

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月25日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCりそな グローバルバランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCりそな グローバルバランス（以下「ファンド」といいます。）

当ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人または事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。ファンドの取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいてファンドの取得申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2022年10月26日から2023年4月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（ 1 2 ） 【 その他 】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

おります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産(投資信託証券（資産複合（株式、債券、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のないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

4. 独立した区分

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

< 補足として使用する商品分類 >

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

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

(2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

う。

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

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

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

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RM国内債券マザーファンド 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	RM先進国債券マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)	RM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダ イバーシファイド(円換算ベース)
	株式	RM国内株式マザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)	RM先進国株式マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式および ETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、 円換算ベース)	RM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIエマージング・マーケット指数 (配当込み、円換算ベース)
	リート	RM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資 信託証券、不動産関連株式および ETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、 配当込み、円換算ベース)	—

2 中長期的な運用に適したポートフォリオ構築を目指します。

ポートフォリオの構築プロセス

(1) 原則年1回程度、独自の定量モデルを用いて「基本的資産配分比率」を決定します。

- 定量モデルを用いたポートフォリオの評価に従い、信託財産の着実な成長が期待でき、かつ運用期間中における信託財産の大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる投資比率を、「基本的資産配分比率」とします。

基本的資産配分比率の決定プロセス図

各資産のリターン・リスクに関する情報、および定量的なポートフォリオ価値の計算に必要な各種要素の条件設定等を行います。

さまざまな市場環境の変化が起こりうるとの想定のもと、各資産の価格変動についてのデータシナリオを多数生成します。

生成したシナリオ毎にポートフォリオ価値を計算した結果を通じ、ポートフォリオの着実な成長が期待でき、かつ運用期間中におけるポートフォリオの大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる資産配分比率を選択します。

(2) 「基本的資産配分比率」をポートフォリオ構築の主体としつつ、適時、市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)を行います。

- 投資環境やマクロ経済の状況に関する定点観測、および市場テーマ・金融政策の動向などに関する分析(定性判断)を行います。
- 相対的な魅力度が高いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや高め、また相対的な魅力度が低いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや低めに調整します。

市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)プロセス図 [適時]

<定点観測>

- 投資環境の分析(主に定量分析)
- 主要国・地域のマクロ分析

<定性判断>

- 政策(特に金融政策を重視)
- イベント(選挙、政治、地政学リスク等)
- 市場のテーマ
- 長期サイクル転換点の判断

- 市場見通しの策定
- 資産配分の見直し

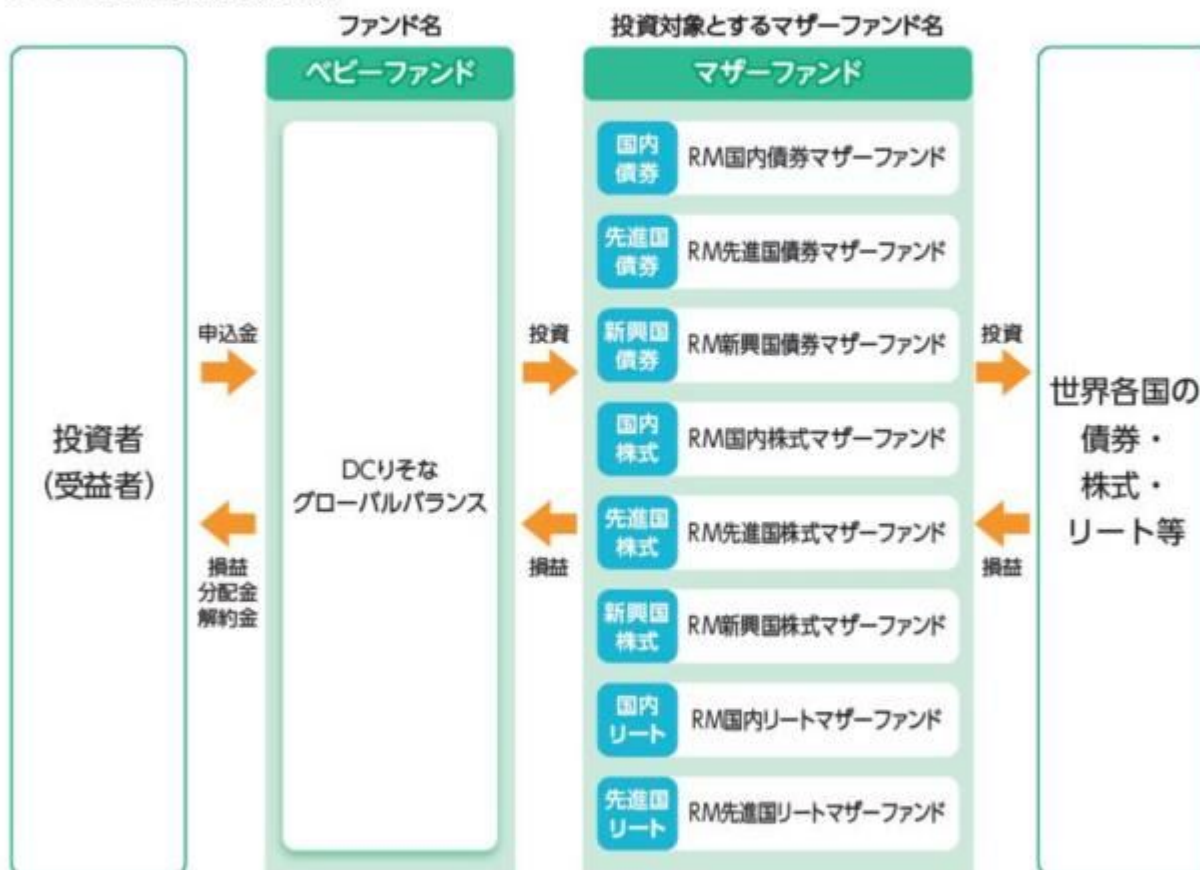
(3) 各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記(1)による独自の定量モデルを用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、(2)の市況動向に応じた資産配分の見直し(調整)を適時行い決定します。

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売却益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
- ③留保額は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM国内債券マザーファンド

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

●RM先進国債券マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内株式マザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

信託金限度額

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

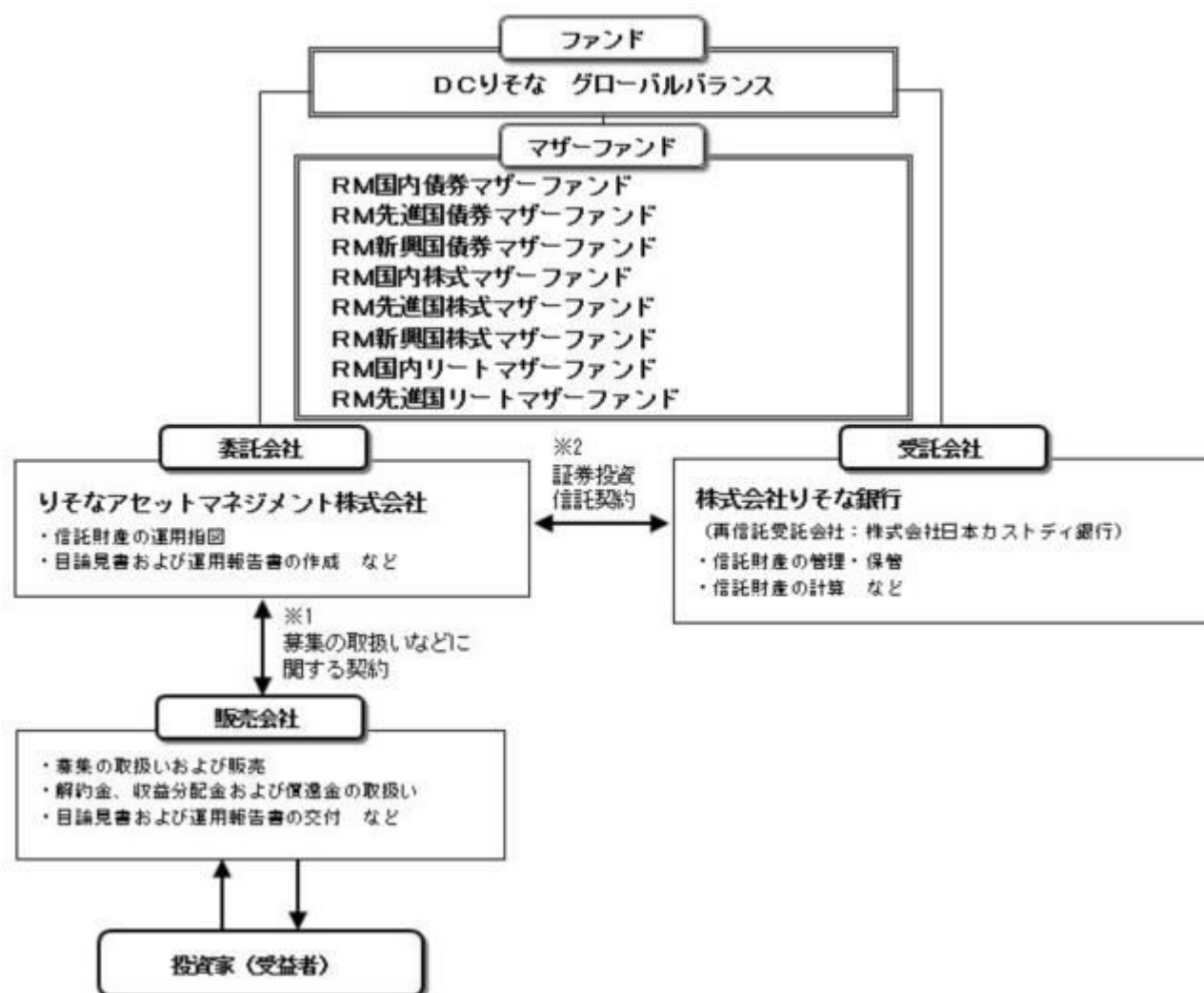
(2)【ファンドの沿革】

2016年5月12日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2022年7月末現在）

- 資本金
1,000百万円
- 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
- 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】

以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

- R M国内債券マザーファンド受益証券
- R M先進国債券マザーファンド受益証券
- R M新興国債券マザーファンド受益証券
- R M国内株式マザーファンド受益証券
- R M先進国株式マザーファンド受益証券
- R M新興国株式マザーファンド受益証券
- R M国内リートマザーファンド受益証券
- R M先進国リートマザーファンド受益証券

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行います。

中長期的な運用に適したポートフォリオ構築にあたり、以下の2つの手法を組み合わせます。

1. 原則年1回程度、独自の定量モデルを用いて「基本的資産配分比率」を決定します。すなわち、定量モデルを用いたポートフォリオの評価に従い、信託財産の着実な成長が期待でき、かつ運用期間中における信託財産の大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる投資比率を、「基本的資産配分比率」とします。
2. また、「基本的資産配分比率」をポートフォリオ構築の主体としつつ、適時、市場動向に応じた資産配分の見直し（調整）を行います。具体的には、投資環境やマクロ経済の状況に関する定点観測、および市場テーマ・金融政策の動向などに関する分析を行い、相対的な魅力度が高いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや高め、また相対的な魅力度が低いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや低めに調整します。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記 1. による独自の定量モデルを用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、上記 2. の市況動向に応じた資産配分の見直し（調整）を適時行い決定します。

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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。

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 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せん。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド >

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

< R M先進国債券マザーファンド >

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

受託会社	株式会社りそな銀行
------	-----------

< R M新興国債券マザーファンド >

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

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

< R M国内株式マザーファンド >

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

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

< R M先進国株式マザーファンド >

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

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

< R M新興国株式マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

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

< R M先進国リートマザーファンド >

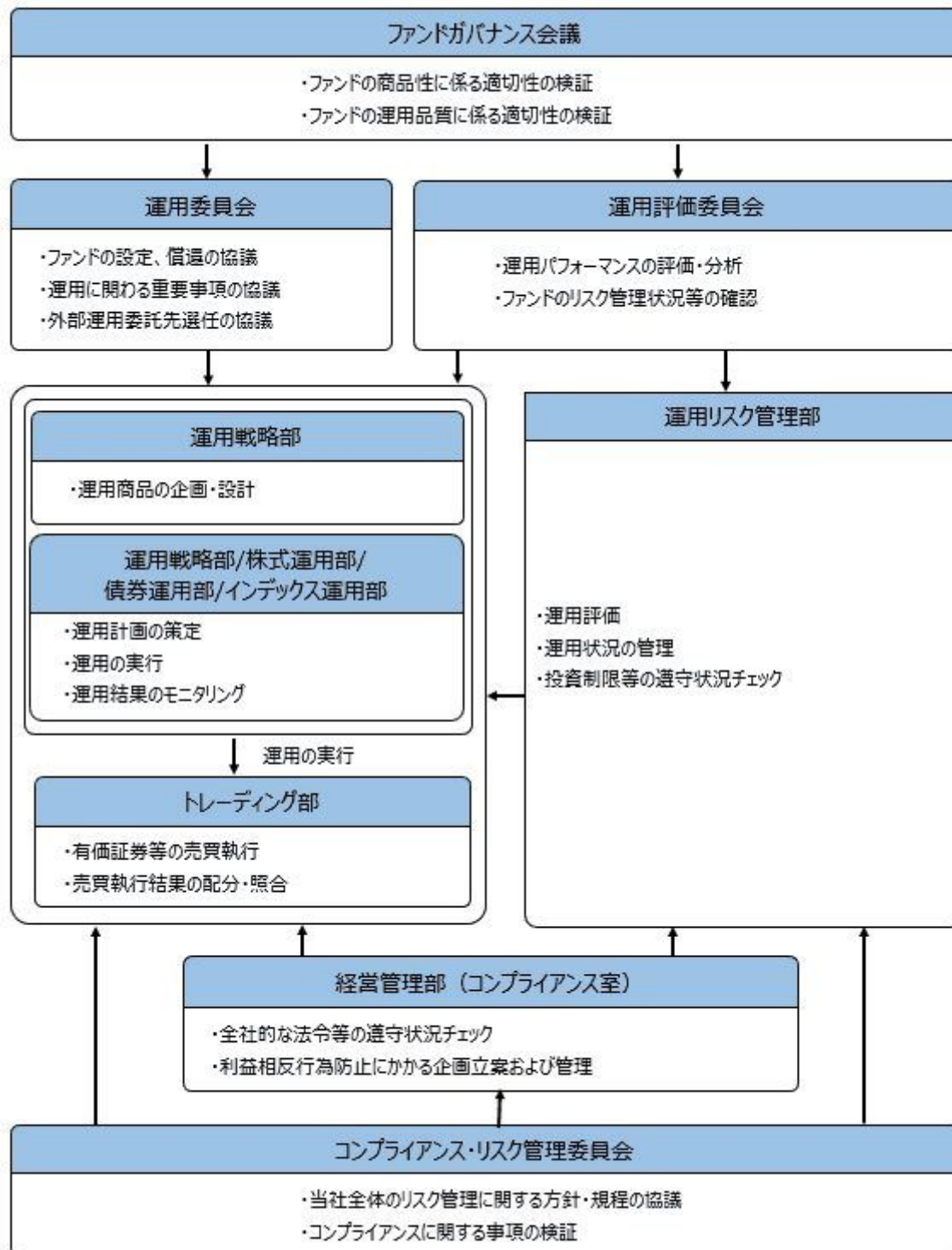
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



ファンドガバナンス会議は3名程度、運用委員会は5名程度、運用評価委員会は6名程度、コンプライアンス・リスク管理委員会は3名程度で構成されています。

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2022年7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

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

八) 有償増資により取得する株券

二) 売出しにより取得する株券

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

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

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

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

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

13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

17) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・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。

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

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

（２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。

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

上記体制は2022年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2017年8月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2017年8月から2022年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.0	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△2.9	△16.0	△12.4	△19.4	△3.5	△4.5	△9.4
平均値	1.9	8.7	16.5	10.5	0.1	3.6	2.7

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2017年8月から2022年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
* 決算日に対応した数値とは異なります。
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数 (TOPIX, 配当込み)

東証株価指数 (TOPIX, 配当込み) は、日本の株式市場を広く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、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込み, 円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み, 円ベース)

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

NOMJURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス (除く日本, 円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.66%（税抜0.60%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.28%	0.28%	0.04%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

上場投資信託証券、上場不動産投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、これら費用を表示

することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

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

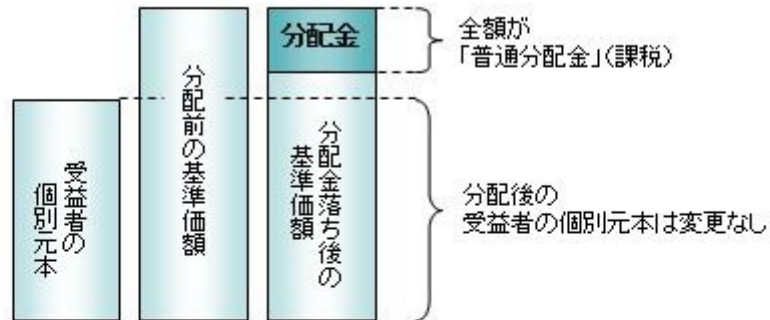
ロ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、収益分配金から

元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

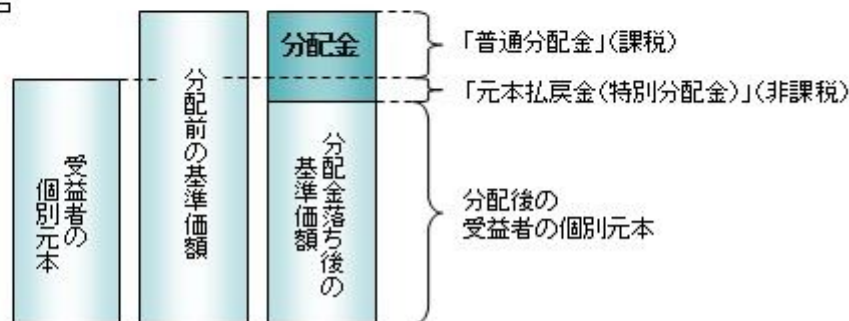
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ) 、ハ) の場合



上記は2022年7月末現在のものですので、税法または確定拠出年金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】

【DCりそな グローバルバランス】

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,209,646,626	99.64
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		4,420,759	0.36
合計(純資産総額)		1,214,067,385	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	784,382,470	1.0433	818,415,020	1.0286	806,815,808	66.46
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式マザーファンド	67,088,437	2.0244	135,819,743	2.1019	141,013,185	11.61
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	78,166,819	1.0912	85,295,761	1.1354	88,750,606	7.31
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	36,662,718	1.3907	50,988,136	1.4393	52,768,650	4.35
日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	23,540,607	1.4360	33,805,830	1.5496	36,478,524	3.00
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	24,155,008	1.4636	35,354,316	1.5062	36,382,273	3.00
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	21,660,667	1.0763	23,314,937	1.0965	23,750,921	1.96
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	14,827,330	1.6131	23,918,023	1.5975	23,686,659	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.64
合計	99.64

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 1月25日)	44	44	1.0004	1.0004
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	117	117	1.0382	1.0382
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	273	273	1.0147	1.0147
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	529	529	1.0590	1.0590
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	740	740	1.0648	1.0648
第6計算期間末 (2022年 1月25日)	970	970	1.0907	1.0907
2021年 7月末日	910		1.0978	
8月末日	934		1.1022	
9月末日	952		1.1019	

10月末日	967		1.1104
11月末日	972		1.1027
12月末日	986		1.1116
2022年 1月末日	981		1.0900
2月末日	972		1.0823
3月末日	1,032		1.1012
4月末日	1,053		1.0928
5月末日	1,104		1.0925
6月末日	1,182		1.0854
7月末日	1,214		1.0997

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.0000
当中間期	2022年 1月26日～2022年 7月25日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.04
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.78
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	2.26
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4.37
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.55
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	2.43
当中間期	2022年 1月26日～2022年 7月25日	0.50

(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	2016年 5月12日～2017年 1月25日	47,045,838	2,987,019

第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	94,737,024	26,010,237
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	234,142,892	77,862,922
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	314,458,168	83,848,056
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	295,744,267	99,995,699
第6期	2021年 1月26日～2022年 1月25日	331,098,576	137,007,666
当中間期	2022年 1月26日～2022年 7月25日	264,903,970	64,135,836

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

R M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	120,298,441,090	84.84
地方債証券	日本	6,848,724,780	4.83
特殊債券	日本	7,623,247,217	5.38
社債券	日本	5,566,635,000	3.93
	フランス	200,244,000	0.14
	小計	5,766,879,000	4.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,250,572,564	0.88
合計(純資産総額)		141,787,864,651	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143回利付国債(5年)	2,580,000,000	100.47	2,592,270,700	100.51	2,593,261,200	0.100	2025/3/20	1.83
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	2,480,000,000	100.21	2,485,446,200	100.32	2,488,109,600	0.005	2026/3/20	1.75
日本	国債証券	第437回利付国債(2年)	2,070,000,000	100.16	2,073,313,400	100.20	2,074,181,400	0.005	2024/6/1	1.46
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	2,030,000,000	100.01	2,030,213,100	100.28	2,035,785,500	0.005	2026/12/20	1.44
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	100.34	1,986,791,400	0.100	2024/3/20	1.40
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	1,930,000,000	100.39	1,937,707,200	100.37	1,937,276,100	0.100	2024/6/20	1.37

日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	1,820,000,000	100.51	1,829,306,800	100.61	1,831,229,400	0.100	2027/9/20	1.29
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	1,690,000,000	99.69	1,684,890,600	100.18	1,693,194,100	0.100	2030/3/20	1.19
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	1,670,000,000	99.61	1,663,640,800	99.91	1,668,597,200	0.100	2030/12/20	1.18
日本	国債証券	第366回日本国債（10年）	1,510,000,000	99.81	1,507,241,100	100.76	1,521,491,100	0.200	2032/3/20	1.07
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	100.31	1,494,753,100	0.100	2023/12/20	1.05
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	1,470,000,000	100.59	1,478,814,800	100.64	1,479,481,500	0.100	2025/12/20	1.04
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	1,420,000,000	100.51	1,427,357,400	100.56	1,428,008,800	0.100	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	1,360,000,000	100.47	1,366,397,400	100.46	1,366,337,600	0.100	2024/12/20	0.96
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	100.69	1,319,117,600	0.100	2027/3/20	0.93
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	1,270,000,000	100.09	1,271,213,200	100.52	1,276,718,300	0.100	2029/3/20	0.90
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	1,270,000,000	98.92	1,256,284,000	99.62	1,265,288,300	0.100	2031/12/20	0.89
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	1,190,000,000	100.57	1,196,809,000	100.61	1,197,294,700	0.100	2025/9/20	0.84
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	1,180,000,000	100.58	1,186,908,600	100.61	1,187,304,200	0.100	2028/3/20	0.84
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	99.73	1,176,884,800	0.100	2031/6/20	0.83
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	100.42	1,175,007,600	0.100	2024/9/20	0.83
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	1,160,000,000	100.44	1,165,167,600	100.42	1,164,953,200	0.100	2029/9/20	0.82
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	1,120,000,000	100.47	1,125,283,500	100.54	1,126,070,400	0.100	2028/12/20	0.79
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	1,120,000,000	100.51	1,125,735,600	100.25	1,122,878,400	0.100	2029/12/20	0.79
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	1,090,000,000	100.23	1,092,588,700	100.07	1,090,850,200	0.100	2030/6/20	0.77
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	100.70	1,077,522,100	0.100	2026/12/20	0.76
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	100.28	1,073,038,800	0.100	2023/9/20	0.76
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	1,020,000,000	100.24	1,022,450,600	100.33	1,023,376,200	0.005	2026/6/20	0.72
日本	国債証券	第151回利付国債（20年）	915,000,000	110.51	1,011,238,300	109.96	1,006,134,000	1.200	2034/12/20	0.71
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	990,000,000	100.70	997,002,200	100.61	996,128,100	0.100	2027/12/20	0.70

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.84
地方債証券	4.83
特殊債券	5.38
社債券	4.07
合計	99.12

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	24,087,123,260	50.26
	カナダ	995,478,795	2.08
	メキシコ	362,276,449	0.76
	ドイツ	3,119,400,387	6.51
	イタリア	3,701,174,424	7.72
	フランス	4,211,327,759	8.79
	オランダ	823,001,483	1.72
	スペイン	2,510,651,630	5.24
	ベルギー	937,812,471	1.96
	オーストリア	615,808,956	1.28
	フィンランド	264,319,102	0.55
	アイルランド	320,372,540	0.67
	イギリス	2,412,744,475	5.03
	スウェーデン	125,865,341	0.26
	ノルウェー	102,383,715	0.21
	デンマーク	184,146,644	0.38
	ポーランド	196,005,119	0.41
	オーストラリア	733,375,865	1.53
	シンガポール	205,621,817	0.43
	マレーシア	250,970,005	0.52
中国	1,069,086,144	2.23	
イスラエル	191,652,191	0.40	
	小計	47,420,598,572	98.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		502,408,849	1.05
合計（純資産総額）		47,923,007,421	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		27,011,127	0.06

(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	2,070,000	13,332.67	275,986,452	12,378.59	256,236,984	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,110,000	12,904.68	272,288,768	11,940.85	251,952,004	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	13,006.88	266,641,197	12,029.71	246,609,180	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	12,553.95	263,633,134	11,699.76	245,695,046	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	12,457.60	239,185,962	12,552.38	241,005,746	1.875	2032/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	13,361.25	227,141,318	13,054.27	221,922,713	0.750	2023/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	12,808.45	220,305,451	11,909.04	204,835,504	1.125	2031/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,560,000	13,338.48	208,080,340	13,117.18	204,628,036	0.125	2023/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	13,777.54	212,174,169	13,286.42	204,610,974	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	13,296.41	210,083,400	12,830.27	202,718,394	0.750	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,520,000	13,010.01	197,752,245	12,795.31	194,488,718	1.875	2029/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,258.03	198,870,485	12,954.10	194,311,628	0.125	2023/12/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	13,132.36	203,551,607	12,374.12	191,799,003	1.250	2028/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	13,217.12	191,648,354	12,763.49	185,070,722	1.500	2027/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,480,000	12,325.30	182,414,495	12,403.57	183,572,912	1.250	2028/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,410,000	13,468.88	189,911,302	12,805.82	180,562,168	1.500	2026/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	12,821.97	184,636,504	12,411.98	178,732,631	1.375	2028/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,380,000	12,955.00	178,779,112	12,474.56	172,148,933	0.750	2026/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,886.38	180,523,041	13,224.37	171,916,938	2.250	2025/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,229.63	175,954,199	12,896.79	171,527,363	0.125	2024/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,197.03	175,520,603	12,813.71	170,422,401	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	12,957.78	176,225,925	12,410.93	168,788,724	0.500	2026/2/28	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	12,351.51	176,626,719	11,533.07	164,923,032	0.625	2030/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	13,308.51	167,687,237	13,059.79	164,553,465	0.125	2023/8/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	12,909.41	170,404,262	12,375.18	163,352,382	0.375	2026/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	13,080.30	171,352,000	12,468.77	163,340,969	0.875	2026/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	14,329.65	200,615,161	11,643.23	163,005,341	2.375	2051/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	13,811.19	165,734,352	13,398.58	160,783,057	2.500	2023/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,390,000	12,315.46	171,185,018	11,484.17	159,630,075	0.625	2030/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,478.46	169,398,002	13,554.06	158,582,611	2.875	2028/8/15	0.33

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.95

合 計	98.95
-----	-------

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	90,400.00	12,317,904	12,166,122	0.03
	カナダドル	買建	29,000.00	3,079,945	3,046,421	0.01
	ユーロ	買建	75,700.00	10,507,841	10,389,605	0.02
	英ポンド	買建	8,600.00	1,423,669	1,408,979	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	2,038,049,599	22.36
	アイルランド	6,874,138,877	75.43
	小計	8,912,188,476	97.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		200,951,309	2.21
合計（純資産総額）		9,113,139,785	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	1,209,547	6,564.95	7,940,616,082	5,683.23	6,874,138,877	75.43
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	623,832	3,832.34	2,390,740,506	3,266.98	2,038,049,599	22.36

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	97.79
合 計	97.79

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	47,691,372,780	98.98
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		493,427,983	1.02
合計（純資産総額）		48,184,800,763	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	465,000,000	0.97

(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	876,200	2,213.45	1,939,425,615	2,137.00	1,872,439,400	3.89
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	120,400	12,232.16	1,472,752,444	11,695.00	1,408,078,000	2.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	17,400	55,705.00	969,267,171	52,430.00	912,282,000	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,109,600	700.07	776,797,872	745.40	827,095,840	1.72
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	211,400	3,546.20	749,668,500	3,807.00	804,799,800	1.67

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	131,600	5,149.23	677,639,291	4,953.00	651,814,800	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	10,800	56,028.83	605,111,364	59,710.00	644,868,000	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	113,100	5,135.91	580,872,432	5,605.00	633,925,500	1.32
日本	株式	日立製作所	電気機器	92,400	6,305.55	582,632,856	6,704.00	619,449,600	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	151,100	3,453.82	521,873,529	3,925.00	593,067,500	1.23
日本	株式	KDDI	情報・通信業	137,500	3,949.69	543,082,468	4,292.00	590,150,000	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	12,200	54,964.88	670,571,640	46,010.00	561,322,000	1.16
日本	株式	信越化学工業	化学	29,800	17,754.04	529,070,400	16,960.00	505,408,000	1.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	123,000	4,080.58	501,912,414	4,107.00	505,161,000	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	37,100	13,766.06	510,721,071	13,270.00	492,317,000	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	139,400	2,802.33	390,645,070	3,523.00	491,106,200	1.02
日本	株式	三菱商事	卸売業	124,100	3,967.07	492,313,933	3,948.00	489,946,800	1.02
日本	株式	ダイキン工業	機械	21,000	23,201.94	487,240,851	23,250.00	488,250,000	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	140,500	3,389.92	476,284,252	3,388.00	476,014,000	0.99
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	285,600	1,468.78	419,485,788	1,538.50	439,395,600	0.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	113,500	3,713.52	421,485,380	3,866.00	438,791,000	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	52,700	6,991.89	368,472,664	7,764.00	409,162,800	0.85
日本	株式	村田製作所	電気機器	52,400	8,360.46	438,088,538	7,747.00	405,942,800	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	137,200	2,915.15	399,958,726	2,925.50	401,378,600	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	19,500	18,820.88	367,007,298	20,150.00	392,925,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	42,700	9,860.21	421,031,384	9,198.00	392,754,600	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	16,900	22,273.98	376,430,404	22,825.00	385,742,500	0.80
日本	株式	S M C	機械	5,600	63,753.93	357,022,008	65,410.00	366,296,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	227,300	1,551.44	352,643,766	1,583.50	359,929,550	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	63,500	5,323.81	338,062,202	5,429.00	344,741,500	0.72

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	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	2.18
		食料品	3.34
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.16
		医薬品	5.29
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.77

	非鉄金属	0.70
	金属製品	0.61
	機械	5.26
	電気機器	17.51
	輸送用機器	7.78
	精密機器	2.76
	その他製品	2.47
	電気・ガス業	1.28
	陸運業	3.00
	海運業	0.68
	空運業	0.41
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	9.15
	卸売業	5.37
	小売業	4.32
	銀行業	5.26
	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	2.20
	その他金融業	1.17
	不動産業	1.98
	サービス業	5.50
合 計		98.98

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	24	日本円	468,613,200	465,000,000	0.97

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

R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	96,147,626,438	65.13

	カナダ	5,253,772,524	3.56
	パナマ	26,597,361	0.02
	ドイツ	2,981,547,628	2.02
	イタリア	631,759,782	0.43
	フランス	4,116,876,710	2.79
	オランダ	2,480,470,742	1.68
	スペイン	949,038,784	0.64
	ベルギー	317,176,246	0.21
	オーストリア	69,753,960	0.05
	ルクセンブルク	88,625,953	0.06
	フィンランド	486,702,999	0.33
	アイルランド	2,451,790,575	1.66
	ポルトガル	73,100,856	0.05
	イギリス	5,929,411,550	4.02
	スイス	4,597,652,590	3.11
	スウェーデン	1,320,188,532	0.89
	ノルウェー	329,495,968	0.22
	デンマーク	1,131,001,690	0.77
	ケイマン	299,720,786	0.20
	リベリア	25,904,669	0.02
	オーストラリア	2,954,035,814	2.00
	バミューダ	183,688,746	0.12
	ニュージーランド	95,778,154	0.06
	香港	930,539,824	0.63
	シンガポール	446,005,198	0.30
	イスラエル	310,497,320	0.21
	キュラソー	142,823,299	0.10
	ジャージー	511,627,224	0.35
	マン島	23,524,861	0.02
	小計	135,306,736,783	91.65
投資証券	アメリカ	3,075,311,736	2.08
	カナダ	15,528,600	0.01
	フランス	56,753,397	0.04
	ベルギー	12,038,573	0.01
	イギリス	74,218,890	0.05
	オーストラリア	187,641,777	0.13
	香港	51,620,299	0.03
	シンガポール	64,702,786	0.04
	小計	3,537,816,058	2.40
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		8,789,003,093	5.95
合計（純資産総額）		147,633,555,934	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	7,210,589,928	4.88
	買建	ドイツ	1,621,968,342	1.10

(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		169,020,208	0.11
	売建		28,259,973	0.02

(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	342,591	21,407.66	7,334,072,914	21,180.88	7,256,380,059	4.92
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	149,532	38,764.24	5,796,494,704	37,207.55	5,563,719,382	3.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	192,300	18,429.87	3,544,065,016	16,460.11	3,165,279,307	2.14
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	18,445	118,622.53	2,187,992,738	113,435.84	2,092,324,198	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	126,366	16,942.36	2,140,938,736	15,375.15	1,942,896,736	1.32
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	119,363	16,934.00	2,021,294,202	15,424.95	1,841,169,489	1.25
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	19,760	64,062.25	1,265,870,218	72,889.96	1,440,305,785	0.98
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	55,212	22,409.82	1,237,291,183	23,449.06	1,294,669,611	0.88
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	52,488	29,266.71	1,536,151,414	24,208.26	1,270,643,277	0.86
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,892	10,403.27	924,767,552	12,470.27	1,108,507,276	0.75
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	27,126	40,450.26	1,097,254,022	39,561.87	1,073,155,530	0.73
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	48,534	36,902.89	1,791,045,065	21,634.51	1,050,009,755	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	50,319	21,191.09	1,066,314,951	19,930.35	1,002,875,614	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	34,843	27,426.44	955,619,583	28,449.82	991,277,200	0.67

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	59,180	16,551.68	979,528,733	16,505.18	976,777,144	0.66
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	61,994	18,515.00	1,147,819,462	15,454.57	958,090,867	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	21,932	46,604.14	1,022,122,096	40,333.19	884,587,617	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	18,339	46,701.98	856,467,640	47,443.29	870,062,578	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	40,895	18,053.25	738,288,018	20,243.99	827,878,294	0.56
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	118,107	6,956.60	821,623,395	6,827.41	806,365,999	0.55
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,003	35,392.56	601,779,714	44,528.98	757,126,383	0.51
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	37,151	18,461.38	685,858,939	20,157.84	748,884,192	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	86,549	8,187.64	708,632,207	8,623.11	746,322,119	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	29,074	23,249.14	675,945,770	23,535.21	684,262,765	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	152,490	5,603.28	854,444,310	4,485.20	683,948,941	0.46
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	14,772	47,940.86	708,182,493	45,741.94	675,700,048	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	9,311	66,366.34	617,937,069	72,175.18	672,023,192	0.46
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,217	76,769.92	630,818,481	80,448.32	661,043,849	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	53,097	11,104.94	589,639,048	12,106.82	642,836,002	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	8,545	77,223.47	659,874,568	74,856.15	639,645,802	0.43

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	4.78
		素材	3.84
		資本財	5.64
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	2.18
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.67
		メディア・娯楽	5.34

	小売	4.56
	食品・生活必需品小売り	1.47
	食品・飲料・タバコ	4.08
	家庭用品・パーソナル用品	1.72
	ヘルスケア機器・サービス	4.61
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.53
	銀行	5.34
	各種金融	4.39
	保険	2.85
	不動産	0.34
	ソフトウェア・サービス	10.57
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.31
	電気通信サービス	1.44
	公益事業	3.07
	半導体・半導体製造装置	4.37
投資証券		2.40
合計		94.05

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	SP500MIN2209	買建	263	米ドル	52,227,637.5	7,030,362,284	53,566,525	7,210,589,928	4.88
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002209	買建	548	ユーロ	11,644,590	1,598,219,976	11,817,620	1,621,968,342	1.10

(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	600,000.00	80,736,600	80,736,960	0.05
	カナダドル	買建	170,000.00	18,054,850	17,858,330	0.01
	ユーロ	買建	70,000.00	9,716,623	9,607,227	0.01
	英ポンド	買建	150,000.00	24,830,565	24,573,975	0.02
	スイスフラン	買建	70,000.00	9,942,240	9,874,900	0.01
	デンマーククローネ	買建	250,000.00	4,662,050	4,610,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	140,000.00	13,327,860	13,185,116	0.01
	香港ドル	買建	500,000.00	8,679,750	8,573,700	0.01

米ドル	売建	210,000.00	28,612,521	28,259,973	0.02
-----	----	------------	------------	------------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	60,202,643	0.32
	メキシコ	336,168,848	1.78
	ブラジル	838,944,687	4.44
	チリ	91,664,418	0.48
	コロンビア	25,805,577	0.14
	ペルー	2,834,554	0.01
	オランダ	0	0.00
	ルクセンブルク	16,425,691	0.09
	ギリシャ	42,495,332	0.22
	トルコ	43,904,588	0.23
	チェコ	26,551,541	0.14
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	26,067,002	0.14
	ポーランド	93,852,388	0.50
	ロシア	0	0.00
	ケイマン	3,070,825,329	16.24
	バミューダ	97,964,575	0.52
	香港	202,880,520	1.07
	シンガポール	4,030,679	0.02
	マレーシア	245,102,359	1.30
	タイ	305,016,406	1.61
	フィリピン	120,567,142	0.64
	インドネシア	308,707,548	1.63
	韓国	1,953,157,344	10.33
	台湾	2,335,487,793	12.35
	中国	2,050,359,956	10.84
	インド	2,244,393,869	11.87
	カタール	179,711,213	0.95
	エジプト	8,092,996	0.04
	南アフリカ	568,208,679	3.00
ジャージー	0	0.00	
英ヴァージン諸島	0	0.00	

	アラブ首長国連邦	216,198,015	1.14
	クウェート	139,221,610	0.74
	サウジアラビア	737,353,204	3.90
	小計	16,392,196,506	86.68
投資証券	メキシコ	11,231,934	0.06
	南アフリカ	7,042,783	0.04
	小計	18,274,717	0.10
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,501,257,192	13.23
合計（純資産総額）		18,911,728,415	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	2,532,014,067	13.39

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

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		79,996,039	0.42
	売建		599,992	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	461,000	2,912.61	1,342,716,332	2,251.29	1,037,846,350	5.49
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	116,900	7,821.99	914,391,499	5,501.72	643,151,068	3.40
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	89,408	7,759.64	693,774,229	6,431.40	575,019,505	3.04
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	284,140	2,021.45	574,375,566	1,700.42	483,158,049	2.55
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	76,700	3,950.77	303,024,514	3,224.20	247,296,140	1.31
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	56,982	4,096.34	233,418,078	4,177.07	238,017,803	1.26
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	63,048	2,930.74	184,777,913	2,579.58	162,637,360	0.86
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	37,560	4,909.53	184,402,183	4,201.75	157,817,730	0.83
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,800,000	101.79	183,224,666	85.92	154,658,700	0.82
ブラジル	株式	VALE SA	素材	74,904	2,178.01	163,141,912	1,834.27	137,394,249	0.73
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	96,256	1,353.02	130,236,499	1,384.82	133,297,234	0.70

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,231	4,297.36	138,508,266	3,973.83	128,080,676	0.68
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	36,709	3,321.38	121,924,681	3,216.64	118,079,638	0.62
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	233,800	465.15	108,753,846	487.55	113,990,499	0.60
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	10,232	12,301.90	125,873,099	10,327.65	105,672,617	0.56
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	41,103	2,572.43	105,734,994	2,516.59	103,439,399	0.55
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	38,900	2,597.48	101,042,034	2,589.65	100,737,385	0.53
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	41,980	2,509.70	105,357,302	2,376.98	99,786,040	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	118,500	1,109.37	131,460,817	820.62	97,244,359	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	17,341	6,374.19	110,534,868	5,542.85	96,118,562	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	15,431	7,042.64	108,674,995	5,922.29	91,387,011	0.48
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,500	1,476.90	99,691,030	1,319.69	89,079,244	0.47
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	28,800	4,768.50	137,333,035	3,064.63	88,261,494	0.47
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,085	19,990.52	81,661,289	20,040.93	81,867,205	0.43
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	15,500	4,348.48	67,401,573	4,959.78	76,876,590	0.41
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,057,000	80.94	85,558,909	71.00	75,048,057	0.40
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	89,200	826.32	73,708,048	837.86	74,737,482	0.40
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,488,000	52.07	77,489,687	48.02	71,453,760	0.38
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,039,900	70.95	73,789,557	66.88	69,553,711	0.37
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	15,444	3,887.80	60,043,246	4,454.16	68,790,201	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	4.36
		素材	7.25
		資本財	3.08
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	3.37
		耐久消費財・アパレル	1.36
		消費者サービス	0.98

	メディア・娯楽	6.04
	小売	6.59
	食品・生活必需品小売り	1.09
	食品・飲料・タバコ	3.51
	家庭用品・パーソナル用品	0.80
	ヘルスケア機器・サービス	0.84
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.69
	銀行	14.11
	各種金融	2.21
	保険	2.23
	不動産	1.60
	ソフトウェア・サービス	2.28
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.08
	電気通信サービス	2.76
	公益事業	2.60
	半導体・半導体製造装置	7.91
投資証券		0.10
合計		86.77

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 2209	買建	375	米ドル	18,723,405	2,520,357,544	18,810,000	2,532,014,067	13.39

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

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	594,452.12	80,682,125	79,996,039	0.42
	チリペソ	売建	104,104.00	15,544	15,374	0.00
	オフショア人民元	売建	12,986.46	262,037	258,890	0.00
	サウジアラビアリアル	売建	9,073.21	329,811	325,728	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	30,897,428,300	98.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		402,104,206	1.28
合計（純資産総額）		31,299,532,506	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	359,790,000	1.15

(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	3,209	660,458.02	2,119,409,786	706,000	2,265,554,000	7.24
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,751	617,651.92	1,699,160,431	643,000	1,768,893,000	5.65
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,508	349,311.42	1,574,695,881	346,000	1,559,768,000	4.98
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,880	95,690.78	1,328,188,026	108,400	1,504,592,000	4.81
日本	投資証券	G L P 投資法人	8,471	179,189.08	1,517,910,696	175,100	1,483,272,100	4.74
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,896	154,823.98	1,377,314,126	166,700	1,482,963,200	4.74
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,147	324,377.27	1,345,192,550	320,500	1,329,113,500	4.25
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,481	167,699.02	919,158,328	191,100	1,047,419,100	3.35
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,750	347,294.26	955,059,215	367,000	1,009,250,000	3.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,193	134,020.62	829,989,699	145,000	897,985,000	2.87
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,881	373,769.53	703,060,485	406,500	764,626,500	2.44
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	4,111	187,620.94	771,309,702	185,100	760,946,100	2.43
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,360	77,515.43	648,028,994	83,400	697,224,000	2.23
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	950	623,731.6	592,545,020	696,000	661,200,000	2.11
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,871	58,534.22	519,257,126	69,000	612,099,000	1.96
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,452	385,641.89	559,952,029	417,500	606,210,000	1.94
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,855	313,719.65	581,949,950	320,000	593,600,000	1.90
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,368	175,811.02	592,131,515	175,600	591,420,800	1.89
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	808	666,045.23	538,164,545	715,000	577,720,000	1.85
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	1,087	556,125.53	604,508,453	523,000	568,501,000	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,021	488,261.22	498,514,710	543,000	554,403,000	1.77
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,108	36,509.52	442,057,268	41,850	506,719,800	1.62

日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,235	144,002.79	465,849,025	153,000	494,955,000	1.58
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,045	146,033.18	444,671,033	156,100	475,324,500	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,722	110,903.06	412,781,189	125,800	468,227,600	1.50
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	1,973	204,320.51	403,124,366	223,700	441,360,100	1.41
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,280	316,243.5	404,791,680	336,500	430,720,000	1.38
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,574	161,781.96	416,426,774	166,700	429,085,800	1.37
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	849	454,526.78	385,893,237	477,500	405,397,500	1.30
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	2,644	145,862.96	385,661,666	152,500	403,210,000	1.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	98.72
合計	98.72

