	
ぴあ	900	3,395.00	3,055,500	
イオンファンタジー	900	2,154.00	1,938,600	
シーティーエス	2,700	808.00	2,181,600	
ネクシィーズグループ	900	665.00	598,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	6,400	2,995.00	19,168,000	
アルプス技研	2,200	1,972.00	4,338,400	
サニックス	4,200	196.00	823,200	
ダイオーズ	500	1,007.00	503,500	
日本空調サービス	2,600	787.00	2,046,200	
オリエンタルランド	28,800	21,830.00	628,704,000	
ダスキン	5,700	2,757.00	15,714,900	
明光ネットワークジャパン	2,900	569.00	1,650,100	
ファルコホールディングス	1,200	2,007.00	2,408,400	
秀英予備校	500	430.00	215,000	
田谷	400	555.00	222,000	
ラウンドワン	6,800	1,487.00	10,111,600	
リゾートトラスト	11,200	1,949.00	21,828,800	
ビー・エム・エル	3,100	3,555.00	11,020,500	
りらいあコミュニケーションズ	3,600	1,074.00	3,866,400	
リソー教育	11,100	404.00	4,484,400	
早稲田アカデミー	1,400	1,008.00	1,411,200	
ユー・エス・エス	27,300	1,932.00	52,743,600	
東京個別指導学院	2,100	620.00	1,302,000	
サイバーエージェント	60,100	1,522.00	91,472,200	
楽天グループ	125,300	981.00	122,919,300	
クリーク・アンド・リバー社	1,300	1,718.00	2,233,400	
モーニングスター	4,300	544.00	2,339,200	
テー・オー・ダブリュー	4,600	291.00	1,338,600	
山田コンサルティンググループ	1,300	1,144.00	1,487,200	
セントラルスポーツ	900	2,409.00	2,168,100	
フルキャストホールディングス	2,100	2,163.00	4,542,300	
エン・ジャパン	3,900	2,875.00	11,212,500	
リソルホールディングス	300	4,325.00	1,297,500	

テクノプロ・ホールディングス	14,600	3,295.00	48,107,000	
アトラグループ	500	261.00	130,500	
インターワークス	700	371.00	259,700	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	3,940.00	4,334,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,600	2,066.00	3,305,600	
ファーストロジック	500	791.00	395,500	
三機サービス	400	1,006.00	402,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,300	753.00	978,900	
デザインワン・ジャパン	500	188.00	94,000	
イー・ガーディアン	1,000	2,602.00	2,602,000	
リブセンス	1,300	161.00	209,300	
ジャパンマテリアル	7,500	1,704.00	12,780,000	
ベクトル	3,400	1,061.00	3,607,400	
ウチヤマホールディングス	1,200	327.00	392,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,800	1,069.00	1,924,200	
キャリアリンク	900	1,560.00	1,404,000	
ＩＢＪ	2,000	802.00	1,604,000	
アサンテ	1,100	1,590.00	1,749,000	
バリューＨＲ	1,000	2,528.00	2,528,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2,000	5,080.00	10,160,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	900	1,375.00	1,237,500	
ＥＲＩホールディングス	700	1,127.00	788,900	
アビスト	400	2,911.00	1,164,400	
シグマクシス・ホールディングス	1,500	2,090.00	3,135,000	
ウィルグループ	1,800	1,214.00	2,185,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,200	192.00	614,400	
メドピア	1,900	2,631.00	4,998,900	
レアジョブ	500	812.00	406,000	
リクルートホールディングス	188,000	5,046.00	948,648,000	
エラン	3,400	992.00	3,372,800	
土木管理総合試験所	1,100	319.00	350,900	
ネットマーケティング	1,200	408.00	489,600	
日本郵政	318,300	981.00	312,252,300	
ベルシステム２４ホールディングス	3,500	1,403.00	4,910,500	
鎌倉新書	2,800	515.00	1,442,000	
ＳＭＮ	500	591.00	295,500	
一蔵	300	375.00	112,500	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	400	794.00	317,600	
エアトリ	1,600	3,355.00	5,368,000	
アトラエ	1,700	2,110.00	3,587,000	
ストライク	900	4,365.00	3,928,500	
ソラスト	6,000	1,025.00	6,150,000	

セラク	800	1,188.00	950,400	
インソース	2,400	1,880.00	4,512,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,700	40,600.00	69,020,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	500	2,877.00	1,438,500	
アイモバイル	700	1,205.00	843,500	
キャリアインデックス	800	735.00	588,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	1,000	863.00	863,000	
船場	500	756.00	378,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	1,581.00	12,173,700	
フルテック	300	1,330.00	399,000	
グリーンズ	900	500.00	450,000	
ツナググループ・ホールディングス	500	279.00	139,500	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	700	438.00	306,600	
ソウルドアウト	600	1,804.00	1,082,400	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	400	695.00	278,000	
ウェルビー	1,600	1,155.00	1,848,000	
エル・ティー・エス	300	1,970.00	591,000	
ミダックホールディングス	1,100	2,429.00	2,671,900	
日総工産	1,900	806.00	1,531,400	
キュービーネットホールディングス	1,100	1,705.00	1,875,500	
ＲＰＡホールディングス	3,400	354.00	1,203,600	
スプリックス	700	1,499.00	1,049,300	
マネジメントソリューションズ	1,200	3,315.00	3,978,000	
プロレド・パートナーズ	500	807.00	403,500	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	500	396.00	198,000	
テノ．ホールディングス	300	556.00	166,800	
フロンティア・マネジメント	600	818.00	490,800	
ピアラ	400	541.00	216,400	
コプロ・ホールディングス	500	1,071.00	535,500	
ギークス	400	1,183.00	473,200	
カーブスホールディングス	6,700	701.00	4,696,700	
フォーラムエンジニアリング	1,700	862.00	1,465,400	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	300	1,928.00	578,400	
ダイレクトマーケティングミックス	2,800	1,511.00	4,230,800	
ポピンズホールディングス	600	2,427.00	1,456,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,000	3,200.00	6,400,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,200	673.00	807,600	
リログループ	13,300	1,846.00	24,551,800	
東祥	1,800	1,699.00	3,058,200	
ＴＲＥホールディングス	3,300	1,437.00	4,742,100	
人・夢・技術グループ	1,000	1,766.00	1,766,000	
エイチ・アイ・エス	5,400	2,060.00	11,124,000	

ラックランド	700	2,790.00	1,953,000	
共立メンテナンス	4,300	4,335.00	18,640,500	
イチネンホールディングス	2,500	1,297.00	3,242,500	
建設技術研究所	1,500	2,320.00	3,480,000	
スペース	1,700	920.00	1,564,000	
燦ホールディングス	1,100	1,491.00	1,640,100	
スバル興業	100	7,920.00	792,000	
東京テアトル	1,000	1,245.00	1,245,000	
タナベ経営	900	641.00	576,900	
ナガワ	800	9,840.00	7,872,000	
東京都競馬	1,800	4,165.00	7,497,000	
常磐興産	1,000	1,363.00	1,363,000	
カナモト	4,300	2,308.00	9,924,400	
西尾レントオール	2,200	2,820.00	6,204,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	13,100	21.00	275,100	
トランス・コスモス	3,100	3,185.00	9,873,500	
乃村工藝社	10,400	942.00	9,796,800	
藤田観光	1,100	2,323.00	2,555,300	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,500	1,532.00	2,298,000	
日本管財	2,600	2,769.00	7,199,400	
トーカイ	2,100	1,828.00	3,838,800	
白洋舎	300	1,178.00	353,400	
セコム	24,000	8,591.00	206,184,000	
セントラル警備保障	1,200	2,421.00	2,905,200	
丹青社	5,000	734.00	3,670,000	
メイテック	2,900	6,880.00	19,952,000	
応用地質	2,700	2,091.00	5,645,700	
船井総研ホールディングス	5,000	2,369.00	11,845,000	
進学会ホールディングス	800	345.00	276,000	
オオバ	1,700	744.00	1,264,800	
いであ	700	1,730.00	1,211,000	
学究社	800	1,607.00	1,285,600	
ベネッセホールディングス	8,100	2,419.00	19,593,900	
イオンディライト	3,000	3,035.00	9,105,000	
ナック	1,200	974.00	1,168,800	
ダイセキ	4,400	4,520.00	19,888,000	
ステップ	900	1,813.00	1,631,700	
合　計	28,030,900		66,768,676,480	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,963,588,392
コール・ローン	242,393,040
株式	107,777,288,415
投資証券	2,503,780,860
派生商品評価勘定	8,076,927
未収入金	24,242,999
未収配当金	81,812,663
差入委託証拠金	3,781,575,772
流動資産合計	123,382,759,068
資産合計	123,382,759,068
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	586,217,328
未払解約金	350,317,000
未払利息	657
流動負債合計	936,534,985
負債合計	936,534,985
純資産の部	
元本等	
元本	61,997,171,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,449,052,318
元本等合計	122,446,224,083
純資産合計	122,446,224,083
負債純資産合計	123,382,759,068

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	51,179,155,054円
期中追加設定元本額	48,725,372,006円
期中一部解約元本額	37,907,355,295円
期末元本額	61,997,171,765円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,420,066,831円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	6,023,352,105円
りそなラップ型ファンド（成長型）	6,668,233,170円
ＤＣりそな　グローバルバランス	24,636,473円
つみたてバランスファンド	1,960,625,973円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,779,812,528円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	1,027,172,516円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	688,455,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	244,682,551円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	151,868,218円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	81,041,281円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	143,004,688円
リスクコントロール・オープン	45,783,915円
ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	301,550,642円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	160,219,140円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	26,057,073,032円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	8,193,280,692円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	338,807,504円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	921,885,996円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	1,078,777,566円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	466,004,851円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	676,679,497円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	413,063,613円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	265,898,936円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	859,341,759円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	146,506,289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）	5,252,164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）	304,799,012円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	479,735,460円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	646,476,859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）	940,392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）	23,388,962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）	21,070,558円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	377,683,324円
２．　計算日における受益権の総数	
	61,997,171,765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	1.9750円
(10,000口当たり純資産額)	(19,750円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	494,579,586

投資証券	△95,099,125
合計	399,480,461

(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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,112,682,391	－	12,534,416,604	△578,265,787
合計		13,112,682,391	－	12,534,416,604	△578,265,787

（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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	413,704,954	－	413,730,856	25,902
	米ドル	288,523,500	－	288,539,250	15,750
	カナダドル	9,066,770	－	9,067,570	800
	ユーロ	80,943,604	－	80,949,184	5,580
	英ポンド	20,308,210	－	20,310,082	1,872
	スイスフラン	6,246,640	－	6,247,270	630
	スウェーデンクローナ	4,918,480	－	4,920,000	1,520
	香港ドル	3,697,750	－	3,697,500	△250

	売建	109,848,713	－	109,749,229	99,484
	米ドル	80,794,000	－	80,793,020	980
	ユーロ	18,880,848	－	18,800,798	80,050
	英ポンド	10,173,865	－	10,155,411	18,454
合計		523,553,667	－	523,480,085	125,386

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	15,178	28.54	433,180.12	
	CHENIERE ENERGY INC	4,215	116.89	492,691.35	
	CHEVRON CORP	34,119	136.67	4,663,043.73	
	CONOCOPHILLIPS	23,383	91.55	2,140,713.65	
	COTERRA ENERGY INC	14,095	23.23	327,426.85	
	DEVON ENERGY CORP	11,449	52.26	598,324.74	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,151	130.47	411,110.97	
	EOG RESOURCES INC	10,144	113.41	1,150,431.04	
	EXXON MOBIL CORP	74,640	78.98	5,895,067.20	
	HALLIBURTON CO	15,912	32.36	514,912.32	
	HESS CORP	5,183	94.73	490,985.59	

KINDER MORGAN INC	35,520	17.19	610,588.80	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,357	79.16	899,020.12	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	41.23	681,366.98	
ONEOK INC	7,921	62.92	498,389.32	
PHILLIPS 66	7,637	90.52	691,301.24	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,195	224.05	939,889.75	
SCHLUMBERGER LTD	24,328	39.30	956,090.40	
VALERO ENERGY CORP	6,797	89.72	609,826.84	
WILLIAMS COS INC	21,953	30.08	660,346.24	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,913	243.49	952,776.37	
ALBEMARLE CORP	2,101	227.68	478,355.68	
AMCOR PLC	30,404	11.57	351,774.28	
AVERY DENNISON CORP	1,524	181.78	277,032.72	
BALL CORP	5,635	92.28	519,997.80	
CELANESE CORP	1,759	154.17	271,185.03	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,978	71.46	284,267.88	
CORTEVA INC	12,364	50.90	629,327.60	
CROWN HOLDINGS INC	2,078	118.36	245,952.08	
DOW INC	12,848	60.83	781,543.84	
DUPONT DE NEMOURS INC	9,146	79.32	725,460.72	
EASTMAN CHEMICAL CO	2,692	120.69	324,897.48	
ECOLAB INC	4,554	182.91	832,972.14	
FMC CORP	2,253	115.75	260,784.75	
FREEPORT-MCMORAN INC	26,009	42.45	1,104,082.05	
INTERNATIONAL PAPER CO	6,946	46.23	321,113.58	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	131.61	567,370.71	
LINDE PLC	8,974	293.51	2,633,958.74	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	100.15	448,772.15	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,158	369.05	427,359.90	
MOSAIC CO/THE	5,552	44.62	247,730.24	
NEWMONT CORP	13,779	64.35	886,678.65	
NUCOR CORP	5,308	117.35	622,893.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,870	147.02	274,927.40	
PPG INDUSTRIES INC	4,073	149.27	607,976.71	
RPM INTERNATIONAL INC	2,344	84.54	198,161.76	

SEALED AIR CORP	2,628	63.31	166,378.68	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,380	270.48	1,184,702.40	
STEEL DYNAMICS INC	3,569	61.61	219,886.09	
VULCAN MATERIALS CO	2,241	183.89	412,097.49	
WESTROCK CO	5,361	45.79	245,480.19	
3M CO	10,000	158.01	1,580,100.00	
ALLEGION PLC	1,523	118.33	180,216.59	
AMETEK INC	3,972	130.16	516,995.52	
BOEING CO/THE	9,870	210.04	2,073,094.80	
CARRIER GLOBAL CORP	14,219	44.79	636,869.01	
CATERPILLAR INC	9,706	199.89	1,940,132.34	
CUMMINS INC	2,516	219.44	552,111.04	
DEERE & CO	5,137	387.26	1,989,354.62	
DOVER CORP	2,606	161.16	419,982.96	
EATON CORP PLC	7,026	152.17	1,069,146.42	
EMERSON ELECTRIC CO	10,598	93.97	995,894.06	
FASTENAL CO	9,880	51.92	512,969.60	
FORTIVE CORP	5,995	65.05	389,974.75	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2,548	89.24	227,383.52	
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	270.45	303,985.80	
GENERAL DYNAMICS CORP	4,138	211.17	873,821.46	
GENERAL ELECTRIC CO	19,463	96.60	1,880,125.80	
HEICO CORP	647	139.08	89,984.76	
HEICO CORP-CLASS A	1,342	114.44	153,578.48	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,986	186.69	2,237,666.34	
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	34.07	199,445.78	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	181.26	109,481.04	
IDEX CORP	1,396	191.68	267,585.28	
ILLINOIS TOOL WORKS	5,557	219.17	1,217,927.69	
INGERSOLL-RAND INC	6,884	53.80	370,359.20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	60.23	246,943.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	12,349	66.50	821,208.50	
KORNIT DIGITAL LTD	899	98.31	88,380.69	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,531	219.82	776,184.42	
LENNOX INTERNATIONAL INC	728	262.75	191,282.00	

LOCKHEED MARTIN CORP	4,314	386.97	1,669,388.58	
MASCO CORP	4,315	57.25	247,033.75	
NORDSON CORP	961	222.11	213,447.71	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,635	390.60	1,029,231.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	7,016	79.75	559,526.00	
OWENS CORNING	1,611	90.47	145,747.17	
PACCAR INC	5,970	92.98	555,090.60	
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	301.14	676,661.58	
PENTAIR PLC	2,913	58.96	171,750.48	
PLUG POWER INC	8,433	21.47	181,056.51	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	26,144	93.57	2,446,294.08	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,998	268.37	536,203.26	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,875	442.19	829,106.25	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	56.72	181,220.40	
SMITH (A.O.) CORP	2,718	71.23	193,603.14	
SNAP-ON INC	1,158	210.71	244,002.18	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	164.33	466,532.87	
SUNRUN INC	2,890	22.60	65,314.00	
TEXTRON INC	4,227	68.56	289,803.12	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,119	151.45	623,822.55	
TRANSDIGM GROUP INC	898	630.74	566,404.52	
UNITED RENTALS INC	1,210	313.25	379,032.50	
WABTEC CORP	3,299	87.48	288,596.52	
WW GRAINGER INC	813	466.39	379,175.07	
XYLEM INC	3,290	89.26	293,665.40	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	74.33	181,365.20	
CINTAS CORP	1,623	370.50	601,321.50	
CLARIVATE PLC	5,086	16.46	83,715.56	
COPART INC	3,654	122.73	448,455.42	
COSTAR GROUP INC	6,783	65.99	447,610.17	
EQUIFAX INC	2,089	220.98	461,627.22	
IHS MARKIT LTD	6,841	107.80	737,459.80	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,482	120.67	299,502.94	
LEIDOS HOLDINGS INC	2,533	87.36	221,282.88	
REPUBLIC SERVICES INC	3,830	118.57	454,123.10	

ROBERT HALF INTL INC	2,316	119.58	276,947.28	
ROLLINS INC	3,021	30.84	93,167.64	
TRANSUNION	3,373	100.58	339,256.34	
VERISK ANALYTICS INC	2,643	191.81	506,953.83	
WASTE CONNECTIONS INC	4,493	119.41	536,509.13	
WASTE MANAGEMENT INC	7,500	141.77	1,063,275.00	
AMERCO	179	577.19	103,317.01	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	89.21	205,539.84	
CSX CORP	39,064	33.92	1,325,050.88	
DELTA AIR LINES INC	2,928	41.97	122,888.16	
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	107.01	329,162.76	
FEDEX CORP	4,433	228.46	1,012,763.18	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,685	192.49	324,345.65	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	54.97	135,226.20	
LYFT INC-A	4,003	39.99	160,079.97	
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,300	272.27	1,170,761.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,802	293.95	529,697.90	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	45.38	100,062.90	
UBER TECHNOLOGIES INC	21,623	34.59	747,939.57	
UNION PACIFIC CORP	11,446	242.55	2,776,227.30	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	12,875	213.99	2,755,121.25	
APTIV PLC	4,894	136.60	668,520.40	
BORGWARNER INC	3,548	42.76	151,712.48	
FORD MOTOR CO	70,192	17.46	1,225,552.32	
GENERAL MOTORS CO	23,162	48.40	1,121,040.80	
LEAR CORP	1,094	167.24	182,960.56	
LUCID GROUP INC	7,369	27.44	202,205.36	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	3,143	62.65	196,908.95	
TESLA INC	14,795	875.76	12,956,869.20	
DR HORTON INC	5,990	82.95	496,870.50	
GARMIN LTD	2,605	120.76	314,579.80	
HASBRO INC	2,664	94.56	251,907.84	
LENNAR CORP-A	4,830	90.59	437,549.70	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,154	313.64	675,580.56	
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	143.82	131,739.12	

NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	24.92	137,907.28	
NIKE INC -CL B	22,578	141.59	3,196,819.02	
NVR INC	54	4,977.94	268,808.76	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,483	32.83	147,176.89	
PULTEGROUP INC	4,833	47.82	231,114.06	
VF CORP	5,597	59.89	335,204.33	
WHIRLPOOL CORP	966	196.62	189,934.92	
AIRBNB INC-CLASS A	4,238	169.66	719,019.08	
ARAMARK	4,618	35.98	166,155.64	
BOOKING HOLDINGS INC	729	2,545.66	1,855,786.14	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,570	81.23	289,991.10	
CARNIVAL CORP	14,286	21.36	305,148.96	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	484	1,563.95	756,951.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	143.42	341,769.86	
DOMINO'S PIZZA INC	663	430.71	285,560.73	
DRAFTKINGS INC - CL A	5,981	22.20	132,778.20	
EXPEDIA GROUP INC	2,522	197.17	497,262.74	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,781	151.43	723,986.83	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	46.21	236,826.25	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,754	171.33	814,502.82	
MCDONALD'S CORP	13,188	253.39	3,341,707.32	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	10.86	39,096.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	44.65	313,755.55	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,914	82.75	323,883.50	
STARBUCKS CORP	20,869	93.65	1,954,381.85	
VAIL RESORTS INC	810	271.44	219,866.40	
WYNN RESORTS LTD	1,490	92.06	137,169.40	
YUM! BRANDS INC	5,112	121.40	620,596.80	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,734	81.50	1,119,321.00	
ALPHABET INC-CL A	5,291	2,710.52	14,341,361.32	
ALPHABET INC-CL C	5,064	2,706.00	13,703,184.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	9,418	17.75	167,169.50	
CABLE ONE INC	110	1,500.72	165,079.20	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,285	607.94	1,389,142.90	
COMCAST CORP-CLASS A	80,609	47.40	3,820,866.60	

DISCOVERY INC - A	1,722	29.42	50,661.24	
DISCOVERY INC-C	5,617	29.33	164,746.61	
DISH NETWORK CORP-A	3,674	30.97	113,783.78	
ELECTRONIC ARTS INC	4,991	133.40	665,799.40	
FOX CORP - CLASS A	6,194	42.67	264,297.98	
FOX CORP- CLASS B	1,836	38.75	71,145.00	
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	131.68	148,271.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	35.08	206,059.92	
LIBERTY BROADBAND-A	223	149.21	33,273.83	
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	152.03	407,288.37	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	62.29	243,927.64	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,025	50.59	153,034.75	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	50.66	47,924.36	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,942	115.27	339,124.34	
MATCH GROUP INC	4,456	113.78	507,003.68	
META PLATFORMS INC	41,897	217.70	9,120,976.90	
NETFLIX INC	7,787	396.57	3,088,090.59	
NEWS CORP - CLASS A	5,861	22.28	130,583.08	
OMNICOM GROUP	3,237	84.74	274,303.38	
PINTEREST INC- CLASS A	9,515	24.71	235,115.65	
ROKU INC	2,074	159.02	329,807.48	
SEA LTD-ADR	2,474	129.17	319,566.58	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.17	64,087.79	
SNAP INC - A	18,792	39.62	744,539.04	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	2,134	167.07	356,527.38	
TWITTER INC	13,838	35.69	493,878.22	
VIACOMCBS INC - CLASS B	10,543	35.03	369,321.29	
WALT DISNEY CO/THE	31,972	150.85	4,822,976.20	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	4,026	55.35	222,839.10	
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	224.28	210,150.36	
AMAZON.COM INC	8,010	3,103.34	24,857,753.40	
AUTOZONE INC	373	1,924.60	717,875.80	
BATH & BODY WORKS INC	4,700	55.03	258,641.00	
BEST BUY CO INC	3,865	100.64	388,973.60	
BURLINGTON STORES INC	1,107	224.59	248,621.13	

CARMAX INC	2,885	110.96	320,119.60	
CARVANA CO	1,380	140.63	194,069.40	
CHEWY INC - CLASS A	1,090	52.63	57,366.70	
DOLLAR GENERAL CORP	4,065	200.61	815,479.65	
DOLLAR TREE INC	3,916	136.96	536,335.36	
DOORDASH INC - A	1,947	97.11	189,073.17	
EBAY INC	11,722	58.18	681,985.96	
ETSY INC	2,268	142.65	323,530.20	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	506	82.20	41,593.20	
GENUINE PARTS CO	2,564	127.06	325,781.84	
HOME DEPOT INC	18,570	351.56	6,528,469.20	
LKQ CORP	4,394	53.77	236,265.38	
LOWE'S COS INC	12,194	225.95	2,755,234.30	
MERCADOLIBRE INC	773	1,119.01	864,994.73	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,200	661.04	793,248.00	
POOL CORP	783	450.94	353,086.02	
ROSS STORES INC	6,131	94.27	577,969.37	
TARGET CORP	8,531	208.57	1,779,310.67	
TJX COMPANIES INC	20,783	67.99	1,413,036.17	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,120	217.93	462,011.60	
ULTA BEAUTY INC	950	362.65	344,517.50	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,439	142.21	204,640.19	
COSTCO WHOLESALE CORP	7,811	506.56	3,956,740.16	
KROGER CO	13,182	45.69	602,285.58	
SYSCO CORP	8,818	81.99	722,987.82	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,659	47.36	599,530.24	
WALMART INC	27,244	133.95	3,649,333.80	
ALTRIA GROUP INC	32,118	50.09	1,608,790.62	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,767	76.12	743,464.04	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	66.37	350,566.34	
BUNGE LTD	2,145	100.83	216,280.35	
CAMPBELL SOUP CO	3,976	44.03	175,063.28	
COCA-COLA CO/THE	72,416	60.68	4,394,202.88	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,239	56.98	241,538.22	
CONAGRA BRANDS INC	8,705	35.30	307,286.50	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,972	233.85	695,002.20	
GENERAL MILLS INC	10,536	67.63	712,549.68	
HERSHEY CO/THE	2,482	203.35	504,714.70	
HORMEL FOODS CORP	4,355	47.46	206,688.30	
JM SMUCKER CO/THE	1,878	137.43	258,093.54	
KELLOGG CO	4,596	64.75	297,591.00	
KEURIG DR PEPPER INC	13,149	38.10	500,976.90	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	34.59	393,322.89	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	100.40	428,005.20	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	49.41	138,100.95	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	24,384	66.14	1,612,757.76	
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	82.57	562,549.41	
PEPSICO INC	24,388	166.70	4,065,479.60	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	27,578	109.24	3,012,620.72	
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	94.88	479,049.12	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	97.57	408,428.02	
CLOROX COMPANY	2,061	142.95	294,619.95	
COLGATE-PALMOLIVE CO	13,947	79.26	1,105,439.22	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,027	303.85	1,223,603.95	
KIMBERLY-CLARK CORP	5,879	132.37	778,203.23	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	42,835	156.74	6,713,957.90	
ABBOTT LABORATORIES	31,273	122.78	3,839,698.94	
ABIOMED INC	756	290.43	219,565.08	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,331	505.67	673,046.77	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,590	140.18	363,066.20	
ANTHEM INC	4,202	443.97	1,865,561.94	
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,563	85.45	731,708.35	
BECTON DICKINSON AND CO	5,101	268.90	1,371,658.90	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	25,011	42.73	1,068,720.03	
CARDINAL HEALTH INC	4,308	52.29	225,265.32	
CENTENE CORP	9,908	82.01	812,555.08	
CERNER CORP	5,093	91.66	466,824.38	
CIGNA CORP	5,878	225.24	1,323,960.72	
COOPER COS INC/THE	912	391.35	356,911.20	
CVS HEALTH CORP	23,358	103.00	2,405,874.00	

DAVITA INC	1,175	113.65	133,538.75	
DENTSPLY SIRONA INC	3,748	53.54	200,667.92	
DEXCOM INC	1,652	407.00	672,364.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,093	107.73	1,195,048.89	
HCA HEALTHCARE INC	4,736	235.42	1,114,949.12	
HENRY SCHEIN INC	2,103	75.79	159,386.37	
HOLOGIC INC	4,309	70.31	302,965.79	
HUMANA INC	2,285	419.64	958,877.40	
IDEXX LABORATORIES INC	1,506	505.53	761,328.18	
INMODE LTD	975	45.60	44,460.00	
INSULET CORP	1,229	245.56	301,793.24	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,319	281.14	1,776,523.66	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	272.68	440,378.20	
MASIMO CORP	1,017	224.59	228,408.03	
MCKESSON CORP	2,622	270.67	709,696.74	
MEDTRONIC PLC	23,778	102.31	2,432,727.18	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,137	307.51	349,638.87	
NOVOCURE LTD	1,677	78.88	132,281.76	
OAK STREET HEALTH INC	1,457	17.03	24,812.71	
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,197	130.29	286,247.13	
RESMED INC	2,476	233.62	578,443.12	
STERIS PLC	1,666	226.55	377,432.30	
STRYKER CORP	6,026	250.45	1,509,211.70	
TELADOC HEALTH INC	2,707	70.84	191,763.88	
TELEFLEX INC	849	317.34	269,421.66	
UNITEDHEALTH GROUP INC	16,600	474.40	7,875,040.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,562	132.22	206,527.64	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,458	227.93	560,251.94	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,535	116.99	413,559.65	
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	89.42	116,871.94	
ABBVIE INC	31,180	143.00	4,458,740.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,278	135.21	713,638.38	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,148	148.66	319,321.68	
AMGEN INC	9,935	224.27	2,228,122.45	
AVANTOR INC	8,797	35.36	311,061.92	

BIO-RAD LABORATORIES-A	375	620.98	232,867.50	
BIO-TECHNE CORP	759	413.64	313,952.76	
BIOGEN INC	2,609	214.12	558,639.08	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,350	90.01	301,533.50	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,624	66.81	2,580,469.44	
CATALENT INC	2,865	98.97	283,549.05	
CHARLES RIVER LABORATORIES	981	327.44	321,218.64	
DANAHER CORP	11,338	271.50	3,078,267.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	25.13	190,686.44	
ELI LILLY & CO	14,345	234.69	3,366,628.05	
EXACT SCIENCES CORP	3,021	78.33	236,634.93	
GILEAD SCIENCES INC	21,697	61.11	1,325,903.67	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,710	96.49	357,977.90	
ILLUMINA INC	2,556	329.45	842,074.20	
INCYTE CORP	3,430	66.02	226,448.60	
IQVIA HOLDINGS INC	3,320	239.90	796,468.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	142.31	107,159.43	
JOHNSON & JOHNSON	46,343	165.60	7,674,400.80	
MERCK & CO. INC.	44,664	76.47	3,415,456.08	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	404	1,416.12	572,112.48	
MODERNA INC	5,902	142.47	840,857.94	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,875	86.52	162,225.00	
NOVAVAX INC	1,081	80.11	86,598.91	
PERKINELMER INC	2,057	181.13	372,584.41	
PFIZER INC	98,807	49.80	4,920,588.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,831	623.53	1,141,683.43	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,242	39.11	244,124.62	
SEAGEN INC	2,365	124.51	294,466.15	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	8.52	178,425.84	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,937	561.19	3,892,975.03	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,485	231.23	1,037,066.55	
VIATRIS INC	22,098	15.03	332,132.94	
WATERS CORP	1,044	318.05	332,044.20	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,251	383.68	479,983.68	
ZOETIS INC	8,212	196.43	1,613,083.16	

BANK OF AMERICA CORP	133,213	47.42	6,316,960.46	
CITIGROUP INC	35,708	66.46	2,373,153.68	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	53.66	402,503.66	
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	48.23	599,740.05	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	210	770.00	161,700.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,042	171.77	522,524.34	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.70	408,733.80	
JPMORGAN CHASE & CO	52,598	152.49	8,020,669.02	
KEYCORP	17,095	25.91	442,931.45	
M & T BANK CORP	2,483	180.41	447,958.03	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,340	204.57	1,501,543.80	
REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	24.52	415,638.52	
SIGNATURE BANK	1,113	331.37	368,814.81	
SVB FINANCIAL GROUP	1,055	621.53	655,714.15	
TRUIST FINANCIAL CORP	23,236	63.00	1,463,868.00	
US BANCORP	24,451	57.87	1,414,979.37	
WEBSTER FINANCIAL CORP	3,156	61.16	193,020.96	
WELLS FARGO & CO	72,485	57.85	4,193,257.25	
ALLY FINANCIAL INC	6,403	48.34	309,521.02	
AMERICAN EXPRESS CO	11,793	192.35	2,268,383.55	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	300.95	624,772.20	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,244	65.63	344,163.72	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14,390	61.47	884,553.30	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	23,341	314.28	7,335,609.48	
BLACKROCK INC	2,692	760.31	2,046,754.52	
BLACKSTONE INC	12,166	121.20	1,474,519.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,945	155.14	1,232,587.30	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	46.77	126,279.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	120.58	235,854.48	
CME GROUP INC	6,339	239.17	1,516,098.63	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	691	195.25	134,917.75	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,266	124.16	653,826.56	
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	33.94	189,996.12	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	749	400.03	299,622.47	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	30.40	138,715.20	

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	44.12	35,296.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,868	360.24	2,113,888.32	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,958	124.84	1,243,156.72	
INVESCO LTD	5,927	22.82	135,254.14	
KKR & CO INC	9,044	60.57	547,795.08	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	370.33	256,638.69	
MOODY'S CORP	2,986	323.47	965,881.42	
MORGAN STANLEY	24,101	102.57	2,472,039.57	
MSCI INC	1,424	532.97	758,949.28	
NASDAQ INC	2,170	171.93	373,088.10	
NORTHERN TRUST CORP	3,716	121.51	451,531.16	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,393	109.48	371,465.64	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,321	13.35	44,335.35	
S&P GLOBAL INC	4,271	380.71	1,626,012.41	
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,625	87.74	2,248,337.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	59.40	103,118.40	
SOFI TECHNOLOGIES INC	9,460	12.00	113,520.00	
STATE STREET CORP	6,599	98.68	651,189.32	
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	44.03	429,644.74	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,918	144.14	564,740.52	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	82.44	126,133.20	
UPSTART HOLDINGS INC	356	104.60	37,237.60	
AFLAC INC	11,207	64.22	719,713.54	
ALLEGHANY CORP	197	672.20	132,423.40	
ALLSTATE CORP	5,193	124.80	648,086.40	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,465	135.82	198,976.30	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,874	58.99	877,417.26	
AON PLC	3,988	279.88	1,116,161.44	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	46.42	283,208.42	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,581	153.35	549,146.35	
ASSURANT INC	896	161.99	145,143.04	
BROWN & BROWN INC	4,086	65.98	269,594.28	
CHUBB LTD	7,783	202.07	1,572,710.81	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,800	119.48	334,544.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	183.58	70,127.56	

EVEREST RE GROUP LTD	734	293.12	215,150.08	
FNF GROUP	4,754	47.80	227,241.20	
GLOBE LIFE INC	1,521	104.03	158,229.63	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	69.66	455,855.04	
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	70.94	237,010.54	
LOEWS CORP	3,999	61.13	244,458.87	
MARKEL CORP	251	1,235.50	310,110.50	
MARSH & MCLENNAN COS	8,802	151.71	1,335,351.42	
METLIFE INC	12,898	70.13	904,536.74	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	74.19	370,504.86	
PROGRESSIVE CORP	10,386	106.21	1,103,097.06	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,833	115.80	791,261.40	
TRAVELERS COS INC/THE	4,363	170.77	745,069.51	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	218.86	472,299.88	
WR BERKLEY CORP	2,140	89.49	191,508.60	
CBRE GROUP INC - A	5,718	98.21	561,564.78	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	5.71	114,771.00	
ZILLOW GROUP INC - A	904	57.35	51,844.40	
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	58.07	156,440.58	
ACCENTURE PLC-CL A	11,199	326.13	3,652,329.87	
ADOBE INC	8,401	474.01	3,982,158.01	
AFFIRM HOLDINGS INC	1,615	43.70	70,575.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	110.65	320,885.00	
ANSYS INC	1,507	317.12	477,899.84	
ASANA INC - CL A	1,233	68.66	84,657.78	
AUTODESK INC	3,802	226.90	862,673.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,352	201.98	1,484,956.96	
AVALARA INC	1,520	99.26	150,875.20	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	39.03	101,126.73	
BILL.COM HOLDINGS INC	1,382	240.00	331,680.00	
BLACK KNIGHT INC	3,383	65.53	221,687.99	
BLOCK INC	8,884	111.64	991,809.76	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,131	144.84	308,654.04	
CADENCE DESIGN SYS INC	4,809	142.08	683,262.72	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	2,496	69.95	174,595.20	

CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	129.68	215,787.52	
CITRIX SYSTEMS INC	2,191	101.96	223,394.36	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,172	105.56	440,396.32	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9,115	86.24	786,077.60	
COUPA SOFTWARE INC	1,218	130.64	159,119.52	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,333	180.60	601,939.80	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	798	153.18	122,237.64	
DATADOG INC - CLASS A	3,490	164.35	573,581.50	
DOCUSIGN INC	3,419	120.78	412,946.82	
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	24.39	130,047.48	
DYNATRACE INC	3,655	42.72	156,141.60	
EPAM SYSTEMS INC	975	427.95	417,251.25	
FAIR ISAAC CORP	571	512.40	292,580.40	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,714	111.50	1,194,611.00	
FISERV INC	10,369	97.89	1,015,021.41	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	244.69	345,012.90	
FORTINET INC	2,399	310.35	744,529.65	
GARTNER INC	1,494	288.58	431,138.52	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,102	146.96	749,789.92	
GODADDY INC - CLASS A	3,327	80.37	267,390.99	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,578	94.47	149,073.66	
HUBSPOT INC	774	545.89	422,518.86	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,931	130.15	2,073,419.65	
INTUIT INC	4,832	529.05	2,556,369.60	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	170.18	218,511.12	
MASTERCARD INC-CLASS A	15,539	374.16	5,814,072.24	
MICROSOFT CORP	125,468	295.00	37,013,060.00	
MONGODB INC	966	429.93	415,312.38	
NORTONLIFELOCK INC	8,787	29.48	259,040.76	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,530	55.25	305,532.50	
OKTA INC	2,109	189.41	399,465.69	
ORACLE CORP	29,659	78.95	2,341,578.05	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,325	13.26	362,329.50	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,683	521.02	876,876.66	
PAYCHEX INC	5,606	118.48	664,198.88	

PAYCOM SOFTWARE INC	910	345.72	314,605.20	
PAYPAL HOLDINGS INC	19,724	114.12	2,250,902.88	
PTC INC	1,603	111.91	179,391.73	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	168.16	213,563.20	
SALESFORCE.COM INC	17,272	206.40	3,564,940.80	
SERVICENOW INC	3,513	579.58	2,036,064.54	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,761	291.13	1,094,939.93	
SPLUNK INC	2,723	124.97	340,293.31	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	75.14	310,027.64	
SYNOPSYS INC	2,636	294.96	777,514.56	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,455	76.51	570,382.05	
TWILIO INC - A	2,853	195.71	558,360.63	
TYLER TECHNOLOGIES INC	748	467.28	349,525.44	
UNITY SOFTWARE INC	839	107.59	90,268.01	
VERISIGN INC	1,710	213.56	365,187.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	29,752	225.34	6,704,315.68	
VMWARE INC-CLASS A	3,863	123.58	477,389.54	
WESTERN UNION CO	5,513	19.80	109,157.40	
WIX.COM LTD	998	112.62	112,394.76	
WORKDAY INC-CLASS A	3,335	232.98	776,988.30	
ZENDESK INC	2,234	116.39	260,015.26	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,674	142.09	522,038.66	
ZSCALER INC	1,359	274.43	372,950.37	
AMPHENOL CORP-CL A	10,315	75.31	776,822.65	
APPLE INC	290,497	168.88	49,059,133.36	
ARISTA NETWORKS INC	4,084	122.82	501,596.88	
ARROW ELECTRONICS INC	1,337	124.57	166,550.09	
CDW CORP/DE	2,596	176.10	457,155.60	
CISCO SYSTEMS INC	74,415	53.18	3,957,389.70	
COGNEX CORP	2,959	63.25	187,156.75	
CORNING INC	14,801	41.29	611,133.29	
DELL TECHNOLOGIES -C	5,156	58.60	302,141.60	
F5 INC	916	193.80	177,520.80	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	24,541	16.87	414,006.67	
HP INC	22,784	36.51	831,843.84	

IPG PHOTONICS CORP	558	146.68	81,847.44	
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	33.79	153,170.07	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	165.93	512,059.98	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,928	213.81	626,035.68	
NETAPP INC	3,840	87.79	337,113.60	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,790	106.13	402,232.70	
TE CONNECTIVITY LTD	5,700	143.53	818,121.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	803	416.94	334,802.82	
TRIMBLE INC	4,462	65.85	293,822.70	
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	52.86	271,964.70	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	426.42	398,276.28	
AT&T INC	125,744	24.05	3,024,143.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	27.68	36,150.08	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	27.74	172,903.42	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	16,742	9.91	165,913.22	
T-MOBILE US INC	10,801	125.51	1,355,633.51	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	72,878	53.27	3,882,211.06	
AES CORP	13,306	21.46	285,546.76	
ALLIANT ENERGY CORP	4,611	56.87	262,227.57	
AMEREN CORPORATION	4,330	85.13	368,612.90	
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,643	86.18	744,853.74	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,140	148.03	464,814.20	
ATMOS ENERGY CORP	2,000	105.98	211,960.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	26.91	266,758.83	
CMS ENERGY CORP	5,193	62.39	323,991.27	
CONSOLIDATED EDISON INC	6,459	83.02	536,226.18	
CONSTELLATION ENERGY	5,632	48.11	270,955.52	
DOMINION ENERGY INC	14,281	78.75	1,124,628.75	
DTE ENERGY COMPANY	3,309	116.05	384,009.45	
DUKE ENERGY CORP	13,295	99.95	1,328,835.25	
EDISON INTERNATIONAL	6,481	60.06	389,248.86	
ENTERGY CORP	3,422	104.50	357,599.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	45.12	179,667.84	
EVERGY INC	3,540	61.91	219,161.40	
EVERSOURCE ENERGY	6,304	82.21	518,251.84	