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
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	179	日本円	353,499,090	359,790,000	1.15

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

R M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29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	263,253,796	0.87
	オーストラリア	18,218,108	0.06
	小計	281,471,904	0.93
投資証券	アメリカ	23,004,478,908	76.19
	カナダ	545,110,631	1.81
	ドイツ	16,026,824	0.05
	イタリア	8,387,591	0.03
	フランス	465,968,932	1.54
	オランダ	52,478,908	0.17

	スペイン	113,138,978	0.37
	ベルギー	335,707,351	1.11
	アイルランド	13,044,547	0.04
	イギリス	1,513,373,439	5.01
	オーストラリア	1,885,425,723	6.24
	ニュージーランド	105,845,618	0.35
	香港	418,205,494	1.39
	シンガポール	1,090,466,685	3.61
	韓国	66,252,955	0.22
	イスラエル	35,496,919	0.12
	ガーンジー	76,365,213	0.25
	小計	29,745,774,716	98.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		164,873,762	0.55
合計（純資産総額）		30,192,120,382	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		37,678,404	0.12

(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	114,482	19,179.23	2,195,676,929	17,822.36	2,040,339,875	6.76
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,079	94,875.82	1,335,756,672	95,749.43	1,348,056,353	4.46
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,613	45,823.93	1,082,040,605	45,377.03	1,071,487,833	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	93,018	9,129.25	849,184,595	9,899.21	920,805,590	3.05
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	70,194	11,432.42	802,487,802	11,573.76	812,409,057	2.69
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	44,032	19,600.56	863,051,950	18,432.14	811,604,310	2.69
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,763	17,683.71	897,678,460	14,465.19	734,296,470	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	148,953	3,860.61	575,050,157	4,549.81	677,709,041	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,624	30,459.55	658,657,326	28,569.62	617,789,601	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	52,922	11,218.39	593,700,027	10,465.92	553,877,815	1.83
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,756	25,180.14	522,639,123	25,325.52	525,656,605	1.74
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,954	24,216.33	555,861,846	21,968.35	504,261,552	1.67
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	59,425	7,528.73	447,395,214	8,406.39	499,549,993	1.65
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	94,387	5,337.28	503,770,461	5,198.63	490,683,864	1.63
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	262,817	2,061.09	541,691,067	1,864.21	489,948,182	1.62
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	61,786	7,011.83	433,233,231	7,177.40	443,463,158	1.47

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,851	25,944.73	463,139,400	24,766.89	442,113,823	1.46
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,807	23,757.31	446,803,897	21,992.58	413,614,486	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,103	42,149.08	425,832,188	38,336.92	387,317,984	1.28
香港	投資証券	LINK REIT	326,600	1,167.74	381,385,028	1,117.32	364,917,529	1.21
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,809	10,482.08	312,460,343	11,418.96	340,387,966	1.13
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	185,760	1,964.68	364,959,217	1,737.73	322,801,709	1.07
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,472	20,194.19	332,638,734	19,024.43	313,370,432	1.04
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	83,384	4,331.74	361,198,625	3,700.42	308,556,563	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	46,282	7,106.06	328,882,757	6,496.27	300,660,766	1.00
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	44,943	6,212.25	279,197,219	6,461.27	290,389,307	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	95,476	3,063.72	292,512,075	2,942.57	280,945,253	0.93
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	22,024	14,672.49	323,146,920	12,125.66	267,055,730	0.88
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,363	2,300.48	253,888,415	2,410.86	266,070,305	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,750	10,048.63	268,801,026	9,823.83	262,787,661	0.87

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	0.93
投資証券			98.52
合計			99.45

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	245,000.00	33,255,337	32,969,920	0.11
	カナダドル	買建	20,000.00	2,100,876	2,100,826	0.01
	ユーロ	買建	19,000.00	2,607,468	2,607,658	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。

参考情報

運用実績

2022年7月29日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
2020年1月27日	0円
2021年1月25日	0円
2022年1月25日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内債券マザーファンド	66.5
RM先進国債券マザーファンド	7.3
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式マザーファンド	4.3
RM先進国株式マザーファンド	11.6
RM新興国株式マザーファンド	2.0
RM国内リートマザーファンド	3.0
RM先進国リートマザーファンド	3.0
現金等	0.4
合計	100.0

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

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第143回利付国債(5年)	2025/3/20	1.83
	日本	第147回利付国債(5年)	2026/3/20	1.75
	日本	第437回利付国債(2年)	2024/6/1	1.46
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.53
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/8/15	0.53
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/11/15	0.51
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	75.43
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	-	22.36
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	3.89
	日本	ソニーグループ	-	2.92
	日本	キーエンス	-	1.89
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	-	4.92
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	3.77
	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	2.14
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	5.49
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	3.40
	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	3.04
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	-	7.24
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	5.65
	日本	日本プロロジスリート投資法人	-	4.98
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	-	6.76
	アメリカ	EQUINIX INC	-	4.46
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	-	3.55

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
 ※2016年5月12日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は5月12日から12月末日までの騰落率です。2022年は7月末日までの騰落率です。
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会等に限るものとします。
- ・当ファンドは、収益分配金を無手数料で自動的にファンドに再投資する〈分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）〉専用です。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 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。

(4) 取得申込不可日

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

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

(5) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(6) 申込単位

1円以上1円単位

(7) 申込代金の支払い

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

(8) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

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

(4) 解約制限

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

(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、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(7) 解約単位

1口単位

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

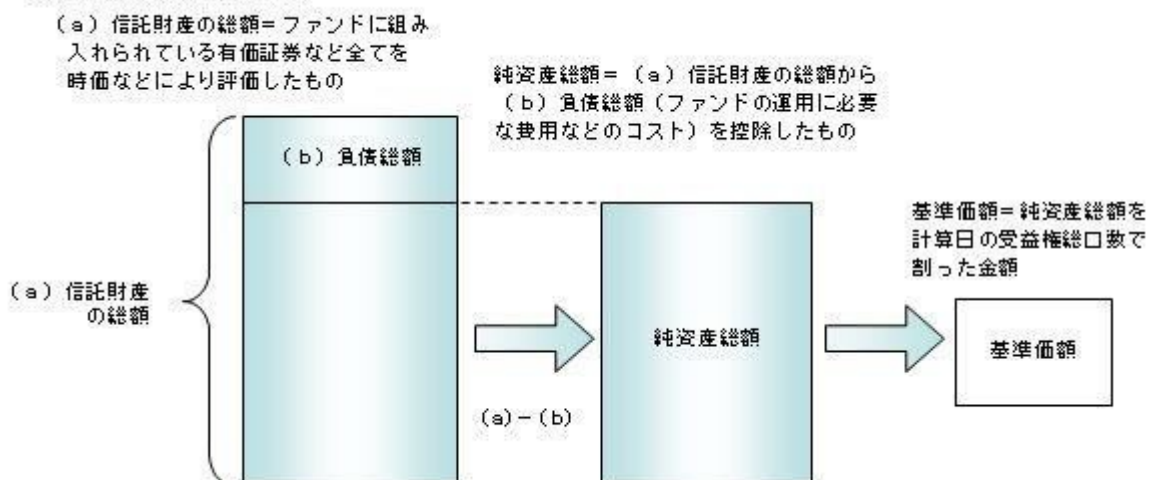
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（2016年5月12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1月26日から翌年1月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（5）【その他】**信託の終了（繰上償還）**

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。（後述の

「書面決議」をご覧ください。)

- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

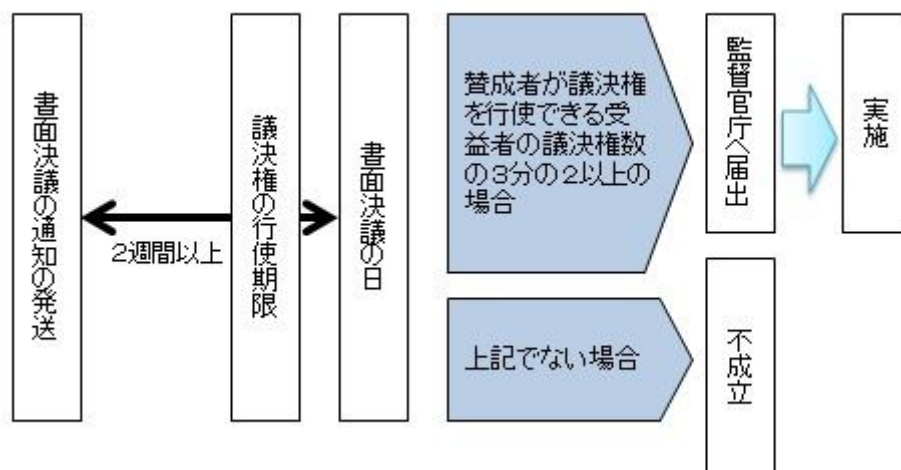
信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

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



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年1月26日から2022年1月25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】

【DCりそな グローバルバランス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年 1月25日現在	第6期 2022年 1月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,878,235	6,554,316
親投資信託受益証券	738,330,183	967,291,158
未収入金	-	6,000,000
流動資産合計	743,208,418	979,845,474
資産合計	743,208,418	979,845,474
負債の部		
流動負債		
未払解約金	496,865	6,496,673
未払受託者報酬	146,965	210,527
未払委託者報酬	2,057,415	2,947,319
未払利息	13	17
その他未払費用	28,567	40,962
流動負債合計	2,729,825	9,695,498
負債合計	2,729,825	9,695,498
純資産の部		
元本等		
元本	695,424,256	889,515,166
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	45,054,337	80,634,810
（分配準備積立金）	20,308,107	31,908,393
元本等合計	740,478,593	970,149,976
純資産合計	740,478,593	970,149,976
負債純資産合計	743,208,418	979,845,474

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自	2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		12,135,643		24,060,975
営業収益合計		12,135,643		24,060,975
営業費用				
支払利息		3,078		5,152
受託者報酬		270,347		393,430
委託者報酬		3,784,655		5,507,893
その他費用		52,897		76,566
営業費用合計		4,110,977		5,983,041
営業利益又は営業損失()		8,024,666		18,077,934
経常利益又は経常損失()		8,024,666		18,077,934
当期純利益又は当期純損失()		8,024,666		18,077,934
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()		1,707,078		3,294,852
期首剰余金又は期首欠損金()		29,467,801		45,054,337
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,211,055		30,234,866
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,211,055		30,234,866
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,356,263		9,437,475
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,356,263		9,437,475
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		45,054,337		80,634,810

(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5期 2021年 1月25日現在	第6期 2022年 1月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 499,675,688円	期首元本額 695,424,256円
期中追加設定元本額 295,744,267円	期中追加設定元本額 331,098,576円
期中一部解約元本額 99,995,699円	期中一部解約元本額 137,007,666円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 695,424,256口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 889,515,166口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0648円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0907円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,648円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,907円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第6期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 5,373,276円	A 費用控除後の配当等収益額 7,299,355円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 4,358,468円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 7,483,727円
C 収益調整金額 27,096,077円	C 収益調整金額 48,726,417円
D 分配準備積立金額 10,576,363円	D 分配準備積立金額 17,125,311円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 47,404,184円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 80,634,810円
F 当ファンドの期末残存口数 695,424,256口	F 当ファンドの期末残存口数 889,515,166口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 681円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 906円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第6期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 1月25日現在	第6期 2022年 1月25日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第6期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25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5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第6期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,441,209	4,608,748
合計	4,441,209	4,608,748

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

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	618,510,848	647,890,113	
	R M先進国債券マザーファンド	70,240,194	76,484,547	
	R M新興国債券マザーファンド	18,103,139	19,493,460	
	R M国内株式マザーファンド	74,010,658	102,697,189	
	R M先進国株式マザーファンド	23,898,163	46,477,147	
	R M新興国株式マザーファンド	11,705,697	19,025,269	
	R M国内リートマザーファンド	19,129,517	26,266,739	
	R M先進国リートマザーファンド	20,420,800	28,956,694	
合計		856,019,016	967,291,158	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 1月25日現在

資産の部

流動資産

2022年 1月25日現在

金銭信託	963,230
コール・ローン	786,849,031
国債証券	102,703,182,970
地方債証券	6,899,600,115
特殊債券	7,678,387,113
社債券	5,724,692,000
未収入金	2,574,734,900
未収利息	181,925,487
前払費用	9,119,024
流動資産合計	126,559,453,870
資産合計	126,559,453,870
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,709,288,000
未払利息	2,134
流動負債合計	2,709,290,134
負債合計	2,709,290,134
純資産の部	
元本等	
元本	118,230,260,033
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,619,903,703
元本等合計	123,850,163,736
純資産合計	123,850,163,736
負債純資産合計	126,559,453,870

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	78,237,277,839円
期中追加設定元本額	59,135,281,431円
期中一部解約元本額	19,142,299,237円
期末元本額	118,230,260,033円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	7,499,799,918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	618,510,848円
つみたてバランスファンド	3,810,731,129円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,204,394,830円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	805,079,980円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	244,955,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	275,372,083円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	80,087,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,357,885円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,606,006円
リスクコントロール・オープン	94,120,016円
FWりそな円建債券アクティブファンド	228,241,199円
FWりそな国内債券インデックスファンド	71,437,954,163円
Smart-i 国内債券インデックス	1,432,758,696円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,080,095,683円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	805,438,240円
Smart-i 8資産バランス 成長型	311,267,841円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,590,501,113円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,562,608,214円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,570,801,401円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	945,152,331円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,950,707,494円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	332,474,172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)	15,403,444円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,749,263,845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)	3,937,824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)	231,248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)	889,528,096円
2. 計算日における受益権の総数	118,230,260,033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	1.0475円
(10,000口当たり純資産額)	(10,475円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		966,198,760
地方債証券		39,376,005
特殊債券		44,484,393

社債券	10,002,000
合計	1,060,061,158

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第4 2 1 回利付国債(2年)	400,000,000	400,772,000	
	第4 2 3 回利付国債(2年)	860,000,000	860,911,600	
	第4 2 4 回利付国債(2年)	600,000,000	600,678,000	
	第4 2 5 回利付国債(2年)	350,000,000	350,423,500	
	第4 2 6 回利付国債(2年)	650,000,000	650,786,500	
	第4 2 7 回利付国債(2年)	840,000,000	841,075,200	
	第4 2 8 回利付国債(2年)	420,000,000	420,567,000	
	第4 2 9 回利付国債(2年)	350,000,000	350,497,000	
	第4 3 0 回利付国債(2年)	630,000,000	630,888,300	
	第1 3 5 回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,002,120,000	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	1,180,000,000	1,182,961,800	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,073,177,900	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	1,490,000,000	1,494,946,800	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,987,444,800	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,716,976,800	

第141回利付国債(5年)	1,250,000,000	1,255,637,500	
第142回利付国債(5年)	1,220,000,000	1,226,014,600	
第143回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,075,724,500	
第144回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,367,860,800	
第145回利付国債(5年)	1,220,000,000	1,227,356,600	
第146回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,469,125,000	
第147回利付国債(5年)	980,000,000	982,440,200	
第148回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,283,097,600	
第149回利付国債(5年)	560,000,000	561,170,400	
第1回利付国債(40年)	100,000,000	141,963,000	
第2回利付国債(40年)	180,000,000	247,516,200	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	152,194,900	
第4回利付国債(40年)	170,000,000	236,301,700	
第5回利付国債(40年)	240,000,000	322,888,800	
第6回利付国債(40年)	240,000,000	318,528,000	
第7回利付国債(40年)	220,000,000	281,047,800	
第8回利付国債(40年)	290,000,000	346,944,400	
第9回利付国債(40年)	480,000,000	431,980,800	
第10回利付国債(40年)	420,000,000	441,823,200	
第11回利付国債(40年)	340,000,000	346,803,400	
第12回利付国債(40年)	360,000,000	332,402,400	
第13回利付国債(40年)	430,000,000	395,767,700	
第14回利付国債(40年)	330,000,000	323,535,300	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	414,226,350	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	300,632,310	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	260,711,080	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,002,600	
第332回利付国債(10年)	652,000,000	660,299,960	
第333回利付国債(10年)	225,000,000	228,237,750	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	265,196,880	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	350,216,400	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	213,475,500	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	171,825,800	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	640,345,110	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	391,160,000	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	949,878,000	

第341回利付国債(10年)	440,000,000	446,274,400	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	382,443,400	
第343回利付国債(10年)	780,000,000	785,155,800	
第344回利付国債(10年)	960,000,000	966,259,200	
第345回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,077,083,400	
第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,319,104,500	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	684,773,600	
第348回利付国債(10年)	980,000,000	987,203,000	
第349回利付国債(10年)	890,000,000	896,568,200	
第350回利付国債(10年)	980,000,000	987,232,400	
第351回利付国債(10年)	710,000,000	715,225,600	
第352回利付国債(10年)	800,000,000	805,848,000	
第353回利付国債(10年)	940,000,000	946,805,600	
第354回利付国債(10年)	720,000,000	725,140,800	
第355回利付国債(10年)	800,000,000	805,320,000	
第356回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,257,637,500	
第357回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,015,565,100	
第358回利付国債(10年)	820,000,000	823,993,400	
第359回利付国債(10年)	840,000,000	843,158,400	
第360回利付国債(10年)	660,000,000	661,986,600	
第361回利付国債(10年)	980,000,000	982,156,000	
第362回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,050,945,000	
第363回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,179,445,400	
第364回利付国債(10年)	950,000,000	948,185,500	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	72,711,600	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	48,782,800	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	32,997,300	
第11回利付国債(30年)	80,000,000	93,528,000	
第12回利付国債(30年)	80,000,000	97,414,400	
第13回利付国債(30年)	200,000,000	241,838,000	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	75,606,600	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	255,184,000	
第16回利付国債(30年)	140,000,000	179,172,000	
第17回利付国債(30年)	160,000,000	203,492,800	
第18回利付国債(30年)	60,000,000	75,750,000	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	126,574,000	

第20回利付国債(30年)	100,000,000	129,612,000	
第21回利付国債(30年)	180,000,000	229,100,400	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	65,191,500	
第23回利付国債(30年)	220,000,000	287,590,600	
第24回利付国債(30年)	170,000,000	222,793,500	
第25回利付国債(30年)	200,000,000	257,044,000	
第26回利付国債(30年)	205,000,000	266,977,650	
第27回利付国債(30年)	295,000,000	390,547,550	
第28回利付国債(30年)	290,000,000	385,868,200	
第29回利付国債(30年)	150,000,000	198,064,500	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	248,719,500	
第31回利付国債(30年)	170,000,000	220,444,100	
第32回利付国債(30年)	335,000,000	441,556,800	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	368,288,400	
第34回利付国債(30年)	335,000,000	438,719,350	
第35回利付国債(30年)	406,000,000	518,202,160	
第36回利付国債(30年)	375,000,000	480,142,500	
第37回利付国債(30年)	450,000,000	569,511,000	
第38回利付国債(30年)	290,000,000	362,094,000	
第39回利付国債(30年)	300,000,000	381,183,000	
第40回利付国債(30年)	215,000,000	269,334,800	
第41回利付国債(30年)	255,000,000	314,774,550	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	234,754,500	
第43回利付国債(30年)	180,000,000	222,607,800	
第44回利付国債(30年)	260,000,000	321,838,400	
第45回利付国債(30年)	290,000,000	347,086,500	
第46回利付国債(30年)	350,000,000	419,125,000	
第47回利付国債(30年)	320,000,000	390,460,800	
第48回利付国債(30年)	353,000,000	415,357,450	
第49回利付国債(30年)	330,000,000	388,426,500	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	365,144,500	
第51回利付国債(30年)	350,000,000	325,230,500	
第52回利付国債(30年)	310,000,000	301,723,000	
第53回利付国債(30年)	310,000,000	308,329,100	
第54回利付国債(30年)	360,000,000	374,500,800	
第55回利付国債(30年)	100,000,000	103,949,000	

第56回利付国債(30年)	300,000,000	311,604,000	
第57回利付国債(30年)	330,000,000	342,490,500	
第58回利付国債(30年)	490,000,000	507,556,700	
第59回利付国債(30年)	280,000,000	282,833,600	
第60回利付国債(30年)	280,000,000	295,562,400	
第61回利付国債(30年)	260,000,000	261,479,400	
第62回利付国債(30年)	230,000,000	219,505,100	
第63回利付国債(30年)	300,000,000	278,349,000	
第64回利付国債(30年)	260,000,000	240,814,600	
第65回利付国債(30年)	300,000,000	277,374,000	
第66回利付国債(30年)	340,000,000	314,537,400	
第67回利付国債(30年)	250,000,000	243,212,500	
第68回利付国債(30年)	360,000,000	350,571,600	
第69回利付国債(30年)	340,000,000	339,588,600	
第70回利付国債(30年)	390,000,000	388,588,200	
第71回利付国債(30年)	360,000,000	358,686,000	
第72回利付国債(30年)	180,000,000	179,119,800	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	50,621,500	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	80,978,400	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	61,573,200	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	123,913,200	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	394,231,000	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	20,844,200	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	94,378,500	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	62,790,000	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	116,509,800	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	105,438,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	222,064,500	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	190,792,800	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	106,823,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	106,192,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,301,600	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	53,345,000	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,406,000	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	96,633,900	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,260,200	

第82回利付国債(20年)	170,000,000	183,428,300	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,841,900	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	129,633,600	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	163,395,000	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	109,761,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	98,411,400	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	204,114,200	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	131,869,200	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	187,736,100	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	88,719,200	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	281,713,800	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	88,391,200	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	155,405,600	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	208,302,600	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	78,059,800	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	146,404,700	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	78,437,100	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	95,670,050	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	171,625,090	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	22,977,800	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	167,422,800	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	114,823,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,354,300	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,684,680	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	45,881,600	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	91,620,800	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	248,921,200	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	90,860,000	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	224,257,800	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	58,094,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	236,668,400	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	98,540,500	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	186,097,600	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	117,099,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	164,617,600	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	262,737,000	

第118回利付国債(20年)	131,000,000	152,360,860	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	171,949,500	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	271,106,400	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	237,455,600	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	218,446,800	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	312,572,800	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	234,136,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	143,030,400	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	117,377,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	151,411,000	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	262,824,750	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	278,112,000	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	255,499,200	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	34,554,300	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	92,319,200	
第133回利付国債(20年)	355,000,000	413,138,350	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	52,472,250	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	46,241,600	
第136回利付国債(20年)	50,000,000	57,302,000	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	196,975,600	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	102,438,000	
第139回利付国債(20年)	370,000,000	424,922,800	
第140回利付国債(20年)	420,000,000	487,725,000	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	215,286,350	
第142回利付国債(20年)	390,000,000	458,019,900	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	386,971,900	
第144回利付国債(20年)	270,000,000	308,939,400	
第145回利付国債(20年)	545,000,000	637,159,500	
第146回利付国債(20年)	560,000,000	655,995,200	
第147回利付国債(20年)	385,000,000	447,381,550	
第148回利付国債(20年)	545,000,000	627,889,050	
第149回利付国債(20年)	540,000,000	623,035,800	
第150回利付国債(20年)	590,000,000	674,434,900	
第151回利付国債(20年)	515,000,000	576,491,000	
第152回利付国債(20年)	660,000,000	739,325,400	
第153回利付国債(20年)	440,000,000	498,916,000	

	第154回利付国債(20年)	408,000,000	457,645,440	
	第155回利付国債(20年)	490,000,000	536,834,200	
	第156回利付国債(20年)	630,000,000	638,114,400	
	第157回利付国債(20年)	480,000,000	472,070,400	
	第158回利付国債(20年)	300,000,000	307,341,000	
	第159回利付国債(20年)	370,000,000	384,185,800	
	第160回利付国債(20年)	510,000,000	536,443,500	
	第161回利付国債(20年)	480,000,000	497,164,800	
	第162回利付国債(20年)	290,000,000	300,086,200	
	第163回利付国債(20年)	420,000,000	434,175,000	
	第164回利付国債(20年)	530,000,000	539,264,400	
	第165回利付国債(20年)	430,000,000	436,948,800	
	第166回利付国債(20年)	610,000,000	638,560,200	
	第167回利付国債(20年)	440,000,000	445,904,800	
	第168回利付国債(20年)	530,000,000	527,456,000	
	第169回利付国債(20年)	410,000,000	400,397,800	
	第170回利付国債(20年)	540,000,000	526,321,800	
	第171回利付国債(20年)	400,000,000	389,092,000	
	第172回利付国債(20年)	360,000,000	355,784,400	
	第173回利付国債(20年)	510,000,000	503,099,700	
	第174回利付国債(20年)	570,000,000	561,233,400	
	第175回利付国債(20年)	490,000,000	490,421,400	
	第176回利付国債(20年)	530,000,000	529,533,600	
	第177回利付国債(20年)	490,000,000	479,636,500	
	第178回利付国債(20年)	200,000,000	199,286,000	
	国債証券合計	97,414,000,000	102,703,182,970	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	113,631,000	
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,247,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	101,679,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,260,000	
	第789回東京都公募公債	100,000,000	99,924,000	
	第808回東京都公募公債	100,000,000	99,573,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,180,000	
	第15回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,391,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,256,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,285,000	

第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,977,000	
第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,970,000	
第376回大阪府公募公債	110,000,000	111,488,300	
第444回大阪府公募公債	100,000,000	99,796,000	
第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,280,000	
第471回大阪府公募公債	140,000,000	138,458,600	
平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,409,000	
平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,721,000	
平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,694,000	
令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	99,927,000	
平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,377,000	
平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,449,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,370,000	
平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	114,788,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,215,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,829,000	
令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	98,854,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,390,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,725,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	115,605,000	
第16回埼玉県公募公債	100,000,000	111,419,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,465,000	
令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,150,000	
平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	114,479,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	101,957,000	
第11回千葉県公募公債	100,000,000	116,239,000	
第19回千葉県公募公債	100,000,000	110,755,000	
平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,991,000	
第15回千葉県公募公債	100,000,000	99,395,000	
第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,216,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,536,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,370,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,778,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,361,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,594,000	
第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,009,000	

	第187回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,172,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,243,000	
	第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,000,000	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,746,000	
	第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,263,000	
	第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,190,000	
	令和3年度第2回堺市公募公債	100,000,000	99,359,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,804,000	
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	116,985,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	111,152,000	
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	114,508,015	
	平成22年度第9回神戸市公募公債	100,000,000	117,118,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	116,411,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	115,230,000	
	第37回川崎市公募公債	100,000,000	99,138,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,471,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,796,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,961,200	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,656,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	100,934,000	
	地方債証券合計	6,684,500,000	6,899,600,115	
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	100,779,000	
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,423,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,980,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,927,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	97,360,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,060,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,102,000	
	第27回道路債券	100,000,000	105,153,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	172,020,000	
	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	100,783,000	
	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	115,804,620	

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	128,884,680	
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	101,390,000	
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	101,675,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,014,680	
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	134,678,460	
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	100,400,000	
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	100,673,000	
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	100,886,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,408,000	
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,104,000	
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,373,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	124,247,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	107,308,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,564,640	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,453,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,864,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,693,100	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,446,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	215,061,840	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,789,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,751,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	113,258,000	
F14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,022,000	
F151回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,126,000	
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	116,090,000	
第97回都市再生債券	100,000,000	106,558,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	111,071,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	69,165,000	68,810,183	

第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	74,119,000	73,938,149	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,325,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,563,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,034,000	80,758,307	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,117,000	80,623,339	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,750,000	82,132,590	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,708,000	81,205,161	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,094,000	84,449,717	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,302,000	86,120,899	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,701,000	89,887,412	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,424,000	92,210,500	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,307,000	95,446,148	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,243,000	97,723,380	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,250,000	98,393,445	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,640,000	98,353,944	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,821,000	98,523,548	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,077,000	98,920,458	
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,414,000	99,698,324	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,861,000	99,964,855	
第223回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,131,000	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	47,225,000	47,080,963	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	48,421,000	48,303,821	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	51,906,000	51,822,950	
第334回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,678,000	
第340回信金中金債	100,000,000	100,086,000	
第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,919,000	
第372回信金中金債	100,000,000	100,019,000	
第376回信金中金債	100,000,000	99,975,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	101,859,000	
第79回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,040,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,089,000	
第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,985,000	
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	7,464,579,000	7,678,387,113
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,102,000
	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	100,075,000
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	99,125,000
	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	99,882,000
	第27回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	99,439,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,958,000
	第18回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,192,000
	第54回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,384,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,587,000
	第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,656,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,733,000
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,662,000
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,531,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,310,000
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,788,000
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,926,000
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,928,000
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	99,408,000
	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	100,277,000
	第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000
	第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,918,000
	第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,760,000
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,630,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,635,000	

第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,828,000	
第81アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,521,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,405,000	
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	100,302,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,224,000	
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
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	99,999,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
第134回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,558,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,309,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,054,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,274,000	
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,990,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,024,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,799,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,381,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,860,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,257,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,768,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,586,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,418,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,310,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,446,000	
第540回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,050,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,213,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,590,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,380,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,442,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,048,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,685,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,002,000	

	社債券合計	5,700,000,000	5,724,692,000	
	合計		123,005,862,198	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	83,332,370
コール・ローン	125,186,651
国債証券	46,855,044,553
派生商品評価勘定	23,307
未収利息	229,919,285
前払費用	30,333,995
流動資産合計	47,323,840,161
資産合計	47,323,840,161
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,867
前受収益	3,289
未払利息	339
流動負債合計	22,495
負債合計	22,495
純資産の部	
元本等	
元本	43,461,502,818
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	3,862,314,848
元本等合計	47,323,817,666
純資産合計	47,323,817,666
負債純資産合計	47,323,840,161

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	29,857,342,278円
期中追加設定元本額	21,119,506,580円
期中一部解約元本額	7,515,346,040円
期末元本額	43,461,502,818円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,010,310,283円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	839,480,381円
りそなラップ型ファンド（成長型）	480,904,989円
DCりそな グローバルバランス	70,240,194円
つみたてバランスファンド	890,529,523円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	676,873,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	169,702,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	51,209,370円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	57,901,486円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	16,733,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,564,825円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,934,273円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	213,729,036円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	193,088,862円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	259,398,022円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	33,342,372,866円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	952,775,480円

Smart-i 8資産バランス 安定型	227,539,777円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	169,574,714円
Smart-i 8資産バランス 成長型	64,567,974円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,094,292円
りそなFT 先進国債券インデックス（適格機関投資家専用）	763,304,884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）	970,265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）	1,925,031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）	776,726円
2. 計算日における受益権の総数	43,461,502,818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	1.0889円
(10,000口当たり純資産額)	(10,889円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,720,813,727
合計		1,720,813,727

(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 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
		うち1年超			

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	66,390,372	-	66,394,812	4,440
	米ドル	28,479,790	-	28,502,006	22,216
	カナダドル	3,164,047	-	3,157,964	6,083
	ユーロ	27,108,180	-	27,102,918	5,262
	英ポンド	4,617,846	-	4,610,874	6,972
	オーストラリアドル	3,020,509	-	3,021,050	541
	合計	66,390,372	-	66,394,812	4,440

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	720,000.00	730,181.23	
		US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,423,921.49	
		US TREASURY N/B	560,000.00	564,861.64	
		US TREASURY N/B	400,000.00	404,546.84	

US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,119,435.24	
US TREASURY N/B	650,000.00	659,429.09	
US TREASURY N/B	300,000.00	302,789.04	
US TREASURY N/B	390,000.00	393,884.75	
US TREASURY N/B	410,000.00	418,808.56	
US TREASURY N/B	930,000.00	925,350.00	
US TREASURY N/B	490,000.00	495,665.62	
US TREASURY N/B	420,000.00	430,713.27	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,077,597.54	
US TREASURY N/B	640,000.00	648,549.95	
US TREASURY N/B	700,000.00	694,695.26	
US TREASURY N/B	320,000.00	323,824.99	
US TREASURY N/B	400,000.00	410,796.84	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,289,234.31	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,013,067.16	
US TREASURY N/B	470,000.00	474,057.41	
US TREASURY N/B	200,000.00	205,289.06	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,545,801.50	
US TREASURY N/B	450,000.00	445,605.43	
US TREASURY N/B	640,000.00	644,299.96	
US TREASURY N/B	320,000.00	329,400.00	
US TREASURY N/B	570,000.00	564,121.87	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,231,218.72	
US TREASURY N/B	830,000.00	820,986.69	
US TREASURY N/B	530,000.00	534,554.66	
US TREASURY N/B	130,000.00	133,925.38	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,245,726.45	
US TREASURY N/B	630,000.00	622,567.95	
US TREASURY N/B	890,000.00	897,648.39	
US TREASURY N/B	480,000.00	496,087.48	
US TREASURY N/B	500,000.00	494,960.89	
US TREASURY N/B	940,000.00	927,882.74	
US TREASURY N/B	540,000.00	546,918.75	
US TREASURY N/B	150,000.00	155,191.39	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,099,875.57	

US TREASURY N/B	710,000.00	733,407.77
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,126,729.60
US TREASURY N/B	440,000.00	449,659.36
US TREASURY N/B	340,000.00	352,139.05
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,202,829.62
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,477,382.70
US TREASURY N/B	140,000.00	143,489.05
US TREASURY N/B	450,000.00	464,343.75
US TREASURY N/B	250,000.00	245,917.95
US TREASURY N/B	420,000.00	430,778.88
US TREASURY N/B	440,000.00	453,492.16
US TREASURY N/B	690,000.00	714,850.76
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,307,140.62
US TREASURY N/B	490,000.00	501,503.48
US TREASURY N/B	340,000.00	349,775.00
US TREASURY N/B	410,000.00	403,369.52
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,576,214.02
US TREASURY N/B	240,000.00	236,521.87
US TREASURY N/B	320,000.00	326,800.00
US TREASURY N/B	700,000.00	718,703.09
US TREASURY N/B	850,000.00	877,757.77
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,972,940.62
US TREASURY N/B	650,000.00	663,990.21
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,303,919.49
US TREASURY N/B	390,000.00	398,485.54
US TREASURY N/B	600,000.00	609,398.40
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,031,378.88
US TREASURY N/B	220,000.00	225,560.14
US TREASURY N/B	730,000.00	741,605.83
US TREASURY N/B	950,000.00	980,058.56
US TREASURY N/B	630,000.00	618,138.23
US TREASURY N/B	650,000.00	662,390.62
US TREASURY N/B	600,000.00	601,687.50
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,166,106.93
US TREASURY N/B	220,000.00	225,620.29

US TREASURY N/B	710,000.00	716,351.16	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,054,493.34	
US TREASURY N/B	310,000.00	319,021.46	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,038,972.22	
US TREASURY N/B	750,000.00	772,001.92	
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,560,681.97	
US TREASURY N/B	400,000.00	410,328.12	
US TREASURY N/B	700,000.00	705,851.51	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,266,195.27	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,906.24	
US TREASURY N/B	860,000.00	873,202.29	
US TREASURY N/B	430,000.00	446,108.18	
US TREASURY N/B	550,000.00	552,212.87	
US TREASURY N/B	730,000.00	746,482.01	
US TREASURY N/B	340,000.00	355,459.35	
US TREASURY N/B	960,000.00	956,287.48	
US TREASURY N/B	250,000.00	260,605.45	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,132,450.00	
US TREASURY N/B	250,000.00	262,695.30	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,029,276.53	
US TREASURY N/B	570,000.00	585,474.58	
US TREASURY N/B	240,000.00	252,328.10	
US TREASURY N/B	850,000.00	820,748.01	
US TREASURY N/B	290,000.00	303,933.57	
US TREASURY N/B	650,000.00	626,716.74	
US TREASURY N/B	470,000.00	494,931.99	
US TREASURY N/B	630,000.00	606,547.24	
US TREASURY N/B	810,000.00	828,003.46	
US TREASURY N/B	310,000.00	325,124.59	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	961,093.70	
US TREASURY N/B	230,000.00	243,530.46	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,133,076.47	
US TREASURY N/B	570,000.00	603,910.49	
US TREASURY N/B	770,000.00	738,117.14	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,341,081.95	

US TREASURY N/B	480,000.00	506,662.46
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,211,683.45
US TREASURY N/B	300,000.00	314,097.63
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,085,506.25
US TREASURY N/B	330,000.00	345,520.29
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,265,910.87
US TREASURY N/B	670,000.00	675,286.70
US TREASURY N/B	350,000.00	364,806.61
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,309,159.24
US TREASURY N/B	430,000.00	444,042.16
US TREASURY N/B	1,000,000.00	971,640.60
US TREASURY N/B	450,000.00	467,121.06
US TREASURY N/B	870,000.00	844,579.64
US TREASURY N/B	730,000.00	735,047.22
US TREASURY N/B	470,000.00	483,108.58
US TREASURY N/B	730,000.00	707,985.90
US TREASURY N/B	450,000.00	458,015.62
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,123,881.99
US TREASURY N/B	520,000.00	529,181.22
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,010,460.87
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,410,826.11
US TREASURY N/B	320,000.00	318,474.97
US TREASURY N/B	1,030,000.00	996,082.40
US TREASURY N/B	400,000.00	402,484.36
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,272,951.49
US TREASURY N/B	350,000.00	352,228.48
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,149,433.50
US TREASURY N/B	850,000.00	869,722.63
US TREASURY N/B	300,000.00	301,898.43
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,195,489.43
US TREASURY N/B	440,000.00	445,259.36
US TREASURY N/B	450,000.00	449,542.93
US TREASURY N/B	140,000.00	144,943.75
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,195,838.26
US TREASURY N/B	300,000.00	286,453.11

US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,070,586.63	
US TREASURY N/B	580,000.00	604,514.04	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,182,275.37	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,115,007.72	
US TREASURY N/B	250,000.00	234,365.22	
US TREASURY N/B	800,000.00	828,843.68	
US TREASURY N/B	410,000.00	386,248.82	
US TREASURY N/B	810,000.00	756,464.02	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,277,337.43	
US TREASURY N/B	690,000.00	714,662.04	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,114,961.70	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	981,662.44	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,092,320.25	
US TREASURY N/B	850,000.00	905,615.16	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,078,434.37	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,246,992.13	
US TREASURY N/B	920,000.00	898,221.85	
US TREASURY N/B	840,000.00	902,114.05	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,512,158.14	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,189,642.86	
US TREASURY N/B	830,000.00	795,924.59	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,258,435.50	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,236,349.95	
US TREASURY N/B	920,000.00	895,203.05	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,667,195.27	
US TREASURY N/B	890,000.00	973,854.64	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,097,252.31	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,212,452.23	
US TREASURY N/B	930,000.00	974,683.52	
US TREASURY N/B	850,000.00	847,277.28	
US TREASURY N/B	680,000.00	684,170.30	
US TREASURY N/B	960,000.00	947,174.97	
US TREASURY N/B	120,000.00	162,656.24	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,312,136.68	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,259,953.40	

US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,958,495.91	
US TREASURY N/B	660,000.00	866,121.03	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,636,620.24	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,342,852.94	
US TREASURY N/B	2,110,000.00	2,022,797.48	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,161,281.15	
US TREASURY N/B	80,000.00	107,028.12	
US TREASURY N/B	90,000.00	127,357.02	
US TREASURY N/B	280,000.00	374,554.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,734.37	
US TREASURY N/B	70,000.00	85,192.18	
US TREASURY N/B	140,000.00	186,254.68	
US TREASURY N/B	190,000.00	260,337.10	
US TREASURY N/B	40,000.00	54,073.43	
US TREASURY N/B	190,000.00	264,545.30	
US TREASURY N/B	210,000.00	285,009.37	
US TREASURY N/B	950,000.00	805,199.19	
US TREASURY N/B	150,000.00	191,525.38	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	937,473.02	
US TREASURY N/B	210,000.00	281,137.50	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,057,031.16	
US TREASURY N/B	230,000.00	327,354.67	
US TREASURY N/B	1,840,000.00	1,761,656.11	
US TREASURY N/B	250,000.00	340,917.95	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,331,901.49	
US TREASURY N/B	230,000.00	290,698.42	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,207,762.50	
US TREASURY N/B	130,000.00	151,155.45	
US TREASURY N/B	950,000.00	927,808.56	
US TREASURY N/B	180,000.00	209,770.30	
US TREASURY N/B	200,000.00	229,039.06	
US TREASURY N/B	200,000.00	220,359.36	
US TREASURY N/B	870,000.00	958,699.19	
US TREASURY N/B	320,000.00	373,174.97	
US TREASURY N/B	590,000.00	663,242.95	

US TREASURY N/B	360,000.00	452,250.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	409,837.47	
US TREASURY N/B	410,000.00	516,744.11	
US TREASURY N/B	390,000.00	475,266.79	
US TREASURY N/B	430,000.00	505,199.60	
US TREASURY N/B	380,000.00	438,142.96	
US TREASURY N/B	530,000.00	562,959.37	
US TREASURY N/B	450,000.00	520,066.39	
US TREASURY N/B	410,000.00	465,285.91	
US TREASURY N/B	290,000.00	336,660.53	
US TREASURY N/B	530,000.00	565,091.77	
US TREASURY N/B	460,000.00	490,690.60	
US TREASURY N/B	620,000.00	632,303.08	
US TREASURY N/B	350,000.00	399,875.00	
US TREASURY N/B	440,000.00	514,473.43	
US TREASURY N/B	350,000.00	410,074.21	
US TREASURY N/B	480,000.00	539,231.23	
US TREASURY N/B	520,000.00	584,512.50	
US TREASURY N/B	640,000.00	754,349.94	
US TREASURY N/B	760,000.00	917,373.42	
US TREASURY N/B	630,000.00	744,359.74	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,377,615.13	
US TREASURY N/B	810,000.00	961,558.53	
US TREASURY N/B	970,000.00	1,128,079.63	
US TREASURY N/B	800,000.00	825,750.00	
US TREASURY N/B	710,000.00	753,071.44	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,136,981.19	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	867,253.84	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,012,921.79	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,194,038.61	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,276,454.65	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,490,343.67	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,354,125.00	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,688,275.73	
米ドル 小計	194,190,000.00	195,270,616.44	

カナダドル	GOV OF CANADA	330,000.00	327,425.34
	GOV OF CANADA	300,000.00	302,334.30
	GOV OF CANADA	380,000.00	376,019.50
	GOV OF CANADA	270,000.00	271,394.55
	GOV OF CANADA	230,000.00	226,869.01
	GOV OF CANADA	380,000.00	384,981.80
	GOV OF CANADA	370,000.00	365,368.34
	GOV OF CANADA	100,000.00	98,955.70
	GOV OF CANADA	210,000.00	214,179.00
	GOV OF CANADA	530,000.00	518,114.22
	GOV OF CANADA	70,000.00	71,905.68
	GOV OF CANADA	180,000.00	180,711.00
	GOV OF CANADA	160,000.00	157,377.28
	GOV OF CANADA	200,000.00	198,822.60
	GOV OF CANADA	150,000.00	153,841.95
	GOV OF CANADA	590,000.00	569,200.73
	GOV OF CANADA	350,000.00	331,927.40
	GOV OF CANADA	130,000.00	129,731.29
	GOV OF CANADA	360,000.00	350,515.44
	GOV OF CANADA	130,000.00	127,585.12
	GOV OF CANADA	160,000.00	155,140.16
	GOV OF CANADA	150,000.00	153,407.55
	GOV OF CANADA	120,000.00	153,934.32
	GOV OF CANADA	130,000.00	135,445.44
	GOV OF CANADA	590,000.00	569,847.37
	GOV OF CANADA	570,000.00	512,597.01
	GOV OF CANADA	710,000.00	693,755.91
	GOV OF CANADA	380,000.00	369,173.42
	GOV OF CANADA	160,000.00	222,872.48
	GOV OF CANADA	120,000.00	167,696.52
	GOV OF CANADA	140,000.00	184,503.76
	GOV OF CANADA	200,000.00	256,415.60
GOV OF CANADA	200,000.00	230,819.60	
GOV OF CANADA	800,000.00	798,961.60	
	270,000.00	251,725.32	

	GOV OF CANADA			
	GOV OF CANADA	110,000.00	130,769.21	
	カナダドル 小計	10,230,000.00	10,344,325.52 (933,368,491)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	2,990,000.00	2,986,770.80	
	UNITED MEXICAN STATE	4,690,000.00	4,746,314.70	
	UNITED MEXICAN STATE	6,100,000.00	6,186,620.00	
	UNITED MEXICAN STATE	4,770,000.00	5,086,942.16	
	UNITED MEXICAN STATE	320,000.00	298,078.94	
	UNITED MEXICAN STATE	8,270,000.00	7,767,992.80	
	UNITED MEXICAN STATE	1,030,000.00	941,924.70	
	UNITED MEXICAN STATE	5,380,000.00	5,376,652.02	
	UNITED MEXICAN STATE	5,760,000.00	6,073,414.84	
	UNITED MEXICAN STATE	5,180,000.00	5,214,136.20	
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,813,330.40	
	UNITED MEXICAN STATE	980,000.00	1,168,060.92	
	UNITED MEXICAN STATE	4,830,000.00	5,063,929.94	
	UNITED MEXICAN STATE	3,430,000.00	3,322,778.20	
	UNITED MEXICAN STATE	4,220,000.00	4,185,569.02	
	メキシコペソ 小計	59,760,000.00	60,232,515.64 (333,290,602)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	80,668.80	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	191,883.85	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	229,308.64	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	192,633.21	
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	254,752.56	
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	111,538.02	
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	275,950.22	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	146,545.32	
	GOV OF AUSTRIA	360,000.00	378,110.52	
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	270,359.70	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	176,939.23	
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	263,851.50	
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	239,099.49	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	189,238.10	
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	246,916.56	

GOV OF AUSTRIA	100,000.00	126,158.60	
GOV OF AUSTRIA	170,000.00	165,359.17	
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	407,124.90	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	63,422.52	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	250,867.84	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	194,825.60	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	112,891.68	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	164,307.41	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	61,018.95	
GOV OF AUSTRIA	104,000.00	159,761.88	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	63,515.17	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	166,641.42	
GOV OF BELGIUM	230,000.00	233,425.85	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	344,893.28	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	277,962.03	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	385,774.83	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	229,456.16	
GOV OF BELGIUM	380,000.00	402,429.12	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	253,582.80	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	171,963.16	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	434,449.11	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	360,816.84	
GOV OF BELGIUM	360,000.00	385,056.00	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	250,510.85	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	366,545.84	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	244,411.50	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	152,568.24	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	378,631.14	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	211,213.12	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	590,167.46	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	158,726.12	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	217,588.32	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	142,498.50	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	509,164.46	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	277,744.47	

GOV OF BELGIUM	210,000.00	245,060.13	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	298,845.50	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	151,586.49	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	167,456.88	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	82,853.42	
GOV OF FINLAND	90,000.00	92,397.69	
GOV OF FINLAND	130,000.00	131,548.30	
GOV OF FINLAND	30,000.00	31,809.90	
GOV OF FINLAND	160,000.00	162,549.44	
GOV OF FINLAND	80,000.00	92,587.68	
GOV OF FINLAND	80,000.00	83,933.92	
GOV OF FINLAND	130,000.00	134,980.95	
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,120.48	
GOV OF FINLAND	120,000.00	125,077.68	
GOV OF FINLAND	70,000.00	83,373.43	
GOV OF FINLAND	140,000.00	145,812.80	
GOV OF FINLAND	120,000.00	125,104.08	
GOV OF FINLAND	120,000.00	119,431.32	
GOV OF FINLAND	60,000.00	63,705.36	
GOV OF FINLAND	140,000.00	139,691.02	
GOV OF FINLAND	80,000.00	88,321.28	
GOV OF FINLAND	80,000.00	77,084.24	
GOV OF FINLAND	70,000.00	67,590.88	
GOV OF FINLAND	110,000.00	158,126.87	
GOV OF FINLAND	70,000.00	85,756.86	
GOV OF FINLAND	70,000.00	62,251.00	
GOV OF FRANCE	300,000.00	302,144.23	
GOV OF FRANCE	770,000.00	775,930.37	
GOV OF FRANCE	1,050,000.00	1,083,988.50	
GOV OF FRANCE	710,000.00	771,336.90	
GOV OF FRANCE	550,000.00	556,770.92	
GOV OF FRANCE	1,080,000.00	1,093,837.48	
GOV OF FRANCE	710,000.00	757,175.95	
GOV OF FRANCE	740,000.00	787,702.62	
GOV OF FRANCE	890,000.00	902,242.84	

GOV OF FRANCE	940,000.00	969,245.28	
GOV OF FRANCE	340,000.00	422,770.28	
GOV OF FRANCE	790,000.00	831,493.96	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,053,660.40	
GOV OF FRANCE	550,000.00	640,119.70	
GOV OF FRANCE	820,000.00	848,543.78	
GOV OF FRANCE	1,050,000.00	1,075,643.83	
GOV OF FRANCE	360,000.00	363,585.60	
GOV OF FRANCE	800,000.00	852,000.00	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,101,095.32	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	1,075,953.12	
GOV OF FRANCE	860,000.00	907,716.24	
GOV OF FRANCE	620,000.00	870,768.30	
GOV OF FRANCE	1,150,000.00	1,192,625.90	
GOV OF FRANCE	830,000.00	826,372.90	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,238,997.89	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,045,132.44	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,189,354.98	
GOV OF FRANCE	840,000.00	819,131.04	
GOV OF FRANCE	720,000.00	1,142,327.80	
GOV OF FRANCE	720,000.00	791,807.76	
GOV OF FRANCE	580,000.00	906,285.96	
GOV OF FRANCE	770,000.00	848,735.58	
GOV OF FRANCE	480,000.00	747,615.36	
GOV OF FRANCE	560,000.00	672,750.96	
GOV OF FRANCE	360,000.00	349,465.06	
GOV OF FRANCE	850,000.00	1,446,021.70	
GOV OF FRANCE	210,000.00	199,899.00	
GOV OF FRANCE	500,000.00	767,565.00	
GOV OF FRANCE	560,000.00	717,724.56	
GOV OF FRANCE	620,000.00	718,297.28	
GOV OF FRANCE	540,000.00	515,907.90	
GOV OF FRANCE	170,000.00	160,515.02	
GOV OF FRANCE	370,000.00	696,381.44	
GOV OF FRANCE	380,000.00	750,132.92	

GOV OF FRANCE	250,000.00	314,449.50	
GOV OF FRANCE	150,000.00	116,788.20	
GOV OF GERMANY	270,000.00	276,439.77	
GOV OF GERMANY	490,000.00	493,861.43	
GOV OF GERMANY	290,000.00	292,543.30	
GOV OF GERMANY	370,000.00	380,691.37	
GOV OF GERMANY	310,000.00	313,023.29	
GOV OF GERMANY	480,000.00	500,533.92	
GOV OF GERMANY	210,000.00	212,385.60	
GOV OF GERMANY	410,000.00	415,155.52	
GOV OF GERMANY	370,000.00	374,639.06	
GOV OF GERMANY	440,000.00	462,517.44	
GOV OF GERMANY	570,000.00	578,563.26	
GOV OF GERMANY	410,000.00	430,766.50	
GOV OF GERMANY	480,000.00	500,461.92	
GOV OF GERMANY	440,000.00	447,648.08	
GOV OF GERMANY	510,000.00	527,449.14	
GOV OF GERMANY	370,000.00	376,909.38	
GOV OF GERMANY	490,000.00	517,084.75	
GOV OF GERMANY	590,000.00	601,687.90	
GOV OF GERMANY	630,000.00	655,441.29	
GOV OF GERMANY	470,000.00	479,520.32	
GOV OF GERMANY	530,000.00	541,207.38	
GOV OF GERMANY	550,000.00	561,203.50	
GOV OF GERMANY	660,000.00	682,377.96	
GOV OF GERMANY	140,000.00	193,693.57	
GOV OF GERMANY	550,000.00	577,385.60	
GOV OF GERMANY	550,000.00	561,964.15	
GOV OF GERMANY	170,000.00	232,173.79	
GOV OF GERMANY	710,000.00	747,381.50	
GOV OF GERMANY	190,000.00	254,162.81	
GOV OF GERMANY	490,000.00	508,967.41	
GOV OF GERMANY	540,000.00	551,517.66	
GOV OF GERMANY	530,000.00	551,107.78	
GOV OF GERMANY	570,000.00	581,981.97	

GOV OF GERMANY	210,000.00	321,697.32	
GOV OF GERMANY	450,000.00	459,093.60	
GOV OF GERMANY	610,000.00	621,457.02	
GOV OF GERMANY	170,000.00	174,049.74	
GOV OF GERMANY	370,000.00	564,495.68	
GOV OF GERMANY	460,000.00	467,387.48	
GOV OF GERMANY	790,000.00	800,602.79	
GOV OF GERMANY	390,000.00	631,446.27	
GOV OF GERMANY	540,000.00	539,339.04	
GOV OF GERMANY	420,000.00	417,240.47	
GOV OF GERMANY	640,000.00	1,034,252.16	
GOV OF GERMANY	340,000.00	596,344.70	
GOV OF GERMANY	370,000.00	698,362.05	
GOV OF GERMANY	340,000.00	566,091.50	
GOV OF GERMANY	520,000.00	808,030.60	
GOV OF GERMANY	570,000.00	907,290.09	
GOV OF GERMANY	600,000.00	773,689.20	
GOV OF GERMANY	540,000.00	513,759.78	
GOV OF GERMANY	130,000.00	124,973.55	
GOV OF GERMANY	130,000.00	122,148.00	
GOV OF IRELAND	90,000.00	94,653.54	
GOV OF IRELAND	190,000.00	206,350.59	
GOV OF IRELAND	200,000.00	236,885.50	
GOV OF IRELAND	250,000.00	263,994.25	
GOV OF IRELAND	160,000.00	163,188.60	
GOV OF IRELAND	150,000.00	159,326.70	
GOV OF IRELAND	200,000.00	215,513.20	
GOV OF IRELAND	160,000.00	190,743.42	
GOV OF IRELAND	150,000.00	150,348.60	
GOV OF IRELAND	120,000.00	133,053.96	
GOV OF IRELAND	210,000.00	204,117.69	
GOV OF IRELAND	110,000.00	121,066.22	
GOV OF IRELAND	90,000.00	88,724.52	
GOV OF IRELAND	130,000.00	151,599.24	
GOV OF IRELAND	90,000.00	87,792.12	

GOV OF IRELAND	160,000.00	203,946.88	
GOV OF IRELAND	140,000.00	161,569.10	
GOV OF ITALY	260,000.00	261,293.99	
GOV OF ITALY	320,000.00	324,753.28	
GOV OF ITALY	270,000.00	274,220.64	
GOV OF ITALY	370,000.00	393,097.25	
GOV OF ITALY	350,000.00	354,939.20	
GOV OF ITALY	340,000.00	366,269.76	
GOV OF ITALY	290,000.00	292,798.50	
GOV OF ITALY	340,000.00	355,555.68	
GOV OF ITALY	490,000.00	497,580.79	
GOV OF ITALY	460,000.00	461,225.90	
GOV OF ITALY	280,000.00	280,634.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	219,390.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	400,385.83	
GOV OF ITALY	330,000.00	344,574.78	
GOV OF ITALY	260,000.00	270,990.98	
GOV OF ITALY	250,000.00	249,809.76	
GOV OF ITALY	270,000.00	296,220.24	
GOV OF ITALY	330,000.00	342,624.81	
GOV OF ITALY	750,000.00	801,787.50	
GOV OF ITALY	170,000.00	169,335.30	
GOV OF ITALY	440,000.00	443,143.36	
GOV OF ITALY	370,000.00	425,843.73	
GOV OF ITALY	350,000.00	364,770.00	
GOV OF ITALY	360,000.00	375,989.04	
GOV OF ITALY	340,000.00	359,095.76	
GOV OF ITALY	310,000.00	336,372.63	
GOV OF ITALY	400,000.00	426,540.00	
GOV OF ITALY	380,000.00	382,506.48	
GOV OF ITALY	670,000.00	784,201.82	
GOV OF ITALY	450,000.00	442,778.87	
GOV OF ITALY	440,000.00	462,909.04	
GOV OF ITALY	370,000.00	397,750.00	
GOV OF ITALY	270,000.00	264,358.08	

GOV OF ITALY	470,000.00	487,672.00	
GOV OF ITALY	360,000.00	365,763.60	
GOV OF ITALY	400,000.00	434,383.20	
GOV OF ITALY	410,000.00	441,847.16	
GOV OF ITALY	380,000.00	386,558.04	
GOV OF ITALY	450,000.00	599,438.25	
GOV OF ITALY	500,000.00	538,552.34	
GOV OF ITALY	400,000.00	388,279.96	
GOV OF ITALY	310,000.00	304,294.14	
GOV OF ITALY	350,000.00	439,402.25	
GOV OF ITALY	440,000.00	498,414.22	
GOV OF ITALY	130,000.00	126,030.32	
GOV OF ITALY	490,000.00	564,341.82	
GOV OF ITALY	480,000.00	637,248.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	478,606.80	
GOV OF ITALY	510,000.00	522,664.32	
GOV OF ITALY	440,000.00	434,640.80	
GOV OF ITALY	430,000.00	448,010.55	
GOV OF ITALY	740,000.00	720,982.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	572,080.00	
GOV OF ITALY	390,000.00	368,052.59	
GOV OF ITALY	370,000.00	358,906.29	
GOV OF ITALY	400,000.00	414,460.00	
GOV OF ITALY	180,000.00	173,147.40	
GOV OF ITALY	340,000.00	494,804.04	
GOV OF ITALY	330,000.00	366,976.50	
GOV OF ITALY	430,000.00	604,518.94	
GOV OF ITALY	260,000.00	316,282.20	
GOV OF ITALY	280,000.00	276,241.84	
GOV OF ITALY	570,000.00	618,399.84	
GOV OF ITALY	510,000.00	670,941.72	
GOV OF ITALY	270,000.00	245,202.39	
GOV OF ITALY	320,000.00	378,063.04	
GOV OF ITALY	400,000.00	597,104.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	337,064.00	

GOV OF ITALY	380,000.00	574,978.00	
GOV OF ITALY	290,000.00	287,709.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	517,461.30	
GOV OF ITALY	250,000.00	230,132.25	
GOV OF ITALY	300,000.00	374,052.00	
GOV OF ITALY	310,000.00	353,692.33	
GOV OF ITALY	290,000.00	374,408.56	
GOV OF ITALY	230,000.00	317,056.15	
GOV OF ITALY	380,000.00	409,955.59	
GOV OF ITALY	310,000.00	284,452.90	
GOV OF ITALY	160,000.00	174,916.80	
GOV OF ITALY	90,000.00	82,689.84	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	166,974.41	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	414,592.40	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	283,693.48	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	425,957.20	
GOV OF NETHERLANDS	420,000.00	430,719.06	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	332,920.32	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	284,390.40	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	317,493.60	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	283,117.38	
GOV OF NETHERLANDS	360,000.00	383,212.08	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	161,490.88	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	257,147.00	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	231,063.98	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	269,423.82	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	354,135.04	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	517,944.24	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	211,376.95	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	210,447.00	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	558,501.24	
GOV OF NETHERLANDS	400,000.00	645,584.40	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	172,342.54	
GOV OF SPAIN	280,000.00	296,971.64	
GOV OF SPAIN	410,000.00	412,896.95	

GOV OF SPAIN	560,000.00	567,662.48	
GOV OF SPAIN	320,000.00	347,888.96	
GOV OF SPAIN	290,000.00	321,273.60	
GOV OF SPAIN	400,000.00	438,772.80	
GOV OF SPAIN	370,000.00	373,173.49	
GOV OF SPAIN	600,000.00	609,427.20	
GOV OF SPAIN	390,000.00	424,028.67	
GOV OF SPAIN	490,000.00	494,463.78	
GOV OF SPAIN	410,000.00	435,275.68	
GOV OF SPAIN	340,000.00	399,260.30	
GOV OF SPAIN	480,000.00	522,741.60	
GOV OF SPAIN	450,000.00	452,053.80	
GOV OF SPAIN	420,000.00	456,988.19	
GOV OF SPAIN	360,000.00	457,984.44	
GOV OF SPAIN	500,000.00	532,869.50	
GOV OF SPAIN	80,000.00	79,821.28	
GOV OF SPAIN	400,000.00	431,286.00	
GOV OF SPAIN	380,000.00	394,823.42	
GOV OF SPAIN	640,000.00	689,564.16	
GOV OF SPAIN	200,000.00	197,969.80	
GOV OF SPAIN	540,000.00	581,689.40	
GOV OF SPAIN	430,000.00	463,872.82	
GOV OF SPAIN	360,000.00	479,612.16	
GOV OF SPAIN	410,000.00	576,113.14	
GOV OF SPAIN	460,000.00	498,987.30	
GOV OF SPAIN	600,000.00	612,462.00	
GOV OF SPAIN	420,000.00	423,503.22	
GOV OF SPAIN	410,000.00	462,346.34	
GOV OF SPAIN	540,000.00	575,864.10	
GOV OF SPAIN	440,000.00	422,116.20	
GOV OF SPAIN	480,000.00	474,372.48	
GOV OF SPAIN	390,000.00	594,235.98	
GOV OF SPAIN	350,000.00	412,263.60	
GOV OF SPAIN	420,000.00	470,813.28	
GOV OF SPAIN	360,000.00	525,867.48	

	GOV OF SPAIN	190,000.00	184,447.25
	GOV OF SPAIN	350,000.00	577,782.80
	GOV OF SPAIN	400,000.00	401,787.20
	GOV OF SPAIN	400,000.00	653,401.60
	GOV OF SPAIN	100,000.00	96,956.10
	GOV OF SPAIN	270,000.00	483,320.52
	GOV OF SPAIN	360,000.00	483,828.84
	GOV OF SPAIN	280,000.00	366,012.64
	GOV OF SPAIN	370,000.00	334,612.46
	GOV OF SPAIN	300,000.00	452,903.20
	GOV OF SPAIN	90,000.00	78,984.85
	ユーロ 小計	124,524,000.00	140,788,921.52 (18,170,218,211)
英ポンド	UK TREASURY	610,000.00	606,222.27
	UK TREASURY	380,000.00	379,981.00
	UK TREASURY	430,000.00	439,894.30
	UK TREASURY	570,000.00	561,615.30
	UK TREASURY	250,000.00	250,887.50
	UK TREASURY	210,000.00	220,105.87
	UK TREASURY	200,000.00	196,103.28
	UK TREASURY	250,000.00	281,359.60
	UK TREASURY	250,000.00	248,027.70
	UK TREASURY	220,000.00	228,699.24
	UK TREASURY	240,000.00	232,767.60
	UK TREASURY	250,000.00	256,742.50
	UK TREASURY	280,000.00	272,278.77
	UK TREASURY	280,000.00	284,670.40
	UK TREASURY	280,000.00	332,180.24
	UK TREASURY	300,000.00	285,189.90
	UK TREASURY	240,000.00	250,118.40
	UK TREASURY	140,000.00	186,446.40
	UK TREASURY	140,000.00	134,848.92
	UK TREASURY	260,000.00	256,981.05
	UK TREASURY	260,000.00	244,790.10
	UK TREASURY	280,000.00	367,175.76

	UK TREASURY	470,000.00	432,706.44
	UK TREASURY	40,000.00	39,349.09
	UK TREASURY	350,000.00	455,633.50
	UK TREASURY	180,000.00	174,198.60
	UK TREASURY	330,000.00	456,634.20
	UK TREASURY	390,000.00	358,336.52
	UK TREASURY	270,000.00	375,287.58
	UK TREASURY	430,000.00	457,688.56
	UK TREASURY	220,000.00	336,644.44
	UK TREASURY	260,000.00	252,423.60
	UK TREASURY	210,000.00	308,475.30
	UK TREASURY	240,000.00	358,399.20
	UK TREASURY	370,000.00	365,132.28
	UK TREASURY	340,000.00	538,526.00
	UK TREASURY	350,000.00	479,020.50
	UK TREASURY	320,000.00	458,550.40
	UK TREASURY	360,000.00	327,569.95
	UK TREASURY	300,000.00	487,152.00
	UK TREASURY	340,000.00	354,943.00
	UK TREASURY	190,000.00	210,487.70
	UK TREASURY	180,000.00	305,420.40
	UK TREASURY	210,000.00	178,571.82
	UK TREASURY	180,000.00	178,920.24
	UK TREASURY	210,000.00	342,140.40
	UK TREASURY	120,000.00	128,885.55
	UK TREASURY	240,000.00	265,500.00
	UK TREASURY	290,000.00	534,327.90
	UK TREASURY	410,000.00	478,068.20
	UK TREASURY	220,000.00	414,079.60
	UK TREASURY	260,000.00	210,514.20
	UK TREASURY	260,000.00	388,018.80
	UK TREASURY	280,000.00	528,155.60
	UK TREASURY	260,000.00	323,408.80
	英bond 小計	15,400,000.00	18,020,256.47 (2,769,713,419)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,940,000.00	1,997,986.20

	GOV OF SWEDEN	1,570,000.00	1,697,963.93	
	GOV OF SWEDEN	1,470,000.00	1,531,321.05	
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,095,812.10	
	GOV OF SWEDEN	1,370,000.00	1,425,272.65	
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	915,976.06	
	GOV OF SWEDEN	790,000.00	944,994.05	
	GOV OF SWEDEN	830,000.00	1,237,905.87	
	スウェーデンクローナ 小計	9,960,000.00	10,847,231.91 (133,420,952)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,550,000.00	1,565,875.10	
	GOV OF NORWAY	1,160,000.00	1,196,756.22	
	GOV OF NORWAY	1,040,000.00	1,043,959.28	
	GOV OF NORWAY	790,000.00	784,439.19	
	GOV OF NORWAY	750,000.00	750,628.50	
	GOV OF NORWAY	720,000.00	730,434.24	
	GOV OF NORWAY	690,000.00	687,429.75	
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	1,023,260.40	
	GOV OF NORWAY	640,000.00	608,160.00	
	ノルウェークローネ 小計	8,400,000.00	8,390,942.68 (106,481,062)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	960,000.00	997,449.60	
	GOV OF DENMARK	850,000.00	861,798.00	
	GOV OF DENMARK	860,000.00	930,049.58	
	GOV OF DENMARK	1,540,000.00	1,603,647.42	
	GOV OF DENMARK	1,530,000.00	1,599,515.55	
	GOV OF DENMARK	1,170,000.00	1,161,536.08	
	GOV OF DENMARK	2,200,000.00	3,909,094.20	
	GOV OF DENMARK	910,000.00	898,752.40	
	デンマーククローネ 小計	10,020,000.00	11,961,842.83 (207,298,736)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	560,000.00	557,345.60	
	GOV OF POLAND	380,000.00	366,187.00	
	GOV OF POLAND	560,000.00	568,092.00	
	GOV OF POLAND	690,000.00	679,581.00	
	GOV OF POLAND	670,000.00	651,240.00	

	GOV OF POLAND	570,000.00	523,088.71
	GOV OF POLAND	650,000.00	643,012.50
	GOV OF POLAND	980,000.00	928,831.84
	GOV OF POLAND	570,000.00	481,080.00
	GOV OF POLAND	610,000.00	567,391.67
	GOV OF POLAND	750,000.00	703,537.50
	GOV OF POLAND	80,000.00	89,749.26
	GOV OF POLAND	950,000.00	878,180.00
	GOV OF POLAND	620,000.00	502,543.78
	ポーランドズロチ 小計	8,640,000.00	8,139,860.86 (230,094,330)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	360,430.77
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	291,606.28
	GOV OF AUSTRALIA	600,000.00	585,055.07
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	349,764.77
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	257,739.08
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	422,411.30
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	304,378.81
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	381,578.72
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	349,413.36
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	340,470.40
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	212,761.22
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	351,875.64
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	352,329.45
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	514,470.44
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	454,449.46
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	424,796.06
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	541,866.32
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	374,491.12
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	372,417.32
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	490,044.11
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	172,125.71
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	263,720.49
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	192,099.77
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	262,032.41
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	293,245.32

	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	242,825.63
	オーストラリアドル 小計	8,900,000.00	9,158,399.03 (747,783,280)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	151,605.00
	GOV OF SINGAPORE	200,000.00	205,440.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,428.80
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	146,314.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	93,069.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	115,920.00
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	194,940.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	130,788.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	116,105.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	129,204.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	195,498.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	59,220.81
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	126,610.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	164,865.60
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	73,535.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	122,046.65
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	133,560.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	113,160.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	56,997.30
	シンガポールドル 小計	2,350,000.00	2,451,307.16 (208,017,925)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	324,875.32
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,766.27
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	275,958.49
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	263,973.06
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	278,509.23
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	246,979.17
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	102,794.41
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	536,775.04
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	440,262.06
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	288,051.93
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	123,249.75

	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	271,721.00	
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	801,142.36	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	81,102.58	
	GOV OF MALAYSIA	470,000.00	478,471.51	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	263,830.67	
	GOV OF MALAYSIA	430,000.00	393,763.12	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	218,479.56	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	186,827.01	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	295,679.86	
	GOV OF MALAYSIA	420,000.00	412,561.08	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	224,810.67	
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	354,057.00	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	130,807.99	
	GOV OF MALAYSIA	500,000.00	468,210.39	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	150,591.22	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	187,287.93	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	266,555.05	
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	306,712.86	
	マレーシアリングット 小計	8,380,000.00	8,516,806.59 (231,845,360)	
中国元	GOV OF CHINA	1,040,000.00	1,046,463.80	
	GOV OF CHINA	580,000.00	582,050.88	
	GOV OF CHINA	1,240,000.00	1,256,485.80	
	GOV OF CHINA	1,520,000.00	1,541,611.05	
	GOV OF CHINA	600,000.00	604,242.48	
	GOV OF CHINA	1,580,000.00	1,563,898.22	
	GOV OF CHINA	1,680,000.00	1,723,786.00	
	GOV OF CHINA	1,200,000.00	1,217,694.00	
	GOV OF CHINA	1,090,000.00	1,109,443.31	
	GOV OF CHINA	800,000.00	833,596.72	
	GOV OF CHINA	840,000.00	855,481.20	
	GOV OF CHINA	1,720,000.00	1,709,250.33	
	GOV OF CHINA	1,340,000.00	1,398,728.71	
	GOV OF CHINA	1,250,000.00	1,358,330.12	
	GOV OF CHINA	530,000.00	570,722.55	

		中国元 小計	17,010,000.00	17,371,785.17 (312,803,312)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL		730,000.00	730,182.50
	GOV OF ISRAEL		310,000.00	317,765.50
	GOV OF ISRAEL		390,000.00	430,638.00
	GOV OF ISRAEL		250,000.00	249,612.50
	GOV OF ISRAEL		430,000.00	430,215.00
	GOV OF ISRAEL		280,000.00	292,502.00
	GOV OF ISRAEL		190,000.00	189,544.00
	GOV OF ISRAEL		260,000.00	329,576.00
	GOV OF ISRAEL		380,000.00	407,341.00
	GOV OF ISRAEL		390,000.00	424,125.00
	GOV OF ISRAEL		490,000.00	481,523.00
	GOV OF ISRAEL		350,000.00	328,037.50
	GOV OF ISRAEL		340,000.00	519,996.00
	GOV OF ISRAEL		500,000.00	633,825.00
		イスラエルシュケル 小計	5,290,000.00	5,764,883.00 (207,905,893)
		合計		46,855,044,553 (46,855,044,553)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 248銘柄	100.0%	47.6%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 341銘柄	100.0%	38.8%
英ポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	5.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%

ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
イスラエルシェケル	国債証券	14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。

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,822,484
コール・ローン	162,808,632
投資信託受益証券	6,955,165,055
未収入金	39,180,740
未収配当金	127,170,165
流動資産合計	7,291,147,076
資産合計	7,291,147,076
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,441
未払解約金	191,594,800
未払利息	441
流動負債合計	191,651,682
負債合計	191,651,682
純資産の部	
元本等	
元本	6,592,999,606
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	506,495,788

2022年 1月25日現在

元本等合計	7,099,495,394
純資産合計	7,099,495,394
負債純資産合計	7,291,147,076

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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	4,721,029,528円
期中追加設定元本額	4,277,823,000円
期中一部解約元本額	2,405,852,922円
期末元本額	6,592,999,606円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,031,087,564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	18,103,139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	35,748,145円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	22,584,587円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,064,422円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	20,558,154円
リスクコントロール・オープン	3,233,077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	107,213,700円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,402,579,045円
Smart-i 8資産バランス 安定型	49,580,458円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	140,586,512円
Smart-i 8資産バランス 成長型	161,437,792円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	109,612,098円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	176,622,147円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	108,263,372円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	65,149,128円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	134,295,881円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	22,874,534円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,081,653円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	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)	1,923,562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)	776,339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)	23,256,681円
2. 計算日における受益権の総数	6,592,999,606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	1.0768円
(10,000口当たり純資産額)	(10,768円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額
	が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額
	自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2022年 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		815,290,889

合計	815,290,889
----	-------------

(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 1月25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	39,493,177	-	39,549,618	56,441
	米ドル	39,493,177	-	39,549,618	56,441
合計		39,493,177	-	39,549,618	56,441

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	852,447	42,997,426.68	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	628,532	18,007,441.80	
		米ドル 小計	1,480,979	61,004,868.48 (6,955,165,055)	
	合計			6,955,165,055 (6,955,165,055)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 1月25日現在

資産の部

2022年 1月25日現在

流動資産	
コール・ローン	1,024,779,977
株式	64,994,960,610
未収入金	3,387,000
未収配当金	88,292,161
前払金	18,015,000
差入委託証拠金	30,525,000
流動資産合計	66,159,959,748
資産合計	66,159,959,748
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,355,350
未払解約金	399,209,000
未払利息	2,779
流動負債合計	430,567,129
負債合計	430,567,129
純資産の部	
元本等	
元本	47,369,957,599
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,359,435,020
元本等合計	65,729,392,619
純資産合計	65,729,392,619
負債純資産合計	66,159,959,748

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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	30,730,895,014円
期中追加設定元本額	48,206,865,463円

期中一部解約元本額	31,567,802,878円
期末元本額	47,369,957,599円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,201,640,516円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,842,266,743円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,475,233,060円
DCりそな グローバルバランス	74,010,658円
つみたてバランスファンド	4,127,985,345円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	401,144,554円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	235,030,002円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	157,401,716円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	54,800,498円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	34,179,896円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	18,236,850円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	31,795,735円
リスクコントロール・オープン	9,800,999円
FWりそな国内株式アクティブファンド	309,678,711円
FWりそな国内株式インデックスファンド	25,041,286,185円
Smart-i TOPIXインデックス	1,809,725,695円
Smart-i 8資産バランス 安定型	74,574,942円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	212,377,461円
Smart-i 8資産バランス 成長型	243,741,990円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	168,393,273円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	271,319,248円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	166,309,254円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	100,070,061円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	205,373,037円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,961,681円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	5,358,996円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	523,744,186円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	891,112,849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）	9,712,863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）	5,761,120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）	79,202,813円
2. 計算日における受益権の総数	47,369,957,599口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3876円
(10,000口当たり純資産額)	(13,876円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		634,750,046
合計		634,750,046

(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 1月25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	731,395,350	-	700,040,000	31,355,350
合計		731,395,350	-	700,040,000	31,355,350

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	評価額

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	1,200	3,130.00	3,756,000	
日本水産	34,000	542.00	18,428,000	
マルハニチロ	5,300	2,427.00	12,863,100	
雪国まいたけ	2,500	1,174.00	2,935,000	
カネコ種苗	1,000	1,488.00	1,488,000	
サカタのタネ	4,100	3,305.00	13,550,500	
ホクト	2,900	1,936.00	5,614,400	
ホクリヨウ	500	694.00	347,000	
住石ホールディングス	5,900	135.00	796,500	
日鉄鉱業	800	6,250.00	5,000,000	
三井松島ホールディングス	1,400	1,693.00	2,370,200	
I N P E X	136,500	1,097.00	149,740,500	
石油資源開発	4,000	2,641.00	10,564,000	
K & O エナジーグループ	1,500	1,497.00	2,245,500	
ヒノキヤグループ	700	2,018.00	1,412,600	
ショーボンドホールディングス	4,900	5,070.00	24,843,000	
ミライト・ホールディングス	11,000	1,863.00	20,493,000	
タマホーム	2,100	2,373.00	4,983,300	
サンヨーホームズ	400	737.00	294,800	
日本アクア	1,400	637.00	891,800	
ファーストコーポレーション	1,000	683.00	683,000	
ベステラ	700	1,312.00	918,400	
Robot Home	5,600	221.00	1,237,600	
キャンディル	600	488.00	292,800	
スペースバリューホールディングス	3,200	1,149.00	3,676,800	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,174.00	821,800	
第一カッター興業	800	1,318.00	1,054,400	
安藤・間	16,900	864.00	14,601,600	
東急建設	10,000	696.00	6,960,000	
コムシスホールディングス	11,000	2,736.00	30,096,000	
ピーアールホールディングス	4,600	350.00	1,610,000	
高松コンストラクショングループ	2,100	1,970.00	4,137,000	
東建コーポレーション	1,000	9,380.00	9,380,000	
ソネック	400	1,026.00	410,400	
ヤマウラ	1,600	964.00	1,542,400	

オリエンタル白石	11,400	237.00	2,701,800	
大成建設	22,700	3,735.00	84,784,500	
大林組	78,600	927.00	72,862,200	
清水建設	73,600	770.00	56,672,000	
飛島建設	2,100	1,040.00	2,184,000	
長谷工コーポレーション	23,400	1,443.00	33,766,200	
松井建設	3,100	700.00	2,170,000	
銭高組	300	4,095.00	1,228,500	
鹿島建設	57,600	1,369.00	78,854,400	
不動テトラ	1,700	1,607.00	2,731,900	
大末建設	800	1,291.00	1,032,800	
鉄建建設	1,700	1,815.00	3,085,500	
西松建設	4,800	3,775.00	18,120,000	
三井住友建設	17,700	427.00	7,557,900	
大豊建設	1,100	3,720.00	4,092,000	
佐田建設	1,700	461.00	783,700	
ナカノフドー建設	1,900	332.00	630,800	
奥村組	4,600	3,265.00	15,019,000	
東鉄工業	3,700	2,470.00	9,139,000	
イチケン	600	1,836.00	1,101,600	
富士ピー・エス	1,000	482.00	482,000	
浅沼組	900	5,330.00	4,797,000	
戸田建設	32,600	740.00	24,124,000	
熊谷組	4,000	2,898.00	11,592,000	
北野建設	500	2,130.00	1,065,000	
植木組	700	1,419.00	993,300	
矢作建設工業	3,500	752.00	2,632,000	
ピーエス三菱	2,600	598.00	1,554,800	
日本ハウスホールディングス	5,400	429.00	2,316,600	
大東建託	8,000	13,330.00	106,640,000	
新日本建設	3,300	757.00	2,498,100	
N I P P O	6,000	3,995.00	23,970,000	
東亜道路工業	400	4,890.00	1,956,000	
日本道路	800	8,430.00	6,744,000	
東亜建設工業	1,900	2,404.00	4,567,600	
日本国土開発	7,600	537.00	4,081,200	

若築建設	1,300	1,680.00	2,184,000	
東洋建設	8,800	556.00	4,892,800	
五洋建設	31,200	638.00	19,905,600	
世紀東急工業	3,800	805.00	3,059,000	
福田組	800	4,285.00	3,428,000	
住友林業	20,100	2,031.00	40,823,100	
日本基礎技術	2,200	569.00	1,251,800	
巴コーポレーション	3,500	486.00	1,701,000	
大和ハウス工業	72,600	3,388.00	245,968,800	
ライト工業	4,900	1,888.00	9,251,200	
積水ハウス	85,200	2,345.00	199,794,000	
日特建設	1,600	652.00	1,043,200	
北陸電気工事	1,600	804.00	1,286,400	
ユアテック	4,500	645.00	2,902,500	
日本リーテック	1,600	1,412.00	2,259,200	
四電工	900	1,655.00	1,489,500	
中電工	3,600	2,130.00	7,668,000	
関電工	12,800	871.00	11,148,800	
きんでん	17,600	1,692.00	29,779,200	
東京エネシス	2,600	933.00	2,425,800	
トーエネック	800	3,160.00	2,528,000	
住友電設	1,900	2,022.00	3,841,800	
日本電設工業	4,300	1,483.00	6,376,900	
エクシオグループ	11,800	2,381.00	28,095,800	
新日本空調	2,100	2,048.00	4,300,800	
九電工	6,100	3,350.00	20,435,000	
三機工業	5,100	1,421.00	7,247,100	
日揮ホールディングス	24,200	1,100.00	26,620,000	
中外炉工業	800	1,623.00	1,298,400	
ヤマト	2,300	698.00	1,605,400	
太平電業	1,700	2,728.00	4,637,600	
高砂熱学工業	7,100	1,901.00	13,497,100	
三晃金属工業	300	2,349.00	704,700	
朝日工業社	500	2,914.00	1,457,000	
明星工業	5,100	701.00	3,575,100	
大気社	3,800	2,932.00	11,141,600	

ダイダン	1,700	2,237.00	3,802,900	
日比谷総合設備	2,500	1,890.00	4,725,000	
フィル・カンパニー	400	947.00	378,800	
テスホールディングス	1,400	1,317.00	1,843,800	
インフロニア・ホールディングス	33,500	1,068.00	35,778,000	
東洋エンジニアリング	3,300	650.00	2,145,000	
レイズネクスト	3,800	1,169.00	4,442,200	
ニッポン	7,400	1,666.00	12,328,400	
日清製粉グループ本社	28,400	1,629.00	46,263,600	
日東富士製粉	400	3,725.00	1,490,000	
昭和産業	2,400	2,678.00	6,427,200	
鳥越製粉	2,200	657.00	1,445,400	
中部飼料	2,800	1,008.00	2,822,400	
フィード・ワン	3,400	703.00	2,390,200	
東洋精糖	400	1,030.00	412,000	
日本甜菜製糖	1,300	1,698.00	2,207,400	
D M三井製糖ホールディングス	2,300	1,986.00	4,567,800	
塩水港精糖	3,000	212.00	636,000	
日新製糖	1,200	1,731.00	2,077,200	
森永製菓	5,900	3,685.00	21,741,500	
中村屋	600	3,465.00	2,079,000	
江崎グリコ	6,900	3,780.00	26,082,000	
名糖産業	1,100	1,649.00	1,813,900	
井村屋グループ	1,400	2,242.00	3,138,800	
不二家	1,400	2,245.00	3,143,000	
山崎製パン	18,900	1,624.00	30,693,600	
第一屋製パン	500	540.00	270,000	
モロゾフ	400	5,690.00	2,276,000	
亀田製菓	1,400	4,170.00	5,838,000	
寿スピリッツ	2,400	4,720.00	11,328,000	
カルビー	11,500	2,712.00	31,188,000	
森永乳業	4,700	5,630.00	26,461,000	
六甲バター	1,800	1,496.00	2,692,800	
ヤクルト本社	18,600	5,980.00	111,228,000	
明治ホールディングス	16,600	7,310.00	121,346,000	
雪印メグミルク	6,100	2,061.00	12,572,100	

プリマハム	3,100	2,538.00	7,867,800	
日本ハム	9,600	4,490.00	43,104,000	
林兼産業	800	502.00	401,600	
丸大食品	2,500	1,572.00	3,930,000	
S Foods	2,300	3,275.00	7,532,500	
柿安本店	900	2,534.00	2,280,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	16,200	673.00	10,902,600	
サッポロホールディングス	8,600	2,250.00	19,350,000	
アサヒグループホールディングス	59,200	4,825.00	285,640,000	
キリンホールディングス	92,500	1,879.00	173,807,500	
宝ホールディングス	17,100	1,119.00	19,134,900	
オエノンホールディングス	7,100	333.00	2,364,300	
養命酒製造	800	1,751.00	1,400,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	17,700	1,349.00	23,877,300	
サントリー食品インターナショナル	16,800	4,395.00	73,836,000	
ダイドーグループホールディングス	1,300	4,750.00	6,175,000	
伊藤園	7,600	6,380.00	48,488,000	
キーコーヒー	2,500	2,057.00	5,142,500	
ユニカフェ	800	931.00	744,800	
ジャパンフーズ	400	1,203.00	481,200	
日清オイリオグループ	3,100	3,010.00	9,331,000	
不二製油グループ本社	5,500	2,362.00	12,991,000	
かどや製油	300	4,000.00	1,200,000	
J - オイルミルズ	2,300	1,732.00	3,983,600	
キッコーマン	18,100	8,430.00	152,583,000	
味の素	55,500	3,180.00	176,490,000	
ブルドックソース	1,100	1,961.00	2,157,100	
キューピー	13,200	2,352.00	31,046,400	
ハウス食品グループ本社	9,400	2,993.00	28,134,200	
カゴメ	9,500	3,070.00	29,165,000	
焼津水産化学工業	1,200	913.00	1,095,600	
アリアケジャパン	2,300	6,200.00	14,260,000	
ピエトロ	300	1,791.00	537,300	
エバラ食品工業	500	2,806.00	1,403,000	
やまみ	300	1,623.00	486,900	

ニチレイ	11,500	2,628.00	30,222,000
東洋水産	12,100	4,715.00	57,051,500
イトアンドホールディングス	900	2,314.00	2,082,600
大冷	300	1,909.00	572,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,300	472.00	613,600
日清食品ホールディングス	9,900	8,130.00	80,487,000
永谷園ホールディングス	1,100	1,943.00	2,137,300
一正蒲鉾	1,000	747.00	747,000
フジッコ	2,300	1,948.00	4,480,400
ロック・フィールド	2,700	1,533.00	4,139,100
日本たばこ産業	134,900	2,351.50	317,217,350
ケンコーマヨネーズ	1,400	1,306.00	1,828,400
わらべや日洋ホールディングス	1,600	1,942.00	3,107,200
なとり	1,400	2,009.00	2,812,600
イフジ産業	400	917.00	366,800
ピクルスコーポレーション	1,200	1,563.00	1,875,600
ファーマフーズ	2,400	1,592.00	3,820,800
ユーグレナ	12,800	752.00	9,625,600
紀文食品	1,500	910.00	1,365,000
ミヨシ油脂	1,000	1,144.00	1,144,000
理研ビタミン	2,600	1,700.00	4,420,000
片倉工業	2,700	2,257.00	6,093,900
ゲンゼ	1,700	3,970.00	6,749,000
東洋紡	9,700	1,269.00	12,309,300
ユニチカ	6,700	304.00	2,036,800
富士紡ホールディングス	1,100	3,980.00	4,378,000
倉敷紡績	2,100	1,879.00	3,945,900
シキボウ	1,300	919.00	1,194,700
日本毛織	7,400	897.00	6,637,800
ダイトウボウ	3,900	91.00	354,900
トーア紡コーポレーション	900	405.00	364,500
ダイドーリミテッド	3,200	138.00	441,600
帝国繊維	2,800	1,906.00	5,336,800
帝人	23,100	1,456.00	33,633,600
東レ	177,700	730.80	129,863,160
住江織物	500	1,811.00	905,500

日本フェルト	1,400	440.00	616,000	
イチカワ	300	1,366.00	409,800	
日東製網	300	1,433.00	429,900	
アツギ	1,900	543.00	1,031,700	
ダイニック	900	706.00	635,400	
セーレン	5,000	2,265.00	11,325,000	
ソトー	900	821.00	738,900	
東海染工	300	1,147.00	344,100	
小松マテーレ	4,000	1,199.00	4,796,000	
ワコールホールディングス	6,100	2,118.00	12,919,800	
ホギメディカル	3,300	3,055.00	10,081,500	
クラウディアホールディングス	600	240.00	144,000	
T S Iホールディングス	8,200	323.00	2,648,600	
マツオカコーポレーション	800	1,177.00	941,600	
ワールド	3,200	1,124.00	3,596,800	
三陽商会	1,200	870.00	1,044,000	
ナイガイ	800	283.00	226,400	
オンワードホールディングス	14,800	299.00	4,425,200	
ルックホールディングス	800	1,217.00	973,600	
キムラタン	12,900	18.00	232,200	
ゴールドウイン	4,400	6,060.00	26,664,000	
デサント	4,800	3,775.00	18,120,000	
キング	1,200	525.00	630,000	
ヤマトインターナショナル	2,100	288.00	604,800	
特種東海製紙	1,500	4,120.00	6,180,000	
王子ホールディングス	102,600	602.00	61,765,200	
日本製紙	11,800	1,157.00	13,652,600	
三菱製紙	3,500	312.00	1,092,000	
北越コーポレーション	16,100	729.00	11,736,900	
中越パルプ工業	900	967.00	870,300	
巴川製紙所	700	799.00	559,300	
大王製紙	11,800	1,848.00	21,806,400	
阿波製紙	600	329.00	197,400	
レンゴー	23,200	859.00	19,928,800	
トーモク	1,500	1,734.00	2,601,000	
ザ・バック	1,900	2,688.00	5,107,200	