EXELON CORP	16,898	42.20	713,095.60	
FIRSTENERGY CORP	10,241	40.74	417,218.34	
NEXTERA ENERGY INC	34,688	74.92	2,598,824.96	
NISOURCE INC	7,043	28.41	200,091.63	
NRG ENERGY INC	5,306	38.68	205,236.08	
P G & E CORP	27,434	11.28	309,455.52	
PPL CORP	13,143	28.35	372,604.05	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,740	64.77	566,089.80	
SEMPRA ENERGY	5,479	135.13	740,377.27	
SOUTHERN CO/THE	18,300	65.85	1,205,055.00	
UGI CORP	3,091	37.49	115,881.59	
VISTRA CORP	9,405	21.60	203,148.00	
WEC ENERGY GROUP INC	5,459	89.63	489,290.17	
XCEL ENERGY INC	9,302	66.40	617,652.80	
ADVANCED MICRO DEVICES	21,400	114.27	2,445,378.00	
ANALOG DEVICES INC	9,295	153.98	1,431,244.10	
APPLIED MATERIALS INC	15,855	131.86	2,090,640.30	
BROADCOM INC	7,233	578.58	4,184,869.14	
ENPHASE ENERGY INC	2,171	143.93	312,472.03	
ENTEGRIS INC	2,468	126.04	311,066.72	
INTEL CORP	71,561	47.58	3,404,872.38	
KLA CORP	2,650	365.16	967,674.00	
LAM RESEARCH CORP	2,465	558.25	1,376,086.25	
MARVELL TECHNOLOGY INC	14,361	67.75	972,957.75	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,458	71.19	673,315.02	
MICRON TECHNOLOGY INC	19,379	89.86	1,741,396.94	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	786	433.32	340,589.52	
NVIDIA CORP	43,959	242.67	10,667,530.53	
NXP SEMICONDUCTORS NV	4,766	185.88	885,904.08	
ON SEMICONDUCTOR CORP	7,719	58.66	452,796.54	
QORVO INC	2,035	129.31	263,145.85	
QUALCOMM INC	19,896	165.13	3,285,426.48	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	134.73	364,175.19	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	952	249.22	237,257.44	
TERADYNE INC	2,952	112.31	331,539.12	

	TEXAS INSTRUMENTS INC	16,293	162.47	2,647,123.71	
	XILINX INC	4,251	194.92	828,604.92	
米ドル 小計		5,552,650		679,259,050.15 (78,400,079,568)	
カナダドル	CAMECO CORP	8,016	27.67	221,802.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	20,529	67.05	1,376,469.45	
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	19.96	439,878.48	
	ENBRIDGE INC	35,044	52.79	1,849,972.76	
	IMPERIAL OIL LTD	4,737	56.27	266,550.99	
	KEYERA CORP	5,630	31.04	174,755.20	
	PARKLAND CORP	1,790	34.70	62,113.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,270	42.29	434,318.30	
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	37.84	969,271.60	
	TC ENERGY CORP	17,347	66.63	1,155,830.61	
	TOURMALINE OIL CORP	6,019	46.26	278,438.94	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,745	66.77	583,903.65	
	BARRICK GOLD CORP	29,830	26.85	800,935.50	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	63.92	198,407.68	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,217	35.39	361,579.63	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,254	182.25	593,041.50	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	11.29	116,953.11	
	KINROSS GOLD CORP	19,092	7.32	139,753.44	
	LUNDIN MINING CORP	16,915	11.94	201,965.10	
	NUTRIEN LTD	9,609	93.43	897,768.87	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	5,353	30.50	163,266.50	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	8,203	45.59	373,974.77	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,663	124.61	207,226.43	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	54.02	426,001.72	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	11.81	31,579.94	
	CAE INC	5,971	31.78	189,758.38	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	113.59	160,843.44	
	WSP GLOBAL INC	1,908	161.91	308,924.28	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	38.26	119,945.10	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	73.08	132,201.72	
	THOMSON REUTERS CORP	2,939	129.58	380,835.62	

AIR CANADA	840	24.24	20,361.60	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,196	156.43	1,907,820.28	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,106	91.61	1,475,470.66	
TFI INTERNATIONAL INC	1,624	135.98	220,831.52	
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	97.55	527,647.95	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	49.27	186,634.76	
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	72.69	385,184.31	
QUEBECOR INC -CL B	4,598	30.77	141,480.46	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	37.64	327,543.28	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	181.48	169,320.84	
DOLLARAMA INC	5,287	63.71	336,834.77	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	14,242	52.65	749,841.30	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	39.04	102,597.12	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	100.75	326,732.25	
METRO INC	4,307	67.42	290,377.94	
WESTON (GEORGE) LTD	1,578	139.67	220,399.26	
SAPUTO INC	3,667	29.74	109,056.58	
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	31.53	193,531.14	
CANOPY GROWTH CORP	3,659	10.72	39,224.48	
BANK OF MONTREAL	11,149	148.73	1,658,190.77	
BANK OF NOVA SCOTIA	20,901	92.52	1,933,760.52	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,713	161.48	1,245,495.24	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	102.43	578,319.78	
ROYAL BANK OF CANADA	25,220	145.00	3,656,900.00	
TORONTO-DOMINION BANK	32,272	106.27	3,429,545.44	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	25,108	72.15	1,811,542.20	
IGM FINANCIAL INC	1,623	45.39	73,667.97	
ONEX CORPORATION	908	91.82	83,372.56	
TMX GROUP LTD	1,457	133.05	193,853.85	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	648.75	295,830.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	39.76	172,081.28	
IA FINANCIAL CORP INC	2,752	81.28	223,682.56	
INTACT FINANCIAL CORP	3,041	181.13	550,816.33	
MANULIFE FINANCIAL CORP	33,538	27.05	907,202.90	
POWER CORP OF CANADA	10,869	41.88	455,193.72	

	SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	68.33	682,616.70	
	FIRSTSERVICE CORP	671	193.23	129,657.33	
	BLACKBERRY LTD	7,347	8.78	64,506.66	
	CGI INC	3,796	106.97	406,058.12	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,126.35	725,085.35	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	36.62	58,335.66	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	78.92	65,424.68	
	OPEN TEXT CORP	4,289	56.30	241,470.70	
	SHOPIFY INC - CLASS A	2,003	1,078.95	2,161,136.85	
	BCE INC	1,259	66.45	83,660.55	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6,149	65.91	405,280.59	
	TELUS CORP	8,222	31.71	260,719.62	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,058	17.73	249,248.34	
	ALTAGAS LTD	7,212	27.69	199,700.28	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	44.02	90,505.12	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.04	34,584.48	
	EMERA INC	4,505	58.78	264,803.90	
	FORTIS INC	8,232	57.19	470,788.08	
	HYDRO ONE LTD	4,991	32.23	160,859.93	
	NORTHLAND POWER INC	3,252	36.32	118,112.64	
カナダドル 小計		694,124		45,491,169.63 (4,125,139,262)	
ユーロ	ENI SPA	42,914	13.32	571,786.13	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.98	73,996.26	
	NESTE OYJ	7,057	37.59	265,272.63	
	OMV AG	2,574	55.96	144,041.04	
	REPSOL SA	24,986	11.66	291,536.64	
	TENARIS SA	5,062	11.50	58,238.31	
	TOTALENERGIES SE	44,618	51.13	2,281,318.34	
	AIR LIQUIDE SA	8,488	142.12	1,206,314.56	
	AKZO NOBEL	3,222	91.74	295,586.28	
	ARCELORMITTAL	12,348	26.34	325,246.32	
	ARKEMA	1,076	124.90	134,392.40	
	BASF SE	16,548	66.34	1,097,794.32	
	COVESTRO AG	3,382	52.70	178,231.40	

CRH PLC	13,641	43.69	595,975.29	
EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	28.65	112,365.30	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,085	36.36	39,450.60	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	63.50	137,414.00	
KONINKLIJKE DSM NV	2,952	159.15	469,810.80	
LANXESS AG	1,915	51.62	98,852.30	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	47.03	186,991.28	
SOLVAY SA	1,489	106.30	158,280.70	
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,685	18.17	212,374.87	
SYMRISE AG	2,370	101.40	240,318.00	
UMICORE	3,883	32.33	125,537.39	
UPM-KYMMENE OYJ	9,909	32.82	325,213.38	
VOESTALPINE AG	2,425	30.58	74,156.50	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,217	21.96	92,605.32	
AIRBUS SE	10,578	116.30	1,230,221.40	
ALSTOM	5,811	25.70	149,342.70	
BOUYGUES SA	3,499	32.11	112,352.89	
BRENNTAG SE	2,419	76.02	183,892.38	
CNH INDUSTRIAL NV	19,340	13.94	269,696.30	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8,682	60.63	526,389.66	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	7,471	31.41	234,664.11	
DASSAULT AVIATION SA	110	115.30	12,683.00	
EIFFAGE	1,503	96.00	144,288.00	
FERROVIAL SA	7,014	23.80	166,933.20	
GEA GROUP AG	3,473	40.54	140,795.42	
IMCD NV	1,073	141.40	151,722.20	
KINGSPAN GROUP PLC	2,977	87.00	258,999.00	
KION GROUP AG	1,385	78.08	108,140.80	
KNORR-BREMSE AG	1,136	87.68	99,604.48	
KONE OYJ-B	5,617	54.78	307,699.26	
LEGRAND SA	4,583	85.32	391,021.56	
MTU AERO ENGINES AG	938	193.90	181,878.20	
PRYSMIAN SPA	4,594	27.54	126,518.76	
RATIONAL AG	80	683.00	54,640.00	
SAFRAN SA	5,873	112.22	659,068.06	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	9,655	142.12	1,372,168.60	
SIEMENS AG-REG	13,602	139.36	1,895,574.72	
SIEMENS ENERGY AG	7,711	18.57	143,193.27	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	16.37	67,575.36	
THALES SA	1,768	83.06	146,850.08	
VINCI SA	9,484	100.04	948,779.36	
WARTSILA OYJ ABP	8,128	10.21	83,027.52	
BUREAU VERITAS SA	4,564	24.51	111,863.64	
RANDSTAD NV	1,871	62.92	117,723.32	
TELEPERFORMANCE	1,061	320.40	339,944.40	
WOLTERS KLUWER	4,948	87.44	432,653.12	
ADP	314	129.35	40,615.90	
AENA SME SA	1,497	150.00	224,550.00	
ATLANTIA SPA	8,066	16.17	130,467.55	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10,938	7.22	78,972.36	
DEUTSCHE POST AG-REG	17,844	50.63	903,441.72	
GETLINK	9,276	13.83	128,333.46	
INPOST SA	3,195	6.28	20,093.35	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,866	91.58	537,208.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	77.30	47,848.70	
CONTINENTAL AG	2,088	87.17	182,010.96	
FAURECIA	2,333	41.35	96,469.55	
FERRARI NV	2,202	193.80	426,747.60	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	14,942	73.45	1,097,489.90	
MICHELIN (CGDE)	3,012	144.75	435,987.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	84.92	203,723.08	
RENAULT SA	3,099	34.38	106,559.11	
STELLANTIS NV	35,353	16.34	577,668.02	
VALEO SA	3,692	25.47	94,035.24	
VOLKSWAGEN AG	462	240.00	110,880.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,269	181.24	592,473.56	
ADIDAS AG	3,306	232.85	769,802.10	
ESSILORLUXOTTICA	5,113	164.46	840,883.98	
HERMES INTERNATIONAL	550	1,186.50	652,575.00	
KERING	1,339	616.20	825,091.80	

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,915	670.00	3,293,050.00	
MONCLER SPA	3,302	54.44	179,760.88	
PUMA SE	2,047	87.68	179,480.96	
SEB SA	609	134.80	82,093.20	
ACCOR SA	2,330	33.10	77,123.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	133.25	372,833.50	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,369	36.17	85,686.73	
SODEXO	1,542	84.54	130,360.68	
BOLLORE	14,850	4.87	72,438.30	
PUBLICIS GROUPE	3,613	63.30	228,702.90	
SCOUT24 SE	1,621	52.04	84,356.84	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,377	50.44	119,895.88	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,144	21.00	297,024.00	
VIVENDI	14,144	11.71	165,696.96	
DELIVERY HERO SE	2,979	42.59	126,875.61	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,585	25.33	470,758.05	
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	38.39	135,035.21	
PROSUS NV	16,565	67.83	1,123,603.95	
ZALANDO SE	3,789	61.58	233,326.62	
CARREFOUR SA	10,978	17.20	188,876.49	
COLRUYT SA	290	36.04	10,451.60	
HELLOFRESH SE	3,031	48.00	145,488.00	
JERONIMO MARTINS	5,217	19.45	101,470.65	
KESKO OYJ-B SHS	4,478	26.50	118,667.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,708	28.77	509,459.16	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,146	54.47	770,532.62	
DANONE	11,362	54.76	622,183.12	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	10.39	93,655.46	
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	75.45	137,319.00	
HEINEKEN NV	4,447	93.16	414,282.52	
JDE PEET'S BV	1,184	26.27	31,103.68	
KERRY GROUP PLC-A	2,701	107.40	290,087.40	
PERNOD RICARD SA	3,643	190.25	693,080.75	
REMY COINTREAU	264	175.70	46,384.80	
BEIERSDORF AG	1,716	87.02	149,326.32	

HENKEL AG & CO KGAA	1,562	70.15	109,574.30	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,219	73.22	235,695.18	
L'OREAL	4,486	353.10	1,584,006.60	
AMPLIFON SPA	2,059	34.74	71,529.66	
BIOMERIEUX	820	101.05	82,861.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	128.45	80,923.50	
DIASORIN SPA	629	119.75	75,322.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	57.56	223,217.68	
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	36.18	257,926.68	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,274	29.28	447,299.09	
ORPEA	1,093	37.04	40,484.72	
SARTORIUS AG-VORZUG	502	409.80	205,719.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	55.22	257,711.74	
ARGENX SE	902	252.30	227,574.60	
BAYER AG-REG	17,000	52.57	893,690.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	85.00	182,665.00	
GRIFOLS SA	3,329	14.44	48,070.76	
IPSEN	158	93.38	14,754.04	
MERCK KGAA	2,192	175.25	384,148.00	
ORION OYJ-CLASS B	2,696	34.77	93,739.92	
QIAGEN N.V.	4,271	42.15	180,022.65	
RECORDATI SPA	1,969	44.78	88,171.82	
SANOFI	20,239	92.20	1,866,035.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	352.40	156,465.60	
UCB SA	2,214	84.94	188,057.16	
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,957	12.89	102,581.64	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	114,269	5.73	654,875.63	
BANCO SANTANDER SA	302,871	3.34	1,013,557.80	
BNP PARIBAS	19,707	61.75	1,216,907.25	
CAIXABANK S.A	78,740	3.29	259,133.34	
COMMERZBANK AG	13,866	8.47	117,458.88	
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	13.56	298,306.44	
ERSTE GROUP BANK AG	5,946	41.84	248,780.64	
FINECOBANK SPA	11,008	15.49	170,513.92	
ING GROEP NV-CVA	69,555	12.88	896,285.73	

INTESA SANPAOLO	281,987	2.76	780,399.02	
KBC GROEP NV	4,507	76.84	346,317.88	
MEDIOBANCA SPA	10,633	10.16	108,084.44	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,444	26.02	63,592.88	
SOCIETE GENERALE SA	14,646	33.79	494,961.57	
UNICREDIT SPA	35,836	15.02	538,471.73	
AMUNDI SA	618	67.95	41,993.10	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	13.78	486,092.76	
DEUTSCHE BOERSE AG	3,278	157.50	516,285.00	
EURAZEO	403	70.50	28,411.50	
EURONEXT NV	1,722	82.65	142,323.30	
EXOR NV	2,224	72.16	160,483.84	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	92.88	183,809.52	
SOFINA	168	340.00	57,120.00	
WENDEL	294	92.90	27,312.60	
AEGON NV	35,058	4.80	168,453.69	
AGEAS	3,211	44.24	142,054.64	
ALLIANZ SE-REG	7,359	222.65	1,638,481.35	
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	18.35	374,790.74	
AXA SA	33,466	27.57	922,824.95	
CNP ASSURANCES	3,403	21.83	74,287.49	
HANNOVER RUECK SE	1,152	170.55	196,473.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,428	261.70	635,407.60	
NN GROUP NV	4,060	50.44	204,786.40	
POSTE ITALIANE SPA	11,160	10.79	120,472.20	
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	44.30	373,050.30	
AROUNDTOWN SA	20,993	5.30	111,346.87	
LEG IMMOBILIEN SE	1,515	110.60	167,559.00	
VONOVIA SE	12,977	47.32	614,071.64	
ADYEN NV	351	1,877.80	659,107.80	
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	60.34	461,480.32	
BECHTLE AG	1,242	47.04	58,423.68	
CAPGEMINI SA	2,763	193.10	533,535.30	
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	40.27	468,076.05	
EDENRED	4,235	38.36	162,454.60	

NEMETSCHEK SE	1,322	77.00	101,794.00	
NEXI SPA	7,091	12.64	89,665.69	
SAP SE	18,577	104.98	1,950,213.46	
WORLDLINE SA	4,054	45.48	184,375.92	
NOKIA OYJ	92,708	4.87	451,997.85	
CELLNEX TELECOM SA	8,821	39.00	344,019.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	57,744	17.20	993,196.80	
ELISA OYJ	2,589	50.68	131,210.52	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.87	21,941.47	
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	3.08	181,553.68	
ORANGE	34,597	10.88	376,484.55	
PROXIMUS	918	18.00	16,528.59	
TELECOM ITALIA SPA	242,872	0.41	100,306.13	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.64	33,394.55	
TELEFONICA SA	91,673	4.37	401,436.06	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	34.30	26,273.80	
E.ON SE	38,444	11.97	460,482.23	
EDF	10,409	8.13	84,687.62	
EDP RENOVAVEIS SA	4,503	17.00	76,551.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.00	198,064.00	
ELIA GROUP SA/NV	345	113.90	39,295.50	
ENAGAS SA	6,522	18.60	121,309.20	
ENDESA SA	4,803	18.33	88,038.99	
ENEL SPA	146,107	6.32	923,396.24	
ENGIE	31,335	14.29	448,027.83	
FORTUM OYJ	7,645	23.57	180,192.65	
IBERDROLA SA	101,726	9.14	930,182.54	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	24.57	114,201.36	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	17.02	146,950.68	
RWE AG	11,090	36.33	402,899.70	
SNAM SPA	32,585	4.74	154,680.99	
TERNA SPA	25,545	6.62	169,107.90	
UNIPER SE	1,582	38.90	61,539.80	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,301	31.51	356,094.51	
VERBUND AG	1,068	94.00	100,392.00	

	ASM INTERNATIONAL NV	888	273.30	242,690.40	
	ASML HOLDING NV	7,232	559.70	4,047,750.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,556	32.21	726,528.76	
	STMICROELECTRONICS NV	12,491	39.10	488,398.10	
ユーロ 小計		3,276,919		82,870,126.14 (10,819,523,668)	
英ポンド	BP PLC	349,095	4.00	1,398,649.11	
	SHELL PLC-NEW	134,629	20.05	2,699,984.59	
	ANGLO AMERICAN PLC	22,057	36.17	797,911.97	
	ANTOFAGASTA PLC	7,429	13.89	103,225.95	
	BHP GROUP LTD	37,095	25.17	933,681.15	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,620	73.24	191,888.80	
	GLENCORE PLC	170,301	4.22	718,840.52	
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	17.65	55,419.04	
	MONDI PLC	7,876	18.64	146,848.02	
	RIO TINTO PLC	20,084	57.22	1,149,206.48	
	ASHTEAD GROUP PLC	7,622	48.41	368,981.02	
	BAE SYSTEMS PLC	55,064	6.00	330,384.00	
	BUNZL PLC	7,087	26.64	188,797.68	
	DCC PLC	1,401	63.58	89,075.58	
	FERGUSON PLC	3,775	109.55	413,551.25	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	68,951	1.52	104,805.52	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.17	193,615.32	
	SMITHS GROUP PLC	6,986	15.40	107,619.33	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	119.80	144,239.20	
	EXPERIAN PLC	16,860	28.65	483,039.00	
	INTERTEK GROUP PLC	2,573	51.64	132,869.72	
	RELX PLC	34,385	22.39	769,880.15	
	RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	4.98	147,351.96	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	6.18	126,779.74	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,383	40.83	56,467.89	
	BURBERRY GROUP PLC	7,146	19.63	140,275.98	
	PERSIMMON PLC	5,194	24.45	126,993.30	
	TAYLOR WIMPEY PLC	77,500	1.52	117,993.75	
	COMPASS GROUP PLC	30,179	17.81	537,638.88	