北の達人コーポレーション	8,800	240.00	2,112,000	
クラレ	35,900	1,027.00	36,869,300	
旭化成	162,700	1,129.50	183,769,650	
共和レザー	1,500	642.00	963,000	
昭和電工	21,300	2,318.00	49,373,400	
住友化学	180,300	572.00	103,131,600	
住友精化	1,100	3,095.00	3,404,500	
日産化学	13,400	6,040.00	80,936,000	
ラサ工業	900	1,557.00	1,401,300	
クレハ	1,900	8,150.00	15,485,000	
多木化学	1,000	5,670.00	5,670,000	
テイカ	1,800	1,284.00	2,311,200	
石原産業	4,100	1,114.00	4,567,400	
片倉コープアグリ	600	1,132.00	679,200	
日本曹達	3,100	3,250.00	10,075,000	
東ソー	35,400	1,765.00	62,481,000	
トクヤマ	7,900	1,843.00	14,559,700	
セントラル硝子	4,000	2,101.00	8,404,000	
東亜合成	14,000	1,131.00	15,834,000	
大阪ソーダ	2,300	2,961.00	6,810,300	
関東電化工業	5,400	1,071.00	5,783,400	
デンカ	9,000	3,940.00	35,460,000	
信越化学工業	42,100	18,135.00	763,483,500	
日本カーバイド工業	900	1,301.00	1,170,900	
堺化学工業	1,700	2,104.00	3,576,800	
第一稀元素化学工業	2,300	1,075.00	2,472,500	
エア・ウォーター	23,200	1,734.00	40,228,800	
日本酸素ホールディングス	23,600	2,347.00	55,389,200	
日本化学工業	800	2,611.00	2,088,800	
東邦アセチレン	400	1,261.00	504,400	
日本パーカライズング	12,400	1,064.00	13,193,600	
高圧ガス工業	3,900	758.00	2,956,200	
チタン工業	300	1,659.00	497,700	
四国化成工業	3,200	1,400.00	4,480,000	
戸田工業	500	3,240.00	1,620,000	
ステラ ケミファ	1,200	2,468.00	2,961,600	

保土谷化学工業	800	5,400.00	4,320,000	
日本触媒	4,100	5,300.00	21,730,000	
大日精化工業	2,000	2,229.00	4,458,000	
カネカ	6,300	3,705.00	23,341,500	
三菱瓦斯化学	22,800	2,106.00	48,016,800	
三井化学	22,300	3,140.00	70,022,000	
J S R	22,900	3,785.00	86,676,500	
東京応化工業	4,200	6,580.00	27,636,000	
大阪有機化学工業	2,100	3,075.00	6,457,500	
三菱ケミカルホールディングス	164,100	882.30	144,785,430	
K H ネオケム	4,000	2,936.00	11,744,000	
ダイセル	35,400	806.00	28,532,400	
住友ベークライト	3,900	5,430.00	21,177,000	
積水化学工業	51,400	1,928.00	99,099,200	
日本ゼオン	22,100	1,300.00	28,730,000	
アイカ工業	6,800	3,270.00	22,236,000	
宇部興産	11,600	2,050.00	23,780,000	
積水樹脂	3,700	2,057.00	7,610,900	
タキロンシーアイ	5,300	558.00	2,957,400	
旭有機材	1,400	1,718.00	2,405,200	
ニチバン	1,500	1,735.00	2,602,500	
リケンテクノス	6,000	480.00	2,880,000	
大倉工業	1,300	1,964.00	2,553,200	
積水化成成品工業	3,300	473.00	1,560,900	
群栄化学工業	600	3,610.00	2,166,000	
タイガースポリマー	1,300	437.00	568,100	
ミライアル	800	1,527.00	1,221,600	
ダイキアクシス	1,000	686.00	686,000	
ダイキョーニシカワ	5,200	600.00	3,120,000	
竹本容器	900	747.00	672,300	
森六ホールディングス	1,300	1,920.00	2,496,000	
恵和	700	5,200.00	3,640,000	
日本化薬	19,300	1,113.00	21,480,900	
カーリットホールディングス	2,400	665.00	1,596,000	
日本精化	2,000	2,159.00	4,318,000	
扶桑化学工業	2,200	4,365.00	9,603,000	

トリケミカル研究所	2,500	3,045.00	7,612,500	
A D E K A	11,300	2,407.00	27,199,100	
日油	8,400	5,250.00	44,100,000	
新日本理化	4,000	244.00	976,000	
ハリマ化成グループ	1,800	808.00	1,454,400	
花王	55,400	5,955.00	329,907,000	
第一工業製薬	900	2,997.00	2,697,300	
石原ケミカル	1,200	1,300.00	1,560,000	
日華化学	800	798.00	638,400	
ニイタカ	500	2,144.00	1,072,000	
三洋化成工業	1,500	5,220.00	7,830,000	
有機合成薬品工業	1,700	267.00	453,900	
大日本塗料	3,000	807.00	2,421,000	
日本ペイントホールディングス	92,200	908.00	83,717,600	
関西ペイント	25,500	2,442.00	62,271,000	
神東塗料	1,900	155.00	294,500	
中国塗料	5,800	916.00	5,312,800	
日本特殊塗料	1,800	859.00	1,546,200	
藤倉化成	3,100	477.00	1,478,700	
太陽ホールディングス	3,600	3,255.00	11,718,000	
D I C	10,400	2,944.00	30,617,600	
サカタインクス	4,900	965.00	4,728,500	
東洋インキ S C ホールディングス	5,200	1,906.00	9,911,200	
T & K T O K A	2,000	791.00	1,582,000	
富士フイルムホールディングス	44,000	7,648.00	336,512,000	
資生堂	46,700	5,875.00	274,362,500	
ライオン	30,300	1,555.00	47,116,500	
高砂香料工業	1,700	2,766.00	4,702,200	
マンダム	5,300	1,378.00	7,303,400	
ミルボン	3,100	5,610.00	17,391,000	
ファンケル	10,100	2,900.00	29,290,000	
コーセー	4,700	10,850.00	50,995,000	
コタ	1,600	1,600.00	2,560,000	
シーボン	300	1,715.00	514,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	10,700	1,773.00	18,971,100	
ノエビアホールディングス	2,100	5,080.00	10,668,000	

アジュバンホールディングス	600	1,056.00	633,600	
新日本製薬	700	1,098.00	768,600	
エステー	1,600	1,514.00	2,422,400	
アグロ カネショウ	800	1,173.00	938,400	
コニシ	4,100	1,656.00	6,789,600	
長谷川香料	4,300	2,421.00	10,410,300	
星光PMC	1,400	645.00	903,000	
小林製薬	7,000	8,800.00	61,600,000	
荒川化学工業	2,100	1,138.00	2,389,800	
メック	1,900	3,145.00	5,975,500	
日本高純度化学	700	2,550.00	1,785,000	
タカラバイオ	6,600	2,291.00	15,120,600	
JCU	2,800	4,890.00	13,692,000	
新田ゼラチン	1,600	656.00	1,049,600	
OATアグリオ	500	1,837.00	918,500	
デクセリアルズ	6,500	3,040.00	19,760,000	
アース製薬	2,100	5,850.00	12,285,000	
北興化学工業	2,300	790.00	1,817,000	
大成ラミック	800	2,727.00	2,181,600	
クミアイ化学工業	9,300	784.00	7,291,200	
日本農薬	4,500	509.00	2,290,500	
アキレス	1,600	1,237.00	1,979,200	
有沢製作所	3,700	1,011.00	3,740,700	
日東電工	15,100	8,810.00	133,031,000	
レック	3,300	889.00	2,933,700	
三光合成	2,600	340.00	884,000	
きもと	3,800	232.00	881,600	
藤森工業	2,200	4,010.00	8,822,000	
前澤化成工業	1,600	1,268.00	2,028,800	
未来工業	900	1,532.00	1,378,800	
ウェーブロックホールディングス	1,000	713.00	713,000	
JSP	1,500	1,600.00	2,400,000	
エフピコ	4,600	3,680.00	16,928,000	
天馬	2,000	2,519.00	5,038,000	
信越ポリマー	4,500	1,018.00	4,581,000	
東リ	6,200	215.00	1,333,000	

ニフコ	8,400	3,755.00	31,542,000	
バルカー	2,000	2,498.00	4,996,000	
ユニ・チャーム	48,300	4,836.00	233,578,800	
ショーエイコーポレーション	700	646.00	452,200	
協和キリン	29,400	2,910.00	85,554,000	
武田薬品工業	197,000	3,282.00	646,554,000	
アステラス製薬	217,300	1,939.50	421,453,350	
大日本住友製薬	15,500	1,349.00	20,909,500	
塩野義製薬	31,500	6,789.00	213,853,500	
わかもと製薬	3,000	295.00	885,000	
日本新薬	6,600	7,600.00	50,160,000	
中外製薬	78,400	3,698.00	289,923,200	
科研製薬	3,900	4,225.00	16,477,500	
エーザイ	30,000	5,893.00	176,790,000	
ロート製薬	12,900	3,195.00	41,215,500	
小野薬品工業	57,600	2,680.00	154,368,000	
久光製薬	6,600	3,590.00	23,694,000	
持田製薬	3,200	3,510.00	11,232,000	
参天製薬	46,700	1,334.00	62,297,800	
扶桑薬品工業	900	2,183.00	1,964,700	
日本ケミファ	300	2,034.00	610,200	
ツムラ	7,800	3,320.00	25,896,000	
日医工	7,800	738.00	5,756,400	
キッセイ薬品工業	4,400	2,298.00	10,111,200	
生化学工業	4,400	939.00	4,131,600	
栄研化学	4,400	1,769.00	7,783,600	
日水製薬	900	990.00	891,000	
鳥居薬品	1,300	2,889.00	3,755,700	
JCRファーマ	7,100	2,048.00	14,540,800	
東和薬品	3,600	2,757.00	9,925,200	
富士製薬工業	1,500	983.00	1,474,500	
ゼリア新薬工業	4,500	1,936.00	8,712,000	
第一三共	196,900	2,606.00	513,121,400	
キョーリン製薬ホールディングス	5,000	1,838.00	9,190,000	
大幸薬品	3,800	599.00	2,276,200	
ダイト	1,600	2,756.00	4,409,600	

大塚ホールディングス	52,100	4,203.00	218,976,300	
大正製薬ホールディングス	6,000	5,580.00	33,480,000	
ペプチドリーム	13,200	2,084.00	27,508,800	
あすか製薬ホールディングス	2,900	977.00	2,833,300	
サワイグループホールディングス	5,500	4,410.00	24,255,000	
日本コークス工業	21,100	129.00	2,721,900	
ニチレキ	3,200	1,280.00	4,096,000	
ユシロ化学工業	1,300	1,099.00	1,428,700	
ビーピー・カストロール	900	1,323.00	1,190,700	
富士石油	6,700	253.00	1,695,100	
MORESCO	800	1,152.00	921,600	
出光興産	27,800	3,250.00	90,350,000	
ENEOSホールディングス	377,000	452.10	170,441,700	
コスモエネルギーホールディングス	7,300	2,302.00	16,804,600	
横浜ゴム	14,500	1,706.00	24,737,000	
TOYO TIRE	13,200	1,634.00	21,568,800	
ブリヂストン	72,200	5,063.00	365,548,600	
住友ゴム工業	22,500	1,197.00	26,932,500	
藤倉コンポジット	2,000	808.00	1,616,000	
オカモト	1,500	4,065.00	6,097,500	
フコク	1,100	989.00	1,087,900	
ニッタ	2,600	2,780.00	7,228,000	
住友理工	4,900	581.00	2,846,900	
三ツ星ベルト	3,000	2,114.00	6,342,000	
バンドー化学	4,000	879.00	3,516,000	
日東紡績	3,700	2,792.00	10,330,400	
A G C	23,000	5,110.00	117,530,000	
日本板硝子	12,000	509.00	6,108,000	
石塚硝子	400	2,078.00	831,200	
日本山村硝子	1,000	783.00	783,000	
日本電気硝子	10,100	2,775.00	28,027,500	
オハラ	1,000	1,061.00	1,061,000	
住友大阪セメント	4,600	3,510.00	16,146,000	
太平洋セメント	14,200	2,298.00	32,631,600	
日本ヒューム	2,500	702.00	1,755,000	
日本コンクリート工業	4,900	281.00	1,376,900	

三谷セキサン	1,200	6,310.00	7,572,000	
アジアパイルホールディングス	3,900	443.00	1,727,700	
東海カーボン	21,000	1,200.00	25,200,000	
日本カーボン	1,300	3,995.00	5,193,500	
東洋炭素	1,600	2,879.00	4,606,400	
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	4,500.00	6,300,000	
TOTO	17,900	4,900.00	87,710,000	
日本碍子	27,100	1,893.00	51,300,300	
日本特殊陶業	19,100	1,954.00	37,321,400	
ダントーホールディングス	1,600	221.00	353,600	
MARUWA	900	14,800.00	13,320,000	
品川リフラクトリーズ	600	3,755.00	2,253,000	
黒崎播磨	400	4,495.00	1,798,000	
ヨータイ	1,600	1,245.00	1,992,000	
イソライト工業	1,000	1,198.00	1,198,000	
東京窯業	3,200	298.00	953,600	
ニッカトー	1,100	676.00	743,600	
フジインコーポレーテッド	2,000	6,730.00	13,460,000	
クニミネ工業	800	1,009.00	807,200	
エーアンドエーマテリアル	400	909.00	363,600	
ニチアス	5,800	2,602.00	15,091,600	
ニチハ	3,500	2,849.00	9,971,500	
日本製鉄	110,900	1,836.00	203,612,400	
神戸製鋼所	46,300	548.00	25,372,400	
中山製鋼所	3,900	427.00	1,665,300	
合同製鐵	1,300	1,386.00	1,801,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	66,900	1,444.00	96,603,600	
東京製鐵	8,400	1,136.00	9,542,400	
共英製鋼	2,800	1,504.00	4,211,200	
大和工業	4,700	3,470.00	16,309,000	
東京鐵鋼	1,100	1,323.00	1,455,300	
大阪製鐵	1,300	1,159.00	1,506,700	
淀川製鋼所	3,300	2,438.00	8,045,400	
丸一鋼管	8,800	2,561.00	22,536,800	
モリ工業	700	2,562.00	1,793,400	
大同特殊鋼	4,100	4,125.00	16,912,500	

日本高周波鋼業	900	347.00	312,300	
日本冶金工業	1,800	2,198.00	3,956,400	
山陽特殊製鋼	2,500	1,948.00	4,870,000	
愛知製鋼	1,400	2,526.00	3,536,400	
日立金属	26,600	2,090.00	55,594,000	
日本金属	600	951.00	570,600	
大太平洋金属	1,500	2,130.00	3,195,000	
新日本電工	16,000	282.00	4,512,000	
栗本鐵工所	1,100	1,541.00	1,695,100	
虹技	300	960.00	288,000	
日本鑄鉄管	300	999.00	299,700	
三菱製鋼	1,600	1,005.00	1,608,000	
日亜鋼業	3,200	279.00	892,800	
日本精線	400	4,580.00	1,832,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,100	1,477.00	1,624,700	
シンニッタン	3,000	221.00	663,000	
新家工業	600	1,619.00	971,400	
大紀アルミニウム工業所	3,700	1,498.00	5,542,600	
日本軽金属ホールディングス	6,300	1,760.00	11,088,000	
三井金属鉱業	6,700	3,135.00	21,004,500	
東邦亜鉛	1,400	2,301.00	3,221,400	
三菱マテリアル	16,400	2,002.00	32,832,800	
住友金属鉱山	31,700	5,088.00	161,289,600	
DOWAホールディングス	6,800	4,890.00	33,252,000	
古河機械金属	4,100	1,267.00	5,194,700	
エス・サイエンス	11,300	23.00	259,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	803.00	2,328,700	
東邦チタニウム	4,400	903.00	3,973,200	
UACJ	3,800	2,538.00	9,644,400	
CKサンエツ	500	4,035.00	2,017,500	
古河電気工業	7,700	2,345.00	18,056,500	
住友電気工業	92,700	1,543.50	143,082,450	
フジクラ	27,600	579.00	15,980,400	
昭和電線ホールディングス	2,200	1,785.00	3,927,000	
東京特殊電線	400	2,861.00	1,144,400	
タツタ電線	4,400	478.00	2,103,200	

カナレ電気	400	1,592.00	636,800
平河ビューテック	1,400	1,121.00	1,569,400
リョービ	3,000	1,106.00	3,318,000
アーレスティ	2,600	378.00	982,800
アサヒホールディングス	9,900	2,068.00	20,473,200
稲葉製作所	1,400	1,290.00	1,806,000
宮地エンジニアリンググループ	800	3,135.00	2,508,000
トーカロ	6,400	1,335.00	8,544,000
アルファC o	1,000	1,121.00	1,121,000
SUMCO	38,100	2,183.00	83,172,300
川田テクノロジーズ	500	3,995.00	1,997,500
RS Technologies	800	5,410.00	4,328,000
ジェイテックコーポレーション	300	1,551.00	465,300
信和	1,500	820.00	1,230,000
東洋製罐グループホールディングス	15,800	1,341.00	21,187,800
ホッカンホールディングス	1,400	1,428.00	1,999,200
コロナ	1,400	883.00	1,236,200
横河ブリッジホールディングス	4,300	2,180.00	9,374,000
駒井ハルテック	500	2,265.00	1,132,500
高田機工	200	2,874.00	574,800
三和ホールディングス	23,400	1,247.00	29,179,800
文化シャッター	7,900	1,064.00	8,405,600
三協立山	3,200	615.00	1,968,000
アルインコ	1,800	942.00	1,695,600
東洋シャッター	500	550.00	275,000
LIXIL	39,000	2,577.00	100,503,000
日本フィルコン	1,700	506.00	860,200
ノーリツ	4,700	1,681.00	7,900,700
長府製作所	2,500	1,992.00	4,980,000
リンナイ	4,700	10,490.00	49,303,000
ダイニチ工業	1,200	708.00	849,600
日東精工	3,100	558.00	1,729,800
三洋工業	300	1,836.00	550,800
岡部	5,000	738.00	3,690,000
ジーテクト	3,100	1,387.00	4,299,700
東プレ	4,600	1,218.00	5,602,800

高周波熱錬	4,400	595.00	2,618,000
東京製鋼	1,500	841.00	1,261,500
サンコール	2,100	570.00	1,197,000
モリテック スチール	1,900	314.00	596,600
パイオラックス	3,600	1,750.00	6,300,000
エイチワン	2,400	663.00	1,591,200
日本発條	22,800	924.00	21,067,200
中央発條	1,200	768.00	921,600
アドバネクス	300	1,400.00	420,000
立川ブラインド工業	1,100	1,052.00	1,157,200
三益半導体工業	1,900	2,332.00	4,430,800
日本ドライケミカル	600	1,837.00	1,102,200
日本製鋼所	7,500	3,680.00	27,600,000
三浦工業	10,700	3,395.00	36,326,500
タクマ	8,400	1,421.00	11,936,400
ツガミ	5,400	1,411.00	7,619,400
オークマ	2,900	4,975.00	14,427,500
芝浦機械	2,800	3,620.00	10,136,000
アマダ	39,100	1,118.00	43,713,800
アイダエンジニアリング	6,500	1,042.00	6,773,000
滝澤鉄工所	700	1,217.00	851,900
F U J I	11,400	2,504.00	28,545,600
牧野フライス製作所	2,700	3,860.00	10,422,000
オーエスジー	11,500	1,995.00	22,942,500
ダイジェット工業	300	988.00	296,400
旭ダイヤモンド工業	6,500	595.00	3,867,500
D M G 森精機	14,700	1,781.00	26,180,700
ソディック	5,500	796.00	4,378,000
ディスコ	3,700	31,250.00	115,625,000
日東工器	1,400	1,675.00	2,345,000
日進工具	1,900	1,401.00	2,661,900
パンチ工業	2,100	488.00	1,024,800
富士ダイス	1,200	618.00	741,600
豊和工業	1,300	775.00	1,007,500
O K K	1,000	1,017.00	1,017,000
石川製作所	600	1,463.00	877,800

東洋機械金属	1,600	503.00	804,800
津田駒工業	500	583.00	291,500
エンシュウ	500	619.00	309,500
島精機製作所	3,600	1,859.00	6,692,400
オプトラン	3,100	2,303.00	7,139,300
NCホールディングス	700	1,556.00	1,089,200
イワキポンプ	1,600	998.00	1,596,800
フリー	2,200	1,209.00	2,659,800
ヤマシンフィルタ	5,000	418.00	2,090,000
日阪製作所	3,100	812.00	2,517,200
やまびこ	4,800	1,053.00	5,054,400
野村マイクロ・サイエンス	700	4,140.00	2,898,000
平田機工	1,200	5,930.00	7,116,000
ペガサスマシン製造	2,500	474.00	1,185,000
マルマエ	1,000	2,421.00	2,421,000
タツモ	1,200	1,307.00	1,568,400
ナプテスコ	14,100	3,425.00	48,292,500
三井海洋開発	2,600	1,138.00	2,958,800
レオン自動機	2,700	1,065.00	2,875,500
S M C	7,300	63,690.00	464,937,000
ホソカワミクロン	1,700	2,997.00	5,094,900
ユニオンツール	900	3,700.00	3,330,000
オイレス工業	3,500	1,609.00	5,631,500
日精エー・エス・ビー機械	800	3,055.00	2,444,000
サトーホールディングス	3,300	2,028.00	6,692,400
技研製作所	2,200	3,915.00	8,613,000
日本エアーテック	1,100	1,059.00	1,164,900
カワタ	800	1,026.00	820,800
日精樹脂工業	1,700	1,025.00	1,742,500
オカダアイオン	800	1,462.00	1,169,600
ワイエイシイホールディングス	1,000	1,113.00	1,113,000
小松製作所	113,600	2,800.00	318,080,000
住友重機械工業	14,300	2,965.00	42,399,500
日立建機	10,000	2,954.00	29,540,000
日工	3,400	616.00	2,094,400
巴工業	1,000	2,133.00	2,133,000

井関農機	2,300	1,322.00	3,040,600	
TOWA	2,100	2,445.00	5,134,500	
丸山製作所	500	1,528.00	764,000	
北川鉄工所	1,100	1,365.00	1,501,500	
ローツェ	1,200	10,140.00	12,168,000	
タカキタ	900	608.00	547,200	
クボタ	122,200	2,418.00	295,479,600	
荏原実業	1,100	2,187.00	2,405,700	
三菱化工機	800	2,129.00	1,703,200	
月島機械	4,600	1,033.00	4,751,800	
帝国電機製作所	1,700	1,376.00	2,339,200	
東京機械製作所	1,000	845.00	845,000	
新東工業	5,500	690.00	3,795,000	
澁谷工業	2,200	2,536.00	5,579,200	
アイチ コーポレーション	3,600	812.00	2,923,200	
小森コーポレーション	6,300	677.00	4,265,100	
鶴見製作所	1,900	1,679.00	3,190,100	
住友精密工業	400	1,901.00	760,400	
日本ギア工業	900	261.00	234,900	
酒井重工業	400	2,650.00	1,060,000	
荏原製作所	10,400	5,580.00	58,032,000	
石井鐵工所	400	2,990.00	1,196,000	
西島製作所	2,300	904.00	2,079,200	
北越工業	2,300	947.00	2,178,100	
ダイキン工業	31,900	24,295.00	775,010,500	
オルガノ	700	8,240.00	5,768,000	
トーヨーカネツ	900	2,477.00	2,229,300	
栗田工業	13,600	4,635.00	63,036,000	
椿本チエイン	3,300	3,135.00	10,345,500	
大同工業	1,100	940.00	1,034,000	
木村化工機	2,100	724.00	1,520,400	
アネスト岩田	3,900	745.00	2,905,500	
ダイフク	13,800	7,940.00	109,572,000	
サムコ	600	2,203.00	1,321,800	
加藤製作所	1,200	830.00	996,000	
油研工業	400	1,733.00	693,200	

タダノ	13,100	1,120.00	14,672,000	
フジテック	9,300	2,688.00	24,998,400	
C K D	7,400	2,018.00	14,933,200	
キトー	2,100	1,724.00	3,620,400	
平和	7,000	1,859.00	13,013,000	
理想科学工業	2,100	2,080.00	4,368,000	
S A N K Y O	5,400	2,973.00	16,054,200	
日本金銭機械	2,500	618.00	1,545,000	
マースグループホールディングス	1,600	1,629.00	2,606,400	
フクシマガリレイ	1,700	4,160.00	7,072,000	
オーイズミ	900	386.00	347,400	
ダイコク電機	1,200	1,219.00	1,462,800	
竹内製作所	3,800	2,818.00	10,708,400	
アマノ	6,600	2,357.00	15,556,200	
J U K I	3,500	773.00	2,705,500	
サンデン	3,500	189.00	661,500	
ジャノメ	2,100	735.00	1,543,500	
マックス	3,300	1,801.00	5,943,300	
グローリー	6,400	2,148.00	13,747,200	
新晃工業	2,300	1,834.00	4,218,200	
大和冷機工業	3,600	1,109.00	3,992,400	
セガサミーホールディングス	24,900	1,900.00	47,310,000	
日本ピストンリング	900	1,309.00	1,178,100	
リケン	1,100	2,601.00	2,861,100	
T P R	3,400	1,445.00	4,913,000	
ツバキ・ナカシマ	5,500	1,372.00	7,546,000	
ホシザキ	7,300	8,350.00	60,955,000	
大豊工業	2,000	788.00	1,576,000	
日本精工	47,200	772.00	36,438,400	
N T N	53,900	228.00	12,289,200	
ジェイテクト	24,000	965.00	23,160,000	
不二越	2,100	4,070.00	8,547,000	
日本トムソン	6,900	599.00	4,133,100	
T H K	14,100	2,798.00	39,451,800	
ユーシン精機	1,900	706.00	1,341,400	
前澤給装工業	1,900	987.00	1,875,300	

イーグル工業	3,100	1,090.00	3,379,000
前澤工業	1,500	617.00	925,500
日本ピラー工業	2,500	3,075.00	7,687,500
キット	8,400	658.00	5,527,200
マキタ	30,500	4,531.00	138,195,500
三井E & Sホールディングス	9,100	354.00	3,221,400
日立造船	21,200	763.00	16,175,600
三菱重工業	39,400	3,022.00	119,066,800
I H I	15,600	2,224.00	34,694,400
サノヤスホールディングス	3,100	126.00	390,600
スター精密	3,800	1,449.00	5,506,200
日清紡ホールディングス	15,300	922.00	14,106,600
イビデン	13,200	5,840.00	77,088,000
コニカミノルタ	54,800	512.00	28,057,600
ブラザー工業	30,600	2,194.00	67,136,400
ミネベアミツミ	43,200	2,656.00	114,739,200
日立製作所	120,500	6,171.00	743,605,500
東芝	43,800	4,661.00	204,151,800
三菱電機	250,600	1,457.00	365,124,200
富士電機	15,100	5,460.00	82,446,000
東洋電機製造	1,000	963.00	963,000
安川電機	27,000	4,815.00	130,005,000
シンフォニアテクノロジー	3,000	1,176.00	3,528,000
明電舎	4,300	2,463.00	10,590,900
オリジン	600	1,232.00	739,200
山洋電気	1,100	5,170.00	5,687,000
デンヨー	2,100	1,680.00	3,528,000
P H Cホールディングス	2,900	1,632.00	4,732,800
東芝テック	2,700	4,200.00	11,340,000
芝浦メカトロニクス	400	8,190.00	3,276,000
マブチモーター	5,900	3,590.00	21,181,000
日本電産	65,000	10,545.00	685,425,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	387.00	425,700
トレックス・セミコンダクター	1,300	2,617.00	3,402,100
東光高岳	1,400	1,371.00	1,919,400
ダブル・スコープ	7,200	826.00	5,947,200

ダイヘン	2,700	4,155.00	11,218,500	
ヤーマン	4,100	898.00	3,681,800	
JVCケンウッド	20,400	175.00	3,570,000	
ミマキエンジニアリング	2,200	738.00	1,623,600	
I - P E X	1,200	1,713.00	2,055,600	
日新電機	5,900	1,446.00	8,531,400	
大崎電気工業	4,600	461.00	2,120,600	
オムロン	20,900	9,199.00	192,259,100	
日東工業	3,300	1,529.00	5,045,700	
I D E C	3,100	2,367.00	7,337,700	
正興電機製作所	800	991.00	792,800	
不二電機工業	500	1,178.00	589,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,200	2,435.00	19,967,000	
サクサホールディングス	600	1,289.00	773,400	
メルコホールディングス	700	3,785.00	2,649,500	
テクノメディカ	600	1,613.00	967,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	700	1,000.00	700,000	
日本電気	31,800	4,920.00	156,456,000	
富士通	22,500	17,655.00	397,237,500	
沖電気工業	10,200	889.00	9,067,800	
岩崎通信機	1,000	813.00	813,000	
電気興業	1,300	2,342.00	3,044,600	
サンケン電気	2,300	4,840.00	11,132,000	
ナカヨ	400	1,177.00	470,800	
アイホン	1,400	2,156.00	3,018,400	
ルネサスエレクトロニクス	135,900	1,250.00	169,875,000	
セイコーエプソン	31,100	1,987.00	61,795,700	
ワコム	19,400	834.00	16,179,600	
アルバック	4,600	5,900.00	27,140,000	
アクセル	1,000	1,068.00	1,068,000	
E I Z O	1,900	3,850.00	7,315,000	
ジャパンディスプレイ	85,200	36.00	3,067,200	
日本信号	6,400	882.00	5,644,800	
京三製作所	5,400	418.00	2,257,200	
能美防災	3,300	2,063.00	6,807,900	

ホーチキ	1,800	1,220.00	2,196,000	
星和電機	1,100	590.00	649,000	
エレコム	5,700	1,394.00	7,945,800	
パナソニック	267,300	1,269.00	339,203,700	
シャープ	28,600	1,246.00	35,635,600	
アンリツ	16,100	1,574.00	25,341,400	
富士通ゼネラル	6,800	2,511.00	17,074,800	
ソニーグループ	157,000	12,480.00	1,959,360,000	
T D K	36,300	4,000.00	145,200,000	
帝国通信工業	1,100	1,318.00	1,449,800	
タムラ製作所	9,700	638.00	6,188,600	
アルプスアルパイン	22,200	1,075.00	23,865,000	
池上通信機	700	636.00	445,200	
日本電波工業	2,300	1,248.00	2,870,400	
鈴木	1,100	834.00	917,400	
メイコー	2,000	3,760.00	7,520,000	
日本トリム	500	2,966.00	1,483,000	
ローランド ディー . ジー .	1,500	2,760.00	4,140,000	
フォスター電機	2,500	737.00	1,842,500	
S M K	600	2,123.00	1,273,800	
ヨコオ	1,900	2,501.00	4,751,900	
ティアック	4,000	155.00	620,000	
ホシデン	6,000	1,110.00	6,660,000	
ヒロセ電機	3,900	17,110.00	66,729,000	
日本航空電子工業	5,700	1,863.00	10,619,100	
T O A	2,700	791.00	2,135,700	
マクセル	5,000	1,285.00	6,425,000	
古野電気	3,000	1,001.00	3,003,000	
ユニデンホールディングス	500	3,455.00	1,727,500	
スミダコーポレーション	2,300	994.00	2,286,200	
アイコム	900	2,315.00	2,083,500	
リオン	1,000	2,054.00	2,054,000	
本多通信工業	1,900	412.00	782,800	
横河電機	25,100	1,915.00	48,066,500	
新電元工業	1,000	3,285.00	3,285,000	
アズビル	14,700	4,480.00	65,856,000	

東亜ディーケーケー	1,200	885.00	1,062,000	
日本光電工業	10,400	3,075.00	31,980,000	
チノー	800	1,604.00	1,283,200	
共和電業	2,400	375.00	900,000	
日本電子材料	1,300	2,326.00	3,023,800	
堀場製作所	4,600	6,070.00	27,922,000	
アドバンテスト	18,600	9,450.00	175,770,000	
小野測器	1,000	480.00	480,000	
エスベック	2,000	2,008.00	4,016,000	
キーエンス	22,700	58,780.00	1,334,306,000	
日置電機	1,200	7,110.00	8,532,000	
シスメックス	21,200	10,660.00	225,992,000	
日本マイクロニクス	4,400	1,519.00	6,683,600	
メガチップス	2,300	4,315.00	9,924,500	
OBARA GROUP	1,100	3,260.00	3,586,000	
澤藤電機	300	1,516.00	454,800	
原田工業	1,200	950.00	1,140,000	
コーセル	3,100	803.00	2,489,300	
イリソ電子工業	2,100	4,500.00	9,450,000	
オブテックスグループ	4,100	1,508.00	6,182,800	
千代田インテグレ	1,100	1,790.00	1,969,000	
アイ・オー・データ機器	900	729.00	656,100	
レーザーテック	11,000	26,035.00	286,385,000	
スタンレー電気	17,500	2,727.00	47,722,500	
岩崎電気	900	2,260.00	2,034,000	
ウシオ電機	12,800	1,794.00	22,963,200	
岡谷電機産業	1,800	316.00	568,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,100	289.00	606,900	
エノモト	700	1,685.00	1,179,500	
日本セラミック	2,300	2,436.00	5,602,800	
遠藤照明	1,100	960.00	1,056,000	
古河電池	1,800	1,238.00	2,228,400	
双信電機	1,200	637.00	764,400	
山一電機	1,800	1,989.00	3,580,200	
図研	1,600	2,912.00	4,659,200	
日本電子	5,200	6,230.00	32,396,000	

カシオ計算機	18,100	1,457.00	26,371,700
ファナック	22,000	22,920.00	504,240,000
日本シイエムケイ	4,900	536.00	2,626,400
エンプラス	600	2,801.00	1,680,600
大真空	3,400	1,209.00	4,110,600
ローム	11,200	9,600.00	107,520,000
浜松ホトニクス	18,000	5,830.00	104,940,000
三井ハイテック	2,500	8,190.00	20,475,000
新光電気工業	7,400	4,675.00	34,595,000
京セラ	35,300	6,899.00	243,534,700
太陽誘電	12,200	5,530.00	67,466,000
村田製作所	73,600	8,553.00	629,500,800
双葉電子工業	4,300	680.00	2,924,000
北陸電気工業	900	1,211.00	1,089,900
ニチコン	7,900	1,162.00	9,179,800
日本ケミコン	2,400	1,605.00	3,852,000
K O A	3,800	1,379.00	5,240,200
市光工業	3,000	507.00	1,521,000
小糸製作所	13,800	6,050.00	83,490,000
ミツバ	4,600	393.00	1,807,800
S C R E E Nホールディングス	4,300	11,220.00	48,246,000
キャノン電子	2,300	1,557.00	3,581,100
キャノン	124,500	2,852.50	355,136,250
リコー	69,600	1,050.00	73,080,000
象印マホービン	6,800	1,392.00	9,465,600
M U T O Hホールディングス	300	2,098.00	629,400
東京エレクトロン	15,900	56,870.00	904,233,000
トヨタ紡織	10,200	2,094.00	21,358,800
芦森工業	500	928.00	464,000
ユニプレス	3,700	823.00	3,045,100
豊田自動織機	20,300	8,950.00	181,685,000
モリタホールディングス	4,000	1,274.00	5,096,000
三櫻工業	3,500	824.00	2,884,000
デンソー	55,200	8,688.00	479,577,600
東海理化電機製作所	6,600	1,486.00	9,807,600
川崎重工業	18,300	2,203.00	40,314,900

名村造船所	7,500	188.00	1,410,000	
日本車輛製造	900	2,029.00	1,826,100	
三菱ロジスネクスト	3,300	1,005.00	3,316,500	
近畿車輛	400	1,016.00	406,400	
日産自動車	295,600	605.40	178,956,240	
いすゞ自動車	78,600	1,386.00	108,939,600	
トヨタ自動車	1,269,400	2,236.50	2,839,013,100	
日野自動車	31,300	962.00	30,110,600	
三菱自動車工業	92,800	310.00	28,768,000	
エフテック	1,700	543.00	923,100	
レシップホールディングス	1,000	530.00	530,000	
G M B	500	805.00	402,500	
ファルテック	400	694.00	277,600	
武蔵精密工業	5,600	1,773.00	9,928,800	
日産車体	3,700	673.00	2,490,100	
新明和工業	7,100	885.00	6,283,500	
極東開発工業	4,700	1,426.00	6,702,200	
トピー工業	2,100	1,089.00	2,286,900	
ティラド	700	2,653.00	1,857,100	
曙ブレーキ工業	13,700	175.00	2,397,500	
タチエス	4,400	1,198.00	5,271,200	
N O K	12,100	1,226.00	14,834,600	
フタバ産業	6,300	420.00	2,646,000	
K Y B	2,600	2,980.00	7,748,000	
大同メタル工業	4,800	622.00	2,985,600	
プレス工業	12,400	379.00	4,699,600	
ミクニ	3,200	437.00	1,398,400	
太平洋工業	5,200	1,107.00	5,756,400	
河西工業	3,100	295.00	914,500	
アイシン	18,300	4,310.00	78,873,000	
マツダ	78,700	892.00	70,200,400	
今仙電機製作所	1,600	577.00	923,200	
本田技研工業	197,300	3,399.00	670,622,700	
スズキ	57,300	4,609.00	264,095,700	
S U B A R U	71,800	2,069.00	148,554,200	
安永	1,200	851.00	1,021,200	

ヤマハ発動機	32,700	2,736.00	89,467,200
T B K	2,700	401.00	1,082,700
エクセディ	3,800	1,699.00	6,456,200
豊田合成	8,100	2,398.00	19,423,800
愛三工業	3,900	680.00	2,652,000
盟和産業	400	1,010.00	404,000
日本プラスト	2,000	542.00	1,084,000
ヨロズ	2,300	994.00	2,286,200
エフ・シー・シー	4,100	1,468.00	6,018,800
シマノ	10,100	26,840.00	271,084,000
テイ・エス テック	10,600	1,447.00	15,338,200
ジャムコ	1,500	825.00	1,237,500
テルモ	70,900	4,161.00	295,014,900
クリエートメディック	800	970.00	776,000
日機装	7,500	840.00	6,300,000
日本エム・ディ・エム	1,400	1,555.00	2,177,000
島津製作所	32,300	4,055.00	130,976,500
J M S	2,100	604.00	1,268,400
クボテック	500	275.00	137,500
長野計器	1,800	1,284.00	2,311,200
ブイ・テクノロジー	1,100	3,390.00	3,729,000
東京計器	1,600	1,006.00	1,609,600
愛知時計電機	400	5,470.00	2,188,000
インターアクション	1,300	1,938.00	2,519,400
オーバル	2,200	253.00	556,600
東京精密	4,200	4,810.00	20,202,000
マニー	10,000	1,643.00	16,430,000
ニコン	38,300	1,225.00	46,917,500
トプコン	11,800	1,346.00	15,882,800
オリンパス	131,400	2,443.00	321,010,200
理研計器	2,000	5,370.00	10,740,000
タムロン	1,900	2,535.00	4,816,500
H O Y A	48,900	14,240.00	696,336,000
シード	1,200	518.00	621,600
ノーリツ鋼機	2,300	2,132.00	4,903,600
エー・アンド・デイ	2,300	982.00	2,258,600

朝日インテック	27,500	2,013.00	55,357,500	
シチズン時計	29,400	485.00	14,259,000	
リズム	800	1,233.00	986,400	
大研医器	2,000	519.00	1,038,000	
メニコン	8,300	2,666.00	22,127,800	
シンシア	300	483.00	144,900	
松風	1,000	1,808.00	1,808,000	
セイコーホールディングス	3,500	2,111.00	7,388,500	
ニプロ	18,700	1,056.00	19,747,200	
中本パックス	700	1,718.00	1,202,600	
スノーピーク	3,300	2,258.00	7,451,400	
パラマウントベッドホールディングス	4,800	1,931.00	9,268,800	
トランザクション	1,400	1,055.00	1,477,000	
粧美堂	700	390.00	273,000	
ニホンフラッシュ	2,100	1,021.00	2,144,100	
前田工織	2,800	3,405.00	9,534,000	
永大産業	3,300	302.00	996,600	
アートネイチャー	2,100	699.00	1,467,900	
バンダイナムコホールディングス	22,500	7,875.00	177,187,500	
アイフィスジャパン	600	659.00	395,400	
共立印刷	4,200	149.00	625,800	
SHOEI	2,400	4,060.00	9,744,000	
フランスベッドホールディングス	3,200	885.00	2,832,000	
パイロットコーポレーション	4,200	4,090.00	17,178,000	
萩原工業	1,600	1,193.00	1,908,800	
フジシールインターナショナル	6,100	2,180.00	13,298,000	
タカラトミー	10,500	1,113.00	11,686,500	
広済堂ホールディングス	1,600	744.00	1,190,400	
エステールホールディングス	600	635.00	381,000	
タカノ	900	650.00	585,000	
プロネクサス	1,900	1,088.00	2,067,200	
ホクシン	1,800	160.00	288,000	
ウッドワン	800	1,001.00	800,800	
大建工業	1,500	2,098.00	3,147,000	
凸版印刷	38,100	2,153.00	82,029,300	
大日本印刷	29,600	2,835.00	83,916,000	

共同印刷	700	2,727.00	1,908,900	
N I S S H A	5,100	1,425.00	7,267,500	
光村印刷	200	1,370.00	274,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,200	1,805.00	2,166,000	
アシックス	22,200	2,160.00	47,952,000	
ツツミ	600	1,766.00	1,059,600	
ローランド	1,700	4,010.00	6,817,000	
小松ウオール工業	800	1,885.00	1,508,000	
ヤマハ	14,900	5,160.00	76,884,000	
河合楽器製作所	700	3,050.00	2,135,000	
クリナップ	2,300	528.00	1,214,400	
ピジョン	15,100	2,399.00	36,224,900	
兼松サステック	200	1,617.00	323,400	
キングジム	2,000	885.00	1,770,000	
リンテック	5,400	2,640.00	14,256,000	
イトーキ	4,600	341.00	1,568,600	
任天堂	14,100	53,950.00	760,695,000	
三菱鉛筆	4,100	1,182.00	4,846,200	
タカラスタANDARD	5,200	1,365.00	7,098,000	
コクヨ	12,000	1,663.00	19,956,000	
ナカバヤシ	2,200	510.00	1,122,000	
グローブライド	2,200	2,749.00	6,047,800	
オカムラ	8,600	1,202.00	10,337,200	
美津濃	2,500	2,167.00	5,417,500	
東京電力ホールディングス	187,600	304.00	57,030,400	
中部電力	76,700	1,252.00	96,028,400	
関西電力	95,000	1,104.00	104,880,000	
中国電力	39,200	949.00	37,200,800	
北陸電力	22,900	593.00	13,579,700	
東北電力	58,700	829.00	48,662,300	
四国電力	22,600	823.00	18,599,800	
九州電力	51,700	869.00	44,927,300	
北海道電力	21,800	504.00	10,987,200	
沖縄電力	5,300	1,440.00	7,632,000	
電源開発	21,400	1,501.00	32,121,400	
エフオン	1,500	523.00	784,500	

イーレックス	3,700	1,512.00	5,594,400
レノバ	4,900	1,712.00	8,388,800
東京瓦斯	48,000	2,224.00	106,752,000
大阪瓦斯	45,400	1,950.00	88,530,000
東邦瓦斯	11,500	2,955.00	33,982,500
北海道瓦斯	1,200	1,492.00	1,790,400
広島ガス	4,800	361.00	1,732,800
西部ガスホールディングス	2,800	2,182.00	6,109,600
静岡ガス	6,500	985.00	6,402,500
メタウォーター	2,600	1,860.00	4,836,000
SBSホールディングス	1,900	3,510.00	6,669,000
東武鉄道	24,500	2,698.00	66,101,000
相鉄ホールディングス	8,000	2,124.00	16,992,000
東急	63,200	1,519.00	96,000,800
京浜急行電鉄	32,200	1,172.00	37,738,400
小田急電鉄	37,300	2,079.00	77,546,700
京王電鉄	13,000	5,270.00	68,510,000
京成電鉄	17,400	3,080.00	53,592,000
富士急行	3,000	4,110.00	12,330,000
新京成電鉄	600	2,005.00	1,203,000
東日本旅客鉄道	44,100	6,702.00	295,558,200
西日本旅客鉄道	30,400	4,849.00	147,409,600
東海旅客鉄道	20,800	14,920.00	310,336,000
西武ホールディングス	32,700	1,136.00	37,147,200
鴻池運輸	4,000	1,153.00	4,612,000
西日本鉄道	6,900	2,585.00	17,836,500
ハマキョウレックス	1,800	2,856.00	5,140,800
サカイ引越センター	1,200	4,455.00	5,346,000
近鉄グループホールディングス	23,700	3,345.00	79,276,500
阪急阪神ホールディングス	29,700	3,345.00	99,346,500
南海電気鉄道	10,600	2,249.00	23,839,400
京阪ホールディングス	10,600	2,658.00	28,174,800
神戸電鉄	600	3,180.00	1,908,000
名古屋鉄道	19,500	1,839.00	35,860,500
山陽電気鉄道	1,800	1,968.00	3,542,400
アルプス物流	1,700	1,008.00	1,713,600

ヤマトホールディングス	33,300	2,417.00	80,486,100	
山九	6,200	4,590.00	28,458,000	
丸運	1,300	241.00	313,300	
丸全昭和運輸	1,900	3,070.00	5,833,000	
センコーグループホールディングス	11,900	918.00	10,924,200	
トナミホールディングス	600	3,760.00	2,256,000	
ニッコンホールディングス	8,000	2,139.00	17,112,000	
日本石油輸送	300	2,632.00	789,600	
福山通運	3,900	3,640.00	14,196,000	
セイノーホールディングス	16,200	1,128.00	18,273,600	
エスライン	700	880.00	616,000	
神奈川中央交通	600	3,305.00	1,983,000	
日立物流	4,600	5,270.00	24,242,000	
丸和運輸機関	5,000	1,358.00	6,790,000	
C & F ロジホールディングス	2,400	1,369.00	3,285,600	
九州旅客鉄道	18,400	2,371.00	43,626,400	
S Gホールディングス	44,800	2,383.00	106,758,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	8,200	6,710.00	55,022,000	
日本郵船	19,800	8,150.00	161,370,000	
商船三井	13,100	8,040.00	105,324,000	
川崎汽船	7,300	6,500.00	47,450,000	
NSユナイテッド海運	1,300	2,900.00	3,770,000	
明治海運	2,800	692.00	1,937,600	
飯野海運	11,000	513.00	5,643,000	
共栄タンカー	400	873.00	349,200	
乾汽船	1,600	2,226.00	3,561,600	
日本航空	54,400	2,137.00	116,252,800	
ANAホールディングス	60,300	2,385.50	143,845,650	
パスコ	400	1,291.00	516,400	
ランコム	700	8,200.00	5,740,000	
日新	1,900	1,584.00	3,009,600	
三菱倉庫	7,500	2,735.00	20,512,500	
三井倉庫ホールディングス	2,500	2,341.00	5,852,500	
住友倉庫	8,400	1,996.00	16,766,400	
澁澤倉庫	1,400	2,116.00	2,962,400	

東陽倉庫	4,000	314.00	1,256,000	
日本トランスシティ	5,200	642.00	3,338,400	
ケイヒン	400	1,314.00	525,600	
中央倉庫	1,400	979.00	1,370,600	
川西倉庫	400	1,082.00	432,800	
安田倉庫	1,900	964.00	1,831,600	
ファイズホールディングス	500	534.00	267,000	
東洋埠頭	700	1,428.00	999,600	
宇徳	1,600	723.00	1,156,800	
上組	13,100	2,216.00	29,029,600	
サンリツ	700	826.00	578,200	
キムラユニティー	600	1,258.00	754,800	
キューソー流通システム	1,200	838.00	1,005,600	
近鉄エクスプレス	4,500	2,777.00	12,496,500	
東海運	1,300	303.00	393,900	
エーアイティー	1,500	1,472.00	2,208,000	
内外トランスライン	900	1,834.00	1,650,600	
日本コンセプト	800	1,317.00	1,053,600	
NEC ネットズエスアイ	8,100	1,735.00	14,053,500	
クロスキャット	600	1,400.00	840,000	
システナ	35,100	349.00	12,249,900	
デジタルアーツ	1,300	6,660.00	8,658,000	
日鉄ソリューションズ	3,600	3,325.00	11,970,000	
キューブシステム	1,200	927.00	1,112,400	
WOW WORLD	300	1,455.00	436,500	
コア	1,000	1,499.00	1,499,000	
ラクーンホールディングス	1,700	1,161.00	1,973,700	
ソリトンシステムズ	1,200	1,286.00	1,543,200	
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	3,640.00	4,004,000	
T I S	23,500	3,050.00	71,675,000	
J N S ホールディングス	1,100	404.00	444,400	
グリー	15,100	851.00	12,850,100	
G M O ペパボ	300	2,192.00	657,600	
コーエーテクモホールディングス	7,800	3,940.00	30,732,000	
三菱総合研究所	1,100	3,800.00	4,180,000	
ボルテージ	700	337.00	235,900	

電算	300	2,259.00	677,700	
A G S	1,200	850.00	1,020,000	
ファインデックス	2,100	903.00	1,896,300	
ブレインパッド	1,900	1,092.00	2,074,800	
K L a b	4,500	438.00	1,971,000	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	3,600	905.00	3,258,000	
ネクソン	55,500	2,050.00	113,775,000	
アイスタイル	7,500	200.00	1,500,000	
エムアップホールディングス	2,800	733.00	2,052,400	
エイチーム	1,700	731.00	1,242,700	
エニグモ	2,700	605.00	1,633,500	
テクノスジャパン	1,900	477.00	906,300	
e n i s h	1,500	353.00	529,500	
コロブラ	8,100	651.00	5,273,100	
オルトプラス	1,900	299.00	568,100	
ブロードリーフ	12,200	356.00	4,343,200	
クロス・マーケティンググループ	900	793.00	713,700	
デジタルハーツホールディングス	1,100	1,673.00	1,840,300	
システム情報	1,800	876.00	1,576,800	
メディアドゥ	900	2,611.00	2,349,900	
じげん	6,900	279.00	1,925,100	
バイキューブ	2,500	803.00	2,007,500	
エンカレッジ・テクノロジー	500	534.00	267,000	
サイバーリンクス	800	852.00	681,600	
ディー・エル・イー	1,600	223.00	356,800	
フィックスターズ	2,600	750.00	1,950,000	
C A R T A H O L D I N G S	1,000	1,854.00	1,854,000	
オブティム	1,700	1,007.00	1,711,900	
セレス	900	1,863.00	1,676,700	
S H I F T	1,200	18,560.00	22,272,000	
ティーガイア	2,200	1,666.00	3,665,200	
セック	400	2,205.00	882,000	
テクマトリックス	4,200	1,691.00	7,102,200	
プロシップ	800	1,380.00	1,104,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,700	2,385.00	15,979,500	

GMOペイメントゲートウェイ	4,800	10,110.00	48,528,000	
ザッパラス	1,000	491.00	491,000	
システムリサーチ	700	1,754.00	1,227,800	
インターネットイニシアティブ	6,600	3,865.00	25,509,000	
さくらインターネット	2,600	500.00	1,300,000	
ヴィンクス	700	854.00	597,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	3,475.00	1,737,500	
SRAホールディングス	1,200	2,758.00	3,309,600	
システムインテグレータ	800	506.00	404,800	
朝日ネット	2,200	593.00	1,304,600	
eBASE	2,900	516.00	1,496,400	
アバント	2,600	990.00	2,574,000	
アドソル日進	900	1,607.00	1,446,300	
ODKソリューションズ	500	630.00	315,000	
フリービット	1,500	879.00	1,318,500	
コムチュア	2,800	2,761.00	7,730,800	
サイバーコム	400	1,052.00	420,800	
アステリア	1,800	854.00	1,537,200	
アイル	1,400	1,209.00	1,692,600	
マークラインズ	1,200	2,502.00	3,002,400	
メディカル・データ・ビジョン	3,100	1,056.00	3,273,600	
gumi	3,400	556.00	1,890,400	
ショーケース	500	451.00	225,500	
モバイルファクトリー	600	795.00	477,000	
テラスカイ	900	1,446.00	1,301,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,176.00	1,293,600	
PCIホールディングス	1,100	1,002.00	1,102,200	
パイプドHD	400	2,340.00	936,000	
アイピーシー	400	637.00	254,800	
ネオジャパン	700	1,092.00	764,400	
PR TIMES	500	2,714.00	1,357,000	
ラクス	8,500	2,405.00	20,442,500	
ランドコンピュータ	600	820.00	492,000	
ダブルスタンダード	700	2,392.00	1,674,400	
オープンドア	1,500	1,448.00	2,172,000	

マイネット	900	469.00	422,100
アカツキ	1,100	2,647.00	2,911,700
ベネフィットジャパン	200	2,090.00	418,000
Ubicomホールディングス	600	2,091.00	1,254,600
カナミックネットワーク	2,600	442.00	1,149,200
ノムラシステムコーポレーション	1,200	247.00	296,400
チェンジ	4,500	1,424.00	6,408,000
シンクロ・フード	1,200	289.00	346,800
オークネット	1,300	1,500.00	1,950,000
キャピタル・アセット・プランニング	500	704.00	352,000
セグエグループ	600	611.00	366,600
エイトレッド	300	2,032.00	609,600
マクロミル	5,000	1,071.00	5,355,000
ビーグリー	600	1,090.00	654,000
オロ	800	2,361.00	1,888,800
ユーザーローカル	700	1,442.00	1,009,400
テモナ	500	398.00	199,000
ニーズウェル	600	586.00	351,600
マネーフォワード	3,700	4,835.00	17,889,500
サインポスト	800	861.00	688,800
電算システムホールディングス	1,000	2,624.00	2,624,000
ソルクシーズ	2,100	408.00	856,800
フェイス	600	651.00	390,600
プロトコーポレーション	2,600	1,315.00	3,419,000
ハイマックス	700	1,134.00	793,800
野村総合研究所	47,500	4,145.00	196,887,500
サイバネットシステム	1,700	644.00	1,094,800
CEホールディングス	1,300	463.00	601,900
日本システム技術	500	2,212.00	1,106,000
インテージホールディングス	3,100	1,731.00	5,366,100
東邦システムサイエンス	600	958.00	574,800
ソースネクスト	10,500	158.00	1,659,000
インフォコム	2,700	1,858.00	5,016,600
シンプレクス・ホールディングス	2,600	2,299.00	5,977,400
HEROZ	700	1,012.00	708,400
ラクスル	2,700	3,750.00	10,125,000

I P S	700	1,776.00	1,243,200	
F I G	2,700	268.00	723,600	
システムサポート	700	972.00	680,400	
イーソル	1,500	525.00	787,500	
アルテリア・ネットワークス	3,100	1,340.00	4,154,000	
E d u L a b	200	722.00	144,400	
東海ソフト	400	889.00	355,600	
ウイングアーク1 s t	1,400	1,305.00	1,827,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	2,032.00	1,219,200	
サーバーワークス	400	2,352.00	940,800	
東名	200	906.00	181,200	
ヴィッツ	200	1,286.00	257,200	
トビラシステムズ	500	789.00	394,500	
S a n s a n	8,700	1,424.00	12,388,800	
L i n k - U	400	715.00	286,000	
ギフトィ	2,200	1,257.00	2,765,400	
ベース	400	3,950.00	1,580,000	
J M D C	2,300	5,440.00	12,512,000	
フォーカスシステムズ	1,600	901.00	1,441,600	
クレスコ	1,800	1,785.00	3,213,000	
フジ・メディア・ホールディングス	23,700	1,156.00	27,397,200	
オービック	7,700	18,200.00	140,140,000	
ジャストシステム	3,500	4,825.00	16,887,500	
T D C ソフト	2,100	999.00	2,097,900	
Zホールディングス	357,400	561.20	200,572,880	
トレンドマイクロ	13,100	5,910.00	77,421,000	
I Dホールディングス	1,500	843.00	1,264,500	
日本オラクル	5,000	8,720.00	43,600,000	
アルファシステムズ	700	3,575.00	2,502,500	
フューチャー	5,200	1,500.00	7,800,000	
C A C H o l d i n g s	1,400	1,334.00	1,867,600	
S Bテクノロジー	1,100	2,290.00	2,519,000	
トーセ	700	704.00	492,800	
オービックビジネスコンサルタント	2,300	4,300.00	9,890,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	11,200	3,250.00	36,400,000	

アイティフォー	3,000	773.00	2,319,000	
東計電算	300	4,730.00	1,419,000	
エクスネット	400	960.00	384,000	
大塚商会	13,300	4,680.00	62,244,000	
サイボウズ	3,300	1,411.00	4,656,300	
電通国際情報サービス	3,600	3,445.00	12,402,000	
A C C E S S	2,800	566.00	1,584,800	
デジタルガレージ	4,100	4,305.00	17,650,500	
E Mシステムズ	4,100	647.00	2,652,700	
ウェザーニューズ	700	7,540.00	5,278,000	
C I J	1,600	822.00	1,315,200	
ビジネスエンジニアリング	300	3,585.00	1,075,500	
日本エンタープライズ	2,500	166.00	415,000	
WOWOW	1,200	1,681.00	2,017,200	
スカラ	2,200	656.00	1,443,200	
インテリジェント ウェイブ	1,400	512.00	716,800	
I M A G I C A G R O U P	2,100	571.00	1,199,100	
ネットワンシステムズ	9,400	2,823.00	26,536,200	
システムソフト	5,300	101.00	535,300	
アルゴグラフィックス	1,900	3,330.00	6,327,000	
マーベラス	3,900	726.00	2,831,400	
エイベックス	4,200	1,280.00	5,376,000	
日本ユニシス	7,700	3,045.00	23,446,500	
兼松エレクトロニクス	1,300	3,830.00	4,979,000	
都築電気	1,300	1,597.00	2,076,100	
T B Sホールディングス	15,000	1,697.00	25,455,000	
日本テレビホールディングス	20,500	1,215.00	24,907,500	
朝日放送グループホールディングス	2,400	699.00	1,677,600	
テレビ朝日ホールディングス	5,900	1,505.00	8,879,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	20,800	433.00	9,006,400	
テレビ東京ホールディングス	1,800	1,982.00	3,567,600	
日本BS放送	800	1,110.00	888,000	
ビジョン	4,200	934.00	3,922,800	
スマートバリュー	600	470.00	282,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,300	2,424.00	5,575,200	
ワイヤレスゲート	1,000	299.00	299,000	

コネクシオ	1,700	1,400.00	2,380,000	
日本通信	20,500	164.00	3,362,000	
クロップス	400	904.00	361,600	
日本電信電話	257,300	3,284.00	844,973,200	
K D D I	179,300	3,653.00	654,982,900	
ソフトバンク	372,500	1,450.00	540,125,000	
光通信	2,900	14,270.00	41,383,000	
エムティーアイ	2,400	563.00	1,351,200	
G M Oインターネット	8,700	2,409.00	20,958,300	
ファイバーゲート	800	1,060.00	848,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	279.00	139,500	
K A D O K A W A	13,400	2,367.00	31,717,800	
学研ホールディングス	3,500	1,024.00	3,584,000	
ゼンリン	4,000	960.00	3,840,000	
昭文社ホールディングス	1,000	436.00	436,000	
インプレスホールディングス	2,000	205.00	410,000	
アイネット	1,300	1,261.00	1,639,300	
松竹	1,600	11,810.00	18,896,000	
東宝	14,500	4,480.00	64,960,000	
東映	800	15,990.00	12,792,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	65,500	2,176.00	142,528,000	
ピー・シー・エー	1,400	1,517.00	2,123,800	
ビジネスブレイン太田昭和	800	1,696.00	1,356,800	
D T S	4,700	2,565.00	12,055,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,400	5,550.00	63,270,000	
シーイーシー	2,600	1,069.00	2,779,400	
カブコン	23,200	2,592.00	60,134,400	
アイ・エス・ピー	1,100	919.00	1,010,900	
ジャステック	1,400	1,038.00	1,453,200	
S C S K	17,000	1,954.00	33,218,000	
日本システムウエア	900	2,134.00	1,920,600	
アイネス	2,200	1,520.00	3,344,000	
T K C	4,200	3,015.00	12,663,000	
富士ソフト	2,600	4,910.00	12,766,000	
N S D	7,900	1,955.00	15,444,500	
コナミホールディングス	8,900	5,910.00	52,599,000	

福井コンピュータホールディングス	1,100	2,928.00	3,220,800	
J B C Cホールディングス	1,700	1,615.00	2,745,500	
ミロク情報サービス	2,200	1,181.00	2,598,200	
ソフトバンクグループ	147,500	5,069.00	747,677,500	
ハウスイ	200	809.00	161,800	
高千穂交易	900	1,484.00	1,335,600	
オルパヘルスケアホールディングス	400	1,375.00	550,000	
伊藤忠食品	600	4,960.00	2,976,000	
エレマテック	2,000	1,020.00	2,040,000	
J A L U X	600	2,548.00	1,528,800	
あらた	2,000	4,050.00	8,100,000	
トーメンデバイス	400	6,130.00	2,452,000	
東京エレクトロン デバイス	700	5,490.00	3,843,000	
フィールズ	2,200	479.00	1,053,800	
双日	27,300	1,768.00	48,266,400	
アルフレッサ ホールディングス	27,400	1,595.00	43,703,000	
横浜冷凍	6,900	850.00	5,865,000	
神栄	300	860.00	258,000	
ラサ商事	1,300	977.00	1,270,100	
アルコニックス	3,100	1,287.00	3,989,700	
神戸物産	19,200	3,600.00	69,120,000	
ハイパー	600	483.00	289,800	
あい ホールディングス	3,500	1,760.00	6,160,000	
ディーブイエックス	800	1,022.00	817,600	
ダイワボウホールディングス	12,000	1,654.00	19,848,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,900	2,397.00	14,142,300	
ラクト・ジャパン	800	1,842.00	1,473,600	
グリムス	1,100	1,963.00	2,159,300	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,300	790.00	3,397,000	
八洲電機	1,800	971.00	1,747,800	
メディアスホールディングス	1,400	856.00	1,198,400	
レスターホールディングス	2,300	1,927.00	4,432,100	
ジューテックホールディングス	600	1,161.00	696,600	
大光	900	660.00	594,000	
O C H Iホールディングス	700	1,335.00	934,500	
T O K A Iホールディングス	12,000	863.00	10,356,000	

黒谷	700	623.00	436,100
C o m i n i x	400	733.00	293,200
三洋貿易	2,500	989.00	2,472,500
ビューティガレージ	400	2,849.00	1,139,600
ウイン・パートナーズ	1,800	942.00	1,695,600
ミタチ産業	700	936.00	655,200
シップヘルスケアホールディングス	7,900	2,581.00	20,389,900
明治電機工業	800	1,248.00	998,400
デリカフーズホールディングス	1,000	566.00	566,000
スターティアホールディングス	600	760.00	456,000
コメダホールディングス	5,400	2,020.00	10,908,000
ピーバンドットコム	300	619.00	185,700
アセンテック	800	730.00	584,000
富士興産	600	1,007.00	604,200
協栄産業	200	1,714.00	342,800
フルサト・マルカホールディングス	2,400	2,226.00	5,342,400
ヤマエグループホールディングス	1,700	1,007.00	1,711,900
小野建	2,400	1,623.00	3,895,200
南陽	500	1,912.00	956,000
佐鳥電機	1,500	904.00	1,356,000
エコートレーディング	500	592.00	296,000
伯東	1,500	2,389.00	3,583,500
コンドーテック	1,900	1,005.00	1,909,500
中山福	1,300	354.00	460,200
ナガイレーベン	3,300	2,177.00	7,184,100
三菱食品	2,400	2,817.00	6,760,800
松田産業	1,800	2,277.00	4,098,600
第一興商	4,700	3,275.00	15,392,500
メディバルホールディングス	26,600	2,070.00	55,062,000
S P K	1,000	1,300.00	1,300,000
萩原電気ホールディングス	900	1,965.00	1,768,500
アズワン	3,500	5,710.00	19,985,000
スズデン	900	1,768.00	1,591,200
尾家産業	600	996.00	597,600
シモジマ	1,500	1,045.00	1,567,500
ドウシシャ	2,300	1,503.00	3,456,900

小津産業	500	1,938.00	969,000
高速	1,500	1,507.00	2,260,500
たけびし	900	1,415.00	1,273,500
リックス	600	1,486.00	891,600
丸文	2,200	738.00	1,623,600
ハピネット	2,100	1,495.00	3,139,500
橋本総業ホールディングス	500	1,986.00	993,000
日本ライフライン	7,300	1,066.00	7,781,800
タカショー	1,900	663.00	1,259,700
I D O M	7,500	668.00	5,010,000
進和	1,500	2,069.00	3,103,500
エスケイジャパン	600	422.00	253,200
ダイトロン	1,000	1,965.00	1,965,000
シークス	3,500	1,269.00	4,441,500
田中商事	800	631.00	504,800
オーハシテクニカ	1,300	1,353.00	1,758,900
白銅	800	2,598.00	2,078,400
ダイコー通産	300	1,145.00	343,500
伊藤忠商事	172,600	3,675.00	634,305,000
丸紅	243,500	1,130.00	275,155,000
高島	400	2,330.00	932,000
長瀬産業	13,600	1,821.00	24,765,600
蝶理	1,400	1,767.00	2,473,800
豊田通商	24,800	4,655.00	115,444,000
三共生興	3,300	567.00	1,871,100
兼松	9,200	1,241.00	11,417,200
ツカモトコーポレーション	400	1,316.00	526,400
三井物産	191,700	2,799.00	536,568,300
日本紙パルプ商事	1,300	3,970.00	5,161,000
カメイ	2,900	1,015.00	2,943,500
東都水産	100	3,965.00	396,500
O U Gホールディングス	400	2,688.00	1,075,200
スターゼン	1,800	2,025.00	3,645,000
山善	10,400	988.00	10,275,200
椿本興業	500	4,285.00	2,142,500
住友商事	155,800	1,733.00	270,001,400

内田洋行	1,100	4,515.00	4,966,500	
三菱商事	185,000	3,812.00	705,220,000	
第一実業	1,100	4,340.00	4,774,000	
キャノンマーケティングジャパン	6,100	2,274.00	13,871,400	
西華産業	1,300	1,538.00	1,999,400	
佐藤商事	2,000	1,118.00	2,236,000	
菱洋エレクトロ	1,500	2,325.00	3,487,500	
東京産業	2,200	704.00	1,548,800	
ユアサ商事	2,300	2,881.00	6,626,300	
神鋼商事	600	3,325.00	1,995,000	
トルク	1,300	202.00	262,600	
阪和興業	4,900	3,145.00	15,410,500	
正栄食品工業	1,600	3,975.00	6,360,000	
カナデン	2,000	1,026.00	2,052,000	
菱電商事	2,000	1,684.00	3,368,000	
岩谷産業	5,900	5,650.00	33,335,000	
ナイス	900	1,744.00	1,569,600	
ニチモウ	400	2,559.00	1,023,600	
極東貿易	700	2,598.00	1,818,600	
アステナホールディングス	3,500	377.00	1,319,500	
三愛石油	6,100	942.00	5,746,200	
稲畑産業	5,400	1,693.00	9,142,200	
G S I クレオス	1,200	1,186.00	1,423,200	
明和産業	2,300	1,073.00	2,467,900	
クワザワホールディングス	1,000	592.00	592,000	
ワキタ	5,300	997.00	5,284,100	
東邦ホールディングス	7,900	1,716.00	13,556,400	
サンゲツ	6,500	1,596.00	10,374,000	
ミツウロコグループホールディングス	3,600	1,070.00	3,852,000	
シナネンホールディングス	900	3,085.00	2,776,500	
伊藤忠エネクス	5,500	1,010.00	5,555,000	
サンリオ	7,600	2,188.00	16,628,800	
サンワテクノス	1,500	1,286.00	1,929,000	
リョーサン	2,700	2,172.00	5,864,400	
新光商事	3,700	865.00	3,200,500	
トーホー	1,100	1,048.00	1,152,800	

三信電気	1,100	1,480.00	1,628,000	
東陽テクニカ	2,400	1,050.00	2,520,000	
モスフードサービス	3,200	3,020.00	9,664,000	
加賀電子	2,200	2,891.00	6,360,200	
ソーダニッカ	2,400	820.00	1,968,000	
立花エレテック	2,000	1,531.00	3,062,000	
フォーバル	1,100	843.00	927,300	
PALTA C	3,500	4,180.00	14,630,000	
三谷産業	2,900	307.00	890,300	
太平洋興発	900	628.00	565,200	
西本Wismettacホールディングス	600	2,900.00	1,740,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,941.00	388,200	
コア商事ホールディングス	1,800	590.00	1,062,000	
国際紙パルプ商事	5,100	301.00	1,535,100	
ヤマタネ	1,100	1,606.00	1,766,600	
丸紅建材リース	200	1,756.00	351,200	
日鉄物産	1,800	5,050.00	9,090,000	
泉州電業	700	6,140.00	4,298,000	
トラスコ中山	5,100	2,528.00	12,892,800	
オートバックスセブン	8,300	1,384.00	11,487,200	
モリト	1,800	682.00	1,227,600	
加藤産業	3,600	3,265.00	11,754,000	
北恵	600	833.00	499,800	
イノテック	1,500	1,405.00	2,107,500	
イエローハット	4,300	1,588.00	6,828,400	
J Kホールディングス	2,000	1,070.00	2,140,000	
日伝	2,000	2,220.00	4,440,000	
北沢産業	1,600	230.00	368,000	
杉本商事	1,200	2,178.00	2,613,600	
因幡電機産業	6,600	2,651.00	17,496,600	
東テク	800	2,443.00	1,954,400	
ミスミグループ本社	31,000	3,675.00	113,925,000	
アルテック	1,600	252.00	403,200	
タキヒヨー	700	1,380.00	966,000	
蔵王産業	500	1,783.00	891,500	
スズケン	9,600	3,335.00	32,016,000	

ジェコス	1,700	805.00	1,368,500	
グローセル	2,900	410.00	1,189,000	
ローソン	5,500	4,985.00	27,417,500	
サンエー	1,900	4,100.00	7,790,000	
カワチ薬品	1,900	2,232.00	4,240,800	
エービーシー・マート	3,900	5,430.00	21,177,000	
ハードオフコーポレーション	1,100	730.00	803,000	
アスクル	4,000	1,374.00	5,496,000	
ゲオホールディングス	3,300	1,162.00	3,834,600	
アダストリア	2,700	1,658.00	4,476,600	
ジーフット	1,500	303.00	454,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	386.00	154,400	
くら寿司	2,600	3,435.00	8,931,000	
キャンドゥ	1,200	2,097.00	2,516,400	
アイケイ	700	352.00	246,400	
パルグループホールディングス	2,200	1,592.00	3,502,400	
エディオン	11,300	1,068.00	12,068,400	
サーラコーポレーション	5,000	628.00	3,140,000	
ワッツ	1,200	688.00	825,600	
ハローズ	1,100	2,758.00	3,033,800	
フジオフードグループ本社	2,100	1,259.00	2,643,900	
あみやき亭	600	2,873.00	1,723,800	
ひらまつ	5,200	178.00	925,600	
大黒天物産	800	4,540.00	3,632,000	
ハニーズホールディングス	2,000	1,011.00	2,022,000	
ファーマライズホールディングス	600	723.00	433,800	
アルペン	1,900	1,955.00	3,714,500	
ハブ	800	550.00	440,000	
クオールホールディングス	3,000	1,314.00	3,942,000	
ジinzホールディングス	1,700	6,900.00	11,730,000	
ビックカメラ	14,600	1,005.00	14,673,000	
D C Mホールディングス	15,200	1,081.00	16,431,200	
ペッパーフードサービス	3,400	344.00	1,169,600	
Monotaro	31,200	1,845.00	57,564,000	
東京一番フーズ	600	587.00	352,200	
D Dホールディングス	1,300	530.00	689,000	

きちりホールディングス	700	352.00	246,400	
アーランドサービスホールディングス	1,800	2,149.00	3,868,200	
J.フロント リテイリング	29,500	1,009.00	29,765,500	
ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,543.00	6,634,900	
マツキヨココカラ&カンパニー	15,200	3,890.00	59,128,000	
ブロンコビリー	1,400	2,134.00	2,987,600	
Z O Z O	17,000	2,796.00	47,532,000	
トレジャー・ファクトリー	700	804.00	562,800	
物語コーポレーション	1,300	6,170.00	8,021,000	
三越伊勢丹ホールディングス	43,200	884.00	38,188,800	
H a m e e	600	1,003.00	601,800	
マーケットエンタープライズ	200	724.00	144,800	
ウエルシアホールディングス	13,000	3,190.00	41,470,000	
クリエイティブSDホールディングス	3,600	3,090.00	11,124,000	
丸善C H Iホールディングス	2,900	360.00	1,044,000	
ミサワ	500	700.00	350,000	
ティーライフ	300	1,345.00	403,500	
エー・ピーホールディングス	500	438.00	219,000	
チムニー	800	1,150.00	920,000	
シュッピン	2,100	1,114.00	2,339,400	
オイシックス・ラ・大地	3,500	2,277.00	7,969,500	
ネクステージ	5,000	2,879.00	14,395,000	
ジョイフル本田	7,200	1,534.00	11,044,800	
鳥貴族ホールディングス	900	1,672.00	1,504,800	
ホットランド	1,800	1,213.00	2,183,400	
すかいらーくホールディングス	31,900	1,480.00	47,212,000	
S F Pホールディングス	1,200	1,397.00	1,676,400	
綿半ホールディングス	1,900	1,268.00	2,409,200	
ヨシックスホールディングス	500	1,915.00	957,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,200	1,057.00	7,610,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,300	1,046.00	1,359,800	
B E E N O S	1,200	1,845.00	2,214,000	
あさひ	2,000	1,396.00	2,792,000	
日本調剤	1,500	1,325.00	1,987,500	
コスモス薬品	2,500	14,670.00	36,675,000	

トーエル	1,200	834.00	1,000,800	
セブン&アイ・ホールディングス	96,600	5,283.00	510,337,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	13,100	715.00	9,366,500	
ツルハホールディングス	5,400	9,570.00	51,678,000	
サンマルクホールディングス	1,900	1,465.00	2,783,500	
フェリシモ	500	1,183.00	591,500	
トリドールホールディングス	6,100	2,226.00	13,578,600	
TOKYO BASE	2,300	446.00	1,025,800	
ウイルプラスホールディングス	400	1,000.00	400,000	
JMホールディングス	1,700	1,597.00	2,714,900	
サツドラホールディングス	1,100	619.00	680,900	
アレンザホールディングス	1,900	1,067.00	2,027,300	
串カツ田中ホールディングス	700	2,037.00	1,425,900	
パロックジャパンリミテッド	1,700	903.00	1,535,100	
クスリのアオキホールディングス	2,500	6,880.00	17,200,000	
力の源ホールディングス	1,300	537.00	698,100	
FOOD & LIFE COMPANIES	14,400	3,370.00	48,528,000	
メディカルシステムネットワーク	2,400	509.00	1,221,600	
一家ホールディングス	500	524.00	262,000	
藤久ホールディングス	600	727.00	436,200	
はるやまホールディングス	1,200	494.00	592,800	
ノジマ	4,000	2,300.00	9,200,000	
カッパ・クリエイト	3,500	1,336.00	4,676,000	
ライトオン	1,800	695.00	1,251,000	
良品計画	28,400	1,580.00	44,872,000	
三城ホールディングス	3,000	230.00	690,000	
アドヴァングループ	2,500	974.00	2,435,000	
アルピス	800	2,173.00	1,738,400	
コナカ	2,900	342.00	991,800	
ハウス オブ ローゼ	300	1,667.00	500,100	
G - 7ホールディングス	2,700	1,408.00	3,801,600	
イオン北海道	4,300	1,077.00	4,631,100	
コジマ	4,200	529.00	2,221,800	
ヒマラヤ	900	995.00	895,500	
コーナン商事	3,500	3,385.00	11,847,500	

エコス	900	1,976.00	1,778,400	
ワタミ	3,000	879.00	2,637,000	
マルシェ	600	408.00	244,800	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	49,400	1,537.00	75,927,800	
西松屋チェーン	5,400	1,407.00	7,597,800	
ゼンショーホールディングス	12,000	2,732.00	32,784,000	
幸楽苑ホールディングス	1,600	1,317.00	2,107,200	
ハークスレイ	1,000	464.00	464,000	
サイゼリヤ	3,700	2,613.00	9,668,100	
V Tホールディングス	9,300	449.00	4,175,700	
魚力	700	2,001.00	1,400,700	
ポブラ	600	132.00	79,200	
フジ・コーポレーション	1,300	1,136.00	1,476,800	
ユナイテッドアローズ	2,600	1,792.00	4,659,200	
ハイデイ日高	3,600	1,645.00	5,922,000	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	1,400	202.00	282,800	
コロワイド	10,100	1,629.00	16,452,900	
ピーシーデポコーポレーション	2,900	289.00	838,100	
壱番屋	1,700	4,630.00	7,871,000	
トップカルチャー	900	278.00	250,200	
P L A N T	600	678.00	406,800	
スギホールディングス	4,900	6,960.00	34,104,000	
薬王堂ホールディングス	1,200	2,300.00	2,760,000	
ヴィア・ホールディングス	3,100	146.00	452,600	
スクロール	3,800	834.00	3,169,200	
ヨンドシーホールディングス	2,300	1,742.00	4,006,600	
木曽路	3,300	2,198.00	7,253,400	
S R Sホールディングス	3,400	768.00	2,611,200	
千趣会	4,500	366.00	1,647,000	
タカキュー	1,800	106.00	190,800	
リテールパートナーズ	3,000	1,199.00	3,597,000	
ケーヨー	4,600	852.00	3,919,200	
上新電機	2,800	2,062.00	5,773,600	
日本瓦斯	12,000	1,478.00	17,736,000	
ロイヤルホールディングス	4,200	1,788.00	7,509,600	

東天紅	200	951.00	190,200	
いなげや	3,100	1,374.00	4,259,400	
チヨダ	2,400	754.00	1,809,600	
ライフコーポレーション	2,300	3,055.00	7,026,500	
リンガーハット	3,000	2,227.00	6,681,000	
MrMaxHD	3,100	599.00	1,856,900	
テンアライド	2,400	307.00	736,800	
AOKIホールディングス	4,800	599.00	2,875,200	
オークワ	3,900	907.00	3,537,300	
コメリ	3,800	2,549.00	9,686,200	
青山商事	5,100	658.00	3,355,800	
しまむら	2,900	10,340.00	29,986,000	
はせがわ	1,300	287.00	373,100	
高島屋	18,000	1,073.00	19,314,000	
松屋	5,000	701.00	3,505,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	11,700	783.00	9,161,100	
近鉄百貨店	900	2,607.00	2,346,300	
丸井グループ	19,500	2,129.00	41,515,500	
アクシアル リテイリング	1,900	3,255.00	6,184,500	
井筒屋	1,200	375.00	450,000	
イオン	95,000	2,546.50	241,917,500	
イズミ	4,500	3,200.00	14,400,000	
平和堂	4,600	1,915.00	8,809,000	
フジ	3,000	1,879.00	5,637,000	
ヤオコー	2,800	6,590.00	18,452,000	
ゼビオホールディングス	3,400	883.00	3,002,200	
ケーズホールディングス	22,800	1,109.00	25,285,200	
Olympicグループ	1,300	686.00	891,800	
日産東京販売ホールディングス	3,600	225.00	810,000	
シルバーライフ	500	1,030.00	515,000	
Genky DrugStores	1,100	4,140.00	4,554,000	
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,165.00	699,000	
ブックオフグループホールディングス	1,400	1,019.00	1,426,600	
ギフト	400	2,277.00	910,800	
アインホールディングス	3,600	5,800.00	20,880,000	
元気寿司	700	2,440.00	1,708,000	

ヤマダホールディングス	90,300	391.00	35,307,300	
アーランドサカモト	3,900	1,542.00	6,013,800	
ニトリホールディングス	9,800	16,835.00	164,983,000	
グルメ杵屋	2,000	976.00	1,952,000	
愛眼	1,700	177.00	300,900	
ケーユーホールディングス	1,300	981.00	1,275,300	
吉野家ホールディングス	8,600	2,406.00	20,691,600	
松屋フーズホールディングス	1,200	3,560.00	4,272,000	
サガミホールディングス	3,800	1,047.00	3,978,600	
関西スーパーマーケット	1,900	1,019.00	1,936,100	
王将フードサービス	1,600	5,860.00	9,376,000	
プレナス	2,800	1,970.00	5,516,000	
ミニストップ	1,800	1,467.00	2,640,600	
アークス	4,700	2,133.00	10,025,100	
バローホールディングス	5,500	2,186.00	12,023,000	
ベルク	1,100	5,420.00	5,962,000	
大庄	1,300	996.00	1,294,800	
ファーストリテイリング	3,300	68,000.00	224,400,000	
サンドラッグ	9,300	2,923.00	27,183,900	
サクスパー ホールディングス	2,300	515.00	1,184,500	
ヤマザワ	600	1,584.00	950,400	
やまや	500	2,425.00	1,212,500	
ベルーナ	5,300	715.00	3,789,500	
島根銀行	800	549.00	439,200	
じもとホールディングス	1,800	652.00	1,173,600	
めぶきフィナンシャルグループ	128,400	255.00	32,742,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,100	1,573.00	4,876,300	
九州フィナンシャルグループ	50,500	442.00	22,321,000	
ゆうちょ銀行	58,300	1,110.00	64,713,000	
富山第一銀行	5,900	302.00	1,781,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	141,200	469.00	66,222,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	16,100	796.00	12,815,600	
三十三フィナンシャルグループ	2,300	1,521.00	3,498,300	
第四北越フィナンシャルグループ	4,000	2,610.00	10,440,000	
ひろぎんホールディングス	36,500	702.00	25,623,000	
おきなわフィナンシャルグループ	2,200	2,244.00	4,936,800	

十六フィナンシャルグループ	3,300	2,266.00	7,477,800	
北國フィナンシャルホールディングス	2,300	2,851.00	6,557,300	
新生銀行	16,100	2,093.00	33,697,300	
あおぞら銀行	13,800	2,559.00	35,314,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,550,200	673.60	1,044,214,720	
りそなホールディングス	281,500	483.40	136,077,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	46,700	4,012.00	187,360,400	
三井住友フィナンシャルグループ	171,100	4,099.00	701,338,900	
千葉銀行	82,500	728.00	60,060,000	
群馬銀行	47,500	374.00	17,765,000	
武蔵野銀行	3,700	1,827.00	6,759,900	
千葉興業銀行	5,800	273.00	1,583,400	
筑波銀行	9,600	185.00	1,776,000	
七十七銀行	7,800	1,383.00	10,787,400	
青森銀行	1,900	1,886.00	3,583,400	
秋田銀行	1,600	1,705.00	2,728,000	
山形銀行	2,800	926.00	2,592,800	
岩手銀行	1,600	1,926.00	3,081,600	
東邦銀行	20,700	213.00	4,409,100	
東北銀行	1,200	1,010.00	1,212,000	
みちのく銀行	1,600	861.00	1,377,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	20,800	2,205.00	45,864,000	
静岡銀行	60,200	911.00	54,842,200	
スルガ銀行	21,700	507.00	11,001,900	
八十二銀行	55,700	408.00	22,725,600	
山梨中央銀行	2,700	923.00	2,492,100	
大垣共立銀行	4,900	2,012.00	9,858,800	
福井銀行	2,100	1,387.00	2,912,700	
清水銀行	1,000	1,585.00	1,585,000	
富山銀行	400	1,925.00	770,000	
滋賀銀行	4,600	2,174.00	10,000,400	
南都銀行	3,900	1,920.00	7,488,000	
百五銀行	23,700	353.00	8,366,100	
京都銀行	8,900	5,270.00	46,903,000	
紀陽銀行	8,400	1,435.00	12,054,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	15,400	895.00	13,783,000	

山陰合同銀行	14,700	643.00	9,452,100	
中国銀行	19,800	935.00	18,513,000	
鳥取銀行	800	1,169.00	935,200	
伊予銀行	32,800	588.00	19,286,400	
百十四銀行	2,600	1,586.00	4,123,600	
四国銀行	3,800	786.00	2,986,800	
阿波銀行	3,800	2,217.00	8,424,600	
大分銀行	1,400	1,925.00	2,695,000	
宮崎銀行	1,500	2,083.00	3,124,500	
佐賀銀行	1,400	1,488.00	2,083,200	
琉球銀行	5,400	790.00	4,266,000	
セブン銀行	73,400	244.00	17,909,600	
みずほフィナンシャルグループ	316,100	1,545.50	488,532,550	
高知銀行	900	766.00	689,400	
山口フィナンシャルグループ	28,800	703.00	20,246,400	
長野銀行	800	1,216.00	972,800	
名古屋銀行	1,800	2,867.00	5,160,600	
北洋銀行	37,300	254.00	9,474,200	
愛知銀行	900	4,700.00	4,230,000	
中京銀行	900	1,735.00	1,561,500	
大光銀行	800	1,351.00	1,080,800	
愛媛銀行	3,500	904.00	3,164,000	
トマト銀行	900	1,059.00	953,100	
京葉銀行	10,500	470.00	4,935,000	
栃木銀行	11,900	218.00	2,594,200	
北日本銀行	800	1,583.00	1,266,400	
東和銀行	4,300	529.00	2,274,700	
福島銀行	2,800	249.00	697,200	
大東銀行	1,200	739.00	886,800	
トモニホールディングス	19,100	323.00	6,169,300	
フィデアホールディングス	2,300	1,379.00	3,171,700	
池田泉州ホールディングス	28,500	180.00	5,130,000	
F P G	8,300	653.00	5,419,900	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,900	1,045.00	1,985,500	
マーキュリアホールディングス	1,000	510.00	510,000	
S B Iホールディングス	30,500	2,914.00	88,877,000	

日本アジア投資	1,900	181.00	343,900	
ジャフコ グループ	3,100	5,800.00	17,980,000	
大和証券グループ本社	185,100	689.40	127,607,940	
野村ホールディングス	377,400	504.80	190,511,520	
岡三証券グループ	19,400	380.00	7,372,000	
丸三証券	7,300	530.00	3,869,000	
東洋証券	8,100	148.00	1,198,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,400	400.00	11,360,000	
光世証券	500	485.00	242,500	
水戸証券	6,600	274.00	1,808,400	
いちよし証券	4,600	674.00	3,100,400	
松井証券	12,100	793.00	9,595,300	
マネックスグループ	20,200	580.00	11,716,000	
極東証券	3,300	744.00	2,455,200	
岩井コスモホールディングス	2,300	1,366.00	3,141,800	
アイザワ証券グループ	4,100	905.00	3,710,500	
マネーパートナーズグループ	2,600	214.00	556,400	
スパークス・グループ	11,400	263.00	2,998,200	
小林洋行	700	215.00	150,500	
かんぽ生命保険	24,900	2,008.00	49,999,200	
S O M P Oホールディングス	40,600	5,234.00	212,500,400	
アニコム ホールディングス	7,600	681.00	5,175,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	55,400	3,921.00	217,223,400	
第一生命ホールディングス	121,700	2,507.50	305,162,750	
東京海上ホールディングス	81,400	6,688.00	544,403,200	
T & Dホールディングス	64,200	1,639.00	105,223,800	
アドバンスクリエイト	1,200	1,028.00	1,233,600	
全国保証	5,900	5,190.00	30,621,000	
あんしん保証	700	287.00	200,900	
ジェイリース	800	1,741.00	1,392,800	
イントラスト	1,000	700.00	700,000	
日本モーゲージサービス	1,400	1,064.00	1,489,600	
C a s a	900	874.00	786,600	
アルヒ	3,600	1,131.00	4,071,600	
プレミアグループ	1,200	3,355.00	4,026,000	

クレディセゾン	15,900	1,273.00	20,240,700
芙蓉総合リース	2,600	7,600.00	19,760,000
みずほリース	3,800	3,185.00	12,103,000
東京センチュリー	4,800	5,590.00	26,832,000
日本証券金融	9,700	911.00	8,836,700
アイフル	41,500	334.00	13,861,000
リコーリース	2,200	3,755.00	8,261,000
イオンフィナンシャルサービス	13,400	1,210.00	16,214,000
アコム	48,800	322.00	15,713,600
ジャックス	2,700	3,080.00	8,316,000
オリエントコーポレーション	67,000	126.00	8,442,000
オリックス	150,100	2,370.00	355,737,000
三菱HCキャピタル	91,300	594.00	54,232,200
九州リースサービス	1,200	583.00	699,600
日本取引所グループ	62,600	2,279.50	142,696,700
イー・ギャランティ	3,600	1,826.00	6,573,600
アサックス	1,300	691.00	898,300
NECキャピタルソリューション	1,000	2,025.00	2,025,000
いちご	27,500	294.00	8,085,000
日本駐車場開発	27,100	131.00	3,550,100
スター・マイカ・ホールディングス	1,300	1,347.00	1,751,100
SREホールディングス	600	4,640.00	2,784,000
ADワークスグループ	5,000	135.00	675,000
ヒューリック	59,000	1,043.00	61,537,000
三栄建築設計	1,000	1,544.00	1,544,000
野村不動産ホールディングス	12,800	2,617.00	33,497,600
三重交通グループホールディングス	5,000	458.00	2,290,000
サムティ	4,000	2,090.00	8,360,000
ディア・ライフ	3,200	518.00	1,657,600
コーセーアールイー	700	715.00	500,500
地主	1,600	1,698.00	2,716,800
プレサンスコーポレーション	3,200	2,099.00	6,716,800
THEグローバル社	1,500	172.00	258,000
ハウスコム	400	1,227.00	490,800
日本管理センター	1,200	956.00	1,147,200
サンセイランディック	700	804.00	562,800