ENTAIN PLC	10,699	16.84	180,224.65	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,117	50.52	157,470.84	
WHITBREAD PLC	2,921	32.01	93,501.21	
AUTO TRADER GROUP PLC	20,378	6.38	130,052.39	
INFORMA PLC	30,041	6.08	182,769.44	
PEARSON PLC	13,772	6.25	86,102.54	
WPP PLC	19,572	11.93	233,591.82	
JD SPORTS FASHION PLC	24,800	1.68	41,788.00	
KINGFISHER PLC	46,444	3.18	147,738.36	
NEXT PLC	2,522	71.58	180,524.76	
OCADO GROUP PLC	9,232	13.00	120,062.16	
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.77	77,205.86	
TESCO PLC	131,492	2.95	388,427.36	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	18.78	93,411.72	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	37,631	34.09	1,282,840.79	
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	24.05	91,822.90	
DIAGEO PLC	41,407	36.32	1,503,902.24	
IMPERIAL BRANDS PLC	16,315	17.81	290,570.15	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,307	59.05	726,728.35	
UNILEVER PLC	45,230	38.10	1,723,263.00	
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00	
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	12.06	203,054.22	
ASTRAZENECA PLC	27,384	83.81	2,295,053.04	
GLAXOSMITHKLINE PLC	89,341	15.71	1,403,725.79	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,811	19.46	74,162.06	
BARCLAYS PLC	290,654	1.95	568,402.96	
HSBC HOLDINGS PLC	362,413	5.58	2,022,989.36	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,213,798	0.51	627,654.94	
NATWEST GROUP PLC	106,419	2.42	258,172.49	
STANDARD CHARTERED PLC	49,470	5.50	272,183.94	
3I GROUP PLC	18,949	13.22	250,505.78	
ABRDN PLC	32,937	2.37	78,159.50	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	13.05	73,014.75	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,605	68.74	385,287.70	
M&G PLC	41,949	2.12	89,015.77	

	SCHRODERS PLC	2,782	32.31	89,886.42	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,459	15.02	172,171.47	
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	30.30	83,173.50	
	AVIVA PLC	74,601	4.31	321,530.31	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.72	283,584.48	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.57	57,505.00	
	PRUDENTIAL PLC	44,928	11.77	528,802.56	
	AVEVA GROUP PLC	2,041	26.78	54,657.98	
	SAGE GROUP PLC/THE	18,579	6.82	126,783.09	
	HALMA PLC	6,704	23.30	156,203.20	
	BT GROUP PLC	161,710	1.92	311,615.17	
	VODAFONE GROUP PLC	498,320	1.36	680,406.12	
	NATIONAL GRID PLC	65,257	10.75	701,512.75	
	SEVERN TRENT PLC	5,286	28.30	149,593.80	
	SSE PLC	18,204	15.25	277,611.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	10.44	137,184.63	
英ポンド 小計		5,105,060		33,241,617.22 (5,193,670,274)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	16.80	47,863.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	913.50	71,253.00	
	GIVAUDAN-REG	160	3,585.00	573,600.00	
	HOLCIM LTD	9,074	50.70	460,051.80	
	SIKA AG-REG	2,454	296.10	726,629.40	
	ABB LTD-REG	29,408	31.40	923,411.20	
	GEBERIT AG-REG	643	596.00	383,228.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	221.40	47,601.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	222.60	157,378.20	
	VAT GROUP AG	505	339.80	171,599.00	
	ADECCO SA-REG	2,354	46.66	109,837.64	
	SGS SA-REG	121	2,576.00	311,696.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	936	253.10	236,901.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	9,372	130.95	1,227,263.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	287.20	117,752.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	55.35	13,892.85	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	76	2,090.00	158,840.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	10,080.00	241,920.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	103,100.00	103,100.00	
	NESTLE SA-REG	49,856	117.30	5,848,108.80	
	ALCON INC	8,564	70.96	607,701.44	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	318.90	328,148.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	176	1,381.00	243,056.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	116	505.00	58,580.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,318	603.00	794,754.00	
	NOVARTIS AG-REG	38,435	79.19	3,043,667.65	
	ROCHE HOLDING AG-BR	604	371.40	224,325.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12,386	342.20	4,238,489.20	
	VIFOR PHARMA AG	638	163.00	103,994.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	44,532	8.31	370,149.98	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	58.18	207,644.42	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,244.00	498,844.00	
	UBS GROUP AG-REG	65,676	19.06	1,252,112.94	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	160.50	105,609.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	568	591.80	336,142.40	
	SWISS RE AG	5,123	98.06	502,361.38	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,680	443.00	1,187,240.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	89.25	99,692.25	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	108.20	126,485.80	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	73.00	215,277.00	
	SWISSCOM AG-REG	414	548.00	226,872.00	
スイスフラン 小計		301,616		26,703,074.25 (3,336,282,096)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	338.10	1,092,063.00	
	BOLIDEN AB	4,039	400.80	1,618,831.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	10,612	161.95	1,718,613.40	
	ALFA LAVAL AB	6,477	284.00	1,839,468.00	
	ASSA ABLOY AB-B	17,222	261.50	4,503,553.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,365	497.60	6,152,824.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	434.80	2,990,554.40	
	EPIROC AB-A	11,278	189.90	2,141,692.20	
	EPIROC AB-B	4,649	162.00	753,138.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	121.30	982,408.70	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	266.80	390,595.20	
	LIFCO AB-B SHS	4,582	203.50	932,437.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	85.14	2,293,927.02	
	SANDVIK AB	19,332	232.90	4,502,422.80	
	SKANSKA AB-B SHS	7,676	238.50	1,830,726.00	
	SKF AB-B SHARES	7,216	187.90	1,355,886.40	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	212.80	701,814.40	
	VOLVO AB-B SHS	25,143	210.90	5,302,658.70	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	118.95	455,935.35	
	ELECTROLUX AB-B	3,653	180.30	658,635.90	
	EVOLUTION AB	3,009	1,060.00	3,189,540.00	
	EMBRACER GROUP AB	8,396	84.57	710,049.72	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	177.96	2,324,869.44	
	SWEDISH MATCH AB	26,306	69.64	1,831,949.84	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,023	264.50	3,180,083.50	
	GETINGE AB-B SHS	4,502	354.90	1,597,759.80	
	NORDEA BANK ABP	55,961	109.64	6,135,564.04	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,381	120.60	3,784,548.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	28,629	96.86	2,773,004.94	
	SWEDBANK AB - A SHARES	17,971	168.52	3,028,472.92	
	EQT AB	5,102	339.00	1,729,578.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	287.60	594,469.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	282.40	664,487.20	
	INVESTOR AB-A SHS	9,765	206.90	2,020,378.50	
	INVESTOR AB-B SHS	31,447	194.96	6,130,907.12	
	KINNEVIK AB - B	3,881	253.20	982,669.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	470.30	432,676.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	586.60	928,587.80	
	SAGAX AB-B	3,246	255.00	827,730.00	
	SINCH AB	7,260	95.80	695,508.00	
	ERICSSON LM-B SHS	50,322	115.14	5,794,075.08	
	HEXAGON AB-B SHS	33,961	122.75	4,168,712.75	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	130.65	969,945.60	
	TELIA CO AB	49,229	37.20	1,831,564.94	

スウェーデンクローナ 小計		597,791		98,545,316.86 (1,212,107,397)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	2,452	271.40	665,472.80	
	EQUINOR ASA	17,989	273.75	4,924,488.75	
	NORSK HYDRO ASA	21,082	77.38	1,631,325.16	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	443.00	1,227,996.00	
	ADEVINTA ASA	3,943	83.00	327,269.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,287	203.40	465,175.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	231.70	269,930.50	
	MOWI ASA	8,760	235.20	2,060,352.00	
	ORKLA ASA	11,182	84.42	943,984.44	
	DNB BANK ASA	15,146	212.10	3,212,466.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	212.40	567,957.60	
	TELENOR ASA	13,825	137.30	1,898,172.50	
ノルウェークローネ 小計		103,277		18,194,591.15 (236,529,684)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	477.40	975,805.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	389.10	1,297,259.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,448.00	315,792.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,442	162.80	2,839,557.60	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	67	21,440.00	1,436,480.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	22,650.00	2,242,350.00	
	DSV A/S	3,468	1,261.00	4,373,148.00	
	PANDORA A/S	1,826	717.80	1,310,702.80	
	CARLSBERG AS-B	2,072	1,029.50	2,133,124.00	
	AMBU A/S-B	1,526	120.50	183,883.00	
	COLOPLAST-B	2,245	916.40	2,057,318.00	
	DEMANT A/S	1,941	267.30	518,829.30	
	GN STORE NORD A/S	1,892	366.00	692,472.00	
	GENMAB A/S	1,125	2,199.00	2,473,875.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	29,811	643.10	19,171,454.10	
	DANSKE BANK A/S	13,184	131.00	1,727,104.00	
	TRYG A/S	4,694	152.00	713,488.00	
	ORSTED A/S	3,278	655.40	2,148,401.20	
		90,177		46,611,044.00	

デンマーククローネ 小計				(817,557,711)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	32.35	97,438.20	
	SANTOS LTD	47,139	7.72	363,913.08	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,985	26.52	105,682.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	27.43	512,310.11	
	BHP GROUP LTD	52,531	48.33	2,538,823.23	
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	18.79	198,967.31	
	EVOLUTION MINING LTD	46,650	3.96	184,734.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	22.75	665,255.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	7,431	46.69	346,953.39	
	NEWCREST MINING LTD	15,067	23.70	357,087.90	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.00	133,893.00	
	ORICA LTD	6,263	14.72	92,191.36	
	RIO TINTO LTD	6,335	121.58	770,209.30	
	SOUTH32 LTD	81,080	4.53	367,292.40	
	REECE LTD	5,105	19.96	101,895.80	
	BRAMBLES LTD	27,700	9.42	260,934.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.62	83,390.32	
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.31	46,197.00	
	TRANSURBAN GROUP	55,676	12.83	714,323.08	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,150	40.23	448,564.50	
	CROWN RESORTS LTD	773	12.64	9,770.72	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	101.14	104,679.90	
	IDP EDUCATION LTD	4,049	27.46	111,185.54	
	TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	5.20	197,095.60	
	REA GROUP LTD	563	135.44	76,252.72	
	SEEK LTD	6,794	27.78	188,737.32	
	WESFARMERS LTD	19,365	53.87	1,043,192.55	
	COLES GROUP LTD	24,160	16.32	394,291.20	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.27	106,345.47	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	33.91	726,047.01	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	16,613	10.63	176,596.19	
	COCHLEAR LTD	1,060	190.07	201,474.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	63.60	174,900.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	37.51	272,697.70	

	CSL LTD	8,417	243.56	2,050,044.52	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	48,894	28.20	1,378,810.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	31,437	100.04	3,144,957.48	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,718	30.43	1,725,928.74	
	WESTPAC BANKING CORP	63,088	23.88	1,506,541.44	
	ASX LTD	3,380	82.92	280,269.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,279	194.22	1,219,507.38	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	18.23	28,384.11	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	43,709	4.72	206,306.48	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	63,743	3.18	202,702.74	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	26,086	12.70	331,292.20	
	SUNCORP GROUP LTD	27,697	11.73	324,885.81	
	LENDLEASE GROUP	17,548	10.04	176,181.92	
	COMPUTERSHARE LTD	12,120	23.06	279,487.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	45.65	73,040.00	
	XERO LTD	2,603	109.00	283,727.00	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	4.06	293,785.66	
	APA GROUP	24,697	10.00	246,970.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	6.21	163,993.68	
オーストラリアドル 小計		1,173,294		26,090,138.56 (2,147,479,304)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.23	161,156.70	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,319	28.01	317,045.19	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	9.35	51,481.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.40	190,630.00	
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.79	41,688.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	4.89	112,269.51	
ニュージーランドドル 小計		112,599		874,270.50 (66,820,494)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	59.75	2,897,875.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25,000	133.40	3,335,000.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	21.60	648,000.00	
	MTR CORP	32,000	42.75	1,368,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	31,000	31.40	973,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	45.75	1,875,750.00	

	SANDS CHINA LTD	50,200	22.00	1,104,400.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	16.08	543,504.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	23.05	507,100.00	
	WH GROUP LTD	152,000	5.73	870,960.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	31.80	2,194,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	167.90	1,998,010.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20,700	437.40	9,054,180.00	
	AIA GROUP LTD	213,800	87.20	18,643,360.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	32,000	52.30	1,673,600.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	26.10	762,120.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	16.42	443,340.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	34.75	1,039,581.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	32.80	852,800.00	
	SINO LAND CO	58,000	10.28	596,240.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	97.55	2,409,485.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	48.35	203,070.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	21.00	105,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	35.95	1,150,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	101,000	10.88	1,098,880.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	50.95	224,180.00	
	CLP HOLDINGS LTD	27,500	79.85	2,195,875.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.88	244,280.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	208,717	12.10	2,525,475.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,000	49.90	1,147,700.00	
香港ドル 小計		1,444,533		62,685,765.70 (927,122,474)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	25,600	6.04	154,624.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	3.82	140,194.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	5.21	137,023.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.77	62,216.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	41,900	4.54	190,226.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	31,100	37.20	1,156,920.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	13.34	756,378.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	32.70	663,810.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,400	9.74	140,256.00	

	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	49,800	3.62	180,276.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.14	21,420.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.30	15,330.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.12	74,292.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	169,000	2.55	430,950.00	
シンガポールドル 小計		561,800		4,123,915.00 (353,378,276)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	12,922	32.43	419,060.46	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	563.50	214,693.50	
	BANK HAPOALIM BM	18,231	33.09	603,263.79	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,954	34.24	1,025,624.96	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	21.29	503,955.59	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	122.00	172,508.00	
	AZRIELI GROUP	234	277.90	65,028.60	
	NICE SYSTEMS LTD	1,161	852.60	989,868.60	
イスラエルシュケル 小計		87,968		3,994,003.50 (141,598,207)	
合　計		19,101,808		107,777,288,415 (107,777,288,415)	

(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	115,671.27	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,660	488,429.20	
		AMERICAN TOWER CORP	8,088	1,894,937.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,521	183,495.99	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	564,177.35	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,764	323,249.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	274,964.91	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,724	1,294,387.92	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,809	654,697.26	
		DUKE REALTY CORP	6,340	345,847.00	

	EQUINIX INC	1,607	1,075,693.66	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,451	264,174.05	
	EQUITY RESIDENTIAL	6,281	539,663.52	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,187	375,507.45	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,391	464,356.11	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,835	315,703.50	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	188,139.49	
	INVITATION HOMES INC	9,853	407,914.20	
	IRON MOUNTAIN INC	5,780	252,297.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	186,064.12	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,088	433,427.04	
	PROLOGIS INC	13,145	1,910,494.30	
	PUBLIC STORAGE	2,693	957,738.52	
	REALTY INCOME CORP	9,338	624,618.82	
	REGENCY CENTERS CORP	2,658	173,195.28	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,865	576,937.75	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	5,918	827,928.20	
	SUN COMMUNITIES INC	2,159	408,525.98	
	UDR INC	5,162	281,896.82	
	VENTAS INC	6,823	341,559.38	
	VICI PROPERTIES INC	10,702	301,368.32	
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	115,253.46	
	WELLTOWER INC	7,706	613,937.02	
	WEYERHAEUSER CO	12,823	524,588.93	
	WP CAREY INC	3,546	268,857.72	
米ドル 小計		219,696	18,569,698.86 (2,143,314,642)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	52,715.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	36,291.60	
カナダドル 小計		2,480	89,007.10 (8,071,163)	
ユーロ	COVIVIO	522	37,792.80	
	GECINA SA	1,073	119,424.90	
	KLEPIERRE	3,496	82,715.36	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	156,157.26	

		ユーロ 小計	7,372	396,090.32 (51,713,552)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	74,525.32	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	14,632	115,417.21	
		SEGRO PLC	22,581	278,875.35	
		英ポンド 小計	51,055	468,817.88 (73,248,105)	
	オーストラリアドル	DEXUS/AU	23,352	237,256.32	
		GOODMAN GROUP	29,600	675,472.00	
		GPT GROUP	32,860	166,271.60	
		MIRVAC GROUP	63,099	157,116.51	
		SCENTRE GROUP	86,904	256,366.80	
		STOCKLAND	54,131	212,193.52	
		VICINITY CENTRES	42,168	71,685.60	
		オーストラリアドル 小計	332,114	1,776,362.35 (146,212,385)	
	香港ドル	LINK REIT	38,700	2,573,550.00	
		香港ドル 小計	38,700	2,573,550.00 (38,062,804)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	208,571.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	81,863	167,819.15	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	41,630.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	49,500	85,635.00	
		シンガポールドル 小計	228,063	503,655.15 (43,158,209)	
合計				2,503,780,860 (2,503,780,860)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率

米ドル	株式	608銘柄	97.3%	—	71.2%
	投資証券	35銘柄	—	2.7%	1.9%
カナダドル	株式	86銘柄	99.8%	—	3.8%
	投資証券	2銘柄	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式	227銘柄	99.5%	—	9.9%
	投資証券	4銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	80銘柄	98.6%	—	4.8%
	投資証券	3銘柄	—	1.4%	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	44銘柄	100.0%	—	1.1%
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%	—	0.7%
オーストラリアドル	株式	53銘柄	93.6%	—	1.9%
	投資証券	7銘柄	—	6.4%	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	96.1%	—	0.8%
	投資証券	1銘柄	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	89.1%	—	0.3%
	投資証券	4銘柄	—	10.9%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%	—	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,894,286,248
コール・ローン	11,498,025
株式	15,991,542,781
投資証券	14,204,731
派生商品評価勘定	5,094,995
未収入金	1,028,063
未収配当金	9,540,989
差入委託証拠金	928,636,310
流動資産合計	18,855,832,142
資産合計	18,855,832,142
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,712,440
未払金	19,864,662
未払解約金	58,098,000
未払利息	31
流動負債合計	121,675,133
負債合計	121,675,133
純資産の部	
元本等	
元本	11,405,410,216
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,328,746,793
元本等合計	18,734,157,009
純資産合計	18,734,157,009
負債純資産合計	18,855,832,142

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	8,411,464,997円
期中追加設定元本額	7,688,596,057円
期中一部解約元本額	4,694,650,838円
期末元本額	11,405,410,216円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	682,299,038円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,424,230,273円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,709,449,490円
ＤＣりそな　グローバルバランス	11,940,904円
つみたてバランスファンド	593,645,552円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	349,016,183円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	207,909,222円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	139,722,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	48,949,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	30,957,209円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	16,583,292円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	29,101,062円
リスクコントロール・オープン	8,605,918円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	163,668,010円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	79,861,814円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	57,475,396円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	3,064,937,789円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	1,652,234,822円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	67,904,306円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	186,862,931円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	219,660,760円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	94,879,981円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	138,844,046円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	84,757,018円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	54,125,515円

りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	174,677,341円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	29,795,357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）	1,505,455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）	234,678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）	5,998,008円
りそなＶＩグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	5,883,170円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	69,694,228円
２．　計算日における受益権の総数	
	11,405,410,216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	1.6426円
(10,000口当たり純資産額)	(16,426円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△21,317,264
投資証券	215,188
合計	△21,102,076

(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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,805,988,316	－	2,767,367,630	△38,620,686
合計		2,805,988,316	－	2,767,367,630	△38,620,686

（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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	48,471,948	－	48,474,594	2,646
	米ドル	48,471,948	－	48,474,594	2,646
	売建	49,053,500	－	49,052,905	595
	米ドル	49,053,500	－	49,052,905	595
合計		97,525,448	－	97,527,499	3,241

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	104,736	8.40	880,620.28	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	7,345	89.04	653,998.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,600	209.60	335,360.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	20,180	7.62	153,811.96	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	4.56	62,869.25	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,090	37.65	153,988.50	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,898	9.13	44,718.74	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,117	28.73	319,391.41	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	29.66	82,247.18	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	22.26	52,221.96	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	83.00	106,904.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	21.00	81,102.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,502	66.31	99,597.62	
	51JOB INC-ADR	500	47.55	23,775.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	4.28	20,116.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	7,676	30.08	230,894.08	
	LI AUTO INC - ADR	9,765	28.48	278,107.20	
	NIO INC - ADR	24,174	23.79	575,099.46	
	XPENG INC - ADR	6,878	37.01	254,554.78	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,159	43.78	138,301.02	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	29,310	1.47	43,085.70	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	3.11	26,354.14	
	TRIP.COM GROUP LTD	9,014	29.58	266,634.12	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	7,453	50.48	376,227.44	
	AUTOHOME INC-ADR	1,241	28.63	35,529.83	
	BAIDU INC - SPON ADR	4,935	160.79	793,498.65	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	3,057	34.33	104,946.81	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	9.73	25,784.50	
	IQIYI INC-ADR	4,500	4.16	18,720.00	
	JOYY INC	913	49.65	45,330.45	

	KANZHUN LTD	1,293	32.90	42,539.70	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	5.90	70,941.60	
	VK CO LTD	2,211	7.70	17,035.75	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	30.85	35,909.40	
	YANDEX NV-A	5,354	45.18	241,893.72	
	DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	10.08	10,080.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	19.23	17,691.60	
	PINDUODUO INC-ADR	7,772	59.16	459,791.52	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	9.68	80,314.96	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,671	14.20	94,728.20	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	22.53	51,728.88	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,147	3.41	34,601.27	
	BEIGENE LTD-ADR	824	205.30	169,167.20	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	25.32	42,233.76	
	I-MAB-SPONSORED ADR	761	24.89	18,941.29	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	736	39.72	29,233.92	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,299	52.50	68,197.50	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	3.20	106,883.20	
	CREDICORP LTD	1,182	152.95	180,786.90	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	47,670	13.52	644,736.75	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	67.10	146,814.80	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	32,868	1.06	34,840.08	
	360 DIGITECH INC	1,366	20.64	28,194.24	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	780	29.69	23,158.20	
	KE HOLDINGS INC	6,358	19.89	126,460.62	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.93	9,444.96	
	AGORA INC-ADR	800	10.74	8,592.00	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	4.87	7,305.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,653	41.67	68,880.51	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	7.64	6,876.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	7,300	4.45	32,485.00	
	VNET GROUP INC	1,400	7.50	10,500.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	8,384	7.46	62,544.64	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,000	38.20	38,200.00	
		531,172		9,305,524.05	

米ドル 小計				(1,074,043,585)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	260,700	11.13	2,901,591.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	54,700	102.18	5,589,246.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	228.01	604,226.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	51.27	1,015,146.00	
	ALFA S.A.B.-A	56,600	14.95	846,170.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	56.03	414,622.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,100	299.46	1,826,706.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	448.94	1,719,440.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	153.50	676,167.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	43.46	1,925,278.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	6,500	60.07	390,455.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	92,400	72.76	6,723,024.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	118.01	908,677.00	
	BECLE SAB DE CV	11,400	49.38	562,932.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	106.91	1,016,714.10	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	34,200	154.64	5,288,688.00	
	GRUMA S.A.B.-B	4,125	271.96	1,121,835.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	62.90	1,679,430.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	23,400	30.24	707,616.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	45,700	135.56	6,195,092.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	45,800	31.60	1,447,280.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	607,600	18.90	11,483,640.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	23.52	463,344.00	
メキシコペソ 小計		1,395,220		55,507,320.30 (313,966,055)	
ブラジルレアル	COSAN SA	19,300	22.27	429,811.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	65,700	36.24	2,380,968.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	84,200	33.00	2,778,600.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	14.62	206,142.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	52.60	152,540.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	27.74	343,976.00	
	GERDAU SA-PREF	21,400	27.78	594,492.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,600	23.96	325,856.00	
	SUZANO SA	13,007	58.36	759,088.52	

VALE SA	72,804	91.57	6,666,662.28	
WEG SA	29,200	30.44	888,848.00	
CCR SA	23,400	12.49	292,266.00	
LOCALIZA RENT A CAR	10,210	58.62	598,510.20	
RUMO SA	24,400	16.19	395,036.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	27.30	73,710.00	
AMERICANAS SA	12,000	33.72	404,640.00	
LOJAS RENNER S.A.	17,820	25.91	461,716.20	
MAGAZINE LUIZA SA	48,800	6.48	316,224.00	
VIA S/A	21,100	4.02	84,822.00	
VIBRA ENERGIA SA	21,700	23.07	500,619.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	16.30	130,400.00	
RAIA DROGASIL SA	20,200	23.00	464,600.00	
AMBEV SA	82,900	15.06	1,248,474.00	
BRF SA	12,600	18.96	238,896.00	
JBS SA	15,200	38.54	585,808.00	
NATURA &CO HOLDING SA	14,800	23.03	340,844.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	75,292	12.19	917,809.48	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	47.75	343,800.00	
HYPERA SA	6,400	32.16	205,824.00	
BANCO BRADESCO S.A.	26,832	17.66	473,853.12	
BANCO BRADESCO SA-PREF	85,579	21.17	1,811,707.43	
BANCO DO BRASIL S.A.	15,800	33.54	529,932.00	
BANCO INTER SA-UNITS	6,100	26.41	161,101.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	32.11	260,091.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	85,500	26.47	2,263,185.00	
ITAUSA SA	80,955	10.48	848,408.40	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	107,800	14.12	1,522,136.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	23.35	488,015.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	23.37	320,169.00	
TOTVS SA	9,200	28.67	263,764.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	49.83	483,351.00	
TIM SA	17,100	13.88	237,348.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	32.85	157,680.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	33.42	163,758.00	

	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	16,642	12.63	210,188.46	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	35.43	233,838.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,500	43.24	108,100.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,775	40.52	193,483.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,000	23.87	429,660.00	
ブラジルレアル 小計		1,318,816		34,290,751.09 (758,206,226)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	6,600.00	48,516,600.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,388.00	32,029,488.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,299	51,899.00	119,315,801.00	
	FALABELLA SA	14,299	2,561.10	36,621,168.90	
	CENCOSUD SA	25,901	1,455.00	37,685,955.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,697.10	22,046,853.20	
	BANCO DE CHILE	727,649	85.34	62,097,565.66	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	30,000.00	29,700,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	39.65	47,714,294.55	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	93.48	35,856,777.96	
	ENEL CHILE SA	369,172	28.46	10,506,635.12	
チリペソ 小計		2,760,993		482,091,139.39 (68,387,520)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,946.00	263,145,558.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	37,500.00	173,887,500.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,517	33,330.00	250,541,610.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,150	35,900.00	77,185,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	22,100.00	180,954,800.00	
コロンビアペソ 小計		111,815		945,714,468.00 (27,685,791)	
ユーロ	OPAP SA	3,467	13.45	46,631.15	
	JUMBO SA	2,215	13.61	30,146.15	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	33,439	1.39	46,680.84	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	1.10	56,531.26	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	17.60	76,929.60	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	8.48	30,537.51	
ユーロ 小計		98,112		287,456.51 (37,530,321)	

英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	11.31	67,301.62	
英ポンド 小計		5,948		67,301.62 (10,515,205)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,516	193.80	487,600.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,394	27.94	625,688.36	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	21.84	333,889.92	
	KOC HOLDING AS	14,295	33.48	478,596.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	18,415	13.34	245,656.10	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	242.20	264,482.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	73.25	606,217.00	
	AKBANK T.A.S.	62,081	7.98	495,406.38	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	44,864	11.81	529,843.84	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	8.58	214,834.62	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	18.49	352,992.59	
トルコリラ 小計		233,351		4,635,208.61 (39,359,410)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,207	977.00	1,179,239.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	93.45	658,355.25	
	CEZ AS	2,959	846.50	2,504,793.50	
チェココルナ 小計		11,211		4,342,387.75 (23,077,619)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,648.00	19,356,880.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	7,895.00	19,555,915.00	
	OTP BANK PLC	3,983	17,405.00	69,324,115.00	
ハンガリーフォリント 小計		13,770		108,236,910.00 (39,528,444)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,618	70.58	396,518.44	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	33,451	5.25	175,617.75	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,316	150.70	349,021.20	
	LPP SA	18	15,400.00	277,200.00	
	CD PROJEKT SA	1,104	178.80	197,395.20	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	29.50	143,842.00	
	ALLEGRO.EU SA	5,653	34.94	197,544.08	
	DINO POLSKA SA	930	281.50	261,795.00	
	BANK PEKAO SA	3,378	131.00	442,518.00	

	MBANK SA	290	459.60	133,284.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,136	46.39	748,549.04	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	350.80	234,334.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,980	35.17	350,996.60	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	8.04	94,059.96	
	PGE SA	17,929	7.77	139,380.04	
ポーランドズロチ 小計		114,046		4,142,055.71 (118,879,069)	
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	37.39	4,921,182.00	
	ALROSA PJSC	46,260	115.67	5,350,894.20	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	83.48	4,591,400.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	133.83	3,075,413.40	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	3.63	2,631,750.00	
ロシアルーブル 小計		980,840		20,570,639.60 (30,855,959)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	45,000	5.09	229,050.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	30,000	8.78	263,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	430,000	4.18	1,797,400.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	59,500	21.80	1,297,100.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	4.69	178,220.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	374,000	4.25	1,589,500.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	26,000	19.26	500,760.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	5.25	346,500.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	43.65	960,300.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	10.54	400,520.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	66,000	4.69	309,540.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	10.98	834,480.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	40,000	7.10	284,000.00	
	DONGYUE GROUP	28,000	8.95	250,600.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,600	121.40	558,440.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	19,000	4.55	86,450.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	14.80	266,400.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	5.55	122,100.00	
	MMG LTD	68,000	2.96	201,280.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	8.14	268,620.00	

SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	14.32	136,040.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	102,000	11.74	1,197,480.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.66	205,040.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	69.95	244,825.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	58,000	4.31	249,980.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	28,500	38.00	1,083,000.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	18,000	13.60	244,800.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	4.91	319,150.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	10.28	411,200.00	
CITIC LTD	102,000	8.90	907,800.00	
CRRC CORP LTD - H	81,000	3.68	298,080.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	9.08	440,380.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	20.85	208,500.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.27	157,130.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	12.00	138,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	14.16	509,760.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	12.88	164,864.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	36.05	371,315.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	5.57	109,172.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	62,000	5.97	370,140.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.50	195,000.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	5.48	164,400.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	15.56	373,440.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	5.39	140,140.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	58,700	15.04	882,848.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.80	217,600.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.60	172,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	8.37	163,215.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.91	221,120.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	14,000	235.40	3,295,600.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.10	312,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	41.55	481,980.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	104,000	16.42	1,707,680.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	55,000	19.36	1,064,800.00	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	7.84	439,040.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	33.95	475,300.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	11.00	220,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	19,200	127.60	2,449,920.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.04	218,160.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	39,800	28.35	1,128,330.00	
LI NING CO LTD	40,000	82.15	3,286,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	14,700	145.00	2,131,500.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	7.98	103,740.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	2.04	48,960.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	20.10	422,100.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	11,000	19.36	212,960.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	16,000	17.12	273,920.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.84	168,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	6,800	46.65	317,220.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	33.30	592,740.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	8,600	89.75	771,850.00	
NETEASE INC	35,700	154.20	5,504,940.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	102,400	472.00	48,332,800.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	269,640	118.70	32,006,268.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	38.75	387,500.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	44,000	2.28	100,320.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	275,000	0.67	184,250.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,500	60.95	396,175.00	
JD.COM INC - CL A	35,810	289.60	10,370,576.00	
MEITUAN	72,600	219.60	15,942,960.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	7.79	186,960.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	58.10	639,100.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	3.41	107,415.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	114.63	252,186.00	
CHINA FEIHE LTD	64,000	11.08	709,120.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	56,000	48.15	2,696,400.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	26,000	60.35	1,569,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.30	131,150.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	31,200	47.10	1,469,520.00	

SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	34.10	1,091,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	34,000	17.78	604,520.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	73.20	732,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	8.24	173,040.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	84,000	7.71	647,640.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	37.15	334,350.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	11,000	40.70	447,700.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	21.40	128,400.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	74,000	5.93	438,820.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	36.65	234,560.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	8.05	161,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	21.55	258,600.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,400	25.15	186,110.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	9.82	479,216.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	15.32	251,248.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	19.22	507,408.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	24.50	85,750.00	
3SBIO INC	20,500	6.45	132,225.00	
AKESO INC	5,000	18.70	93,500.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	127.20	203,520.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	13.38	374,640.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	44,000	4.35	191,400.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	158,000	9.41	1,486,780.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20,000	24.70	494,000.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	74.20	140,980.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	16.86	404,640.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,000	28.65	573,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,600	85.65	222,690.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	30.80	308,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	183,250	5.47	1,002,377.50	
WUXI APPTEC CO LTD-H	6,168	90.70	559,437.60	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	64,000	56.00	3,584,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	462,000	3.12	1,441,440.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,410,000	3.18	4,483,800.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	5.52	888,720.00	

CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	69,000	1.84	126,960.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.86	644,620.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,709,000	6.14	10,493,260.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.03	142,410.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	69,500	68.45	4,757,275.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	3.20	353,920.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,002,000	4.88	4,889,760.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	6.63	981,240.00	
(Right)CITIC SECURITIES CO LTD-RTS	6,525	1.98	12,919.50	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	141,000	1.46	205,860.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.71	263,760.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	20.85	567,120.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	43,500	19.78	860,430.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	7.05	204,450.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	12.98	280,368.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	7.09	380,024.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	13.40	345,720.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	131,000	14.48	1,896,880.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	46,400	24.85	1,153,040.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,200	11.72	307,064.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	23.90	413,470.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.59	422,170.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	120,000	8.13	975,600.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	112,500	66.65	7,498,125.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,800	31.75	247,650.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	16.18	145,620.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	4.25	76,500.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	2.99	281,060.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	68,000	24.10	1,638,800.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	9.05	181,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	58,000	38.20	2,215,600.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,800	45.20	488,160.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	20.15	646,815.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	15.82	189,840.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	60,000	5.49	329,400.00	

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	140,000	6.53	914,200.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	32,000	50.70	1,622,400.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	12.54	188,100.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	24,000	8.64	207,360.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,770	16.40	193,028.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	4.38	94,170.00	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	4.32	99,360.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	32,500	45.65	1,483,625.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	4.30	107,500.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	5.37	193,320.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	6.15	123,000.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	7.06	70,600.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	57,000	9.68	551,760.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	22,000	8.92	196,240.00	
WHARF HOLDINGS LTD	26,000	27.45	713,700.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	30,800	8.30	255,640.00	
CHINA YOUZAN LTD	220,000	0.29	63,800.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	7.93	380,640.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	19.14	880,440.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	16.82	201,840.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	16.08	321,600.00	
WEIMOB INC	38,000	6.29	239,020.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	23.50	329,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	11,000	23.45	257,950.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	39.00	507,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	13.74	226,710.00	
LENOVO GROUP LTD	128,000	8.77	1,122,560.00	
SUNNY OPTICAL TECH	12,600	192.80	2,429,280.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	253,800	16.34	4,147,092.00	
ZTE CORP-H	15,400	20.05	308,770.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	834,000	0.97	808,980.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	28.15	239,275.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.09	234,840.00	
CGN POWER CO LTD-H	202,000	2.28	460,560.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	53,600	13.80	739,680.00	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	59,000	15.60	920,400.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	3.89	385,110.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,000	39.05	624,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	18.52	666,720.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	14,000	122.10	1,709,400.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	10.94	612,640.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	60,000	4.04	242,400.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	8.49	560,340.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	28.70	200,900.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	36.85	368,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	86,000	13.52	1,162,720.00	
香港ドル 小計		15,357,363		258,728,791.60 (3,826,598,827)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.86	199,628.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	20.90	123,310.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	9.26	411,144.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	53,500	6.70	358,450.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.60	93,480.00	
	SIME DARBY BERHAD	32,000	2.28	72,960.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,700	6.20	140,740.00	
	MISC BHD	26,800	6.98	187,064.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	3.93	77,028.00	
	GENTING BHD	41,300	4.64	191,632.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.91	162,087.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	23.80	49,980.00	
	IOI CORP BHD	49,600	4.14	205,344.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	24.36	202,188.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	133.90	174,070.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	16.60	184,592.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	4.86	83,349.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.24	128,896.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	5.04	168,840.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.50	206,700.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	80,000	2.12	169,600.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.41	124,806.00	

	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	111,300	5.61	624,393.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	20.26	249,198.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	19.00	100,700.00	
	MALAYAN BANKING BHD	80,300	8.60	690,580.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	253,200	4.36	1,103,952.00	
	RHB BANK BHD	26,900	5.82	156,558.00	
	INARI AMERTRON BHD	42,600	3.20	136,320.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.96	189,288.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	4.19	221,651.00	
	MAXIS BHD	45,700	4.48	204,736.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.29	97,336.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	17.38	243,320.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	42,100	9.12	383,952.00	
マレーシアリンギット 小計		1,438,670		8,117,872.00 (223,736,670)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	133.50	3,163,950.00	
	PTT PCL-NVDR	174,400	40.50	7,063,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	16,000	53.50	856,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	25,900	50.75	1,314,425.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	57.25	2,410,225.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	19,800	62.00	1,227,600.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	383.00	5,170,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	73,800	63.75	4,704,750.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.65	1,339,885.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	9.30	1,463,820.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.94	941,564.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	31.75	1,882,775.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	38.00	1,262,550.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.80	1,645,760.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	25.25	1,376,125.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	32.50	536,250.00	
	CP ALL PCL-NVDR	101,900	64.00	6,521,600.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	98.50	482,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	25.50	1,874,250.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	33.00	643,500.00	

	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	21.00	1,020,600.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	176,000	22.90	4,030,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	151.00	1,494,900.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	29.00	388,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	48,300	14.30	690,690.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	134.00	2,063,600.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	21.20	790,760.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	67.25	988,575.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	56.75	925,025.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	62.00	1,004,400.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	56.00	2,156,000.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	9.65	1,507,330.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	6,200	387.00	2,399,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,600	234.00	4,820,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	77.75	1,648,300.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	167,500	4.94	827,450.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	32.50	308,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	174.50	698,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	91.50	2,562,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	74.00	984,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	50.00	2,705,000.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	45.50	509,600.00	
タイバーツ 小計		2,293,025		80,405,359.00 (287,047,131)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	29,260	58.05	1,698,543.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	852.00	4,047,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	560.00	873,600.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	58.85	3,030,245.35	
	SM INVESTMENTS CORP	4,000	940.00	3,760,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	16,350	208.60	3,410,610.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	249.00	1,730,550.00	
	MONDE NISSIN CORP	90,200	17.00	1,533,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	127.00	2,211,070.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	100.00	3,468,000.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	138.30	4,897,203.00	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	59.50	2,190,314.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.67	1,038,610.00	
	AYALA LAND INC	152,200	37.85	5,760,770.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	173,800	38.00	6,604,400.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,784.00	1,252,800.00	
	PLDT INC	1,175	1,820.00	2,138,500.00	
	AC ENERGY CORP	154,600	8.60	1,329,560.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	362.00	1,683,300.00	
フィリピンペソ 小計		1,098,748		52,658,475.35 (118,323,594)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	226,800	2,230.00	505,764,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	23,450.00	792,610,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,890.00	331,884,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	1,000.00	559,600,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,575.00	408,292,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	10,775.00	249,980,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	209,100	3,650.00	763,215,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	7,200.00	398,160,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	353,700	5,300.00	1,874,610,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	139,000	5,800.00	806,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	30,900.00	203,940,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	8,550.00	401,850,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,350.00	515,620,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	3,850.00	541,695,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,600.00	554,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	982,100	7,700.00	7,562,170,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	327,300	7,800.00	2,552,940,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	7,700.00	1,051,050,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,206,045	4,410.00	5,318,658,450.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,035.00	359,455,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	873,900	4,400.00	3,845,160,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,750.00	387,475,000.00	
インドネシアルピア 小計		6,466,045		29,984,729,450.00 (242,876,308)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	41,400.00	35,107,200.00	

S-OIL CORP	847	90,300.00	76,484,100.00	
SK INNOVATION CO LTD	896	204,500.00	183,232,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	32,800.00	76,916,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,620	39,950.00	64,719,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	158	532,000.00	84,056,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	154,000.00	47,278,000.00	
LG CHEM LTD	805	619,000.00	498,295,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	313,000.00	41,629,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	320	218,500.00	69,920,000.00	
POSCO	1,302	284,000.00	369,768,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	576	109,000.00	62,784,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	263	125,500.00	33,006,500.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	361	117,000.00	42,237,000.00	
SKC CO LTD	401	134,000.00	53,734,000.00	
CJ CORP	193	81,800.00	15,787,400.00	
DOOSAN BOBCAT INC	883	38,400.00	33,907,200.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	6,396	15,600.00	99,777,600.00	
ECOPRO BM CO LTD	207	330,400.00	68,392,800.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	38,450.00	48,216,300.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	40,900.00	60,082,100.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	49,250.00	40,040,250.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	35,350.00	49,808,150.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	81,400.00	58,526,600.00	
LG CORP	1,582	75,500.00	119,441,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	374	463,000.00	173,162,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,449	107,500.00	155,767,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	23,000.00	68,103,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,320.00	64,409,240.00	
SK	724	221,500.00	160,366,000.00	
S-1 CORPORATION	228	67,800.00	15,458,400.00	
CJ LOGISTICS	135	117,500.00	15,862,500.00	
HMM CO LTD	4,920	25,000.00	123,000,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	287	167,500.00	48,072,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	29,900.00	95,261,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	6,080.00	32,564,480.00	

HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	35,150.00	48,963,950.00	
HANON SYSTEMS	3,541	11,500.00	40,721,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,161	223,000.00	258,903,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,447	176,500.00	431,895,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	95,600.00	58,316,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	93,700.00	31,483,200.00	
KIA CORP	4,629	77,000.00	356,433,000.00	
COWAY CO LTD	1,045	71,500.00	74,717,500.00	
F&F CO LTD / NEW	65	912,000.00	59,280,000.00	
HLB INC	1,659	29,700.00	49,272,300.00	
LG ELECTRONICS INC	1,859	123,000.00	228,657,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	25,750.00	48,384,250.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,950.00	24,097,500.00	
HYBE CO LTD	292	254,000.00	74,168,000.00	
KAKAO CORP	5,480	88,800.00	486,624,000.00	
KAKAO GAMES CORP	600	69,500.00	41,700,000.00	
KRAFTON INC	400	267,500.00	107,000,000.00	
NAVER CORP	2,175	322,000.00	700,350,000.00	
NCSOFT CORP	284	510,000.00	144,840,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	99,700.00	39,082,400.00	
PEARL ABYSS CORP	460	95,000.00	43,700,000.00	
CJ ENM CO LTD	195	124,000.00	24,180,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	78,800.00	47,437,600.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	84,500.00	18,759,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	165,500.00	22,839,000.00	
E-MART INC	374	131,500.00	49,181,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	371,500.00	59,440,000.00	
KT&G CORP	1,988	79,600.00	158,244,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	99,600.00	41,035,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	172,500.00	105,397,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	44,100.00	18,918,900.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	176	950,000.00	167,200,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	550,000.00	17,050,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,458	63,400.00	92,437,200.00	
SD BIOSENSOR INC	691	59,800.00	41,321,800.00	

ALTEOGEN INC	544	48,000.00	26,112,000.00	
CELLTRION INC	1,725	158,500.00	273,412,500.00	
CELLTRION PHARM INC	339	85,800.00	29,086,200.00	
GREEN CROSS CORP	90	185,000.00	16,650,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	255,000.00	34,935,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	289	763,000.00	220,507,000.00	
SEEGENE INC	734	51,800.00	38,021,200.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	652	23,950.00	15,615,400.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	78,800.00	41,685,200.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	162,500.00	67,762,500.00	
YUHAN CORP	794	56,500.00	44,861,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,241	50,000.00	262,050,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	11,050.00	49,227,750.00	
KAKAOBANK CORP	1,800	43,950.00	79,110,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	6,950	64,600.00	448,970,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	7,695	40,400.00	310,878,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	8,605	14,700.00	126,493,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	649	78,600.00	51,011,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	6,100.00	37,088,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	8,980.00	50,763,940.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	11,900.00	35,271,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	42,000.00	51,324,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	63,600.00	57,939,600.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	511	212,500.00	108,587,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,244	62,700.00	77,998,800.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	357	51,800.00	18,492,600.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	137,000.00	88,639,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	91,200.00	40,128,000.00	
L&F CO LTD	420	179,000.00	75,180,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,329	19,200.00	83,116,800.00	
LG INNOTEK CO LTD	235	315,000.00	74,025,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	973	162,500.00	158,112,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	84,863	73,700.00	6,254,403,100.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	14,570	67,100.00	977,647,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	972	526,000.00	511,272,000.00	

	LG UPLUS CORP	3,303	13,400.00	44,260,200.00	
	SK TELECOM	476	54,700.00	26,037,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	22,200.00	104,895,000.00	
	SK HYNIX INC	9,673	132,500.00	1,281,672,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	308	54,600.00	16,816,800.00	
韓国ウォン 小計		283,599		19,807,263,110.00 (1,909,420,163)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	98.90	1,879,100.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	45.30	1,857,300.00	
	CHINA STEEL CORP	209,000	35.50	7,419,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	65,000	80.20	5,213,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	67,000	105.00	7,035,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	91,000	88.40	8,044,400.00	
	TAIWAN CEMENT	91,477	47.15	4,313,140.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	940.00	2,444,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	29.45	1,619,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,299	272.00	1,441,328.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,280.00	1,280,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	44,550	130.00	5,791,500.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.00	1,102,000.00	
	WAN HAI LINES LTD	11,000	180.00	1,980,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	30,000	110.50	3,315,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.25	1,057,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	586.00	1,769,720.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	221.00	1,785,680.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	302.50	1,815,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	372.00	1,116,000.00	
	POU CHEN	45,000	32.15	1,446,750.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	631.00	3,155,000.00	
	MOMO.COM INC	1,000	1,110.00	1,110,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	261.00	2,610,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	85,000	68.10	5,788,500.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	4,000	243.00	972,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	72,332	18.00	1,301,976.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	328,000	28.65	9,397,200.00	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	211,900	30.35	6,431,165.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	182,263	26.40	4,811,743.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	159,991	22.85	3,655,794.35	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	192,000	38.45	7,382,400.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	17.40	3,166,713.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	177,708	20.30	3,607,472.40	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	167,361	27.45	4,594,059.45	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	49.15	3,293,050.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	22,996	266.50	6,128,434.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	170,920	25.45	4,349,914.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	140,000	64.20	8,988,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	282,000	19.20	5,414,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	133,500	76.10	10,159,350.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	11.30	2,438,935.50	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	67.50	1,557,360.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	9,000	256.00	2,304,000.00	
ACER INC	56,000	28.60	1,601,600.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	379.00	2,766,321.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	12,000	363.00	4,356,000.00	
AU OPTRONICS CORP	141,000	20.95	2,953,950.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	153.50	1,995,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	25.50	1,989,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	34,000	256.00	8,704,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	18,000	62.30	1,121,400.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	221,800	104.00	23,067,200.00	
INNOLUX CORP	163,000	16.90	2,754,700.00	
INVENTEC CORP	52,000	25.40	1,320,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,080.00	3,952,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	66.70	2,601,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	11,000	153.00	1,683,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	496.00	1,984,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	69.60	2,575,200.00	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	92.60	4,444,800.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	69.00	1,794,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	21,000	217.50	4,567,500.00	

	WISTRON CORP	52,951	30.30	1,604,415.30	
	WIWYNN CORP	1,500	989.00	1,483,500.00	
	WPG HOLDINGS LTD	26,960	55.80	1,504,368.00	
	YAGEO CORPORATION	7,198	464.00	3,339,872.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	92.50	1,202,500.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	67,000	120.00	8,040,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	66.90	2,007,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	103.00	3,090,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	58,000	100.00	5,800,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,795.00	897,500.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,650.00	1,650,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	719.00	2,876,000.00	
	MEDIATEK INC	26,800	1,105.00	29,614,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	78.70	1,652,700.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	454.50	4,545,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	2,045.00	2,863,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	487.50	3,900,000.00	
	SILERGY CORP	1,410	3,825.00	5,393,250.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	438,000	637.00	279,006,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	209,000	53.00	11,077,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	124.00	1,860,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	312.50	1,875,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	50,000	32.10	1,605,000.00	
新台湾ドル 小計		5,771,617		619,461,511.75 (2,564,880,389)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	361.70	5,838,923.10	
	COAL INDIA LTD	25,983	161.65	4,200,151.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,986	289.75	2,893,443.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	35,280	116.55	4,111,884.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,103	166.20	7,163,718.60	
	PETRONET LNG LTD	12,992	216.05	2,806,921.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	50,611	2,338.55	118,356,354.05	
	ACC LTD	1,469	2,153.90	3,164,079.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,774	355.10	4,891,147.40	
	ASIAN PAINTS LTD	6,736	3,143.45	21,174,279.20	

BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	699.80	2,852,384.80	
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,642.95	8,037,311.40	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	27,397	521.25	14,280,686.25	
JSW STEEL LTD	14,544	626.55	9,112,543.20	
PI INDUSTRIES LTD	1,583	2,540.95	4,022,323.85	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,388.55	6,554,181.20	
SHREE CEMENT LTD	197	23,589.20	4,647,072.40	
SRF LTD	2,458	2,345.65	5,765,607.70	
TATA STEEL LTD	12,591	1,186.85	14,943,628.35	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,758	7,089.10	12,462,637.80	
UPL LTD	9,171	721.70	6,618,710.70	
VEDANTA LTD	20,779	361.50	7,511,608.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	4,705	1,663.95	7,828,884.75	
BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	195.90	4,499,431.20	
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,156.05	5,217,253.65	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,072	1,799.00	21,717,528.00	
SIEMENS LTD	1,348	2,330.40	3,141,379.20	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	798.35	3,530,303.70	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	695.75	6,621,452.75	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,598	588.35	2,116,883.30	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	2,092.30	4,033,954.40	
BAJAJ AUTO LTD	1,154	3,487.95	4,025,094.30	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,084.95	3,354,684.55	
BHARAT FORGE LTD	4,571	700.10	3,200,157.10	
EICHER MOTORS LTD	2,527	2,570.80	6,496,411.60	
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,648.50	5,975,016.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	15,155	825.05	12,503,632.75	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,383	8,366.40	19,937,131.20	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	23,659	197.34	4,668,867.06	
MRF LTD	38	65,929.00	2,505,302.00	
TATA MOTORS LTD	28,949	471.45	13,648,006.05	
PAGE INDUSTRIES LTD	89	39,129.30	3,482,507.70	
TITAN CO LTD	6,204	2,398.00	14,877,192.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,498	2,947.70	4,415,654.60	
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	4,511.40	6,446,790.60	

TRENT LTD	3,269	1,036.30	3,387,664.70	
ZOMATO LTD	27,665	82.45	2,280,979.25	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,821	3,979.75	11,226,874.75	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,847	3,398.00	6,276,106.00	
ITC LTD	54,609	219.45	11,983,945.05	
NESTLE INDIA LTD	623	17,670.25	11,008,565.75	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	694.30	7,701,175.60	
UNITED SPIRITS LTD	4,671	813.60	3,800,325.60	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,413.30	3,383,440.20	
DABUR INDIA LTD	10,503	553.10	5,809,209.30	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,424	799.75	5,137,594.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	14,503	2,228.55	32,320,660.65	
MARICO LTD	9,787	489.80	4,793,672.60	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,882	4,486.35	8,443,310.70	
AUROBINDO PHARMA LTD	4,528	680.40	3,080,851.20	
BIOCON LTD	8,322	393.55	3,275,123.10	
CIPLA LTD	9,018	954.90	8,611,288.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,293	4,277.90	9,809,224.70	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,154	4,204.60	9,056,708.40	
LUPIN LTD	4,421	761.35	3,365,928.35	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,592	864.85	12,619,891.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	2,551.20	2,224,646.40	
AXIS BANK LTD	39,962	773.35	30,904,612.70	
BANDHAN BANK LTD	12,468	310.60	3,872,560.80	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	30,413	2,296.80	69,852,578.40	
ICICI BANK LTD	90,857	753.70	68,478,920.90	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	9,726	1,746.85	16,989,863.10	
STATE BANK OF INDIA	31,195	501.40	15,641,173.00	
YES BANK LTD	214,143	13.25	2,837,394.75	
BAJAJ FINANCE LTD	4,790	6,785.95	32,504,700.50	
BAJAJ FINSERV LTD	660	15,674.15	10,344,939.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,646	660.00	4,386,360.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,091	2,172.35	2,370,033.85	
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,355.20	3,213,179.20	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	2,255.40	4,657,401.00	

	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	824.00	3,584,400.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,160.85	4,466,950.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	557.30	9,421,156.50	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,285.75	5,384,721.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	502.60	3,031,180.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	7,738	1,096.30	8,483,169.40	
	DLF LTD	11,721	355.05	4,161,541.05	
	GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,472.20	3,533,280.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	19,104	1,146.45	21,901,780.80	
	INFOSYS LTD	60,457	1,682.20	101,700,765.40	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,030	5,885.35	6,061,910.50	
	MINDTREE LTD	1,148	3,776.45	4,335,364.60	
	MPHASIS LTD	1,375	2,899.95	3,987,431.25	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	16,384	3,733.75	61,173,760.00	
	TECH MAHINDRA LTD	11,055	1,390.15	15,368,108.25	
	WIPRO LTD	23,970	541.70	12,984,549.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	43,560	689.70	30,043,332.00	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	247.20	3,347,335.20	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	6,776	1,862.15	12,617,928.40	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	1,712.30	8,647,115.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	1,915.25	9,672,012.50	
	GAIL INDIA LTD	29,821	137.55	4,101,878.55	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	3,739	380.65	1,423,250.35	
	NTPC LTD	83,762	132.50	11,098,465.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	54,298	201.85	10,960,051.30	
	TATA POWER CO LTD	24,154	220.50	5,325,957.00	
インドルピー 小計		1,580,991		1,238,121,414.46 (1,906,706,978)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	19.48	191,585.80	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	3.47	169,002.88	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.70	204,898.06	
	INDUSTRIES QATAR	27,513	18.03	496,059.39	
	COMMERCIAL BANK PQSC	28,465	6.96	198,116.40	
	MASRAF AL RAYAN	90,428	4.99	452,049.57	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	10.30	154,942.90	

	QATAR ISLAMIC BANK	21,511	20.08	431,940.88	
	QATAR NATIONAL BANK	78,249	21.07	1,648,706.43	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.43	139,749.54	
	OOREDOO QPSC	12,412	7.38	91,600.56	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	18.10	146,573.80	
カタールリアル 小計		456,774		4,325,226.21 (137,023,166)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	192.15	808,375.05	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	254.89	583,698.10	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,932.25	1,899,401.75	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,153	323.00	2,310,419.00	
	GOLD FIELDS LTD	15,294	184.44	2,820,825.36	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	58.55	629,939.45	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	14,294	239.27	3,420,125.38	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	671.27	716,245.09	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,936	210.72	1,250,833.92	
	SASOL LTD	9,875	339.31	3,350,686.25	
	SIBANYE STILLWATER LTD	47,629	61.60	2,933,946.40	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	212.00	1,121,480.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	125.24	906,988.08	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	213.91	994,895.41	
	NASPERS LTD-N SHS	3,817	2,287.19	8,730,204.23	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	24,000	22.73	545,520.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	53.31	1,007,878.86	
	BID CORP LTD	6,193	329.81	2,042,513.33	
	CLICKS GROUP LTD	4,114	298.66	1,228,687.24	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,578	222.35	1,907,318.30	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	170.50	627,440.00	
	TIGER BRANDS LTD	3,270	173.52	567,410.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	202.44	1,476,597.36	
	ABSA GROUP LTD	13,383	175.77	2,352,329.91	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,414	2,113.37	2,988,305.18	
	NEDBANK GROUP LTD	7,694	206.60	1,589,580.40	
	STANDARD BANK GROUP LTD	22,686	154.58	3,506,801.88	
	FIRSTRAND LTD	88,928	63.78	5,671,827.84	

	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	319.90	873,007.10	
	REMGRO LTD	10,067	133.90	1,347,971.30	
	DISCOVERY LTD	8,270	161.50	1,335,605.00	
	OLD MUTUAL LTD	90,974	13.62	1,239,065.88	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	15,014	48.90	734,184.60	
	SANLAM LTD	32,128	65.11	2,091,854.08	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,950	105.27	836,896.50	
	MTN GROUP LTD	29,863	187.44	5,597,520.72	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	148.29	1,655,064.69	
南アフリカランド 小計		558,783		73,701,444.04 (562,342,018)	
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	48,436	4.09	198,103.24	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	9.57	485,667.93	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	8.05	218,050.35	
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.68	311,286.72	
	EMIRATES NBD PJSC	49,345	13.90	685,895.50	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	75,394	20.74	1,563,671.56	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.22	304,021.46	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	4.84	361,480.24	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	60,264	33.10	1,994,738.40	
アラブディルハム 小計		512,808		6,122,915.40 (192,749,376)	
クウェートディナール	AGILITY	23,191	1.01	23,562.05	
	BOUBYAN BANK K.S.C	21,129	0.81	17,241.26	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	81,445	0.90	73,544.83	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	120,535	1.03	124,392.12	
	MABANEE CO KPSC	11,548	0.80	9,330.78	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,960	0.61	22,007.52	
クウェートディナール 小計		293,808		270,078.56 (103,253,734)	
オフショア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.44	144,300.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	25.77	229,353.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.79	19,686.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	6.68	7,348.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.75	2,375.00	

PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.82	126,294.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	13.97	132,715.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	9.21	78,469.20	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	2,900	13.07	37,903.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	991	29.67	29,402.97	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	46.22	41,598.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	6.06	76,962.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	42.45	165,555.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	50.17	25,085.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	24,500	7.36	180,320.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.92	2,628.00	
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	75.53	52,871.00	
CHENGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	9.67	42,548.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	48.24	67,536.00	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.02	36,048.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	16.72	55,410.08	
CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	34.46	65,474.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	5.69	97,868.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	43.99	153,965.00	
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	3,300	10.45	34,485.00	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	41.28	61,920.00	
GEM CO LTD-A	3,500	9.19	32,165.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	87.20	103,768.00	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	29.57	59,140.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	25.16	143,915.20	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.28	20,046.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.50	3,750.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	106.06	74,242.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	9.81	45,126.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	20.74	22,814.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	33.57	63,783.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.85	20,475.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.50	110,750.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.02	17,570.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	9.22	54,398.00	

JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	17.30	55,360.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	123.49	37,047.00	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	54.97	27,485.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	22.18	44,360.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	136.50	150,150.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	10.76	34,432.00	
LB GROUP CO LTD-A	1,700	25.14	42,738.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	15.94	30,286.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	17.52	106,872.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.71	26,712.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	19.67	197,683.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	1,680	46.26	77,716.80	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	19.97	69,255.96	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	35.17	64,009.40	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	4.70	47,000.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.57	25,454.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	128.00	92,160.00	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	13.72	50,764.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	7.30	35,040.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	17.81	30,277.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	87.29	52,374.00	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,200	31.24	37,488.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.77	53,534.00	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	21.58	51,792.00	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	25.41	48,279.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	28.68	63,096.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	4.03	2,418.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	109.16	61,129.60	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.94	67,050.00	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	29.85	44,775.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	22.38	33,570.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.86	40,144.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.90	10,270.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	99.12	376,656.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	68.98	27,592.00	

WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	76.50	76,500.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	20.69	24,828.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	11.02	45,182.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	8.71	20,729.80	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	126.84	88,788.00	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	12.90	39,990.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,000	227.36	227,360.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	23.05	80,675.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	101.00	117,160.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	13.30	30,590.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.82	41,024.00	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	31.10	46,650.00	
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	9.08	40,860.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,500	11.06	293,090.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	23.77	23,770.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	47.55	118,875.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	12.38	37,140.00	
AVICOPTER PLC-A	500	55.91	27,955.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	33.61	47,054.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	109.92	43,968.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	13.19	59,355.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	21.55	94,820.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	10.43	101,171.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.47	138,458.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	45,100	5.35	241,285.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,500	508.00	1,270,000.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	3.23	59,432.00	
CRRC CORP LTD-A	26,200	5.96	156,152.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	15.99	70,356.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	2,020	83.50	168,670.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	9.73	4,057.41	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	400	201.05	80,420.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	39.42	70,956.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	143.90	57,560.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	35.96	21,576.00	

HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	59.08	17,724.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,436	65.00	93,340.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	15.72	40,872.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	19.95	43,890.00	
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	200	131.00	26,200.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	4.10	89,380.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	1,800	24.00	43,200.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	5,946	31.94	189,915.24	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	18.08	43,392.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	16,500	9.12	150,480.00	
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	24.36	48,720.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	9,100	20.46	186,186.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.54	19,824.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.50	46,800.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	60.56	163,512.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	4,500	10.81	48,645.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	42.89	64,335.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	95.58	143,370.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	34.22	44,486.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	448.75	71,800.00	
TBEA CO LTD-A	5,500	18.82	103,510.00	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	19.40	54,320.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	5,900	15.25	89,975.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	121.93	60,965.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.74	44,198.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.83	2,949.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	14.44	49,096.00	
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	30.91	30,291.80	
YOUNGY CO LTD-A	400	102.00	40,800.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.07	32,171.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	42.53	85,060.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	63.15	26,523.00	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	76.48	61,184.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	18.94	56,630.60	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	22.27	28,951.00	

ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	16.42	65,680.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	7.39	47,296.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	6.88	17,888.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	54.55	43,640.00	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	1,800	30.74	55,332.00	
AIR CHINA LTD-A	6,400	10.82	69,248.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	44,000	5.30	233,200.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	5.84	63,072.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	7.41	67,431.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	16.15	207,850.50	
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	60.88	340,928.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	57.45	57,450.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.88	52,332.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.35	8,700.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	16.14	64,560.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	18.38	89,510.60	
AUTEL INTELLIGENT TECHNOLO-A	1,000	53.88	53,880.00	
BYD CO LTD -A	2,100	231.98	487,158.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	158.10	31,620.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	12.47	75,069.40	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	9.71	31,072.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	46.06	87,514.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	38.10	125,730.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	26.28	78,840.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	117.70	58,850.00	
MIANYANG FULIN PRECISION C-A	1,100	23.41	25,751.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	16.66	19,992.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,100	51.80	56,980.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,610	18.80	161,868.00	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	10.98	34,038.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	27.70	36,010.00	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	129.83	51,932.00	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	817.00	163,400.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	124.50	74,700.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	6,900	25.89	178,641.00	

HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	24.00	26,400.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	34.33	34,330.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	70.88	56,704.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	16.58	14,922.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	129.92	70,156.80	
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	4.39	19,755.00	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	75.39	60,312.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	5.76	81,216.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	31.14	15,881.40	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.47	2,988.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	51.03	15,309.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	60.28	36,168.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	7.31	60,673.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	16.51	17,830.80	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	10.21	13,273.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	15,900	7.99	127,041.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	354.99	35,499.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	9.91	1,982.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	18.49	14,792.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	37.15	115,536.50	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	13.78	18,603.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	3,900	25.10	97,890.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	7,100	6.99	49,629.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,100	227.50	477,750.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.17	50,850.00	
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	3.80	34,580.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.58	33,480.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	36.37	26,186.40	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	43.52	12,185.60	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	49.69	27,130.74	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	3.86	11,966.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	55.67	38,969.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	236.90	142,140.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	74.40	37,200.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	68.01	40,806.00	

ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	135.86	54,344.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	8.23	4,115.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	28.13	16,878.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	56.59	22,636.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	138.32	55,328.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	31.90	22,330.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,190	96.00	402,240.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	21.40	19,260.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,800	66.75	120,150.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.74	34,350.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	30.88	74,112.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	6,900	40.00	276,000.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	54.14	54,140.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,600	172.96	276,736.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	7.24	14,480.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	162.20	64,880.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	35.53	10,659.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	55.20	16,560.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,300	1,868.67	2,429,271.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,600	219.40	351,040.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,716	59.18	338,272.88	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	16.56	125,856.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	43.25	42,385.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,320	293.10	386,892.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	97.97	39,188.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	700	26.55	18,585.00	
TONGWEI CO LTD-A	4,900	37.45	183,505.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	94.89	85,401.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	7,060	21.20	149,672.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,200	198.01	831,642.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	56.76	124,872.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	18.62	20,482.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	26.63	34,619.00	
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	15.20	15,200.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	171.71	17,171.00	

SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	40.49	24,294.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	33.40	185,871.00	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	48.65	30,649.50	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	28.34	11,336.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	75.75	53,025.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	36.06	62,744.40	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	450	51.14	23,013.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	47.55	56,109.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	30.20	15,100.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	13.71	2,742.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	21.00	39,900.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.25	3,480.00	
OVCTEK CHINA INC-A	920	39.79	36,606.80	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	19.00	38,000.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,300	298.90	388,570.00	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	36.87	36,870.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	148.70	44,610.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	11.41	11,866.40	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	26.06	23,454.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	276.60	55,320.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	27.57	29,775.60	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	500	206.19	103,095.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	58.50	17,550.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	86.00	25,800.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	252.98	50,596.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	163.55	65,420.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	34.22	3,422.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	122.48	244,960.00	
DAAN GENE CO LTD-A	960	17.74	17,030.40	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	36.80	3,680.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	29.50	41,300.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	93.16	27,948.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	25.73	45,799.40	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	19.05	26,670.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	412.62	123,786.00	

JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,916	39.75	274,911.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.90	19,040.00	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	90.45	50,652.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	35.70	17,850.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	33.95	28,687.75	
PHARMABLOCK SCIENCES NANJI-A	400	82.28	32,912.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	107.14	74,998.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.94	5,184.40	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	41.58	79,002.00	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	60.08	50,166.80	
SHANGHAI MEDICILON INC-A	200	325.36	65,072.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	6.81	19,749.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	78.20	46,920.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	24.58	2,458.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	21.81	30,534.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	18.04	3,608.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	50.00	75,000.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	3,128	85.30	266,818.40	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,400	92.17	129,038.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	700	342.50	239,750.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	19.86	24,030.60	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	40.13	52,169.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	32.21	68,800.56	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	42.37	16,948.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	3.04	215,536.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.62	86,394.00	
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	8.11	60,825.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	14.34	21,510.00	
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.17	106,512.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.92	184,500.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.65	84,970.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.78	101,022.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.12	90,068.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	39.81	314,499.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.21	98,128.10	

CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	6.26	57,592.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	3.44	193,672.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	22,100	51.20	1,131,520.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	3.96	118,008.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.51	59,319.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	4.01	34,085.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.76	70,848.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.80	371,520.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	22,400	22.25	498,400.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	16.58	381,340.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	29,400	5.84	171,696.00	
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.83	20,299.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	8.60	314,760.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.96	3,564.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	11.80	35,400.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	9.79	14,685.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.08	48,144.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.64	29,792.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	11.00	33,000.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	43.43	52,116.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	8,200	16.63	136,366.00	
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	24.80	275,280.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	26.00	130,000.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	10.60	65,720.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	11,204	27.49	307,997.96	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	13.88	44,416.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.60	3,300.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	7.52	54,144.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	18.80	110,920.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	3,240	8.59	27,831.60	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	15.16	33,352.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	10.97	50,462.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8,300	17.66	146,578.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.39	3,695.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.71	104,219.00	

HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	109.54	54,770.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,100	16.87	136,647.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.25	2,775.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.50	56,950.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	9.02	14,432.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.58	25,740.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	12.39	64,428.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	7.67	41,970.24	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.07	10,175.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.04	2,416.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.74	128,928.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	10.44	44,892.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	8.04	77,988.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.84	18,392.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	3.80	16,340.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	7.77	3,885.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	11.92	15,496.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	8.75	91,875.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	30.80	77,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.92	187,064.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	39.79	75,601.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.74	16,590.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,400	53.90	668,360.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	13.84	110,720.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	20.24	259,072.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	33.88	81,312.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	12.28	40,524.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.48	66,796.80	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.82	3,374.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	15.31	195,968.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.19	2,514.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	14.60	24,528.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	14.23	12,807.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.89	21,359.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.68	60,840.00	

360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	8,400	10.61	89,124.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	25.55	12,264.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	212.79	127,674.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	24.50	3,430.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.00	9,800.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	13.99	9,793.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	8.15	3,260.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	2,364	52.22	123,448.08	
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	49.15	122,875.00	
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	29.06	23,248.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	144.50	57,800.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,920	51.22	98,342.40	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	125.60	37,680.00	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	15.13	13,617.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	3,708	32.00	118,656.00	
ADDSINO CO LTD -A	1,700	14.87	25,279.00	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	34.26	78,798.00	
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	35.13	17,565.00	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	152.30	30,460.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	41,400	4.93	204,102.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	34.64	62,352.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	12.90	33,540.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.94	54,340.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	108.07	54,035.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	16.86	18,546.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.26	79,946.00	
GOERTEK INC -A	3,300	40.91	135,003.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	12.94	28,468.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.10	42,090.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.64	2,892.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	76.42	38,210.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	13.62	50,394.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	23.52	23,520.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	30.82	18,492.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	14.71	67,666.00	

LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	9.01	20,723.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	7,633	41.90	319,822.70	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	247.50	89,100.00	
NINESTAR CORP-A	1,800	48.50	87,300.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	7.38	2,952.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	64.70	45,290.00	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	200	302.92	60,584.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	19.44	44,712.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	112.70	31,556.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	13.63	13,630.00	
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	32.27	25,816.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	21.98	19,782.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	131.93	131,930.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	23.53	16,471.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	37.52	26,264.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	12.09	29,016.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	20.41	38,289.16	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	14.13	18,369.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	38.89	50,557.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	106.47	127,764.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	21.57	41,069.28	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	9.43	23,575.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	15.89	27,966.40	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	61.25	39,200.00	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	179.70	71,880.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	75.46	67,914.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	19.01	45,624.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	34.84	17,420.00	
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	83.35	58,345.00	
ZTE CORP-A	3,800	29.30	111,340.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.96	184,140.00	
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	8.89	57,785.00	
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	5.29	41,791.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	15,600	7.42	115,752.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	24,300	23.39	568,377.00	

	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.75	33,725.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	2.77	85,870.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.18	5,434.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	8.15	92,095.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	10.25	67,650.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	7.27	4,362.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.97	62,244.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	111.39	105,040.77	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	41.17	45,287.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.57	15,351.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	139.54	105,492.24	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	100.37	120,444.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	49.20	98,400.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	104.45	41,780.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	2,200	75.60	166,320.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	27.44	52,136.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,240	65.33	407,659.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	71.06	50,736.84	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	22.59	81,324.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	251.50	125,750.00	
	SG MICRO CORP-A	250	299.10	74,775.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	90.75	22,687.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	74.17	22,251.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	305.70	61,140.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	4,300	42.33	182,019.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	11.69	22,211.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	17.81	14,248.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	188.81	151,048.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,100	229.00	251,900.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	54.30	48,870.00	
オフショア人民元 小計		2,346,113		43,397,029.46 (787,860,050)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	23.52	92,457.12	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	38,627	37.30	1,440,787.10	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	75.40	141,676.60	

	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	4,640	21.74	100,873.60	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	43.80	87,600.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,710	165.00	612,150.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	43.80	292,321.20	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	7,462	93.50	697,697.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	15,860	120.60	1,912,716.00	
	SAUDI CEMENT	1,265	57.90	73,243.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	4,366	34.25	149,535.50	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	19.50	269,685.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	67.10	304,231.40	
	JARIR MARKETING CO	1,096	200.20	219,419.20	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	973	108.00	105,084.00	
	ALMARAI CO	4,232	49.85	210,965.20	
	SAVOLA	4,558	33.25	151,553.50	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	165.20	129,847.20	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	198.40	189,472.00	
	AL RAJHI BANK	21,662	150.00	3,249,300.00	
	ALINMA BANK	18,025	30.40	547,960.00	
	ARAB NATIONAL BANK	11,172	29.00	323,988.00	
	BANK AL-JAZIRA	7,856	25.50	200,328.00	
	BANK ALBILAD	6,762	56.40	381,376.80	
	BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	52.80	573,091.20	
	RIYAD BANK	23,469	33.70	790,905.30	
	SAUDI BRITISH BANK	14,183	39.35	558,101.05	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	38,769	71.00	2,752,599.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	170.60	199,260.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,298	81.60	105,916.80	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	7,066	10.26	72,497.16	
	EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	12.20	101,199.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	7,054	35.15	247,948.10	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	13.36	121,375.60	
	SAUDI TELECOM CO	10,529	116.20	1,223,469.80	
	SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	26.45	411,535.55	
サウジアラビアリアル 小計		334,184		19,042,167.28 (586,689,173)	

合　計	46,367,822		15,991,542,781 (15,991,542,781)	

(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	1,314,059.00	
		メキシコペソ 小計	58,900	1,314,059.00 (7,432,711)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	887,551.83	
		南アフリカランド 小計	63,261	887,551.83 (6,772,020)	
合計				14,204,731 (14,204,731)	

(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%	—	6.7%
メキシコペソ	株式	23銘柄	97.7%	—	2.0%
	投資証券	1銘柄	—	2.3%	0.0%
ブラジルレアル	株式	49銘柄	100.0%	—	4.7%
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	206銘柄	100.0%	—	24.0%
マレーシアリンギット	株式	35銘柄	100.0%	—	1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%	—	1.8%
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%	—	1.5%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%	—	12.0%
新台湾ドル	株式	86銘柄	100.0%	—	16.1%
インドルピー	株式	106銘柄	100.0%	—	12.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%	—	0.9%
南アフリカランド	株式	37銘柄	98.8%	—	3.5%
	投資証券	1銘柄	—	1.2%	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	490銘柄	100.0%	—	4.9%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%	—	3.7%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	

	2022年 2月15日現在
預金	13,011,629
コール・ローン	15,272,193
投資信託受益証券	7,077,152,230
流動資産合計	7,105,436,052
資産合計	7,105,436,052
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,904,000
未払利息	41
流動負債合計	25,904,041
負債合計	25,904,041
純資産の部	
元本等	
元本	6,417,964,547
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	661,567,464
元本等合計	7,079,532,011
純資産合計	7,079,532,011
負債純資産合計	7,105,436,052

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）

2022年 2月15日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日

期首元本額	4,842,031,112円
期中追加設定元本額	4,097,925,187円
期中一部解約元本額	2,521,991,752円
期末元本額	6,417,964,547円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,008,327,185円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	849,687,493円
りそなラップ型ファンド（成長型）	490,687,519円
ＤＣりそな　グローバルバランス	17,938,122円
つみたてバランスファンド	905,452,459円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	264,874,796円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	155,756,116円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	104,355,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	35,763,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	22,773,610円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	12,283,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	21,559,526円
リスクコントロール・オープン	3,232,249円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	126,198,464円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	46,988,611円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	122,026,755円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	1,413,679,306円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	50,133,957円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	139,220,166円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	164,723,234円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	70,598,927円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	104,583,069円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	63,842,413円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	40,280,694円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	131,592,926円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	22,310,094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）	1,162,210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）	366,631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）	2,535,071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）	1,608,511円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	23,421,881円
２．　計算日における受益権の総数	
	6,417,964,547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	1.1031円
(10,000口当たり純資産額)	(11,031円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2 .金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3 .金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

II金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	75,542,997
合計	75,542,997

(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

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	857,147	43,817,354.64	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	608,032	17,499,160.96	
		米ドル 小計	1,465,179	61,316,515.60 (7,077,152,230)	
合計				7,077,152,230 (7,077,152,230)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入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

該当事項はありません。

ＲＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	788,232,988
投資証券	27,962,572,800
未収配当金	248,783,405
前払金	14,659,300
差入委託証拠金	18,500,500
流動資産合計	29,032,748,993
資産合計	29,032,748,993
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,159,730
未払金	123,396,750
未払解約金	656,022,000
未払利息	2,137
流動負債合計	798,580,617
負債合計	798,580,617
純資産の部	
元本等	

	2022年 2月15日現在
元本	20,706,040,047
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,528,128,329
元本等合計	28,234,168,376
純資産合計	28,234,168,376
負債純資産合計	29,032,748,993

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	20,846,254,157円
期中追加設定元本額	14,673,228,121円
期中一部解約元本額	14,813,442,231円
期末元本額	20,706,040,047円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	950,022,966円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	941,888,323円
りそなラップ型ファンド（成長型）	827,150,528円
ＤＣりそな　グローバルバランス	20,415,101円
つみたてバランスファンド	1,436,467,161円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	201,177,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	119,000,829円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	83,352,022円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	27,394,050円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	18,100,411円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	9,501,139円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	17,159,752円
リスクコントロール・オープン	2,529,731円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	90,293,569円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	42,116,411円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	680,041円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	5,192,997,588円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	4,386,200,254円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,610,977,847円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	38,591,577円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	108,832,338円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	130,048,764円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	56,931,917円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	82,060,446円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	50,092,577円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	32,499,935円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	102,736,911円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	17,699,892円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,303,936,076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）	1,920,547円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	631,952,851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）	335,878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）	3,828,799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）	4,063,015円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	18,387,836円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０２１０２（適格機関投資家専用）	144,695,308円
２．　計算日における受益権の総数	
	20,706,040,047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	1.3636円
(10,000口当たり純資産額)	(13,636円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△297,245,454
合計	△297,245,454

(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)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	321,361,730	－	302,202,000	△19,159,730
合計		321,361,730	－	302,202,000	△19,159,730

（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	547	73,298,000	

サンケイリアルエステート投資法人	860	94,858,000	
ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	1,263	184,776,900	
東海道リート投資法人	208	22,651,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	937	563,137,000	
森ヒルズリート投資法人	3,192	438,580,800	
産業ファンド投資法人	3,854	662,502,600	
アドバンス・レジデンス投資法人	2,714	868,480,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,854	350,220,600	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,447	549,860,000	
ＧＬＰ投資法人	8,792	1,499,036,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,263	386,478,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,441	1,485,514,500	
星野リゾート・リート投資法人	455	288,470,000	
Ｏｎｅリート投資法人	471	135,459,600	
イオンリート投資法人	3,192	451,029,600	
ヒューリックリート投資法人	2,532	400,562,400	
日本リート投資法人	838	319,697,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,240	622,944,000	
トーセイ・リート投資法人	567	71,782,200	
ケネディクス商業リート投資法人	1,084	284,008,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	665	91,304,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	615	70,356,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,778	1,370,245,800	
いちごホテルリート投資法人	450	36,000,000	
ラサールロジポート投資法人	3,323	566,903,800	
スターアジア不動産投資法人	2,805	164,092,500	
マリモ地方創生リート投資法人	318	38,986,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,069	571,915,000	
大江戸温泉リート投資法人	438	28,776,600	
投資法人みらい	3,288	154,864,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	637	77,395,500	
三菱地所物流リート投資法人	690	294,975,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,051	206,206,200	
ザイマックス・リート投資法人	394	47,477,000	
タカラレーベン不動産投資法人	1,070	121,766,000	

	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,058	156,478,200	
	日本ビルファンド投資法人	3,165	2,022,435,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,715	1,642,575,000	
	日本都市ファンド投資法人	13,696	1,262,771,200	
	オリックス不動産投資法人	5,409	886,535,100	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,855	678,002,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,602	382,494,000	
	東急リアル・エステート投資法人	1,820	325,234,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,885	205,653,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,111	796,263,300	
	森トラスト総合リート投資法人	1,940	261,512,000	
	インヴィンシブル投資法人	11,948	459,400,600	
	フロンティア不動産投資法人	952	438,872,000	
	平和不動産リート投資法人	1,759	243,621,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,774	538,409,000	
	福岡リート投資法人	1,404	222,955,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	840	566,160,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,224	180,588,800	
	大和証券オフィス投資法人	574	391,468,000	
	阪急阪神リート投資法人	1,226	176,789,200	
	スターツプロシード投資法人	423	92,848,500	
	大和ハウスリート投資法人	4,076	1,259,484,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,316	481,496,400	
	大和証券リビング投資法人	3,668	383,306,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,519	312,607,900	
合計		158,301	27,962,572,800	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	138,477,887
コール・ローン	31,720,458
株式	85,420,062
投資証券	26,719,764,983
派生商品評価勘定	53,507
未収入金	35,216,906
未収配当金	39,372,324
流動資産合計	27,050,026,127
資産合計	27,050,026,127
負債の部	
流動負債	
未払解約金	55,603,000
未払利息	86
流動負債合計	55,603,086
負債合計	55,603,086
純資産の部	
元本等	
元本	19,292,773,715
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,701,649,326
元本等合計	26,994,423,041
純資産合計	26,994,423,041
負債純資産合計	27,050,026,127

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月15日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	22,246,292,394円
期中追加設定元本額	15,250,940,789円
期中一部解約元本額	18,204,459,468円
期末元本額	19,292,773,715円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,353,578,074円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,350,373,035円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,156,171,832円
ＤＣりそな　グローバルバランス	20,815,324円
つみたてバランスファンド	676,384,398円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	400,862,316円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	234,762,851円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	161,200,625円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	56,176,968円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	35,778,612円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	18,864,051円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	33,774,317円
リスクコントロール・オープン	9,909,450円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	187,239,175円
九州ＳＤＧｓ・グローバルバランス	83,931,109円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	5,245,744,996円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	4,307,682,904円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	2,083,618,811円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	77,968,899円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	215,778,290円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	253,686,200円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	109,372,205円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	159,847,801円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	97,576,447円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	62,377,100円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	200,085,936円

りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	34,099,801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）	570,220,887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）	204,953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）	6,145,244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）	6,781,755円
りそなＤＡＡマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	78,698,205円
２．　計算日における受益権の総数	
	19,292,773,715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	1.3992円
(10,000口当たり純資産額)	(13,992円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2022年 2月15日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月15日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価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）

2022年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△2,734,336
投資証券	△711,510,978
合計	△714,245,314

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2022年 2月15日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,780,140	－	25,726,633	53,507
	米ドル	8,079,400	－	8,079,302	98
	ユーロ	11,800,530	－	11,750,499	50,031
	オーストラリアドル	2,471,250	－	2,469,288	1,962
	シンガポールドル	3,428,960	－	3,427,544	1,416
合計		25,780,140	－	25,726,633	53,507

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BROADSTONE NET LEASE INC-A	24,377	21.84	532,393.68	
米ドル 小計		24,377		532,393.68 (61,448,878)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	99,058	2.94	291,230.52	
オーストラリアドル 小計		99,058		291,230.52 (23,971,184)	
合　計		123,435		85,420,062 (85,420,062)	