エストラスト	300	589.00	176,700
フージャースホールディングス	3,200	677.00	2,166,400
オープンハウスグループ	7,900	5,780.00	45,662,000
東急不動産ホールディングス	72,800	652.00	47,465,600
飯田グループホールディングス	20,600	2,364.00	48,698,400
イーランド	400	1,368.00	547,200
ムゲンエステート	1,500	481.00	721,500
ビーロッド	1,700	475.00	807,500
ファーストブラザーズ	600	741.00	444,600
And Doホールディングス	1,200	820.00	984,000
シーアールイー	700	1,631.00	1,141,700
プロパティエージェント	300	1,522.00	456,600
ケイアイスター不動産	1,100	6,960.00	7,656,000
アグレ都市デザイン	400	1,324.00	529,600
グッドコムアセット	1,100	1,040.00	1,144,000
ジェイ・エス・ビー	500	2,860.00	1,430,000
テンポイノベーション	700	807.00	564,900
グローバル・リンク・マネジメント	400	817.00	326,800
フェイスネットワーク	200	1,274.00	254,800
パーク24	13,300	1,697.00	22,570,100
パラカ	600	1,560.00	936,000
宮越ホールディングス	900	888.00	799,200
三井不動産	112,700	2,351.00	264,957,700
三菱地所	162,400	1,647.00	267,472,800
平和不動産	4,200	3,910.00	16,422,000
東京建物	24,400	1,682.00	41,040,800
ダイビル	5,800	2,197.00	12,742,600
京阪神ビルディング	3,800	1,422.00	5,403,600
住友不動産	51,900	3,463.00	179,729,700
テオーシー	4,400	700.00	3,080,000
東京楽天地	400	3,890.00	1,556,000
レオパレス21	25,700	172.00	4,420,400
スターツコーポレーション	3,400	2,480.00	8,432,000
フジ住宅	2,900	660.00	1,914,000
空港施設	2,500	562.00	1,405,000
明和地所	1,200	602.00	722,400

ゴールドクレスト	1,900	1,616.00	3,070,400
エスリード	1,000	1,706.00	1,706,000
日神グループホールディングス	4,000	497.00	1,988,000
日本エスコン	4,600	761.00	3,500,600
タカラレーベン	10,400	299.00	3,109,600
A V A N T I A	1,300	831.00	1,080,300
イオンモール	12,400	1,636.00	20,286,400
毎日コムネット	800	695.00	556,000
ファースト住建	900	1,172.00	1,054,800
ランド	133,900	10.00	1,339,000
カチタス	6,100	3,520.00	21,472,000
トーセイ	3,400	1,058.00	3,597,200
穴吹興産	500	1,906.00	953,000
サンフロンティア不動産	3,400	1,030.00	3,502,000
F J ネクストホールディングス	2,400	984.00	2,361,600
インテリックス	600	621.00	372,600
ランドビジネス	1,000	254.00	254,000
サンネクスタグループ	800	1,032.00	825,600
グランディハウス	1,700	487.00	827,900
日本空港ビルデング	9,400	4,855.00	45,637,000
明豊ファシリティワークス	1,100	769.00	845,900
日本工営	1,400	3,035.00	4,249,000
L I F U L L	7,300	216.00	1,576,800
ミクシィ	5,500	2,076.00	11,418,000
ジェイエシーリクルートメント	1,900	1,943.00	3,691,700
日本M & A センターホールディングス	39,300	1,850.00	72,705,000
メンバーズ	700	2,098.00	1,468,600
中広	400	380.00	152,000
UTグループ	3,500	3,175.00	11,112,500
アイティメディア	1,100	1,476.00	1,623,600
E・Jホールディングス	1,300	1,128.00	1,466,400
夢真ビーネックスグループ	6,400	1,560.00	9,984,000
コシダカホールディングス	6,400	584.00	3,737,600
アルトナー	600	896.00	537,600
パソナグループ	2,600	2,568.00	6,676,800
C D S	600	1,616.00	969,600

リンクアンドモチベーション	5,300	452.00	2,395,600
エス・エム・エス	8,100	3,185.00	25,798,500
サニーサイドアップグループ	800	701.00	560,800
パーソルホールディングス	23,900	2,867.00	68,521,300
リニカル	1,300	637.00	828,100
クックパッド	7,500	249.00	1,867,500
エスクリ	1,100	328.00	360,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,200	586.00	703,200
学情	1,000	981.00	981,000
スタジオアリス	1,100	2,136.00	2,349,600
シミックホールディングス	1,300	1,455.00	1,891,500
エプロ	500	722.00	361,000
N J S	500	1,975.00	987,500
総合警備保障	9,500	4,340.00	41,230,000
カカクコム	17,600	2,427.00	42,715,200
アイロムグループ	900	1,513.00	1,361,700
セントケア・ホールディング	1,600	742.00	1,187,200
サイネックス	400	586.00	234,400
ルネサンス	1,700	1,013.00	1,722,100
ディップ	4,200	3,470.00	14,574,000
デジタルホールディングス	1,700	1,277.00	2,170,900
新日本科学	2,900	1,183.00	3,430,700
キャリアデザインセンター	600	927.00	556,200
ベネフィット・ワン	8,700	3,630.00	31,581,000
エムスリー	42,300	4,397.00	185,993,100
ツカダ・グローバルホールディング	1,500	264.00	396,000
プラス	300	615.00	184,500
アウトソーシング	13,700	1,332.00	18,248,400
ウェルネット	2,400	421.00	1,010,400
ワールドホールディングス	1,000	2,319.00	2,319,000
ディー・エヌ・エー	9,100	1,806.00	16,434,600
博報堂D Yホールディングス	33,300	1,804.00	60,073,200
ぐるなび	3,900	378.00	1,474,200
タカミヤ	2,900	387.00	1,122,300
ジャパンベストレスキューシステム	1,600	865.00	1,384,000
ファンコミュニケーションズ	6,000	379.00	2,274,000

ライク	600	1,837.00	1,102,200	
ビジネス・ブレイクスルー	900	406.00	365,400	
エスプール	6,800	1,102.00	7,493,600	
WDBホールディングス	1,100	2,711.00	2,982,100	
手間いらず	300	4,460.00	1,338,000	
ティア	1,400	436.00	610,400	
CDG	300	1,351.00	405,300	
アドウェイズ	3,600	725.00	2,610,000	
バリューコマース	1,900	3,505.00	6,659,500	
インフォーマート	26,200	732.00	19,178,400	
JPホールディングス	6,100	224.00	1,366,400	
エコナックホールディングス	4,300	87.00	374,100	
CLホールディングス	500	1,188.00	594,000	
プレステージ・インターナショナル	9,000	697.00	6,273,000	
アミューズ	1,300	2,034.00	2,644,200	
ドリームインキュベータ	600	1,781.00	1,068,600	
クイック	1,600	1,237.00	1,979,200	
TAC	1,300	209.00	271,700	
電通グループ	24,700	3,960.00	97,812,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,100	950.00	1,045,000	
ぴあ	800	3,100.00	2,480,000	
イオンファンタジー	900	1,842.00	1,657,800	
シーティーエス	2,700	757.00	2,043,900	
ネクシィーズグループ	800	681.00	544,800	
H.U.グループホールディングス	6,300	2,833.00	17,847,900	
アルプス技研	2,100	1,803.00	3,786,300	
サニックス	4,200	222.00	932,400	
ダイオーズ	500	993.00	496,500	
日本空調サービス	2,500	780.00	1,950,000	
オリエンタルランド	28,300	18,455.00	522,276,500	
ダスキン	5,600	2,713.00	15,192,800	
明光ネットワークジャパン	2,800	559.00	1,565,200	
ファルコホールディングス	1,100	1,997.00	2,196,700	
秀英予備校	500	414.00	207,000	
田谷	400	549.00	219,600	
ラウンドワン	6,700	1,314.00	8,803,800	

リゾートトラスト	11,000	1,848.00	20,328,000
ビー・エム・エル	3,100	3,575.00	11,082,500
りらいあコミュニケーションズ	3,500	975.00	3,412,500
リソー教育	10,900	395.00	4,305,500
早稲田アカデミー	1,300	1,025.00	1,332,500
ユー・エス・エス	26,800	1,869.00	50,089,200
東京個別指導学院	2,100	578.00	1,213,800
サイバーエージェント	59,000	1,683.00	99,297,000
楽天グループ	123,000	990.00	121,770,000
クリーク・アンド・リバー社	1,300	1,784.00	2,319,200
モーニングスター	4,200	593.00	2,490,600
テー・オー・ダブリュー	4,200	294.00	1,234,800
山田コンサルティンググループ	1,200	1,029.00	1,234,800
セントラルスポーツ	900	2,382.00	2,143,800
フルキャストホールディングス	2,000	2,050.00	4,100,000
エン・ジャパン	3,900	2,787.00	10,869,300
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	14,300	2,976.00	42,556,800
アトラグループ	500	258.00	129,000
インターワークス	700	385.00	269,500
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	5,120.00	5,632,000
Keeper 技研	1,500	1,733.00	2,599,500
ファーストロジック	500	781.00	390,500
三機サービス	500	976.00	488,000
Gunosy	1,500	713.00	1,069,500
デザインワン・ジャパン	500	182.00	91,000
イー・ガーディアン	1,000	2,731.00	2,731,000
リブセンス	1,300	173.00	224,900
ジャパンマテリアル	7,400	1,624.00	12,017,600
ベクトル	3,400	983.00	3,342,200
ウチヤマホールディングス	1,200	302.00	362,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,800	1,225.00	2,205,000
キャリアリンク	900	1,662.00	1,495,800
I B J	2,000	747.00	1,494,000
アサンテ	1,100	1,646.00	1,810,600
バリューHR	1,000	2,356.00	2,356,000

M & Aキャピタルパートナーズ	2,000	4,640.00	9,280,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	900	1,493.00	1,343,700	
E R Iホールディングス	700	1,117.00	781,900	
アビスト	400	2,897.00	1,158,800	
シグマクシス・ホールディングス	1,400	2,113.00	2,958,200	
ウィルグループ	1,800	1,230.00	2,214,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,200	171.00	547,200	
メドピア	1,800	2,850.00	5,130,000	
レアジョブ	500	777.00	388,500	
リクルートホールディングス	184,700	5,506.00	1,016,958,200	
エラン	3,300	980.00	3,234,000	
土木管理総合試験所	1,100	318.00	349,800	
ネットマーケティング	1,200	405.00	486,000	
日本郵政	312,700	965.60	301,943,120	
ベルシステム24ホールディングス	3,400	1,413.00	4,804,200	
鎌倉新書	2,700	502.00	1,355,400	
S M N	500	624.00	312,000	
一蔵	300	390.00	117,000	
グローバルキッズCOMPANY	400	790.00	316,000	
エアトリ	1,500	2,586.00	3,879,000	
アトラエ	1,700	1,750.00	2,975,000	
ストライク	900	4,250.00	3,825,000	
ソラスト	5,900	1,032.00	6,088,800	
セラク	800	1,127.00	901,600	
インソース	2,300	1,857.00	4,271,100	
ベйкаレント・コンサルティング	1,700	40,150.00	68,255,000	
Orchestra Holdings	500	2,614.00	1,307,000	
アイモバイル	700	1,115.00	780,500	
キャリアインデックス	800	728.00	582,400	
MS - Japan	1,000	819.00	819,000	
船場	500	734.00	367,000	
グレイステクノロジー	3,100	63.00	195,300	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,600	1,585.00	12,046,000	
フルテック	300	1,363.00	408,900	
グリーンズ	900	454.00	408,600	

ツナググループ・ホールディングス	500	246.00	123,000	
GameWith	700	423.00	296,100	
ソウルドアウト	600	1,020.00	612,000	
MS&Consulting	300	651.00	195,300	
ウェルビー	1,600	1,139.00	1,822,400	
エル・ティー・エス	300	2,368.00	710,400	
ミダックホールディングス	1,000	2,661.00	2,661,000	
日総工産	1,900	788.00	1,497,200	
キュービーネットホールディングス	1,100	1,663.00	1,829,300	
RPAホールディングス	3,400	328.00	1,115,200	
スプリックス	700	1,461.00	1,022,700	
マネジメントソリューションズ	1,200	3,080.00	3,696,000	
プロレド・パートナーズ	500	815.00	407,500	
and factory	500	345.00	172,500	
テノ・ホールディングス	300	585.00	175,500	
フロンティア・マネジメント	600	625.00	375,000	
ピアラ	400	567.00	226,800	
コプロ・ホールディングス	500	1,091.00	545,500	
ギークス	400	1,393.00	557,200	
カーブスホールディングス	6,600	682.00	4,501,200	
フォーラムエンジニアリング	1,700	824.00	1,400,800	
ダイレクトマーケティングミックス	2,800	1,339.00	3,749,200	
ポピンズホールディングス	600	2,467.00	1,480,200	
LITALICO	1,900	2,975.00	5,652,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,200	672.00	806,400	
リログループ	13,100	2,042.00	26,750,200	
東祥	1,800	1,423.00	2,561,400	
TREホールディングス	3,300	1,405.00	4,636,500	
人・夢・技術グループ	1,000	1,808.00	1,808,000	
エイチ・アイ・エス	5,300	1,840.00	9,752,000	
ラックランド	700	2,791.00	1,953,700	
共立メンテナンス	4,300	3,980.00	17,114,000	
イチネンホールディングス	2,500	1,264.00	3,160,000	
建設技術研究所	1,400	2,403.00	3,364,200	
スペース	1,700	881.00	1,497,700	
燦ホールディングス	1,000	1,509.00	1,509,000	

スバル興業	100	8,400.00	840,000	
東京テアトル	900	1,215.00	1,093,500	
タナベ経営	900	640.00	576,000	
ナガワ	800	9,720.00	7,776,000	
東京都競馬	1,800	4,050.00	7,290,000	
常磐興産	1,000	1,370.00	1,370,000	
カナモト	4,200	2,253.00	9,462,600	
西尾レントオール	2,200	2,774.00	6,102,800	
アゴーラ ホスピタリティィー グループ	13,100	21.00	275,100	
トランス・コスモス	3,000	2,974.00	8,922,000	
乃村工藝社	10,300	933.00	9,609,900	
藤田観光	1,000	2,234.00	2,234,000	
KNT - CTホールディングス	1,500	1,302.00	1,953,000	
日本管財	2,600	2,784.00	7,238,400	
トーカイ	2,100	1,892.00	3,973,200	
白洋舎	300	1,130.00	339,000	
セコム	23,600	8,087.00	190,853,200	
セントラル警備保障	1,200	2,296.00	2,755,200	
丹青社	4,900	740.00	3,626,000	
メイテック	2,900	6,390.00	18,531,000	
応用地質	2,700	2,069.00	5,586,300	
船井総研ホールディングス	4,900	2,447.00	11,990,300	
進学会ホールディングス	800	304.00	243,200	
オオバ	1,700	753.00	1,280,100	
いであ	600	1,714.00	1,028,400	
学究社	800	1,536.00	1,228,800	
ベネッセホールディングス	8,000	2,247.00	17,976,000	
イオンディライト	3,000	3,125.00	9,375,000	
ナック	1,100	953.00	1,048,300	
ダイセキ	4,400	4,560.00	20,064,000	
ステップ	900	1,871.00	1,683,900	
合 計	27,541,800		64,994,960,610	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2022年 1月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	8,127,597,352
コール・ローン	1,714,297,620
株式	106,056,038,603
投資証券	2,567,757,104
派生商品評価勘定	200,319
未収入金	34,984,000
未収配当金	74,311,465
差入委託証拠金	3,784,305,185
流動資産合計	122,359,491,648
資産合計	122,359,491,648
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	606,368,958
未払解約金	2,042,467,700
未払利息	4,649
流動負債合計	2,648,841,307
負債合計	2,648,841,307
純資産の部	
元本等	
元本	61,552,790,809
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,157,859,532
元本等合計	119,710,650,341
純資産合計	119,710,650,341
負債純資産合計	122,359,491,648

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	53,970,185,829円
期中追加設定元本額	48,821,289,734円
期中一部解約元本額	41,238,684,754円
期末元本額	61,552,790,809円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,408,045,794円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,874,167,715円
りそなラップ型ファンド(成長型)	6,531,079,425円
DCりそな グローバルバランス	23,898,163円
つみたてバランスファンド	1,931,173,374円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,694,219,863円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,014,136,654円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	663,149,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	231,181,789円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	145,581,389円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	76,904,511円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	135,998,064円
リスクコントロール・オープン	44,315,848円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	110,262,602円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	38,771,695円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	25,563,971,116円
Smart-i 先進国株式インデックス	7,976,337,970円
Smart-i 8資産バランス 安定型	321,308,310円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	895,934,023円
Smart-i 8資産バランス 成長型	1,027,920,801円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	715,096,249円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,151,890,996円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	706,125,610円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	424,764,261円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	867,587,314円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	147,693,697円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,178,678円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	296,492,103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)	17,570,797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)	10,158,552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)	374,721,602円
2. 計算日における受益権の総数	61,552,790,809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	1.9448円
(10,000口当たり純資産額)	(19,448円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	7,509,311,045	
投資証券	355,817,173	
合計	7,865,128,218	

(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 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,688,145,190	-	11,082,107,280	606,037,910
合計		11,688,145,190	-	11,082,107,280	606,037,910

(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 1月25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	295,581,059	-	295,711,788	130,729
	米ドル	237,491,100	-	237,822,148	331,048
	カナダドル	14,946,855	-	14,887,686	59,169
	英ポンド	19,136,052	-	19,058,477	77,575
	スイスフラン	13,718,320	-	13,715,053	3,267

	スウェーデンク ローナ	4,311,024	-	4,280,400	30,624
	ノルウェークロー ネ	2,907,643	-	2,880,561	27,082
	デンマーククロー ネ	3,070,065	-	3,067,463	2,602
	合計	295,581,059	-	295,711,788	130,729

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	15,178	27.07	410,868.46	
	CHENIERE ENERGY INC	4,215	105.13	443,122.95	
	CHEVRON CORP	34,119	127.18	4,339,254.42	
	CONOCOPHILLIPS	23,383	83.02	1,941,256.66	
	COTERRA ENERGY INC	14,095	19.53	275,275.35	
	DEVON ENERGY CORP	11,449	48.33	553,330.17	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,151	119.42	376,292.42	
	EOG RESOURCES INC	10,144	102.31	1,037,832.64	
	EXXON MOBIL CORP	74,640	72.79	5,433,045.60	
	HALLIBURTON CO	15,912	28.59	454,924.08	

HESS CORP	5,183	88.74	459,939.42
KINDER MORGAN INC	35,520	17.32	615,206.40
MARATHON PETROLEUM CORP	11,357	70.39	799,419.23
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	34.01	562,049.26
ONEOK INC	7,921	58.63	464,408.23
PHILLIPS 66	7,637	82.83	632,572.71
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,195	206.00	864,170.00
SCHLUMBERGER LTD	24,328	36.60	890,404.80
VALERO ENERGY CORP	6,797	78.59	534,176.23
WILLIAMS COS INC	21,953	28.27	620,611.31
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,913	282.81	1,106,635.53
ALBEMARLE CORP	2,101	211.92	445,243.92
AMCOR PLC	30,404	11.92	362,415.68
AVERY DENNISON CORP	1,524	200.37	305,363.88
BALL CORP	5,635	87.23	491,541.05
CELANESE CORP	1,759	160.80	282,847.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,978	68.36	271,936.08
CORTEVA INC	12,364	46.07	569,609.48
CROWN HOLDINGS INC	2,078	108.19	224,818.82
DOW INC	12,848	56.62	727,453.76
DUPONT DE NEMOURS INC	9,146	77.15	705,613.90
EASTMAN CHEMICAL CO	2,692	119.24	320,994.08
ECOLAB INC	4,554	192.61	877,145.94
FMC CORP	2,253	107.40	241,972.20
FREEPORT-MCMORAN INC	26,009	39.96	1,039,319.64
INTERNATIONAL PAPER CO	6,946	48.23	335,005.58
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	136.62	588,968.82
LINDE PLC	8,974	316.16	2,837,219.84
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	93.39	418,480.59
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,158	383.71	444,336.18
MOSAIC CO/THE	5,552	39.11	217,138.72
NEWMONT CORP	13,779	63.08	869,179.32
NUCOR CORP	5,308	95.31	505,905.48
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,870	136.57	255,385.90
PPG INDUSTRIES INC	4,073	155.03	631,437.19

RPM INTERNATIONAL INC	2,344	89.26	209,225.44
SEALED AIR CORP	2,628	66.30	174,236.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,380	298.52	1,307,517.60
STEEL DYNAMICS INC	3,569	54.70	195,224.30
VULCAN MATERIALS CO	2,241	188.79	423,078.39
WESTROCK CO	5,361	44.99	241,191.39
3M CO	10,000	172.80	1,728,000.00
ALLEGION PLC	1,523	123.55	188,166.65
AMETEK INC	3,972	136.33	541,502.76
BOEING CO/THE	9,870	204.20	2,015,454.00
CARRIER GLOBAL CORP	14,219	47.66	677,677.54
CATERPILLAR INC	9,706	214.33	2,080,286.98
CUMMINS INC	2,516	224.00	563,584.00
DEERE & CO	5,137	364.03	1,870,022.11
DOVER CORP	2,606	173.69	452,636.14
EATON CORP PLC	7,026	160.72	1,129,218.72
EMERSON ELECTRIC CO	10,598	93.04	986,037.92
FASTENAL CO	9,880	57.47	567,803.60
FORTIVE CORP	5,995	71.96	431,400.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2,548	97.87	249,372.76
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	286.19	321,677.56
GENERAL DYNAMICS CORP	4,138	207.08	856,897.04
GENERAL ELECTRIC CO	19,463	96.91	1,886,159.33
HEICO CORP	647	145.13	93,899.11
HEICO CORP-CLASS A	1,342	120.95	162,314.90
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,986	204.45	2,450,537.70
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	32.82	192,128.28
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	195.65	118,172.60
IDEX CORP	1,396	220.60	307,957.60
ILLINOIS TOOL WORKS	5,557	237.91	1,322,065.87
INGERSOLL-RAND INC	6,884	57.16	393,489.44
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	59.30	243,130.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	12,349	73.79	911,232.71
KORNIT DIGITAL LTD	899	97.75	87,877.25
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,531	225.05	794,651.55

LENNOX INTERNATIONAL INC	728	288.60	210,100.80
LOCKHEED MARTIN CORP	4,314	373.33	1,610,545.62
MASCO CORP	4,315	65.00	280,475.00
NORDSON CORP	961	234.63	225,479.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,635	403.06	1,062,063.10
OTIS WORLDWIDE CORP	7,016	83.23	583,941.68
OWENS CORNING	1,611	92.27	148,646.97
PACCAR INC	5,970	91.15	544,165.50
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	314.17	705,939.99
PENTAIR PLC	2,913	65.27	190,131.51
PLUG POWER INC	8,433	20.70	174,563.10
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	26,144	88.12	2,303,809.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,998	311.78	622,936.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,875	434.45	814,593.75
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	58.97	188,409.15
SMITH (A.O.) CORP	2,718	78.78	214,124.04
SNAP-ON INC	1,158	210.78	244,083.24
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	178.63	507,130.57
SUNRUN INC	2,890	27.04	78,145.60
TEXTRON INC	4,227	71.89	303,879.03
TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,119	176.25	725,973.75
TRANSDIGM GROUP INC	898	621.27	557,900.46
UNITED RENTALS INC	1,210	312.19	377,749.90
WABTEC CORP	3,299	90.51	298,592.49
WW GRAINGER INC	813	494.05	401,662.65
XYLEM INC	3,290	107.59	353,971.10
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	86.69	211,523.60
CINTAS CORP	1,623	386.32	626,997.36
CLARIVATE PLC	5,086	16.46	83,715.56
COPART INC	3,654	129.42	472,900.68
COSTAR GROUP INC	6,783	69.65	472,435.95
EQUIFAX INC	2,089	234.19	489,222.91
IHS MARKIT LTD	6,841	117.85	806,211.85
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,482	132.13	327,946.66
LEIDOS HOLDINGS INC	2,533	93.04	235,670.32

REPUBLIC SERVICES INC	3,830	127.60	488,708.00
ROBERT HALF INTL INC	2,316	109.88	254,482.08
ROLLINS INC	3,021	31.90	96,369.90
TRANSUNION	3,373	102.68	346,339.64
VERISK ANALYTICS INC	2,643	197.38	521,675.34
WASTE CONNECTIONS INC	4,493	123.30	553,986.90
WASTE MANAGEMENT INC	7,500	149.79	1,123,425.00
AMERCO	179	623.00	111,517.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	107.58	247,864.32
CSX CORP	39,064	34.36	1,342,239.04
DELTA AIR LINES INC	2,928	37.91	111,000.48
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	118.27	363,798.52
FEDEX CORP	4,433	245.72	1,089,276.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,685	202.67	341,498.95
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	57.16	140,613.60
LYFT INC-A	4,003	37.13	148,631.39
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,300	276.31	1,188,133.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,802	309.05	556,908.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	43.87	96,733.35
UBER TECHNOLOGIES INC	21,623	36.28	784,482.44
UNION PACIFIC CORP	11,446	245.10	2,805,414.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	12,875	204.13	2,628,173.75
APTIV PLC	4,894	139.89	684,621.66
BORGWARNER INC	3,548	44.17	156,715.16
FORD MOTOR CO	70,192	20.39	1,431,214.88
GENERAL MOTORS CO	23,162	52.64	1,219,247.68
LEAR CORP	1,094	173.67	189,994.98
LUCID GROUP INC	7,369	37.75	278,179.75
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	3,143	63.90	200,837.70
TESLA INC	14,795	930.00	13,759,350.00
DR HORTON INC	5,990	91.09	545,629.10
GARMIN LTD	2,605	123.41	321,483.05
HASBRO INC	2,664	97.41	259,500.24
LENNAR CORP-A	4,830	100.01	483,048.30
LULULEMON ATHLETICA INC	2,154	321.62	692,769.48

MOHAWK INDUSTRIES INC	916	158.83	145,488.28
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	23.41	129,550.94
NIKE INC -CL B	22,578	146.00	3,296,388.00
NVR INC	54	5,287.17	285,507.18
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,483	29.71	133,189.93
PULTEGROUP INC	4,833	54.00	260,982.00
VF CORP	5,597	68.00	380,596.00
WHIRLPOOL CORP	966	207.20	200,155.20
AIRBNB INC-CLASS A	4,238	147.90	626,800.20
ARAMARK	4,618	34.38	158,766.84
BOOKING HOLDINGS INC	729	2,349.62	1,712,872.98
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,570	75.96	271,177.20
CARNIVAL CORP	14,286	19.74	282,005.64
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	484	1,416.57	685,619.88
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	136.59	325,493.97
DOMINO'S PIZZA INC	663	456.24	302,487.12
DRAFTKINGS INC - CL A	5,981	20.03	119,799.43
EXPEDIA GROUP INC	2,522	171.35	432,144.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,781	140.48	671,634.88
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	44.89	230,061.25
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,754	155.74	740,387.96
MCDONALD'S CORP	13,188	253.61	3,344,608.68
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	11.03	39,708.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	41.89	294,361.03
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,914	78.73	308,149.22
STARBUCKS CORP	20,869	98.10	2,047,248.90
VAIL RESORTS INC	810	283.75	229,837.50
WYNN RESORTS LTD	1,490	84.80	126,352.00
YUM! BRANDS INC	5,112	126.34	645,850.08
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,734	79.97	1,098,307.98
ALPHABET INC-CL A	5,291	2,616.08	13,841,679.28
ALPHABET INC-CL C	5,064	2,607.44	13,204,076.16
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	9,418	16.64	156,715.52
CABLE ONE INC	110	1,541.33	169,546.30
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,285	577.13	1,318,742.05

COMCAST CORP-CLASS A	80,609	50.07	4,036,092.63
DISCOVERY INC - A	1,722	26.88	46,287.36
DISCOVERY INC-C	5,617	26.25	147,446.25
DISH NETWORK CORP-A	3,674	30.83	113,269.42
ELECTRONIC ARTS INC	4,991	135.20	674,783.20
FOX CORP - CLASS A	6,194	39.09	242,123.46
FOX CORP- CLASS B	1,836	35.86	65,838.96
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	128.52	144,713.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	35.61	209,173.14
LIBERTY BROADBAND-A	223	141.22	31,492.06
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	143.05	383,230.95
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	58.32	228,381.12
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,025	45.99	139,119.75
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	45.78	43,307.88
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,942	108.82	320,148.44
MATCH GROUP INC	4,456	117.25	522,466.00
META PLATFORMS INC	41,897	308.71	12,934,022.87
NETFLIX INC	7,787	387.15	3,014,737.05
NEWS CORP - CLASS A	5,861	22.00	128,942.00
OMNICOM GROUP	3,237	75.61	244,749.57
PINTEREST INC- CLASS A	9,515	31.11	296,011.65
ROKU INC	2,074	157.32	326,281.68
SEA LTD-ADR	2,474	149.32	369,417.68
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.05	62,841.35
SNAP INC - A	18,792	31.80	597,585.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,134	164.99	352,088.66
TWITTER INC	13,838	35.06	485,160.28
VIACOMCBS INC - CLASS B	10,543	32.55	343,174.65
WALT DISNEY CO/THE	31,972	137.46	4,394,871.12
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	4,026	49.48	199,206.48
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	232.81	218,142.97
AMAZON.COM INC	8,010	2,890.88	23,155,948.80
AUTOZONE INC	373	1,972.13	735,604.49
BATH & BODY WORKS INC	4,700	56.18	264,046.00
BEST BUY CO INC	3,865	101.38	391,833.70

BURLINGTON STORES INC	1,107	229.60	254,167.20
CARMAX INC	2,885	111.92	322,889.20
CARVANA CO	1,380	157.90	217,902.00
CHEWY INC - CLASS A	1,090	43.27	47,164.30
DOLLAR GENERAL CORP	4,065	216.58	880,397.70
DOLLAR TREE INC	3,916	132.15	517,499.40
DOORDASH INC - A	1,947	117.35	228,480.45
EBAY INC	11,722	59.66	699,334.52
ETSY INC	2,268	154.06	349,408.08
FIVERR INTERNATIONAL LTD	506	81.56	41,269.36
GENUINE PARTS CO	2,564	134.98	346,088.72
HOME DEPOT INC	18,570	363.81	6,755,951.70
LKQ CORP	4,394	55.29	242,944.26
LOWE'S COS INC	12,194	232.35	2,833,275.90
MERCADOLIBRE INC	773	1,026.63	793,584.99
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,200	657.77	789,324.00
POOL CORP	783	477.62	373,976.46
ROSS STORES INC	6,131	98.25	602,370.75
TARGET CORP	8,531	220.58	1,881,767.98
TJX COMPANIES INC	20,783	69.06	1,435,273.98
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,120	217.17	460,400.40
ULTA BEAUTY INC	950	364.84	346,598.00
WAYFAIR INC- CLASS A	1,439	152.78	219,850.42
COSTCO WHOLESALE CORP	7,811	488.90	3,818,797.90
KROGER CO	13,182	47.72	629,045.04
SYSCO CORP	8,818	77.17	680,485.06
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,659	52.38	663,078.42
WALMART INC	27,244	140.20	3,819,608.80
ALTRIA GROUP INC	32,118	49.95	1,604,294.10
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,767	68.59	669,918.53
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	66.17	349,509.94
BUNGE LTD	2,145	93.69	200,965.05
CAMPBELL SOUP CO	3,976	45.32	180,192.32
COCA-COLA CO/THE	72,416	59.96	4,342,063.36
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,239	56.86	241,029.54

CONAGRA BRANDS INC	8,705	35.31	307,373.55
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,972	240.06	713,458.32
GENERAL MILLS INC	10,536	68.55	722,242.80
HERSHEY CO/THE	2,482	199.92	496,201.44
HORMEL FOODS CORP	4,355	49.01	213,438.55
JM SMUCKER CO/THE	1,878	142.02	266,713.56
KELLOGG CO	4,596	66.20	304,255.20
KEURIG DR PEPPER INC	13,149	38.17	501,897.33
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	36.39	413,790.69
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	94.17	401,446.71
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	49.86	139,358.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	24,384	67.61	1,648,602.24
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	88.14	600,497.82
PEPSICO INC	24,388	173.33	4,227,172.04
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	27,578	100.58	2,773,795.24
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	90.65	457,691.85
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	102.42	428,730.12
CLOROX COMPANY	2,061	176.95	364,693.95
COLGATE-PALMOLIVE CO	13,947	83.67	1,166,945.49
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,027	301.79	1,215,308.33
KIMBERLY-CLARK CORP	5,879	141.80	833,642.20
PROCTER & GAMBLE CO/THE	42,835	161.30	6,909,285.50
ABBOTT LABORATORIES	31,273	123.82	3,872,222.86
ABIOMED INC	756	311.94	235,826.64
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,331	474.43	631,466.33
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,590	131.55	340,714.50
ANTHEM INC	4,202	449.50	1,888,799.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,563	85.96	736,075.48
BECTON DICKINSON AND CO	5,101	259.96	1,326,055.96
BOSTON SCIENTIFIC CORP	25,011	42.66	1,066,969.26
CARDINAL HEALTH INC	4,308	50.81	218,889.48
CENTENE CORP	9,908	77.53	768,167.24
CERNER CORP	5,093	91.71	467,079.03
CIGNA CORP	5,878	236.42	1,389,676.76
COOPER COS INC/THE	912	393.31	358,698.72

CVS HEALTH CORP	23,358	103.51	2,417,786.58
DAVITA INC	1,175	110.73	130,107.75
DENTSPLY SIRONA INC	3,748	53.88	201,942.24
DEXCOM INC	1,652	426.83	705,123.16
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,093	110.60	1,226,885.80
HCA HEALTHCARE INC	4,736	243.60	1,153,689.60
HENRY SCHEIN INC	2,103	74.38	156,421.14
HOLOGIC INC	4,309	70.89	305,465.01
HUMANA INC	2,285	379.10	866,243.50
IDEXX LABORATORIES INC	1,506	511.65	770,544.90
INMODE LTD	975	44.61	43,494.75
INSULET CORP	1,229	223.00	274,067.00
INTUITIVE SURGICAL INC	6,319	271.98	1,718,641.62
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	272.15	439,522.25
MASIMO CORP	1,017	223.51	227,309.67
MCKESSON CORP	2,622	248.35	651,173.70
MEDTRONIC PLC	23,778	104.21	2,477,905.38
MOLINA HEALTHCARE INC	1,137	279.77	318,098.49
NOVOCURE LTD	1,677	68.94	115,612.38
OAK STREET HEALTH INC	1,457	18.22	26,546.54
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,197	138.30	303,845.10
RESMED INC	2,476	238.52	590,575.52
STERIS PLC	1,666	224.29	373,667.14
STRYKER CORP	6,026	251.92	1,518,069.92
TELADOC HEALTH INC	2,707	75.16	203,458.12
TELEFLEX INC	849	317.29	269,379.21
UNITEDHEALTH GROUP INC	16,600	462.27	7,673,682.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,562	130.74	204,215.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,458	227.36	558,850.88
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,535	123.65	437,102.75
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	94.66	123,720.62
ABBVIE INC	31,180	132.16	4,120,748.80
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,278	138.12	728,997.36
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,148	136.53	293,266.44
AMGEN INC	9,935	226.08	2,246,104.80

AVANTOR INC	8,797	36.57	321,706.29
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	583.96	218,985.00
BIO-TECHNE CORP	759	381.89	289,854.51
BIOGEN INC	2,609	224.69	586,216.21
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,350	86.22	288,837.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,624	62.61	2,418,248.64
CATALENT INC	2,865	103.74	297,215.10
CHARLES RIVER LABORATORIES	981	330.09	323,818.29
DANAHER CORP	11,338	276.86	3,139,038.68
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	27.10	205,634.80
ELI LILLY & CO	14,345	240.42	3,448,824.90
EXACT SCIENCES CORP	3,021	74.66	225,547.86
GILEAD SCIENCES INC	21,697	68.57	1,487,763.29
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,710	86.85	322,213.50
ILLUMINA INC	2,556	364.96	932,837.76
INCYTE CORP	3,430	75.34	258,416.20
IQVIA HOLDINGS INC	3,320	243.70	809,084.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	135.67	102,159.51
JOHNSON & JOHNSON	46,343	162.97	7,552,518.71
MERCK & CO. INC.	44,664	78.83	3,520,863.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	404	1,462.64	590,906.56
MODERNA INC	5,902	157.30	928,384.60
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,875	75.86	142,237.50
NOVAVAX INC	1,081	79.47	85,907.07
PERKINELMER INC	2,057	174.11	358,144.27
PFIZER INC	98,807	51.54	5,092,512.78
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,831	621.48	1,137,929.88
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,242	39.47	246,371.74
SEAGEN INC	2,365	129.55	306,385.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	8.46	177,169.32
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,937	575.80	3,994,324.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,485	229.68	1,030,114.80
VIATRIS INC	22,098	14.36	317,327.28
WATERS CORP	1,044	322.88	337,086.72
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,251	383.52	479,783.52

ZOETIS INC	8,212	200.07	1,642,974.84
BANK OF AMERICA CORP	133,213	44.55	5,934,639.15
CITIGROUP INC	35,708	62.70	2,238,891.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	51.10	383,301.10
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	45.48	565,543.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	210	825.77	173,411.70
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,042	174.86	531,924.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.64	407,171.76
JPMORGAN CHASE & CO	52,598	144.95	7,624,080.10
KEYCORP	17,095	24.99	427,204.05
M & T BANK CORP	2,483	166.63	413,742.29
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,340	204.11	1,498,167.40
REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	22.97	389,364.47
SIGNATURE BANK	1,113	314.17	349,671.21
SVB FINANCIAL GROUP	1,055	570.01	601,360.55
TRUIST FINANCIAL CORP	23,236	62.30	1,447,602.80
US BANCORP	24,451	56.81	1,389,061.31
WELLS FARGO & CO	72,485	53.32	3,864,900.20
ALLY FINANCIAL INC	6,403	46.68	298,892.04
AMERICAN EXPRESS CO	11,793	158.93	1,874,261.49
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	300.96	624,792.96
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,244	65.35	342,695.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14,390	58.90	847,571.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	23,341	303.73	7,089,361.93
BLACKROCK INC	2,692	786.82	2,118,119.44
BLACKSTONE INC	12,166	109.39	1,330,838.74
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,945	148.30	1,178,243.50
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	48.04	129,708.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	118.10	231,003.60
CME GROUP INC	6,339	224.25	1,421,520.75
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	691	191.48	132,312.68
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,266	115.34	607,380.44
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	32.93	184,342.14
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	749	420.98	315,314.02
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	31.69	144,601.47

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	43.25	34,600.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,868	343.39	2,015,012.52
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,958	125.32	1,247,936.56
INVESCO LTD	5,927	21.57	127,845.39
KKR & CO INC	9,044	65.41	591,568.04
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	365.22	253,097.46
MOODY'S CORP	2,986	344.08	1,027,422.88
MORGAN STANLEY	24,101	98.08	2,363,826.08
MSCI INC	1,424	507.07	722,067.68
NASDAQ INC	2,170	176.33	382,636.10
NORTHERN TRUST CORP	3,716	116.32	432,245.12
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,393	97.64	331,292.52
ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,321	13.12	43,571.52
S&P GLOBAL INC	4,271	417.95	1,785,064.45
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,625	88.71	2,273,193.75
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	58.48	101,521.28
SOFI TECHNOLOGIES INC	9,460	13.30	125,818.00
STATE STREET CORP	6,599	93.80	618,986.20
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	44.93	438,426.94
T ROWE PRICE GROUP INC	3,918	159.32	624,215.76
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	89.58	137,057.40
UPSTART HOLDINGS INC	356	91.36	32,524.16
AFLAC INC	11,207	61.48	689,006.36
ALLEGHANY CORP	197	657.00	129,429.00
ALLSTATE CORP	5,193	121.92	633,130.56
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,465	129.00	188,985.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,874	57.46	854,660.04
AON PLC	3,988	273.65	1,091,316.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	45.70	278,815.70
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,581	156.29	559,674.49
ASSURANT INC	896	149.60	134,041.60
BROWN & BROWN INC	4,086	64.61	263,996.46
CHUBB LTD	7,783	195.90	1,524,689.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,800	117.17	328,076.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	179.35	68,511.70

EVEREST RE GROUP LTD	734	284.11	208,536.74
FNF GROUP	4,754	50.31	239,173.74
GLOBE LIFE INC	1,521	102.06	155,233.26
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	70.58	461,875.52
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	66.56	222,376.96
LOEWS CORP	3,999	58.96	235,781.04
MARKEL CORP	251	1,229.41	308,581.91
MARSH & MCLENNAN COS	8,802	157.96	1,390,363.92
METLIFE INC	12,898	65.41	843,658.18
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	72.16	360,367.04
PROGRESSIVE CORP	10,386	109.88	1,141,213.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,833	109.44	747,803.52
TRAVELERS COS INC/THE	4,363	168.83	736,605.29
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	230.84	498,152.72
WR BERKLEY CORP	2,140	83.36	178,390.40
CBRE GROUP INC - A	5,718	100.75	576,088.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	5.49	110,349.00
ZILLOW GROUP INC - A	904	52.27	47,252.08
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	53.29	143,563.26
ACCENTURE PLC-CL A	11,199	339.00	3,796,461.00
ADOBE INC	8,401	519.66	4,365,663.66
AFFIRM HOLDINGS INC	1,615	58.25	94,073.75
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	114.19	331,151.00
ANSYS INC	1,507	334.77	504,498.39
ASANA INC - CL A	1,233	54.69	67,432.77
AUTODESK INC	3,802	245.35	932,820.70
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,352	218.24	1,604,500.48
AVALARA INC	1,520	106.42	161,758.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	39.80	103,121.80
BILL.COM HOLDINGS INC	1,382	166.73	230,420.86
BLACK KNIGHT INC	3,383	74.12	250,747.96
BLOCK INC	8,884	117.30	1,042,093.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,131	157.92	336,527.52
CADENCE DESIGN SYS INC	4,809	151.66	729,332.94
CERIDIAN HCM HOLDING INC	2,496	77.65	193,814.40

CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	124.24	206,735.36
CITRIX SYSTEMS INC	2,191	106.34	232,990.94
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,172	93.28	389,164.16
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9,115	85.10	775,686.50
COUPA SOFTWARE INC	1,218	132.35	161,202.30
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,333	167.27	557,510.91
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	798	140.29	111,951.42
DATADOG INC - CLASS A	3,490	136.07	474,884.30
DOCUSIGN INC	3,419	121.83	416,536.77
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	24.00	127,968.00
DYNATRACE INC	3,655	50.19	183,444.45
EPAM SYSTEMS INC	975	468.41	456,699.75
FAIR ISAAC CORP	571	439.45	250,925.95
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,714	111.79	1,197,718.06
FISERV INC	10,369	102.74	1,065,311.06
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	225.45	317,884.50
FORTINET INC	2,399	290.37	696,597.63
GARTNER INC	1,494	287.03	428,822.82
GLOBAL PAYMENTS INC	5,102	140.81	718,412.62
GODADDY INC - CLASS A	3,327	73.39	244,168.53
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,578	99.67	157,279.26
HUBSPOT INC	774	465.07	359,964.18
INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,931	128.82	2,052,231.42
INTUIT INC	4,832	534.68	2,583,573.76
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	163.22	209,574.48
MASTERCARD INC-CLASS A	15,539	349.42	5,429,637.38
MICROSOFT CORP	125,468	296.37	37,184,951.16
MONGODB INC	966	386.45	373,310.70
NORTONLIFELOCK INC	8,787	26.13	229,604.31
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,530	55.05	304,426.50
OKTA INC	2,109	190.90	402,608.10
ORACLE CORP	29,659	82.42	2,444,494.78
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,325	13.40	366,155.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,683	504.21	848,585.43
PAYCHEX INC	5,606	120.09	673,224.54