(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	13,471	262,684.50	
		AGREE REALTY CORP	10,530	660,862.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,055	245,421.00	
		ALEXANDER'S INC	312	79,566.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,414	3,932,038.68	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	30,666.36	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,003	279,144.64	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,117	1,054,582.98	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,329	159,077.67	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,064	1,657,964.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	40,445	1,125,584.35	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,825	1,239,614.75	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,755	157,495.65	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,751	544,976.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,796	135,674.60	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,318	35,493.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,221	5,053,781.15	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,936	103,713.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,547	2,519,921.65	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,084	46,483.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	26,447	348,571.46	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,050	1,109,581.50	
		BRT APARTMENTS CORP	1,668	36,946.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	15,595	2,526,857.85	
		CARETRUST REIT INC	14,733	284,641.56	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	42,161.11	
		CENTERSPACE	2,173	200,024.65	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,087	98,792.78	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	15,000.00	

		CITY OFFICE REIT INC	6,494	114,489.22	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	11,988.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,705	156,980.85	
		COREPOINT LODGING INC	6,315	99,019.20	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,016	429,143.52	
		COUSINS PROPERTIES INC	22,528	859,893.76	
		CTO REALTY GROWTH INC	900	52,416.00	
		CUBESMART	33,092	1,647,650.68	
		CYRUSONE INC	19,264	1,729,329.28	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,493	302,332.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	43,111	5,869,131.54	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	77,384	537,818.80	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	34,590	100,656.90	
		DOUGLAS EMMETT INC	26,557	829,109.54	
		DUKE REALTY CORP	58,084	3,168,482.20	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,347	273,213.09	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	6,169	1,183,399.27	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,071	200,404.68	
		EPR PROPERTIES	11,525	513,554.00	
		EQUINIX INC	13,684	9,159,795.92	
		EQUITY COMMONWEALTH	18,314	477,445.98	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,952	1,986,625.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,796	4,450,312.32	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,743	464,076.68	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,928	3,140,722.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,409	3,963,631.89	
		FARMLAND PARTNERS INC	4,291	47,243.91	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,622	1,254,670.64	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,755	1,152,901.80	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,950	310,102.50	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,910	76,922.30	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,369	1,490,239.84	
		GETTY REALTY CORP	6,200	173,290.00	

GLADSTONE COMMERCIAL CORP		5,758	122,702.98	
GLADSTONE LAND CORP		4,670	139,913.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC		9,087	145,937.22	
GLOBAL NET LEASE INC		15,387	216,648.96	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		22,648	698,690.80	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A		33,492	1,028,204.40	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		82,249	2,640,192.90	
HERSHA HOSPITALITY TRUST		5,878	55,311.98	
HIGHWOODS PROPERTIES INC		16,032	673,824.96	
HOST HOTELS & RESORTS INC		109,115	1,956,431.95	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		22,963	550,652.74	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		15,821	370,686.03	
INDUS REALTY TRUST INC		935	71,901.50	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		9,982	216,010.48	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		3,671	693,892.42	
INVITATION HOMES INC		90,602	3,750,922.80	
IRON MOUNTAIN INC		43,954	1,918,592.10	
JBG SMITH PROPERTIES		17,601	481,387.35	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		111,100	81,103.00	
KILROY REALTY CORP		15,871	1,075,418.96	
KIMCO REALTY CORP		94,096	2,192,436.80	
KITE REALTY GROUP TRUST		33,050	706,278.50	
LIFE STORAGE INC		12,520	1,654,768.40	
LTC PROPERTIES INC		5,856	195,531.84	
LXP INDUSTRIAL TRUST		43,452	659,601.36	
MACERICH CO/THE		32,786	513,756.62	
MANULIFE US REAL ESTATE INV		213,400	139,777.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		91,051	1,892,039.78	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		17,558	3,644,689.64	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR		14,862	310,764.42	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		26,641	1,127,979.94	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES		12,355	746,365.55	
NATL HEALTH INVESTORS INC		7,063	376,669.79	
NETSTREIT CORP		5,746	122,964.40	
NEXPOINT RESIDENTIAL		3,447	270,727.38	

		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	173,349.34	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,245	1,031,895.15	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	64,906.15	
		ORION OFFICE REIT INC	7,881	131,218.65	
		PARAMOUNT GROUP INC	25,119	224,061.48	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	35,773	666,450.99	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,310	465,099.00	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	8,013.31	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,825	88,535.50	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	33,270	571,245.90	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,233	322,345.08	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,087	141,164.25	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,959	33,733.98	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,897	175,234.43	
		PRIME US REIT	91,700	75,652.50	
		PROLOGIS INC	112,353	16,329,385.02	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,098	490,723.20	
		PUBLIC STORAGE	23,187	8,246,224.68	
		REALTY INCOME CORP	85,931	5,747,924.59	
		REGENCY CENTERS CORP	23,384	1,523,701.44	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,142	324,378.96	
		RETAIL VALUE INC	2,135	6,618.50	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,979	1,605,312.94	
		RLJ LODGING TRUST	25,353	366,350.85	
		RPT REALTY	12,721	156,595.51	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,332	724,050.80	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,191	450,444.80	
		SAFEHOLD INC	2,155	134,752.15	
		SAUL CENTERS INC	2,026	93,398.60	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,971	44,739.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	25,323	209,167.98	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	49,926	6,984,647.40	
		SITE CENTERS CORP	27,707	418,375.70	
		SL GREEN REALTY CORP	10,242	789,555.78	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,898	860,992.88	

		STAG INDUSTRIAL INC	26,776	1,074,520.88	
		STORE CAPITAL CORP	37,204	1,117,608.16	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,489	160,437.97	
		SUN COMMUNITIES INC	17,688	3,346,923.36	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,352	379,545.76	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,831	259,786.71	
		TERRENO REALTY CORP	11,465	798,422.60	
		UDR INC	44,352	2,422,062.72	
		UMH PROPERTIES INC	6,767	154,355.27	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,860	104,364.60	
		URBAN EDGE PROPERTIES	16,468	285,225.76	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,380	82,694.40	
		VENTAS INC	60,592	3,033,235.52	
		VERIS RESIDENTIAL INC	12,245	207,185.40	
		VICI PROPERTIES INC	95,967	2,702,430.72	
		VORNADO REALTY TRUST	24,075	980,815.50	
		WASHINGTON REIT	12,665	296,994.25	
		WELLTOWER INC	66,097	5,265,947.99	
		WHITESTONE REIT	6,335	71,142.05	
		WP CAREY INC	28,243	2,141,384.26	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,080	310,514.40	
	米ドル 小計		3,859,758	176,532,943.76 (20,375,432,368)	
カナダドル		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,579	402,988.53	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,169	115,712.78	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	50,120.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,608	196,816.40	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	23,335.04	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,790	709,717.10	
		CHOICE PROPERTIES REIT	23,926	342,141.80	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,741	160,220.06	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,887	118,249.79	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,649	130,185.98	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,317	274,647.62	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	94,798.44	

		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	30,166.50	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,666	294,321.56	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,963	463,147.16	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,951	267,544.27	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	25,608.01	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	164,509.40	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	170,822.40	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	64,485.96	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	45,219.62	
		NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,635	32,621.30	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	16,650	222,277.50	
		PLAZA RETAIL REIT	10,000	47,600.00	
		PRIMARIS REIT	5,227	72,393.95	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,368	554,288.96	
		SLATE GROCERY REIT	4,386	66,491.76	
		SLATE OFFICE REIT	4,169	21,053.45	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,042	337,112.26	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,422	291,928.50	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	39,271.80	
		カナダドル 小計	289,925	5,829,797.90 (528,646,073)	
ユーロ	AEDIFICA		5,499	531,203.40	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG		2,209	36,470.59	
	ALTAREA		684	102,873.60	
	BEFIMMO		3,898	125,515.60	
	CARE PROPERTY INVEST		3,794	85,365.00	
	CARMILA		6,580	96,989.20	
	COFINIMMO		4,458	507,766.20	
	COIMA RES SPA		3,638	28,376.40	
	COVIVIO		7,141	517,008.40	
	CROMWELL REIT EUR		43,440	101,649.60	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		5,881	130,822.84	
	GECINA SA		8,239	917,000.70	
	HAMBORNER REIT AG		10,215	99,238.72	
	HIBERNIA REIT PLC		107,669	130,494.82	

		ICADE	4,972	288,376.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	28,985.67	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	41,362	309,594.57	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,446	88,906.80	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	63,839	98,695.09	
		KLEPIERRE	29,761	704,145.26	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,012	51,762.04	
		MERCIALYS	7,777	71,859.48	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,533	507,351.32	
		MONTEA NV	1,535	161,175.00	
		NSI NV	2,616	92,475.60	
		RETAIL ESTATES	1,787	121,694.70	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,667	1,209,482.82	
		VASTNED RETAIL NV	2,828	75,083.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,262	730,987.56	
		WERELDHAVE NV	6,589	105,160.44	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	3,006	143,085.60	
	ユーロ 小計		489,288	8,199,596.42 (1,070,539,308)	
英ポンド		AEW UK REIT PLC	20,000	23,200.00	
		ASSURA PLC	441,362	273,865.12	
		BIG YELLOW GROUP PLC	25,960	371,228.00	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	125,514	140,324.65	
		BRITISH LAND CO PLC	143,604	773,163.93	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	130,732	222,113.66	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	83,454.73	
		CUSTODIAN REIT PLC	60,787	64,069.49	
		DERWENT LONDON PLC	17,212	550,611.88	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	87,550	77,744.40	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	38,050	270,345.25	
		HAMMERSON PLC	652,218	243,016.42	
		HOME REIT PLC	87,702	98,664.75	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,490	63,369.58	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	114,938	906,630.94	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	140,203	365,369.01	

		LXI REIT PLC	108,442	152,686.33	
		NEWRIVER REIT PLC	48,868	44,323.27	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	79,142	80,883.12	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205,608	274,692.28	
		PRS REIT PLC/THE	86,720	88,020.80	
		REGIONAL REIT LTD	63,471	56,489.19	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,652	400,397.80	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	86,166	47,735.96	
		SEGRO PLC	182,495	2,253,813.25	
		SHAFTESBURY PLC	43,170	255,566.40	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	56,875	45,670.62	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	148,459	175,181.62	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	54,174.56	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	282,592	643,179.39	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	135,613	109,575.30	
		UNITE GROUP PLC	60,426	598,459.10	
		WORKSPACE GROUP PLC	19,933	152,387.78	
	英ポンド 小計		4,050,131	9,960,408.58 (1,556,214,236)	
オーストラリアドル		ABACUS PROPERTY GROUP	60,535	212,477.85	
		ARENA REIT	52,273	249,864.94	
		AVENTUS GROUP	60,193	195,025.32	
		BWP TRUST	74,391	290,868.81	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,812	309,716.88	
		CENTURIA OFFICE REIT	63,819	138,487.23	
		CHARTER HALL GROUP	70,569	1,104,404.85	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	90,932	443,748.16	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	81,252	329,883.12	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	48,631	185,284.11	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	221,920	193,070.40	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	32,499	103,021.83	
		DEXUS/AU	163,223	1,658,345.68	
		GDI PROPERTY GROUP	66,335	68,988.40	
		GOODMAN GROUP	259,257	5,916,244.74	
		GPT GROUP	290,936	1,472,136.16	

	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	47,137	190,433.48	
	HOME CONSORTIUM LTD	29,343	181,926.60	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	81,478	109,587.91	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	29,868	106,628.76	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	54,932	299,928.72	
	IRONGATE GROUP	80,328	148,606.80	
	MIRVAC GROUP	598,808	1,491,031.92	
	NATIONAL STORAGE REIT	162,171	390,832.11	
	RURAL FUNDS GROUP	61,194	179,298.42	
	SCENTRE GROUP	793,535	2,340,928.25	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,439	476,015.54	
	STOCKLAND	362,562	1,421,243.04	
	VICINITY CENTRES	594,920	1,011,364.00	
	WAYPOINT REIT	111,621	303,609.12	
オーストラリアドル 小計		4,893,913	21,523,003.15 (1,771,558,389)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	134,637	189,838.17	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	159,358	396,004.63	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	244,365	270,023.32	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	201,503	319,382.25	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,632	190,384.48	
ニュージーランドドル 小計		800,495	1,365,632.85 (104,375,318)	
香港ドル	CHAMPION REIT	276,000	1,104,000.00	
	FORTUNE REIT	219,000	1,767,330.00	
	LINK REIT	319,100	21,220,150.00	
	PROSPERITY REIT	198,000	595,980.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	141,000	602,070.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	350,000	1,148,000.00	
香港ドル 小計		1,503,100	26,437,530.00 (391,011,068)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	70,900	97,133.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	207,400	167,994.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	513,700	1,453,771.00	
	ASCOTT TRUST	301,896	304,914.96	
	CAPITALAND CHINA TRUST	167,700	199,563.00	

		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	763,732	1,565,650.60	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,100	130,036.00	
		EC WORLD REIT	50,000	38,000.00	
		ESR REIT	428,400	184,212.00	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	91,314.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	51,863.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	161,900	365,894.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	448,779	628,290.60	
		IREIT GLOBAL	95,000	61,750.00	
		KEPPEL DC REIT	199,900	431,784.00	
		KEPPEL REIT	296,500	335,045.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	114,757.50	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	330,100	597,481.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	292,600	731,500.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	450,600	779,538.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	330,500	360,245.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	156,145.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57,300	261,288.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	85,600	70,620.00	
		SPH REIT	153,000	146,880.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	211,700	127,020.00	
		SUNTEC REIT	329,700	527,520.00	
	シンガポールドル 小計		6,893,007	9,980,209.66 (855,204,165)	
韓国ウォン		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,100	128,077,000.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	23,280,000.00	
		JR REIT XXVII	18,000	95,220,000.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	27,587,430.00	
		LOTTE REIT CO LTD	20,693	111,121,410.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	46,207,270.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	40,513,120.00	
	韓国ウォン 小計		83,117	472,006,230.00 (45,501,400)	
イスラエルシュケル		REIT 1 LTD	27,424	600,311.36	
	イスラエルシュケル 小計		27,424	600,311.36 (21,282,658)	

合計		26,719,764,983 (26,719,764,983)	

(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	154銘柄	—	99.7%	75.9%
カナダドル	投資証券	31銘柄	—	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券	31銘柄	—	100.0%	4.0%
英ポンド	投資証券	34銘柄	—	100.0%	5.8%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.3%	—	0.1%
	投資証券	30銘柄	—	98.7%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	—	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	—	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券	27銘柄	—	100.0%	3.2%
韓国ウォン	投資証券	7銘柄	—	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	1銘柄	—	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 2月28日現在です。

【りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	13,779,746,087円
Ⅱ　負債総額	1,420,547,230円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,359,198,857円
Ⅳ　発行済口数	11,934,770,543口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0356円

（参考）

RM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	124,927,214,492円
Ⅱ　負債総額	1,897,453,283円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	123,029,761,209円
Ⅳ　発行済口数	118,485,763,361口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0384円

RM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

Ⅰ　資産総額	288,716,370,036円
Ⅱ　負債総額	8,766,827,464円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	279,949,542,572円
Ⅳ　発行済口数	279,252,117,339口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0025円

RM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	66,793,673,504円
Ⅱ　負債総額	485,626,500円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	66,308,047,004円
Ⅳ　発行済口数	48,007,577,081口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3812円

ＲＭ先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	122,078,883,361円
Ⅱ　負債総額	1,990,021,539円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	120,088,861,822円
Ⅳ　発行済口数	61,283,118,876口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9596円

ＲＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	18,038,883,746円
Ⅱ　負債総額	365,309,226円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,673,574,520円
Ⅳ　発行済口数	11,179,115,459口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5809円

ＲＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	6,901,409,279円
Ⅱ　負債総額	131,923,844円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,769,485,435円
Ⅳ　発行済口数	6,216,764,738口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0889円

ＲＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	28,480,535,506円
Ⅱ　負債総額	144,134,883円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	28,336,400,623円
Ⅳ　発行済口数	20,521,677,875口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3808円

ＲＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	27,399,397,729円
Ⅱ　負債総額	270,958,944円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,128,438,785円
Ⅳ　発行済口数	19,004,528,117口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4275円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

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

（５）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2022年2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（2022年2月末現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。
取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。取締役会は、業務執行を分担して行う責任者を執行役員として選任することができます。また、取締役会は、取締役および執行役員の職務執行を監督します。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。
取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。
取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
経営会議は、経営に関する全般的重要事項および重要な業務執行案件を協議します。
監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

②　投資運用の意思決定機構

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2022年2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	111	1,229,374
単位型株式投資信託	8	84,340
合計	119	1,313,714

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	※２	760,759	1,255,082
未払費用		85,094	99,584
未払法人税等		192,367	269,609
未払消費税等		287,966	352,528
預り金		1,648	1,387
賞与引当金		96,675	224,862
流動負債計		1,735,890	2,459,343
負債合計		1,735,890	2,459,343
純資産の部			
株主資本			
資本金		1,000,000	1,000,000
資本剰余金			
資本準備金		490,000	490,000
資本剰余金計		490,000	490,000
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		1,778,051	4,548,350
利益剰余金計		1,778,051	4,548,350
株主資本計		3,268,051	6,038,350
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		△433	1,804
評価・換算差額等計		△433	1,804
純資産合計		3,267,617	6,040,155
負債・純資産合計		5,003,507	8,499,498

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	3,170,025	3,539,887
運用受託報酬	1,201,400	4,624,333
投資助言報酬	1,166,500	839,669

その他営業収益		―	261
営業収益計		5,537,925	9,004,153
営業費用			
支払手数料		1,050,201	1,166,440
広告宣伝費		63,238	37,315
調査費			
調査費		500,578	1,297,321
委託調査費		128,044	98,375
委託計算費		188,413	207,635
事務委託費		―	23,815
営業雑経費			
印刷費		68,686	75,269
協会費		5,690	9,101
販売促進費		5,255	3,264
その他		55,169	55,514
営業費用計		2,065,279	2,974,056
一般管理費			
給料			
役員報酬		82,651	110,648
給料・手当		490,014	1,104,231
賞与		3,982	143,217
賞与引当金繰入額		132,198	224,862
旅費交通費		13,634	4,372
租税公課		48,964	73,538
不動産賃借料		48,771	97,751
固定資産減価償却費		16,096	21,729
諸経費		119,502	256,552
一般管理費計		955,815	2,036,904
営業利益		2,516,831	3,993,191
営業外収益			
受取配当金		23	189
投資有価証券売却益		73	―
雑収入		46	1,694
営業外収益計		142	1,883
営業外費用			
投資有価証券売却損		―	277
雑損失		13	273
営業外費用計		13	550
経常利益		2,516,960	3,994,525
税引前当期純利益		2,516,960	3,994,525
法人税、住民税及び事業税	※1	769,705	1,281,563
法人税等調整額		△38,032	△57,337
法人税等計		731,672	1,224,226
当期純利益		1,785,287	2,770,298

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年４月１日　　至　2020年３月31日）

（単位：千円）

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

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

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

2016年４月１日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。
その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。
なお、主な耐用年数は次のとおりであります。
建物　　８～15年
器具備品　３～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

賞与引当金

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

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用

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

(３) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

（未適用の会計基準等）

１．収益認識に関する会計基準等

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

（１）概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し、認識されます。
ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（２）適用予定日

2022年３月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響
当財務諸表に与える影響はありません。

２．時価の算定に関する会計基準等

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

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

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

（２）適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響
当財務諸表に与える影響はありません。

注記事項
（貸借対照表関係）
※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社に対する資産及び負債

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

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（損益計算書関係）
※１　関係会社に対する主な取引

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

（株主資本等変動計算書関係）
前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2020年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2021年３月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
預金	4,261,664	4,261,664	－
未収委託者報酬	768,778	768,778	－
未収運用受託報酬	2,597,734	2,597,734	－

未収投資助言報酬	437,046	437,046	－
資産計	8,065,223	8,065,223	－
未払手数料	256,287	256,287	－
その他未払金	1,255,082	1,255,082	－
負債計	1,511,370	1,511,370	－

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

負債

未払手数料、その他未払金

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(＊１) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2020年３月31日）

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

※税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度（2021年３月31日）

該当事項はありません。

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

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

法定実効税率　30.61%

（調整）

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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

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

（セグメント情報等）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）製品及びサービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、

記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．関連当事者との取引

（１）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（２）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（注２）投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
（注３）投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。
（注４）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

２．親会社に関する注記
親会社情報
株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）
１．関連当事者との取引
（１）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（２）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等
（注１）投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
（注２）投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
（注３）投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。
（注４）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

２．親会社に関する注記
親会社情報
株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

(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。

①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。

②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。

③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

① 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。

② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が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）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運

用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

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

５【その他】

（１）定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

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

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額　：51,000百万円（2021年3月末現在）

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

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

（２）販売会社

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

（３）保証会社

名　　称	資本金の額 （2021年3月末現在）	事業の内容

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

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（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）保証会社
基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 5月14日	有価証券報告書
2021年11月15日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人トーマツ
東　京　事　務　所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年4月5日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　山　田　　信　之　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３の2021年2月16日から2022年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３の2022年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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