PAYCOM SOFTWARE INC	910	326.29	296,923.90
PAYPAL HOLDINGS INC	19,724	162.17	3,198,641.08
PTC INC	1,603	117.60	188,512.80
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	173.54	220,395.80
SALESFORCE.COM INC	17,272	223.03	3,852,174.16
SERVICENOW INC	3,513	525.84	1,847,275.92
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,761	277.50	1,043,677.50
SPLUNK INC	2,723	121.29	330,272.67
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	78.91	325,582.66
SYNOPSYS INC	2,636	308.34	812,784.24
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,455	65.33	487,035.15
TWILIO INC - A	2,853	197.50	563,467.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	748	466.82	349,181.36
UNITY SOFTWARE INC	839	110.92	93,061.88
VERISIGN INC	1,710	220.10	376,371.00
VISA INC-CLASS A SHARES	29,752	201.85	6,005,441.20
VMWARE INC-CLASS A	3,863	125.19	483,608.97
WESTERN UNION CO	5,513	17.86	98,462.18
WIX.COM LTD	998	129.38	129,121.24
WORKDAY INC-CLASS A	3,335	247.63	825,846.05
ZENDESK INC	2,234	95.77	213,950.18
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,674	152.95	561,938.30
ZSCALER INC	1,359	243.20	330,508.80
AMPHENOL CORP-CL A	10,315	77.35	797,865.25
APPLE INC	290,497	161.62	46,950,125.14
ARISTA NETWORKS INC	4,084	121.52	496,287.68
ARROW ELECTRONICS INC	1,337	125.85	168,261.45
CDW CORP/DE	2,596	185.15	480,649.40
CISCO SYSTEMS INC	74,415	56.90	4,234,213.50
COGNEX CORP	2,959	67.71	200,353.89
CORNING INC	14,801	35.33	522,919.33
DELL TECHNOLOGIES -C	5,156	55.42	285,745.52
F5 INC	916	226.67	207,629.72
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	24,541	16.10	395,110.10
HP INC	22,784	35.62	811,566.08

IPG PHOTONICS CORP	558	153.79	85,814.82
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	32.29	146,370.57
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	175.36	541,160.96
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,928	239.51	701,285.28
NETAPP INC	3,840	86.52	332,236.80
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,790	97.16	368,236.40
TE CONNECTIVITY LTD	5,700	152.51	869,307.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	803	417.01	334,859.03
TRIMBLE INC	4,462	72.52	323,584.24
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	57.02	293,367.90
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	490.56	458,183.04
AT&T INC	125,744	26.34	3,312,096.96
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	26.48	34,582.88
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	26.63	165,984.79
LUMEN TECHNOLOGIES INC	16,742	12.25	205,089.50
T-MOBILE US INC	10,801	106.65	1,151,926.65
VERIZON COMMUNICATIONS INC	72,878	52.96	3,859,618.88
AES CORP	13,306	22.59	300,582.54
ALLIANT ENERGY CORP	4,611	58.75	270,896.25
AMEREN CORPORATION	4,330	86.40	374,112.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,643	89.12	770,264.16
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,140	159.79	501,740.60
ATMOS ENERGY CORP	2,000	102.32	204,640.00
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	27.16	269,237.08
CMS ENERGY CORP	5,193	62.60	325,081.80
CONSOLIDATED EDISON INC	6,459	81.99	529,573.41
DOMINION ENERGY INC	14,281	78.48	1,120,772.88
DTE ENERGY COMPANY	3,309	116.88	386,755.92
DUKE ENERGY CORP	13,295	102.58	1,363,801.10
EDISON INTERNATIONAL	6,481	62.27	403,571.87
ENERGY CORP	3,422	108.19	370,226.18
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	47.83	190,459.06
EVERGY INC	3,540	63.58	225,073.20
EVERSOURCE ENERGY	6,304	86.15	543,089.60
EXELON CORP	16,898	56.10	947,977.80

FIRSTENERGY CORP	10,241	41.31	423,055.71
NEXTERA ENERGY INC	34,688	81.92	2,841,640.96
NISOURCE INC	7,043	27.04	190,442.72
NRG ENERGY INC	5,306	39.82	211,284.92
P G & E CORP	27,434	12.17	333,871.78
PPL CORP	13,143	29.56	388,507.08
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,740	64.35	562,419.00
SEMPRA ENERGY	5,479	131.65	721,310.35
SOUTHERN CO/THE	18,300	67.37	1,232,871.00
UGI CORP	3,091	44.41	137,271.31
VISTRA CORP	9,405	21.96	206,533.80
WEC ENERGY GROUP INC	5,459	95.13	519,314.67
XCEL ENERGY INC	9,302	67.43	627,233.86
ADVANCED MICRO DEVICES	21,400	116.53	2,493,742.00
ANALOG DEVICES INC	9,295	161.44	1,500,584.80
APPLIED MATERIALS INC	15,855	139.29	2,208,442.95
BROADCOM INC	7,233	541.58	3,917,248.14
ENPHASE ENERGY INC	2,171	128.10	278,105.10
ENTEGRIS INC	2,468	122.85	303,193.80
INTEL CORP	71,561	51.94	3,716,878.34
KLA CORP	2,650	391.10	1,036,415.00
LAM RESEARCH CORP	2,465	621.82	1,532,786.30
MARVELL TECHNOLOGY INC	14,361	72.09	1,035,284.49
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,458	74.85	707,931.30
MICRON TECHNOLOGY INC	19,379	82.95	1,607,488.05
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	786	402.02	315,987.72
NVIDIA CORP	43,959	233.72	10,274,097.48
NXP SEMICONDUCTORS NV	4,766	203.07	967,831.62
ON SEMICONDUCTOR CORP	7,719	55.34	427,169.46
QORVO INC	2,035	137.65	280,117.75
QUALCOMM INC	19,896	170.07	3,383,712.72
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	143.84	388,799.52
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	952	225.87	215,028.24
TERADYNE INC	2,952	147.44	435,242.88
TEXAS INSTRUMENTS INC	16,293	178.34	2,905,693.62

	XILINX INC	4,251	185.51	788,603.01
	米ドル 小計	5,543,862		678,923,941.13 (77,404,118,528)
カナダドル	CAMECO CORP	8,016	25.33	203,045.28
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	20,529	62.30	1,278,956.70
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	17.61	388,089.18
	ENBRIDGE INC	35,044	50.87	1,782,688.28
	IMPERIAL OIL LTD	4,737	50.58	239,597.46
	KEYERA CORP	5,630	27.76	156,288.80
	PARKLAND CORP	1,790	33.16	59,356.40
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,270	38.50	395,395.00
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	33.20	850,418.00
	TC ENERGY CORP	17,347	62.37	1,081,932.39
	TOURMALINE OIL CORP	6,019	43.43	261,405.17
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,733	63.56	300,829.48
	BARRICK GOLD CORP	29,830	24.45	729,343.50
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	64.84	201,263.36
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,217	32.24	329,396.08
	FRANCO-NEVADA CORP	3,254	163.52	532,094.08
	IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	11.28	116,849.52
	KINROSS GOLD CORP	19,092	7.07	134,980.44
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,057	50.24	254,063.68
	LUNDIN MINING CORP	16,915	10.48	177,269.20
	NUTRIEN LTD	9,609	88.01	845,688.09
	PAN AMERICAN SILVER CORP	5,353	29.11	155,825.83
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	8,203	40.52	332,385.56
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,663	112.19	186,571.97
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	50.83	400,845.38
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	12.39	33,130.86
	CAE INC	5,971	30.95	184,802.45
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	107.04	151,568.64
	WSP GLOBAL INC	1,908	166.17	317,052.36
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	41.06	128,723.10
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	78.03	141,156.27
	THOMSON REUTERS CORP	2,939	134.40	395,001.60

AIR CANADA	840	21.79	18,303.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,196	153.59	1,873,183.64
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,106	93.20	1,501,079.20
TFI INTERNATIONAL INC	1,624	122.03	198,176.72
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	99.12	536,140.08
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	49.27	186,634.76
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	70.41	373,102.59
QUEBECOR INC -CL B	4,598	28.99	133,296.02
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	37.86	329,457.72
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	176.98	165,122.34
DOLLARAMA INC	5,287	61.83	326,895.21
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	14,242	49.75	708,539.50
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	37.27	97,945.56
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	93.30	302,571.90
METRO INC	4,307	64.45	277,586.15
WESTON (GEORGE) LTD	1,578	132.82	209,589.96
SAPUTO INC	3,667	27.45	100,659.15
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	31.11	190,953.18
CANOPY GROWTH CORP	3,659	9.35	34,211.65
BANK OF MONTREAL	11,149	142.10	1,584,272.90
BANK OF NOVA SCOTIA	20,901	88.99	1,859,979.99
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,713	158.26	1,220,659.38
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	97.25	549,073.50
ROYAL BANK OF CANADA	25,220	143.34	3,615,034.80
TORONTO-DOMINION BANK	32,272	99.21	3,201,705.12
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	25,108	67.75	1,701,067.00
IGM FINANCIAL INC	1,623	45.03	73,083.69
ONEX CORPORATION	908	90.03	81,747.24
TMX GROUP LTD	1,457	125.23	182,460.11
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	600.95	274,033.20
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	38.19	165,286.32
IA FINANCIAL CORP INC	2,752	77.86	214,270.72
INTACT FINANCIAL CORP	3,041	166.70	506,934.70
MANULIFE FINANCIAL CORP	33,538	25.04	839,791.52
POWER CORP OF CANADA	10,869	40.19	436,825.11

	SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	69.74	696,702.60	
	FIRSTSERVICE CORP	671	198.28	133,045.88	
	BLACKBERRY LTD	7,347	10.36	76,114.92	
	CGI INC	3,796	105.45	400,288.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,080.97	709,610.77	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	38.25	60,932.25	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	74.85	62,050.65	
	OPEN TEXT CORP	4,289	59.08	253,394.12	
	SHOPIFY INC - CLASS A	2,003	1,188.46	2,380,485.38	
	BCE INC	1,259	64.96	81,784.64	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6,149	60.73	373,428.77	
	TELUS CORP	8,222	29.25	240,493.50	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,058	17.45	245,312.10	
	ALTAGAS LTD	7,212	25.62	184,771.44	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	41.60	85,529.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.75	35,285.25	
	EMERA INC	4,505	59.58	268,407.90	
	FORTIS INC	8,232	58.68	483,053.76	
	HYDRO ONE LTD	4,991	32.06	160,011.46	
	NORTHLAND POWER INC	3,252	35.99	117,039.48	
	カナダドル 小計	695,169		43,863,431.01 (3,957,797,380)	
ユーロ	ENI SPA	42,914	12.68	544,407.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.26	68,646.24	
	NESTE OYJ	7,057	39.27	277,128.39	
	OMV AG	2,574	51.66	132,972.84	
	REPSOL SA	24,986	10.42	260,454.06	
	TENARIS SA	5,062	9.85	49,860.70	
	TOTALENERGIES SE	44,618	47.91	2,137,871.47	
	AIR LIQUIDE SA	8,488	150.72	1,279,311.36	
	AKZO NOBEL	3,222	90.08	290,237.76	
	ARCELORMITTAL	12,348	26.98	333,210.78	
	ARKEMA	1,076	123.10	132,455.60	
	BASF SE	16,548	64.89	1,073,799.72	
	COVESTRO AG	3,382	51.80	175,187.60	

CRH PLC	13,641	43.14	588,472.74
EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	28.64	112,326.08
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,085	37.34	40,513.90
HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	60.04	129,926.56
KONINKLIJKE DSM NV	2,952	167.95	495,788.40
LANXESS AG	1,915	51.92	99,426.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	45.05	179,118.80
SOLVAY SA	1,489	105.55	157,163.95
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,685	16.14	188,595.90
SYMRISE AG	2,370	109.15	258,685.50
UMICORE	3,883	32.61	126,624.63
UPM-KYMMENE OYJ	9,909	34.01	337,005.09
VOESTALPINE AG	2,425	30.00	72,750.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,217	22.48	94,798.16
AIRBUS SE	10,578	107.34	1,135,442.52
ALSTOM	5,811	30.79	178,920.69
BOUYGUES SA	3,499	31.05	108,643.95
BRENTAG SE	2,419	75.00	181,425.00
CNH INDUSTRIAL NV	19,340	13.12	253,837.50
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8,682	57.96	503,208.72
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	7,471	31.72	237,017.47
DASSAULT AVIATION SA	110	100.00	11,000.00
EIFFAGE	1,503	91.00	136,773.00
FERROVIAL SA	7,014	24.71	173,315.94
GEA GROUP AG	3,473	41.34	143,573.82
IMCD NV	1,073	149.95	160,896.35
KINGSPAN GROUP PLC	2,977	79.22	235,837.94
KION GROUP AG	1,385	81.12	112,351.20
KNORR-BREMSE AG	1,136	87.90	99,854.40
KONE OYJ-B	5,617	56.10	315,113.70
LEGRAND SA	4,583	89.18	408,711.94
MTU AERO ENGINES AG	938	186.50	174,937.00
PRYSMIAN SPA	4,594	29.52	135,614.88
RATIONAL AG	80	740.60	59,248.00
SAFRAN SA	5,873	104.02	610,909.46

SCHNEIDER ELECTRIC SE	9,655	149.94	1,447,670.70
SIEMENS AG-REG	13,602	139.46	1,896,934.92
SIEMENS ENERGY AG	7,711	18.20	140,340.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	16.58	68,442.24
THALES SA	1,768	80.42	142,182.56
VINCI SA	9,484	95.28	903,635.52
WARTSILA OYJ ABP	8,128	11.74	95,422.72
BUREAU VERITAS SA	4,564	24.67	112,593.88
RANDSTAD NV	1,871	56.94	106,534.74
TELEPERFORMANCE	1,061	331.20	351,403.20
WOLTERS KLUWER	4,948	86.94	430,179.12
ADP	314	120.95	37,978.30
AENA SME SA	1,497	142.85	213,846.45
ATLANTIA SPA	8,066	16.25	131,072.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10,938	6.63	72,617.38
DEUTSCHE POST AG-REG	17,844	50.45	900,229.80
GETLINK	9,276	13.86	128,611.74
INPOST SA	3,195	6.49	20,757.91
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,866	91.83	538,674.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	74.50	46,115.50
CONTINENTAL AG	2,088	86.75	181,134.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	14,942	68.71	1,026,664.82
FAURECIA	2,333	38.82	90,567.06
FERRARI NV	2,202	197.95	435,885.90
MICHELIN (CGDE)	3,012	145.15	437,191.80
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	81.36	195,182.64
RENAULT SA	3,099	32.38	100,345.62
STELLANTIS NV	35,353	16.78	593,506.16
VALEO SA	3,692	24.17	89,235.64
VOLKSWAGEN AG	462	244.80	113,097.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,269	181.02	591,754.38
ADIDAS AG	3,306	240.40	794,762.40
ESSILORLUXOTTICA	5,113	167.22	854,995.86
HERMES INTERNATIONAL	550	1,308.50	719,675.00
KERING	1,339	648.90	868,877.10

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,915	662.80	3,257,662.00
MONCLER SPA	3,302	55.58	183,525.16
PUMA SE	2,047	90.80	185,867.60
SEB SA	609	126.60	77,099.40
ACCOR SA	2,330	30.84	71,857.20
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	125.15	350,169.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,369	35.32	83,673.08
SODEXO	1,542	81.72	126,012.24
BOLLORE	14,850	4.63	68,755.50
PUBLICIS GROUPE	3,613	57.04	206,085.52
SCOUT24 SE	1,621	54.58	88,474.18
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,377	49.82	118,422.14
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,144	20.96	296,458.24
VIVENDI	14,144	11.17	158,059.20
DELIVERY HERO SE	2,979	68.72	204,716.88
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,585	27.15	504,582.75
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	42.77	150,422.09
PROSUS NV	16,565	72.48	1,200,631.20
ZALANDO SE	3,789	65.02	246,360.78
CARREFOUR SA	10,978	17.39	190,962.31
COLRUYT SA	290	35.44	10,277.60
HELLOFRESH SE	3,031	53.98	163,613.38
JERONIMO MARTINS	5,217	20.79	108,461.43
KESKO OYJ-B SHS	4,478	26.18	117,234.04
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,708	28.46	504,058.22
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,146	56.49	799,107.54
DANONE	11,362	56.06	636,953.72
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	11.13	100,370.89
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	79.80	145,236.00
HEINEKEN NV	4,447	97.66	434,294.02
JDE PEET'S BV	1,184	25.35	30,014.40
KERRY GROUP PLC-A	2,701	111.20	300,351.20
PERNOD RICARD SA	3,643	193.00	703,099.00
REMY COINTREAU	264	191.90	50,661.60
BEIERSDORF AG	1,716	89.42	153,444.72

HENKEL AG & CO KGAA	1,562	72.45	113,166.90
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,219	76.00	244,644.00
L'OREAL	4,486	366.35	1,643,446.10
AMPLIFON SPA	2,059	37.24	76,677.16
BIOMERIEUX	820	101.00	82,820.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	133.55	84,136.50
DIASORIN SPA	629	134.70	84,726.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	56.52	219,184.56
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	35.50	253,044.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,274	28.03	428,206.59
ORPEA	1,093	69.28	75,723.04
SARTORIUS AG-VORZUG	502	440.00	220,880.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	58.00	270,686.00
ARGENX SE	902	232.80	209,985.60
BAYER AG-REG	17,000	50.59	860,030.00
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	87.98	189,069.02
GRIFOLS SA	3,329	15.36	51,150.08
IPSEN	158	83.56	13,202.48
MERCK KGAA	2,192	190.45	417,466.40
ORION OYJ-CLASS B	2,696	34.15	92,068.40
QIAGEN N.V.	4,271	42.65	182,158.15
RECORDATI SPA	1,969	50.52	99,473.88
SANOFI	20,239	88.52	1,791,556.28
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	368.80	163,747.20
UCB SA	2,214	86.40	191,289.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,957	13.82	109,997.56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	114,269	5.43	620,594.93
BANCO SANTANDER SA	302,871	2.94	891,349.35
BNP PARIBAS	19,707	60.10	1,184,390.70
CAIXABANK S.A	78,740	2.68	211,653.12
COMMERZBANK AG	13,866	7.16	99,280.56
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	12.86	282,951.13
ERSTE GROUP BANK AG	5,946	40.48	240,694.08
FINECOBANK SPA	11,008	14.90	164,074.24
ING GROEP NV-CVA	69,555	12.45	866,377.08

INTESA SANPAOLO	281,987	2.46	695,520.93
KBC GROEP NV	4,507	75.50	340,278.50
MEDIOBANCA SPA	10,633	9.79	104,097.07
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,444	23.10	56,456.40
SOCIETE GENERALE SA	14,646	31.11	455,710.29
UNICREDIT SPA	35,836	12.84	460,420.92
AMUNDI SA	618	67.20	41,529.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	10.97	386,927.58
DEUTSCHE BOERSE AG	3,278	160.60	526,446.80
EURAZEO	403	71.20	28,693.60
EURONEXT NV	1,722	83.35	143,528.70
EXOR NV	2,224	71.74	159,549.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	92.74	183,532.46
SOFINA	168	344.80	57,926.40
WENDEL	294	94.55	27,797.70
AEGON NV	35,058	4.82	169,014.61
AGEAS	3,211	41.58	133,513.38
ALLIANZ SE-REG	7,359	216.45	1,592,855.55
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	17.80	363,458.20
AXA SA	33,466	26.76	895,717.49
CNP ASSURANCES	3,403	21.76	74,049.28
HANNOVER RUECK SE	1,152	161.00	185,472.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,428	262.25	636,743.00
NN GROUP NV	4,060	47.91	194,514.60
POSTE ITALIANE SPA	11,160	11.02	123,039.00
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	41.19	346,860.99
AROUNDTOWN SA	20,993	5.35	112,438.50
LEG IMMOBILIEN SE	1,515	113.05	171,270.75
VONOVIA SE	12,977	47.15	611,865.55
ADYEN NV	351	1,678.20	589,048.20
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	59.80	457,350.40
BECHTLE AG	1,242	51.08	63,441.36
CAPGEMINI SA	2,763	190.70	526,904.10
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	42.67	495,968.85
EDENRED	4,235	38.21	161,819.35

NEMETSCHKE SE	1,322	75.68	100,048.96
NEXI SPA	7,091	12.93	91,722.08
SAP SE	18,577	116.94	2,172,394.38
WORLDLINE SA	4,054	42.00	170,268.00
NOKIA OYJ	92,708	4.79	444,673.92
CELLNEX TELECOM SA	8,821	41.05	362,102.05
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	57,744	15.94	920,901.31
ELISA OYJ	2,589	51.38	133,022.82
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.11	22,519.92
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.80	165,284.58
ORANGE	34,597	9.98	345,485.64
PROXIMUS	918	17.49	16,055.82
TELECOM ITALIA SPA	242,872	0.40	99,310.36
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.54	32,057.25
TELEFONICA SA	91,673	4.02	368,708.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	33.74	25,844.84
E.ON SE	38,444	11.91	457,944.92
EDF	10,409	8.14	84,729.26
EDP RENOVAVEIS SA	4,503	18.57	83,620.71
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.43	219,405.39
ELIA GROUP SA/NV	345	112.10	38,674.50
ENAGAS SA	6,522	19.59	127,798.59
ENDESA SA	4,803	19.43	93,346.30
ENEL SPA	146,107	6.66	973,803.15
ENGIE	31,335	13.17	412,744.62
FORTUM OYJ	7,645	23.46	179,351.70
IBERDROLA SA	101,726	9.97	1,014,208.22
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	28.25	131,306.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	17.79	153,598.86
RWE AG	11,090	35.20	390,368.00
SNAM SPA	32,585	4.94	161,132.82
TERNA SPA	25,545	6.83	174,574.53
UNIPER SE	1,582	38.82	61,413.24
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,301	30.76	347,618.76
VERBUND AG	1,068	88.75	94,785.00

	ASM INTERNATIONAL NV	888	303.30	269,330.40
	ASML HOLDING NV	7,232	585.00	4,230,720.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,556	34.45	777,054.20
	STMICROELECTRONICS NV	12,491	38.69	483,276.79
	ユーロ 小計	3,276,919		82,653,338.13 (10,667,239,819)
英bond	BP PLC	349,095	3.64	1,271,054.89
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	70,726	17.47	1,235,724.67
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	63,903	17.47	1,116,896.63
	ANGLO AMERICAN PLC	22,057	32.21	710,455.97
	ANTOFAGASTA PLC	7,429	13.56	100,774.38
	BHP GROUP PLC	37,095	23.33	865,611.82
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,620	77.42	202,840.40
	EVRAZ PLC	3,072	4.96	15,252.48
	GLENCORE PLC	170,301	3.88	661,193.63
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	18.71	58,746.38
	MONDI PLC	7,876	17.65	139,011.40
	RIO TINTO PLC	20,084	52.64	1,057,221.76
	ASHTREAD GROUP PLC	7,622	49.50	377,289.00
	BAE SYSTEMS PLC	55,064	5.98	329,282.72
	BUNZL PLC	7,087	26.99	191,278.13
	DCC PLC	1,401	61.24	85,797.24
	FERGUSON PLC	3,775	113.55	428,651.25
	MELROSE INDUSTRIES PLC	68,951	1.49	102,943.84
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.13	185,883.87
	SMITHS GROUP PLC	6,986	15.17	106,012.55
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	126.90	152,787.60
	EXPERIAN PLC	16,860	29.49	497,201.40
	INTERTEK GROUP PLC	2,573	52.84	135,957.32
	RELX PLC	34,385	22.28	766,097.80
	RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	5.21	154,151.91
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	6.14	125,878.27
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,383	40.90	56,564.70
	BURBERRY GROUP PLC	7,146	18.86	134,773.56
	PERSIMMON PLC	5,194	23.90	124,136.60

TAYLOR WIMPEY PLC	77,500	1.47	113,963.75
COMPASS GROUP PLC	30,179	16.18	488,296.22
ENTAIN PLC	10,699	15.45	165,299.55
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,117	46.66	145,439.22
WHITBREAD PLC	2,921	29.42	85,935.82
AUTO TRADER GROUP PLC	20,378	6.59	134,331.77
INFORMA PLC	30,041	5.27	158,316.07
PEARSON PLC	13,772	5.99	82,494.28
WPP PLC	19,572	11.44	223,903.68
JD SPORTS FASHION PLC	24,800	1.82	45,359.20
KINGFISHER PLC	46,444	3.16	146,995.26
NEXT PLC	2,522	72.62	183,147.64
OCADO GROUP PLC	9,232	13.58	125,416.72
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.84	79,071.28
TESCO PLC	131,492	2.88	378,959.94
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	19.86	98,808.51
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	37,631	31.84	1,198,359.19
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	24.90	95,068.20
DIAGEO PLC	41,407	36.72	1,520,465.04
IMPERIAL BRANDS PLC	16,315	17.36	283,228.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,307	64.26	790,847.82
UNILEVER PLC	45,230	39.43	1,783,645.05
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	12.13	204,232.81
ASTRAZENECA PLC	27,384	83.16	2,277,253.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	89,341	16.14	1,442,499.78
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,811	19.82	75,553.07
BARCLAYS PLC	290,654	1.90	553,288.95
HSBC HOLDINGS PLC	362,413	4.92	1,783,615.57
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,213,798	0.49	598,038.27
NATWEST GROUP PLC	106,419	2.29	244,657.28
STANDARD CHARTERED PLC	49,470	4.87	241,364.13
3I GROUP PLC	18,949	12.98	246,052.76
ABRDN PLC	32,937	2.29	75,491.60
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	12.96	72,539.17

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,605	73.62	412,640.10
	M&G PLC	41,949	2.06	86,666.63
	SCHRODERS PLC	2,782	32.81	91,277.42
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,459	15.08	172,801.72
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	31.25	85,781.25
	AVIVA PLC	74,601	4.24	316,382.84
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.81	293,384.82
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.60	57,750.00
	PRUDENTIAL PLC	44,928	12.33	553,962.24
	AVEVA GROUP PLC	2,041	28.15	57,454.15
	SAGE GROUP PLC/THE	18,579	7.67	142,538.08
	HALMA PLC	6,704	24.43	163,778.72
	BT GROUP PLC	161,710	1.86	300,942.31
	VODAFONE GROUP PLC	498,320	1.22	612,235.95
	NATIONAL GRID PLC	65,257	10.79	704,123.03
	SEVERN TRENT PLC	5,286	28.85	152,501.10
	SSE PLC	18,204	15.37	279,886.50
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	10.59	139,089.06
	英ポンド 小計	5,108,132		32,154,607.53 (4,942,163,177)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.02	54,202.22
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	904.00	70,512.00
	GIVAUDAN-REG	160	4,015.00	642,400.00
	HOLCIM LTD	9,074	48.34	438,637.16
	SIKA AG-REG	2,454	308.80	757,795.20
	ABB LTD-REG	29,408	32.01	941,350.08
	GEBERIT AG-REG	643	618.80	397,888.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	214.40	46,096.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	216.80	153,277.60
	VAT GROUP AG	505	354.60	179,073.00
	ADECCO SA-REG	2,354	45.36	106,777.44
	SGS SA-REG	121	2,574.00	311,454.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	936	249.90	233,906.40
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	9,372	127.85	1,198,210.20
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	289.70	118,777.00

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	54.80	13,754.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	76	2,168.00	164,768.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	9,955.00	238,920.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	101,400.00	101,400.00	
	NESTLE SA-REG	49,856	118.00	5,883,008.00	
	ALCON INC	8,564	67.78	580,467.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	304.80	313,639.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	176	1,463.50	257,576.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	116	517.00	59,972.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,318	612.40	807,143.20	
	NOVARTIS AG-REG	38,435	76.75	2,949,886.25	
	ROCHE HOLDING AG-BR	604	370.20	223,600.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12,386	344.75	4,270,073.50	
	VIFOR PHARMA AG	638	161.55	103,068.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	44,532	8.27	368,546.83	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	58.94	210,356.86	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,242.50	498,242.50	
	UBS GROUP AG-REG	65,676	16.67	1,094,818.92	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	154.00	101,332.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	568	562.40	319,443.20	
	SWISS RE AG	5,123	96.62	494,984.26	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,680	423.10	1,133,908.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	87.05	97,234.85	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	104.00	121,576.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	66.38	195,754.62	
	SWISSCOM AG-REG	414	515.60	213,458.40	
	スイスフラン 小計	301,616		26,467,291.71 (3,299,941,930)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	350.70	1,132,761.00	
	BOLIDEN AB	4,039	372.10	1,502,911.90	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	10,612	152.65	1,619,921.80	
	ALFA LAVAL AB	6,477	307.50	1,991,677.50	
	ASSA ABLOY AB-B	17,222	246.70	4,248,667.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,365	543.80	6,724,087.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	470.20	3,234,035.60	

EPIROC AB-A	11,278	208.00	2,345,824.00
EPIROC AB-B	4,649	174.70	812,180.30
HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	122.00	988,078.00
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	278.90	408,309.60
LIFCO AB-B SHS	4,582	203.40	931,978.80
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	85.76	2,310,631.68
SANDVIK AB	19,332	236.30	4,568,151.60
SKANSKA AB-B SHS	7,676	224.20	1,720,959.20
SKF AB-B SHARES	7,216	204.60	1,476,393.60
VOLVO AB-A SHS	3,298	208.20	686,643.60
VOLVO AB-B SHS	25,143	206.70	5,197,058.10
SECURITAS AB-B SHS	3,833	110.20	422,396.60
ELECTROLUX AB-B	3,653	191.15	698,270.95
EVOLUTION AB	3,009	1,137.80	3,423,640.20
EMBRACER GROUP AB	8,396	83.88	704,256.48
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	167.92	2,193,706.88
SWEDISH MATCH AB	26,306	71.76	1,887,718.56
ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,023	268.70	3,230,580.10
GETINGE AB-B SHS	4,502	323.20	1,455,046.40
NORDEA BANK ABP	55,961	103.46	5,789,725.06
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,381	116.30	3,649,610.30
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	28,629	99.12	2,837,706.48
SWEDBANK AB - A SHARES	17,971	177.74	3,194,165.54
EQT AB	5,102	359.60	1,834,679.20
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	280.00	578,760.00
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	274.90	646,839.70
INVESTOR AB-A SHS	9,765	203.50	1,987,177.50
INVESTOR AB-B SHS	31,447	194.28	6,109,523.16
KINNEVIK AB - B	3,881	262.15	1,017,404.15
LUNDBERGS AB-B SHS	920	455.20	418,784.00
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	564.80	894,078.40
SAGAX AB-B	3,246	255.80	830,326.80
SINCH AB	7,260	87.16	632,781.60
ERICSSON LM-B SHS	50,322	100.36	5,050,315.92
HEXAGON AB-B SHS	33,961	118.80	4,034,566.80

	TELE2 AB-B SHS	7,424	130.10	965,862.40	
	TELIA CO AB	49,229	35.43	1,744,183.47	
	スウェーデンクローナ 小計	597,791		98,132,377.33	(1,207,028,241)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	2,452	287.30	704,459.60	
	EQUINOR ASA	17,989	247.00	4,443,283.00	
	NORSK HYDRO ASA	21,082	68.24	1,438,635.68	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	439.10	1,217,185.20	
	ADEVINTA ASA	3,943	91.40	360,390.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,287	238.00	544,306.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	264.00	307,560.00	
	MOWI ASA	8,760	201.20	1,762,512.00	
	ORKLA ASA	11,182	84.62	946,220.84	
	DNB BANK ASA	15,146	202.80	3,071,608.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	214.10	572,503.40	
	TELENOR ASA	13,825	141.10	1,950,707.50	
	ノルウェークローネ 小計	103,277		17,319,372.22	(219,782,833)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	527.00	1,077,188.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	458.00	1,526,972.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,433.00	313,857.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,442	174.00	3,034,908.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	67	20,480.00	1,372,160.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	22,000.00	2,178,000.00	
	DSV A/S	3,468	1,268.00	4,397,424.00	
	PANDORA A/S	1,826	716.00	1,307,416.00	
	CARLSBERG AS-B	2,072	1,064.50	2,205,644.00	
	AMBU A/S-B	1,526	130.00	198,380.00	
	COLOPLAST-B	2,245	939.40	2,108,953.00	
	DEMANT A/S	1,941	279.60	542,703.60	
	GN STORE NORD A/S	1,892	368.00	696,256.00	
	GENMAB A/S	1,125	2,146.00	2,414,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	29,811	608.90	18,151,917.90	
DANSKE BANK A/S	13,184	123.80	1,632,179.20		
TRYG A/S	4,694	157.35	738,600.90		

	ORSTED A/S	3,278	707.60	2,319,512.80
	デンマーククローネ 小計	90,177		46,216,322.40 (800,928,867)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	29.80	89,757.60
	SANTOS LTD	47,139	7.06	332,801.34
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,985	27.38	109,109.30
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	25.13	469,353.01
	BHP GROUP LTD	52,531	45.60	2,395,413.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	18.48	195,684.72
	EVOLUTION MINING LTD	46,650	4.02	187,533.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	20.52	600,045.84
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	7,431	48.97	363,896.07
	NEWCREST MINING LTD	15,067	25.18	379,387.06
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.65	143,563.05
	ORICA LTD	6,263	14.11	88,370.93
	RIO TINTO LTD	6,335	107.96	683,926.60
	SOUTH32 LTD	81,080	3.94	319,455.20
	REECE LTD	5,105	21.90	111,799.50
	BRAMBLES LTD	27,700	10.04	278,108.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.58	82,468.88
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.82	41,934.00
	SYDNEY AIRPORT	22,505	8.65	194,668.25
	TRANSURBAN GROUP	55,676	12.84	714,879.84
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,150	41.05	457,707.50
	CROWN RESORTS LTD	773	12.12	9,368.76
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	103.41	107,029.35
	IDP EDUCATION LTD	4,049	30.25	122,482.25
	TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	5.05	191,410.15
	REA GROUP LTD	563	151.02	85,024.26
	SEEK LTD	6,794	29.23	198,588.62
WESFARMERS LTD	19,365	53.00	1,026,345.00	
COLES GROUP LTD	24,160	16.33	394,532.80	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.35	107,702.35	
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	35.02	749,813.22	
TREASURY WINE ESTATES LTD	16,613	11.03	183,241.39	

	COCHLEAR LTD	1,060	193.10	204,686.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	63.50	174,625.00
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	38.94	283,093.80
	CSL LTD	8,417	262.57	2,210,051.69
	AUST AND NZ BANKING GROUP	48,894	27.77	1,357,786.38
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	31,437	97.44	3,063,221.28
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,718	28.17	1,597,746.06
	WESTPAC BANKING CORP	63,088	20.80	1,312,230.40
	ASX LTD	3,380	83.77	283,142.60
	MACQUARIE GROUP LTD	6,279	189.98	1,192,884.42
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	19.12	29,769.84
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	43,709	4.38	191,445.42
	MEDIBANK PRIVATE LTD	63,743	3.22	205,252.46
	QBE INSURANCE GROUP LTD	26,086	11.55	301,293.30
	SUNCORP GROUP LTD	27,697	11.23	311,037.31
	LENDLEASE GROUP	17,548	10.37	181,972.76
	COMPUTERSHARE LTD	12,120	19.72	239,006.40
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	51.43	82,288.00
	XERO LTD	2,603	116.25	302,598.75
	TELSTRA CORP LTD	72,361	4.05	293,062.05
	APA GROUP	24,697	9.57	236,350.29
	AUSNET SERVICES	37,470	2.49	93,300.30
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	5.60	147,884.80
	オーストラリアドル 小計	1,233,269		25,710,130.75 (2,099,232,175)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.20	160,488.00
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,319	30.36	343,644.84
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	10.80	59,464.80
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.43	192,146.37
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.80	41,760.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	4.53	104,004.27
	ニュージーランドドル 小計	112,599		901,508.28 (68,830,157)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	56.45	2,737,825.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25,000	133.00	3,325,000.00

	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	21.70	651,000.00	
	MTR CORP	32,000	42.65	1,364,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	31,000	29.75	922,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	45.95	1,883,950.00	
	SANDS CHINA LTD	50,200	21.45	1,076,790.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	13.90	469,820.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	21.60	475,200.00	
	WH GROUP LTD	152,000	5.23	794,960.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	30.00	2,070,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	156.20	1,858,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20,700	473.40	9,799,380.00	
	AIA GROUP LTD	213,800	88.05	18,825,090.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	32,000	53.70	1,718,400.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	26.60	776,720.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	16.62	448,740.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	35.05	1,048,555.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	32.25	838,500.00	
	SINO LAND CO	58,000	9.97	578,260.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	97.05	2,397,135.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	46.30	194,460.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	20.50	102,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	38.25	1,224,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	101,000	10.58	1,068,580.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	49.45	217,580.00	
	CLP HOLDINGS LTD	27,500	78.40	2,156,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.79	241,490.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	208,717	12.18	2,542,173.06	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,000	48.55	1,116,650.00	
	香港ドル 小計	1,444,533		62,924,588.86 (921,215,980)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	25,600	5.40	138,240.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	3.72	136,524.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	5.07	133,341.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.76	61,408.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	41,900	4.27	178,913.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	31,100	35.66	1,109,026.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	12.30	697,410.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	30.01	609,203.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,400	9.51	136,944.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	49,800	3.64	181,272.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.12	21,360.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.27	15,267.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.16	74,456.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	169,000	2.49	420,810.00	
	シンガポールドル 小計	561,800		3,914,174.00 (332,156,805)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	12,922	30.23	390,632.06	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	521.10	198,539.10	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	32.20	587,038.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,954	32.36	969,311.44	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	20.40	482,888.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	118.60	167,700.40	
	AZRIELI GROUP	234	294.00	68,796.00	
	NICE SYSTEMS LTD	1,161	771.00	895,131.00	
	イスラエルシュケル 小計	87,968		3,760,036.60 (135,602,711)	
	合 計	19,157,112		106,056,038,603 (106,056,038,603)	

(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	124,277.01	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,660	519,391.60	
		AMERICAN TOWER CORP	8,088	2,009,059.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,521	193,704.39	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	569,483.91	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,764	317,942.92	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	268,109.03	
	CROWN CASTLE INTL CORP	7,724	1,418,203.64	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,809	740,153.19	
	DUKE REALTY CORP	6,340	361,570.20	
	EQUINIX INC	1,607	1,174,459.88	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,451	263,587.38	
	EQUITY RESIDENTIAL	6,281	554,863.54	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,187	395,152.30	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,391	466,245.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,835	342,848.10	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	178,381.00	
	INVITATION HOMES INC	9,853	410,771.57	
	IRON MOUNTAIN INC	5,780	256,458.60	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	205,852.46	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,088	423,446.40	
	PROLOGIS INC	13,145	2,015,259.95	
	PUBLIC STORAGE	2,693	948,286.09	
	REALTY INCOME CORP	9,338	638,812.58	
	REGENCY CENTERS CORP	2,658	188,425.62	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,865	608,997.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	5,918	864,619.80	
	SUN COMMUNITIES INC	2,159	403,258.02	
	UDR INC	5,162	290,052.78	
	VENTAS INC	6,823	352,885.56	
	VICI PROPERTIES INC	10,702	294,305.00	
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	117,177.18	
	WELLTOWER INC	7,706	662,870.12	
	WEYERHAEUSER CO	12,823	498,173.55	
	WP CAREY INC	3,546	269,105.94	
	米ドル 小計	219,696	19,346,190.61	(2,205,659,191)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	51,243.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	33,231.60	
	カナダドル 小計	2,480	84,474.60	(7,622,143)

ユーロ	COVIVIO	522	38,304.36	
	GECINA SA	1,073	124,736.25	
	KLEPIERRE	3,496	80,442.96	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	140,486.79	
ユーロ 小計		7,372	383,970.36	(49,555,214)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	73,168.81	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,632	113,310.20	
	SEGro PLC	22,581	289,149.70	
英ポンド 小計		51,055	475,628.71	(73,104,132)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	23,352	251,501.04	
	GOODMAN GROUP	29,600	693,528.00	
	GPT GROUP	32,860	170,543.40	
	MIRVAC GROUP	63,099	174,153.24	
	SCENTRE GROUP	86,904	258,104.88	
	STOCKLAND	54,131	219,230.55	
	VICINITY CENTRES	42,168	70,420.56	
オーストラリアドル 小計		332,114	1,837,481.67	(150,030,378)
香港ドル	LINK REIT	38,700	2,660,625.00	
香港ドル 小計		38,700	2,660,625.00	(38,951,550)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	210,782.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	81,863	164,544.63	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	42,320.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	49,500	87,120.00	
シンガポールドル 小計		228,063	504,766.63	(42,834,496)
合計			2,567,757,104	(2,567,757,104)

(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 606銘柄	97.2%		71.4%
	投資証券 35銘柄		2.8%	2.0%
カナダドル	株式 87銘柄	99.8%		3.7%
	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 82銘柄	98.5%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式 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 55銘柄	93.3%		1.9%
	投資証券 7銘柄		6.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	95.9%		0.8%
	投資証券 1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	88.6%		0.3%
	投資証券 4銘柄		11.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	880,800,465
コール・ローン	288,529,618
株式	17,055,235,912
投資証券	13,708,334
派生商品評価勘定	300,986
未収入金	1,878,386
未収配当金	6,549,055
差入委託証拠金	916,132,143
流動資産合計	19,163,134,899
資産合計	
19,163,134,899	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,624,864
未払金	5,645,725
未払解約金	377,022,300
未払利息	782
流動負債合計	426,293,671
負債合計	
426,293,671	
純資産の部	
元本等	
元本	11,528,471,845
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,208,369,383
元本等合計	18,736,841,228
純資産合計	
18,736,841,228	
負債純資産合計	
19,163,134,899	

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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	8,352,954,743円
期中追加設定元本額	7,839,919,236円
期中一部解約元本額	4,664,402,134円
期末元本額	11,528,471,845円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	683,516,472円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,417,476,834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	11,705,697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	347,894,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	202,445,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	136,416,875円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	46,692,180円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	29,427,003円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,700,411円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	27,002,502円
リスクコントロール・オープン	8,378,010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	78,571,550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	3,035,128,480円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,620,564,443円
Smart-i 8資産バランス 安定型	67,146,891円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	184,634,141円

Smart-i 8資産バランス 成長型	213,712,400円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	142,358,621円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	229,337,035円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	140,582,085円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	84,577,362円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	175,263,556円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,936,724円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,410,023円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	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)	4,381,678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)	2,756,548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)	66,981,924円
2. 計算日における受益権の総数	11,528,471,845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	1.6253円
(10,000口当たり純資産額)	(16,253円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	1,560,358,804	
投資証券	484,218	
合計	1,559,874,586	

(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 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,686,862,887	-	1,643,665,068	43,197,819
合計		1,686,862,887	-	1,643,665,068	43,197,819

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2022年 1月25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	112,172,250	-	112,298,309	126,059
	米ドル	112,172,250	-	112,298,309	126,059
合計		112,172,250	-	112,298,309	126,059

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	114,465	7.34	840,630.96	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	8,032	77.72	624,247.04	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,762	189.35	333,634.70	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	21,841	6.67	145,766.83	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	13,769	4.21	57,995.02	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,619	34.16	157,785.04	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,898	8.32	40,751.36	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	12,284	26.69	327,859.96	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,773	24.76	68,659.48	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	18.40	43,166.40	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,288	74.40	95,827.20	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,862	17.64	68,125.68	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,502	64.82	97,359.64	
	51JOB INC-ADR	500	49.99	24,995.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	4.76	22,372.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	8,444	28.70	242,342.80	
	LI AUTO INC - ADR	10,692	27.27	291,570.84	
	NIO INC - ADR	26,248	24.87	652,787.76	
	XPENG INC - ADR	7,521	39.99	300,764.79	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,539	38.68	136,888.52	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	29,310	1.49	43,671.90	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,474	3.18	26,947.32	
	TRIP.COM GROUP LTD	9,917	25.79	255,759.43	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	8,144	45.97	374,379.68	
	AUTOHOME INC-ADR	1,495	31.38	46,913.10	
	BAIDU INC - SPON ADR	5,354	149.05	798,013.70	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	3,057	35.19	107,575.83	
HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	8.94	23,691.00		
IQIYI INC-ADR	4,500	4.25	19,125.00		
JOYY INC	1,174	45.79	53,757.46		

KANZHUN LTD	1,293	27.88	36,048.84
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	6.19	74,428.56
VK CO LTD	2,211	7.18	15,886.03
WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	33.02	38,435.28
YANDEX NV-A	5,904	42.50	250,920.00
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	10.94	10,940.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	16.95	15,594.00
PINDUODUO INC-ADR	8,473	60.52	512,785.96
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	8.76	72,681.72
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,671	11.88	79,284.83
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	20.57	47,228.72
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	12,431	3.49	43,384.19
BEIGENE LTD-ADR	913	248.85	227,200.05
HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	27.78	46,337.04
I-MAB-SPONSORED ADR	761	28.90	21,992.90
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,008	37.91	38,213.28
ZAI LAB LTD-ADR	1,574	49.86	78,479.64
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	3.27	109,221.27
CREDICORP LTD	1,296	137.56	178,277.76
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	51,862	11.66	604,710.92
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	57.22	125,197.36
VTB BANK JSC -GDR-REG S	32,868	0.98	32,473.58
360 DIGITECH INC	1,829	19.84	36,287.36
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	780	30.39	23,704.20
KE HOLDINGS INC	7,106	21.07	149,723.42
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.93	9,384.48
AGORA INC-ADR	800	11.10	8,880.00
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	4.68	7,020.00
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,653	40.46	66,880.38
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	10.91	9,819.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	7,300	4.85	35,441.50
VNET GROUP INC	1,400	8.37	11,718.00
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	8,384	7.05	59,107.20
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,000	38.89	38,890.00
	562,115		9,439,942.91

米ドル 小計				(1,076,247,891)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	300,300	11.89	3,570,567.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	60,700	86.83	5,270,581.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	226.98	601,497.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	48.53	960,894.00
	ALFA S.A.B.-A	56,600	14.50	820,700.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	58.82	435,268.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	7,500	268.95	2,017,125.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	399.27	1,529,204.10
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	148.73	655,155.65
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	39.57	1,752,951.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	6,500	64.19	417,235.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	102,500	70.61	7,237,525.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	122.23	941,171.00
	BECLE SAB DE CV	11,400	49.30	562,020.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	108.48	1,031,644.80
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	38,300	165.77	6,348,991.00
	GRUMA S.A.B.-B	4,125	249.59	1,029,558.75
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	62.89	1,679,163.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	33,000	29.91	987,030.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	50,300	130.05	6,541,515.00
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	45,800	26.36	1,207,288.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	663,300	19.95	13,232,835.00	
TELESITES SAB DE CV	19,700	21.66	426,702.00	
メキシコペソ 小計		1,526,320		59,256,621.30 (327,890,588)
ブラジルリアル	COSAN SA	19,300	21.65	417,845.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	71,600	34.65	2,480,940.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	91,600	31.95	2,926,620.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	13.46	189,786.00
	BRASKEM SA-PREF A	4,100	49.95	204,795.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	25.94	321,656.00
	GERDAU SA-PREF	21,400	27.80	594,920.00
	KLABIN SA - UNIT	13,600	24.30	330,480.00
	SUZANO SA	14,507	58.22	844,597.54

VALE SA	78,904	83.87	6,617,678.48
WEG SA	32,400	29.90	968,760.00
CCR SA	23,400	12.03	281,502.00
LOCALIZA RENT A CAR	11,510	53.62	617,166.20
RUMO SA	24,400	16.63	405,772.00
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	28.75	77,625.00
AMERICANAS SA	12,000	34.27	411,240.00
LOJAS RENNER S.A.	17,820	25.88	461,181.60
MAGAZINE LUIZA SA	61,500	6.39	392,985.00
VIA S/A	21,100	4.22	89,042.00
VIBRA ENERGIA SA	21,700	21.02	456,134.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	14.95	119,600.00
RAIA DROGASIL SA	20,200	21.00	424,200.00
AMBEV SA	91,100	14.70	1,339,170.00
BRF SA	12,600	23.46	295,596.00
JBS SA	16,900	35.92	607,048.00
NATURA &CO HOLDING SA	18,600	23.16	430,776.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	22,700	11.34	257,418.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	10,600	66.00	699,600.00
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	40.61	292,392.00
HYPERA SA	6,400	29.06	185,984.00
BANCO BRADESCO S.A.	26,832	17.63	473,048.16
BANCO BRADESCO SA-PREF	93,179	21.30	1,984,712.70
BANCO DO BRASIL S.A.	15,800	31.35	495,330.00
BANCO INTER SA-UNITS	6,100	23.45	143,045.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	31.18	252,558.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	93,100	23.27	2,166,437.00
ITAUSA SA	89,355	9.50	848,872.50
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	118,300	13.06	1,544,998.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	21.55	450,395.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	20.93	286,741.00
TOTVS SA	9,200	25.85	237,820.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	9,700	48.08	466,376.00
TIM SA	17,100	12.82	219,222.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	32.91	157,968.00

	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	7,000	33.31	233,170.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	21,742	12.82	278,732.44	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	35.45	233,970.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,200	41.08	172,536.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,775	39.22	187,275.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,600	21.76	404,736.00	
	ブラジルリアル 小計	1,373,424		34,980,453.12	(726,057,783)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	6,925.00	50,905,675.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,475.00	34,037,100.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,511	41,879.00	105,158,169.00	
	FALABELLA SA	14,299	2,700.10	38,608,729.90	
	CENCOSUD SA	25,901	1,429.00	37,012,529.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,615.00	21,776,580.00	
	BANCO DE CHILE	966,095	77.50	74,872,362.50	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	29,030.00	28,739,700.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	39.69	47,762,430.03	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	95.02	36,447,486.54	
	ENEL CHILE SA	369,172	33.18	12,249,126.96	
	チリペソ 小計	2,999,651		487,569,888.93	(68,829,753)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,824.00	252,248,152.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	40,000.00	185,480,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	9,697	34,450.00	334,061,650.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,150	27,250.00	58,587,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	24,200.00	198,149,600.00	
	コロンビアペソ 小計	113,995		1,028,526,902.00	(29,501,237)
ユーロ	OPAP SA	3,467	12.52	43,406.84	
	JUMBO SA	2,215	13.67	30,279.05	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	46,578	1.22	56,848.44	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	0.96	49,367.91	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	16.65	72,777.15	
	PUBLIC POWER CORP	3,599	8.55	30,771.45	
		111,251		283,450.84	

	ユーロ 小計			(36,582,165)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	7,215	11.32	81,673.80	
	英ポンド 小計	7,215		81,673.80	(12,553,263)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,516	166.40	418,662.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	28,057	26.96	756,416.72	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	20.88	319,213.44	
	KOC HOLDING AS	14,295	29.80	425,991.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	29,869	13.05	389,790.45	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	239.30	261,315.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	66.95	554,078.20	
	AKBANK T.A.S.	62,081	7.58	470,573.98	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	44,864	11.68	524,011.52	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	7.87	197,056.93	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	17.67	337,337.97	
	トルコリラ 小計	250,468		4,654,448.21	(39,380,820)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,568	923.50	1,448,048.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	91.65	645,674.25	
	CEZ AS	2,959	796.50	2,356,843.50	
	チェココルナ 小計	11,572		4,450,565.75	(23,392,173)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,620.00	19,152,200.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	8,315.00	20,596,255.00	
	OTP BANK PLC	4,407	17,140.00	75,535,980.00	
	ハンガリーフォリント 小計	14,194		115,284,435.00	(41,184,903)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,618	72.80	408,990.40	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	33,451	5.30	177,290.30	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,785	135.05	376,114.25	
	LPP SA	22	15,840.00	348,480.00	
	CD PROJEKT SA	1,432	178.00	254,896.00	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	31.92	155,641.92	
	ALLEGRO.EU SA	7,282	36.70	267,249.40	
	DINO POLSKA SA	930	344.00	319,920.00	

	BANK PEKAO SA	3,378	128.00	432,384.00	
	MBANK SA	290	425.20	123,308.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,136	45.23	729,831.28	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	347.80	232,330.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	11,978	34.19	409,527.82	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	8.13	95,171.36	
	PGE SA	17,929	7.60	136,296.25	
	ポーランドズロチ 小計	118,474		4,467,431.38	(126,283,563)
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	36.34	4,783,002.00	
	ALROSA PJSC	46,260	99.21	4,589,454.60	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	69.68	3,832,675.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	31,800	141.50	4,499,700.00	
	INTER RAO UES PJSC	725,000	3.75	2,722,737.50	
	ロシアルーブル 小計	989,660		20,427,569.10	(29,415,699)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	45,000	4.91	220,950.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	40,000	7.50	300,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	470,000	4.13	1,941,100.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	66,000	21.15	1,395,900.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	5.23	198,740.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	410,000	3.92	1,607,200.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	26,000	18.84	489,840.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	4.47	295,020.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	24,000	42.60	1,022,400.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	44,500	9.07	403,615.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	66,000	4.20	277,200.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	10.64	808,640.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	50,000	6.81	340,500.00	
	DONGYUE GROUP	28,000	9.72	272,160.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,600	125.10	575,460.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	19,000	4.86	92,340.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	24,000	13.60	326,400.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	5.41	119,020.00	
	MMG LTD	68,000	2.87	195,160.00	

NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	8.28	273,240.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	14.06	133,570.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	112,000	10.72	1,200,640.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.74	208,560.00
BOC AVIATION LTD	3,500	66.00	231,000.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	58,000	3.96	229,680.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	32,500	37.95	1,233,375.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	24,000	15.30	367,200.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	4.80	312,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	9.47	378,800.00
CITIC LTD	114,000	8.85	1,008,900.00
CRRC CORP LTD - H	81,000	3.58	289,980.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	8.81	427,285.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	21.40	214,000.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.30	157,700.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	12.60	144,900.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	36,000	14.96	538,560.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	13.32	170,496.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	40.50	417,150.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	5.51	107,996.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	75,000	5.84	438,000.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.07	182,100.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	5.19	155,700.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	30,000	14.98	449,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	5.17	134,420.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	66,200	14.00	926,800.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.61	211,520.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.46	169,200.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	8.48	165,360.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.85	219,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00
BYD CO LTD-H	15,000	252.20	3,783,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.12	313,280.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	45.25	524,900.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	114,000	18.76	2,138,640.00

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,500	23.30	1,409,650.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	8.11	454,160.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	36.30	508,200.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	12.12	242,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	20,800	121.30	2,523,040.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.14	223,560.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	43,800	32.30	1,414,740.00	
LI NING CO LTD	43,500	79.45	3,456,075.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	16,000	156.40	2,502,400.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	11.16	145,080.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	2.22	53,280.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	19.44	408,240.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	17,000	17.30	294,100.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	20,800	16.12	335,296.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.87	174,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	7,800	52.35	408,330.00	
KINGSOFT CORP LTD	17,800	37.30	663,940.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	8,600	85.25	733,150.00	
NETEASE INC	38,800	150.20	5,827,760.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	110,600	469.60	51,937,760.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	291,540	119.10	34,722,414.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	36.45	364,500.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	275,000	0.68	187,000.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	2.26	99,440.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,500	70.15	455,975.00	
JD.COM INC - CL A	38,710	289.20	11,194,932.00	
MEITUAN	78,600	232.80	18,298,080.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	7.76	186,240.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	62.30	685,300.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	3.14	98,910.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	114.16	251,152.00	
CHINA FEIHE LTD	64,000	11.76	752,640.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	62,000	48.10	2,982,200.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	28,000	60.55	1,695,400.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.78	145,790.00	

NONGFU SPRING CO LTD-H	34,800	46.90	1,632,120.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	35,000	36.75	1,286,250.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	16.26	617,880.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	73.80	738,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.60	159,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	93,000	7.91	735,630.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	35.10	315,900.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	13,000	39.90	518,700.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	19.98	119,880.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	74,000	6.85	506,900.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	38.90	248,960.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	29,500	8.42	248,390.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	26.75	321,000.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	9,700	27.50	266,750.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	9.78	477,264.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	15.94	261,416.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	18.64	492,096.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	30.40	106,400.00	
3SBIO INC	20,500	6.40	131,200.00	
AKESO INC	5,000	25.80	129,000.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	146.20	233,920.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	13.94	390,320.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60,000	5.09	305,400.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	168,000	9.54	1,602,720.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	22,000	30.30	666,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	95.00	180,500.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	17.92	430,080.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,500	41.35	971,725.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,600	115.90	301,340.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	34.60	346,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	202,250	5.93	1,199,342.50	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	6,868	124.80	857,126.40	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	69,500	87.65	6,091,675.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	507,000	2.97	1,505,790.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,530,000	3.03	4,635,900.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	5.24	843,640.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	69,000	2.22	153,180.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.76	627,920.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,848,000	5.94	10,977,120.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.03	142,410.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	75,000	67.75	5,081,250.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	3.25	359,450.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,086,000	4.72	5,125,920.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	6.41	948,680.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	202,000	1.44	290,880.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.68	262,080.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	21.95	597,040.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	43,500	21.15	920,025.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.70	194,300.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	14.32	309,312.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	7.23	387,528.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	13.96	360,168.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	144,000	14.04	2,021,760.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	51,400	24.75	1,272,150.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	32,800	11.68	383,104.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	23.35	403,955.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.50	407,500.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	136,000	7.20	979,200.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	122,000	65.45	7,984,900.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,900	28.65	312,285.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	15.82	142,380.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	4.52	81,360.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	126,000	2.90	365,400.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	76,000	23.45	1,782,200.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	9.07	272,100.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	62,000	38.45	2,383,900.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,800	43.15	466,020.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	21.35	685,335.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	18,000	15.02	270,360.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	70,000	5.50	385,000.00	

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	148,000	6.67	987,160.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	35,000	48.40	1,694,000.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	13.12	196,800.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	32,000	8.58	274,560.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,770	17.20	202,444.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	5.00	107,500.00
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	6.82	156,860.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	36,000	45.55	1,639,800.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	4.47	111,750.00
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	6.11	219,960.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	6.17	123,400.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	6.53	65,300.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	57,000	10.76	613,320.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	22,000	8.98	197,560.00
WHARF HOLDINGS LTD	26,000	26.25	682,500.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	30,800	7.87	242,396.00
CHINA YOUZAN LTD	220,000	0.33	73,700.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	8.74	419,520.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	51,000	23.30	1,188,300.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	17.88	214,560.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	14.58	291,600.00
WEIMOB INC	38,000	7.05	267,900.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	26.10	365,400.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,500	25.10	338,850.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	39.95	519,350.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	14.00	231,000.00
LENOVO GROUP LTD	140,000	8.38	1,173,200.00
SUNNY OPTICAL TECH	13,800	208.40	2,875,920.00
XIAOMI CORP-CLASS B	275,400	18.20	5,012,280.00
ZTE CORP-H	15,400	22.45	345,730.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	834,000	0.95	792,300.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	28.20	239,700.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.04	231,040.00
CGN POWER CO LTD-H	202,000	2.25	454,500.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	60,600	14.08	853,248.00

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	66,000	16.06	1,059,960.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	4.30	425,700.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	18,000	40.30	725,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	20.65	743,400.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	15,400	130.20	2,005,080.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	10.46	585,760.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	74,000	4.29	317,460.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	76,000	7.51	570,760.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	35.20	246,400.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	40.40	404,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	96,000	12.50	1,200,000.00	
	香港ドル 小計	16,399,138		283,720,445.90 (4,153,667,327)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.58	180,084.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	19.12	112,808.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	8.90	395,160.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	65,200	6.10	397,720.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.58	93,234.00	
	SIME DARBY BERHAD	58,700	2.17	127,379.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,700	5.72	129,844.00	
	MISC BHD	26,800	7.00	187,600.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	3.96	77,616.00	
	GENTING BHD	41,300	4.49	185,437.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.78	154,846.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	25.00	52,500.00	
	IOI CORP BHD	49,600	3.93	194,928.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	21.50	178,450.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	133.00	172,900.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	16.60	184,592.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	4.99	85,578.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.00	121,600.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	5.53	185,255.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.47	205,746.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	116,600	2.08	242,528.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.38	123,708.00	

	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	127,900	5.25	671,475.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	19.16	235,668.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	18.48	97,944.00	
	MALAYAN BANKING BHD	91,700	8.25	756,525.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	283,300	4.19	1,187,027.00	
	RHB BANK BHD	39,800	5.59	222,482.00	
	INARI AMERTRON BHD	65,100	3.29	214,179.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.77	180,206.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	3.94	208,426.00	
	MAXIS BHD	45,700	4.33	197,881.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.15	94,760.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	16.98	237,720.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	42,100	9.11	383,531.00	
	マレーシアリングット 小計	1,607,170		8,477,337.50 (230,770,929)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	27,500	124.00	3,410,000.00	
	PTT PCL-NVDR	194,400	38.50	7,484,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,000	51.75	1,242,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	36,300	47.25	1,715,175.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	57.25	2,410,225.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,800	61.75	1,716,650.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	15,200	378.00	5,745,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	84,200	62.00	5,220,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.10	1,254,690.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	9.15	1,440,210.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.68	892,008.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	30.50	1,808,650.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	33.50	1,113,037.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.00	1,556,800.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	25.25	1,376,125.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	30.75	507,375.00	
	CP ALL PCL-NVDR	116,100	59.00	6,849,900.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	108.50	531,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	26.00	1,911,000.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	32.75	638,625.00	

	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	20.20	981,720.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	176,000	21.80	3,836,800.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	136.50	1,351,350.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	28.75	385,250.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	76,200	13.70	1,043,940.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	123.00	1,894,200.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	19.90	742,270.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	59.50	874,650.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	56.50	920,950.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	63.00	1,020,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	53.00	2,040,500.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	9.15	1,429,230.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	6,200	371.00	2,300,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	23,400	223.00	5,218,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	77.00	1,632,400.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	260,800	4.78	1,246,624.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	36.75	349,125.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	170.00	680,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	98.25	2,751,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	81.75	1,087,275.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	50.25	2,718,525.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	44.50	498,400.00	
	タイパーツ 小計	2,493,525		83,827,729.50 (289,205,666)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,460	63.50	2,696,210.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	862.00	4,094,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	557.50	869,700.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	61.05	3,143,525.55	
	SM INVESTMENTS CORP	4,870	950.00	4,626,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	21,600	201.00	4,341,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	229.00	1,591,550.00	
	MONDE NISSIN CORP	90,200	16.64	1,500,928.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	127.90	2,226,739.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	93.60	3,246,048.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	127.40	4,511,234.00	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	57.00	2,098,284.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.84	1,086,720.00	
	AYALA LAND INC	152,200	35.10	5,342,220.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	202,700	34.40	6,972,880.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	3,260.00	1,467,000.00	
	PLDT INC	1,555	1,859.00	2,890,745.00	
	AC ENERGY CORP	154,600	9.59	1,482,614.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	315.00	1,464,750.00	
	フィリピンペソ 小計	1,147,348		55,653,747.55 (123,673,757)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	323,600	2,270.00	734,572,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	23,400.00	790,920,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,885.00	331,006,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	855.00	478,458,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,700.00	415,030,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	11,125.00	258,100,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	209,100	3,910.00	817,581,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	6,975.00	385,717,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	399,700	5,525.00	2,208,342,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	6,525.00	906,975,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	31,750.00	209,550,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	8,600.00	404,200,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,400.00	519,680,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	4,080.00	574,056,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,700.00	589,050,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,070,300	7,800.00	8,348,340,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	364,300	7,275.00	2,650,282,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	7,100.00	969,150,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,320,845	4,120.00	5,441,881,400.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,070.00	371,611,000.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	964,700	4,300.00	4,148,210,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,980.00	419,882,000.00		
	インドネシアルピア 小計	6,939,645		31,972,594,900.00 (255,780,759)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	38,650.00	32,775,200.00	

S-OIL CORP	847	89,600.00	75,891,200.00	
SK INNOVATION CO LTD	987	247,500.00	244,282,500.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	35,550.00	83,364,750.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,620	40,800.00	66,096,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	158	528,000.00	83,424,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	156,000.00	47,892,000.00	
LG CHEM LTD	889	671,000.00	596,519,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	319,000.00	42,427,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	320	207,000.00	66,240,000.00	
POSCO	1,433	274,500.00	393,358,500.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	576	124,000.00	71,424,000.00	
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	263	139,500.00	36,688,500.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	361	147,000.00	53,067,000.00	
SKC CO LTD	401	149,500.00	59,949,500.00	
(Right)DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRU	716	2,980.00	2,133,680.00	
CJ CORP	193	78,000.00	15,054,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	883	38,550.00	34,039,650.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	6,396	18,000.00	115,128,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	207	400,400.00	82,882,800.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	40,000.00	50,160,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	41,950.00	61,624,550.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	48,600.00	39,511,800.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	35,500.00	50,019,500.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	85,600.00	61,546,400.00	
LG CORP	1,582	76,600.00	121,181,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,639	109,500.00	179,470,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	22,700.00	67,214,700.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,390.00	65,256,730.00	
SK	818	229,500.00	187,731,000.00	
S-1 CORPORATION	228	70,900.00	16,165,200.00	
CJ LOGISTICS	135	121,000.00	16,335,000.00	
HMM CO LTD	4,920	23,800.00	117,096,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	399	160,500.00	64,039,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	26,900.00	85,703,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	5,120.00	27,422,720.00	

HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	36,150.00	50,356,950.00	
HANON SYSTEMS	3,541	11,300.00	40,013,300.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,290	235,000.00	303,150,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,685	197,000.00	528,945,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	98,200.00	59,902,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	96,000.00	32,256,000.00	
KIA CORP	5,106	79,000.00	403,374,000.00	
COWAY CO LTD	1,045	70,600.00	73,777,000.00	
F&F CO LTD / NEW	65	839,000.00	54,535,000.00	
HLB INC	1,659	32,700.00	54,249,300.00	
LG ELECTRONICS INC	2,059	134,000.00	275,906,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	24,850.00	46,693,150.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	21,700.00	22,785,000.00	
HYBE CO LTD	292	277,000.00	80,884,000.00	
KAKAO CORP	6,059	90,000.00	545,310,000.00	
KAKAO GAMES CORP	600	69,700.00	41,820,000.00	
KRAFTON INC	400	302,000.00	120,800,000.00	
NAVER CORP	2,379	328,500.00	781,501,500.00	
NCSOFT CORP	327	567,000.00	185,409,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	118,500.00	46,452,000.00	
PEARL ABYSS CORP	597	105,000.00	62,685,000.00	
CJ ENM CO LTD	195	130,500.00	25,447,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	73,500.00	44,247,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	81,500.00	18,093,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	153,000.00	21,114,000.00	
E-MART INC	374	134,500.00	50,303,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	367,000.00	58,720,000.00	
KT&G CORP	2,371	78,600.00	186,360,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	102,000.00	42,024,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	154,500.00	94,399,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	41,100.00	17,631,900.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	176	969,000.00	170,544,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	560,000.00	17,360,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,792	67,900.00	121,676,800.00	
SD BIOSENSOR INC	691	55,700.00	38,488,700.00	

ALTEOGEN INC	544	51,500.00	28,016,000.00	
CELLTRION INC	1,940	166,500.00	323,010,000.00	
CELLTRION PHARM INC	339	89,900.00	30,476,100.00	
GREEN CROSS CORP	90	181,500.00	16,335,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	256,000.00	35,072,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	329	811,000.00	266,819,000.00	
SEEGENE INC	734	62,800.00	46,095,200.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	652	25,300.00	16,495,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	83,100.00	43,959,900.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	178,000.00	74,226,000.00	
YUHAN CORP	1,093	59,000.00	64,487,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,816	44,350.00	257,939,600.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	10,300.00	45,886,500.00	
KAKAObANK CORP	1,800	42,000.00	75,600,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,621	58,800.00	448,114,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,490	38,350.00	325,591,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	10,151	14,500.00	147,189,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	889	75,800.00	67,386,200.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	6,490.00	39,459,200.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	8,460.00	47,824,380.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	11,550.00	34,234,200.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	41,250.00	50,407,500.00	
DB INSURANCE CO LTD	911	63,400.00	57,757,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	578	208,500.00	120,513,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,244	63,800.00	79,367,200.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	357	58,400.00	20,848,800.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	647	150,000.00	97,050,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	440	106,000.00	46,640,000.00	
L&F CO LTD	420	196,500.00	82,530,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,329	21,550.00	93,289,950.00	
LG INNOTEK CO LTD	290	360,000.00	104,400,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,092	182,500.00	199,290,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	91,699	75,100.00	6,886,594,900.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,835	68,200.00	1,079,947,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,061	682,000.00	723,602,000.00	

	LG UPLUS CORP	4,620	13,350.00	61,677,000.00	
	SK TELECOM	476	56,300.00	26,798,800.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	21,000.00	99,225,000.00	
	SK HYNIX INC	10,498	119,000.00	1,249,262,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	308	59,200.00	18,233,600.00	
	韓国ウォン 小計	302,321		21,661,981,510.00 (2,066,553,036)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	98.00	1,862,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	44.65	1,830,650.00	
	CHINA STEEL CORP	228,000	33.45	7,626,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	65,000	79.00	5,135,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	74,000	105.50	7,807,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	100,000	87.00	8,700,000.00	
	TAIWAN CEMENT	101,477	47.15	4,784,640.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	951.00	2,472,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	28.80	1,584,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,299	265.50	1,406,884.50	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,400.00	1,400,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	49,550	115.00	5,698,250.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	28.45	1,081,100.00	
	WAN HAI LINES LTD	11,000	153.00	1,683,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	34,000	99.90	3,396,600.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.10	1,053,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,020	596.00	2,395,920.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	223.50	1,805,880.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	317.00	1,902,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	391.00	1,173,000.00	
	POU CHEN	45,000	32.45	1,460,250.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	615.00	3,690,000.00	
	MOMO.COM INC	1,000	1,290.00	1,290,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,000	267.50	3,210,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	95,000	68.10	6,469,500.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	4,000	237.00	948,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	72,332	17.75	1,283,893.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	357,000	27.50	9,817,500.00	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	231,900	28.85	6,690,315.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	200,263	25.15	5,036,614.45	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	159,991	21.85	3,495,803.35	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	210,000	36.90	7,749,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	16.55	3,012,017.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	202,708	20.00	4,054,160.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	184,361	26.35	4,857,912.35	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	47.65	3,192,550.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	24,996	248.00	6,199,008.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	188,920	25.20	4,760,784.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	152,000	64.30	9,773,600.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	282,000	18.45	5,202,900.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	145,500	76.50	11,130,750.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	11.10	2,395,768.50	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	64.40	1,485,836.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	10,000	266.00	2,660,000.00	
ACER INC	56,000	29.45	1,649,200.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	388.00	2,832,012.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	14,000	364.50	5,103,000.00	
AU OPTRONICS CORP	163,000	20.30	3,308,900.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	157.50	2,047,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	25.45	1,985,100.00	
DELTA ELECTRONICS INC	38,000	272.00	10,336,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	18,000	61.50	1,107,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	239,800	103.00	24,699,400.00	
INNOLUX CORP	188,000	17.20	3,233,600.00	
INVENTEC CORP	52,000	25.45	1,323,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,075.00	3,942,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	63.90	2,492,100.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	156.50	2,191,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	496.00	1,984,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	70.80	2,619,600.00	
QUANTA COMPUTER INC	53,000	94.00	4,982,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	68.00	1,768,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	23,000	207.00	4,761,000.00	

	WISTRON CORP	52,951	31.45	1,665,308.95	
	WIWYNN CORP	1,500	1,020.00	1,530,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	32,960	54.40	1,793,024.00	
	YAGEO CORPORATION	8,198	463.00	3,795,674.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	96.40	1,253,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	74,000	117.00	8,658,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	64.90	1,947,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	100.50	3,015,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	63,000	101.50	6,394,500.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,605.00	802,500.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,700.00	1,700,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	781.00	3,124,000.00	
	MEDIATEK INC	29,000	1,090.00	31,610,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	25,000	72.60	1,815,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	490.50	5,395,500.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	1,945.00	2,723,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	9,000	535.00	4,815,000.00	
	SILERGY CORP	1,510	3,715.00	5,609,650.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	473,200	653.00	308,999,600.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	227,000	62.60	14,210,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	18,000	137.50	2,475,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	7,000	343.50	2,404,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	29.50	1,799,500.00	
	新台湾ドル 小計	6,188,117		674,564,756.70 (2,776,103,799)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	373.10	6,022,953.30	
	COAL INDIA LTD	25,983	156.30	4,061,142.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	13,029	303.50	3,954,301.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	35,280	120.35	4,245,948.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	49,267	165.70	8,163,541.90	
	PETRONET LNG LTD	12,992	209.05	2,715,977.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	54,815	2,377.90	130,344,588.50	
	ACC LTD	1,469	2,167.45	3,183,984.05	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,774	352.85	4,860,155.90	
	ASIAN PAINTS LTD	7,416	3,155.15	23,398,592.40	

BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	713.45	2,908,022.20
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,690.70	8,270,904.40
HINDALCO INDUSTRIES LTD	30,537	478.40	14,608,900.80
JSW STEEL LTD	16,425	621.80	10,213,065.00
PI INDUSTRIES LTD	1,583	2,477.65	3,922,119.95
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,640.35	7,245,120.40
SHREE CEMENT LTD	197	24,320.90	4,791,217.30
SRF LTD	2,982	2,369.70	7,066,445.40
TATA STEEL LTD	14,002	1,099.20	15,390,998.40
ULTRATECH CEMENT LTD	1,962	7,156.00	14,040,072.00
UPL LTD	9,171	762.60	6,993,804.60
VEDANTA LTD	20,779	312.10	6,485,125.90
ADANI ENTERPRISES LTD	5,363	1,715.80	9,201,835.40
BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	197.30	4,531,586.40
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,179.95	5,325,114.35
LARSEN & TOUBRO LTD	13,288	1,899.90	25,245,871.20
SIEMENS LTD	1,348	2,230.75	3,007,051.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	809.80	3,580,935.60
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	702.45	6,685,216.65
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	5,259	622.55	3,273,990.45
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	1,992.20	3,840,961.60
BAJAJ AUTO LTD	1,401	3,382.30	4,738,602.30
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,609	2,358.50	3,794,826.50
BHARAT FORGE LTD	4,571	718.90	3,286,091.90
EICHER MOTORS LTD	2,527	2,656.40	6,712,722.80
HERO MOTOCORP LTD	2,256	2,706.20	6,105,187.20
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,966	854.70	14,500,840.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,638	8,052.30	21,241,967.40
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	23,659	210.96	4,991,102.64
MRF LTD	38	71,077.35	2,700,939.30
TATA MOTORS LTD	32,315	478.45	15,461,111.75
PAGE INDUSTRIES LTD	114	39,915.60	4,550,378.40
TITAN CO LTD	6,867	2,403.05	16,501,744.35
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,498	3,500.65	5,243,973.70
INFO EDGE INDIA LTD	1,429	4,508.60	6,442,789.40

TRENT LTD	3,269	1,121.95	3,667,654.55
ZOMATO LTD	27,665	91.35	2,527,197.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,211	4,035.30	12,957,348.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,225	3,523.85	7,840,566.25
ITC LTD	54,609	211.80	11,566,186.20
NESTLE INDIA LTD	623	18,717.75	11,661,158.25
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,092	691.45	7,669,563.40
UNITED SPIRITS LTD	5,981	855.35	5,115,848.35
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,404.10	3,361,415.40
DABUR INDIA LTD	12,799	546.10	6,989,533.90
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,424	860.80	5,529,779.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	16,005	2,284.60	36,565,023.00
MARICO LTD	9,787	471.40	4,613,591.80
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,882	4,498.15	8,465,518.30
AUROBINDO PHARMA LTD	6,216	609.70	3,789,895.20
BIOCON LTD	8,322	372.80	3,102,441.60
CIPLA LTD	9,018	892.10	8,044,957.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,589	4,056.60	10,502,537.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,154	4,364.35	9,400,809.90
LUPIN LTD	4,421	922.00	4,076,162.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	16,340	800.85	13,085,889.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	3,117.85	2,718,765.20
AXIS BANK LTD	43,731	704.60	30,812,862.60
BANDHAN BANK LTD	12,468	307.85	3,838,273.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,990	2,539.80	83,788,002.00
ICICI BANK LTD	98,593	798.45	78,721,580.85
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,725	1,830.90	19,636,402.50
STATE BANK OF INDIA	32,901	494.15	16,258,029.15
YES BANK LTD	214,143	13.45	2,880,223.35
BAJAJ FINANCE LTD	5,241	6,931.75	36,329,301.75
BAJAJ FINSERV LTD	743	15,707.15	11,670,412.45
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,200	643.40	5,275,880.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,091	2,258.85	2,464,405.35
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,441.90	3,418,744.90
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	2,366.30	4,886,409.50

	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	814.90	3,544,815.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,154.60	4,442,900.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	627.60	10,609,578.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,331.00	5,574,228.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	568.05	3,425,909.55	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	8,761	1,225.00	10,732,225.00	
	DLF LTD	11,721	372.00	4,360,212.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,655.90	3,974,160.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,954	1,124.90	23,571,154.60	
	INFOSYS LTD	65,472	1,736.80	113,711,769.60	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,030	5,969.10	6,148,173.00	
	MINDTREE LTD	1,148	3,888.95	4,464,514.60	
	MPHASIS LTD	1,722	2,947.35	5,075,336.70	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	17,786	3,771.35	67,077,231.10	
	TECH MAHINDRA LTD	12,179	1,513.15	18,428,653.85	
	WIPRO LTD	26,526	572.75	15,192,766.50	
	BHARTI AIRTEL LTD	47,698	689.90	32,906,850.20	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	248.55	3,365,615.55	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,631	1,837.85	14,024,633.35	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	1,781.15	8,994,807.50	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	2,035.90	10,281,295.00	
	GAIL INDIA LTD	29,821	140.85	4,200,287.85	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,303	396.45	2,498,824.35	
	NTPC LTD	94,749	132.60	12,563,717.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	61,368	214.00	13,132,752.00	
	TATA POWER CO LTD	28,533	229.55	6,549,750.15	
	インドルピー 小計	1,683,937		1,365,936,355.49 (2,103,541,987)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	19.09	187,750.15	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	48,704	3.61	175,821.44	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.43	184,271.76	
	INDUSTRIES QATAR	27,513	16.70	459,467.10	
	COMMERCIAL BANK PQSC	41,465	7.14	296,433.28	
	MASRAF AL RAYAN	90,428	5.09	460,549.80	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	10.16	152,836.88	

	QATAR ISLAMIC BANK	21,511	19.22	413,441.42	
	QATAR NATIONAL BANK	87,549	21.80	1,908,568.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.43	139,627.48	
	COOREDOO QPSC	12,412	7.22	89,701.52	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	17.49	141,634.02	
	カタールリアル 小計	479,074		4,610,103.05 (143,927,417)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	171.27	720,532.89	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	227.23	520,356.70	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,735.00	1,705,505.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,267	301.72	2,494,319.24	
	GOLD FIELDS LTD	17,529	164.86	2,889,830.94	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	61.19	658,343.21	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,858	216.38	3,431,354.04	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	497.84	531,195.28	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	7,213	197.64	1,425,577.32	
	SASOL LTD	10,981	293.20	3,219,629.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	54,416	54.00	2,938,464.00	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	186.01	983,992.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	117.04	847,603.68	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	207.50	965,082.50	
	NASPERS LTD-N SHS	4,197	2,504.32	10,510,631.04	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	24,000	22.87	548,880.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	50.55	955,698.30	
	BID CORP LTD	6,193	318.49	1,972,408.57	
	CLICKS GROUP LTD	5,071	310.75	1,575,813.25	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,412	204.65	1,926,165.80	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	173.21	637,412.80	
	TIGER BRANDS LTD	3,270	180.45	590,071.50	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	203.00	1,480,682.00	
ABSA GROUP LTD	13,383	157.48	2,107,554.84		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,567	1,980.42	3,103,318.14		
NEDBANK GROUP LTD	8,655	177.55	1,536,695.25		
STANDARD BANK GROUP LTD	25,074	140.84	3,531,422.16		
FIRSTRAND LTD	97,623	61.72	6,025,291.56		

	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	291.76	796,213.04	
	REMGRO LTD	10,067	126.58	1,274,280.86	
	DISCOVERY LTD	8,270	144.38	1,194,022.60	
	OLD MUTUAL LTD	90,974	13.25	1,205,405.50	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	15,014	44.75	671,876.50	
	SANLAM LTD	37,509	59.78	2,242,288.02	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,950	103.00	818,850.00	
	MTN GROUP LTD	32,829	158.66	5,208,649.14	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	136.32	1,521,467.52	
	南アフリカランド 小計	595,581		74,766,885.29	(560,003,970)
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	48,436	4.14	200,525.04	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	8.78	445,576.22	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	6.83	185,004.21	
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.48	300,325.92	
	EMIRATES NBD PJSC	49,345	13.25	653,821.25	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	84,394	20.46	1,726,701.24	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.14	298,258.02	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	4.66	348,036.76	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	67,264	32.08	2,157,829.12	
	アラブディルハム 小計	528,808		6,316,077.78	(195,735,250)
クウェートディナール	AGILITY	23,191	0.99	22,959.09	
	BOUBYAN BANK K.S.C	21,129	0.82	17,431.42	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	88,927	0.90	80,301.08	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	130,986	1.04	136,225.44	
	MABANEE CO KPSC	11,548	0.81	9,434.71	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	43,086	0.59	25,765.42	
	クウェートディナール 小計	318,867		292,117.16	(110,353,099)
オフショア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.28	139,100.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	24.12	214,668.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.10	17,340.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	6.30	6,930.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.64	2,320.00	

PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.30	115,010.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	13.31	126,445.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	9.32	79,406.40	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	6,300	13.61	85,743.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	991	25.22	24,993.02	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	43.54	39,186.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	5.70	72,390.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	41.91	163,449.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	53.96	26,980.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	30,600	7.56	231,336.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.85	2,565.00	
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	85.57	59,899.00	
CHENGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	10.49	46,156.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	47.77	66,878.00	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.32	36,768.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	16.82	55,741.48	
CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	32.79	62,301.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	5.66	97,352.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	41.08	143,780.00	
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	3,300	11.49	37,917.00	
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	41.85	62,775.00	
GEM CO LTD-A	3,500	9.39	32,865.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	101.00	120,190.00	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	31.67	63,340.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	23.78	136,021.60	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.25	19,987.50	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.47	3,705.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	112.40	78,680.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	10.19	46,874.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	20.37	22,407.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	32.40	61,560.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.69	19,915.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.51	111,193.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.00	17,500.00	
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	9.24	54,516.00	

JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	18.52	59,264.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	123.70	37,110.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	72.32	36,160.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	21.74	43,480.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	134.87	148,357.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	12.17	38,944.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	26.03	44,251.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	15.34	29,146.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	16.37	99,857.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.88	27,936.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	18.93	190,246.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	1,680	44.00	73,920.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	19.67	68,215.56
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	30.95	56,329.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	4.61	46,100.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.78	25,916.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	146.87	105,746.40
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	14.07	52,059.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	7.33	35,184.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	17.27	29,359.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	98.59	59,154.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,200	35.76	42,912.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.63	51,546.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	21.87	52,488.00
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	24.98	47,462.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	30.00	66,000.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	4.01	2,406.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	116.66	65,329.60
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.72	65,400.00
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	31.57	47,355.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	22.20	33,300.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	23,500	3.66	86,010.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	8.10	10,530.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	93.43	355,034.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	70.57	28,228.00

WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	77.80	77,800.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	21.10	25,320.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	10.68	43,788.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	8.96	21,324.80
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	118.89	83,223.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	12.17	37,727.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,200	267.28	320,736.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	22.65	79,275.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	107.50	124,700.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	11.55	26,565.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.92	41,344.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	36.86	55,290.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	9.89	44,505.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,500	10.29	272,685.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	24.35	24,350.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	50.15	125,375.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	12.52	37,560.00
AVICOPTER PLC-A	500	57.26	28,630.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	34.00	47,600.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	118.55	47,420.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	14.35	64,575.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	21.95	96,580.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	10.94	106,118.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.46	138,244.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	56,800	5.41	307,288.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,800	580.99	1,626,772.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	3.10	57,040.00
CRRC CORP LTD-A	35,700	6.07	216,699.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	18.74	82,456.00
EVE ENERGY CO LTD-A	2,620	99.99	261,973.80
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	9.91	4,132.47
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	400	247.99	99,196.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	3,000	43.56	130,680.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	172.13	68,852.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	34.22	20,532.00

HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	68.04	20,412.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,036	80.95	164,814.20	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	14.55	37,830.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	19.25	42,350.00	
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	500	148.76	74,380.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	4.03	87,854.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	23.85	95,400.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,646	38.10	291,312.60	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	21.91	52,584.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	8.96	206,080.00	
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	26.99	53,980.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	11,600	22.75	263,900.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.45	19,320.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.45	46,280.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	66.41	179,307.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	11.17	100,530.00	
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	47.65	71,475.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	131.57	197,355.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	38.95	50,635.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	532.90	85,264.00	
TBEA CO LTD-A	5,500	19.64	108,020.00	
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	17.72	49,616.00	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	17.12	15,408.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	16.33	96,347.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	135.64	67,820.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.91	45,507.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.73	2,919.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	14.86	50,524.00	
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	31.03	30,409.40	
YOUNGY CO LTD-A	400	102.02	40,808.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.21	32,913.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	48.51	97,020.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	74.86	31,441.20	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	91.45	73,160.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	22.33	66,766.70	

ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	24.15	31,395.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	18.00	72,000.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	7.44	47,616.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	6.94	18,044.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	56.02	44,816.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	1,800	32.40	58,320.00
AIR CHINA LTD-A	6,400	9.69	62,016.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	56,900	4.97	282,793.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	5.58	60,264.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	7.15	65,065.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	16.62	213,899.40
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	65.33	365,848.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	52.33	52,330.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.78	51,442.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.31	8,620.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	15.80	63,200.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	20.47	99,688.90
AUTEL INTELLIGENT TECHNOLO-A	1,000	68.01	68,010.00
BYD CO LTD -A	2,100	251.40	527,940.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	180.64	36,128.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	13.54	81,510.80
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	9.82	31,424.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	49.04	93,176.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	43.26	142,758.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	28.90	86,700.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	148.32	74,160.00
MIANYANG FULIN PRECISION C-A	1,100	26.18	28,798.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	20.19	24,228.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	2,100	59.30	124,530.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	11,510	19.52	224,675.20
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	11.88	36,828.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	32.71	42,523.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	158.41	63,364.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	886.01	177,202.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	134.01	80,406.00

HAIER SMART HOME CO LTD-A	8,700	29.45	256,215.00	
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	26.66	29,326.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	36.96	36,960.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	77.00	61,600.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	16.65	14,985.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	141.09	76,188.60	
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	4.65	20,925.00	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	70.21	56,168.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	6.00	84,600.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	31.50	16,065.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.34	2,936.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	55.41	16,623.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	58.77	35,262.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	8.06	66,898.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	15.70	16,956.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	10.85	14,105.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	22,600	8.21	185,546.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	374.98	37,498.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	10.97	2,194.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	21.18	16,944.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	39.01	121,321.10	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	14.63	19,750.50	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	3,900	27.66	107,874.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	13,900	7.97	110,783.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,300	207.30	476,790.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.71	48,550.00	
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	4.04	36,764.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.52	33,120.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	41.28	29,721.60	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	45.94	12,863.20	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	54.29	29,642.34	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	4.08	12,648.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	56.85	39,795.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	216.36	129,816.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	70.50	35,250.00	

ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	1,300	71.69	93,197.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.42	4,710.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	33.20	19,920.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	58.04	23,216.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	137.37	54,948.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	33.14	23,198.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,190	103.31	432,868.90
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	147.41	58,964.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	22.48	20,232.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,600	73.11	190,086.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.11	35,275.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	31.48	75,552.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	8,500	39.40	334,900.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	53.32	53,320.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,900	167.25	317,775.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	9.25	18,500.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	183.13	73,252.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	33.91	10,173.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	56.88	17,064.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,500	1,950.20	2,925,300.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,800	232.90	419,220.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	6,516	53.82	350,691.12
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	16.17	122,892.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	47.46	46,510.80
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,520	274.75	417,620.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	107.36	42,944.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	27.60	19,320.00
TONGWEI CO LTD-A	6,300	40.84	257,292.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	95.36	85,824.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	9,660	19.28	186,244.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,700	215.07	1,010,829.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	61.04	134,288.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	19.66	21,626.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	25.95	33,735.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	15.76	15,760.00

PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	176.50	17,650.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	41.73	25,038.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	34.46	191,769.90
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	50.44	31,777.20
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	29.00	11,600.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	83.90	58,730.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	37.22	64,762.80
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	450	58.44	26,298.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	50.24	59,283.20
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	31.21	15,605.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	13.90	2,780.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	3,700	23.82	88,134.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.35	3,528.00
OVCTEK CHINA INC-A	920	43.05	39,606.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	19.70	39,400.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,500	337.48	506,220.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	43.11	43,110.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	161.69	48,507.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	13.99	14,549.60
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	30.28	27,252.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	342.00	68,400.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	28.10	30,348.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	700	240.22	168,154.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	70.50	21,150.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	88.28	26,484.00
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	265.00	53,000.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	171.24	68,496.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	37.17	3,717.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	105.55	211,100.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	18.98	18,220.80
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	39.40	3,940.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	30.99	43,386.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	116.70	35,010.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	26.65	47,437.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	21.67	30,338.00

IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	473.29	141,987.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	8,016	43.29	347,012.64
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.25	19,600.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	103.16	57,769.60
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.51	18,255.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	37.40	31,603.00
PHARMABLOCK SCIENCES NANJI-A	400	105.92	42,368.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	130.80	91,560.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	22.49	5,847.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	47.68	90,592.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	74.63	62,316.05
SHANGHAI MEDICILON INC-A	200	394.15	78,830.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	6.98	20,242.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	84.98	50,988.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	25.16	2,516.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	22.36	31,304.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	19.10	3,820.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	52.60	78,900.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,128	111.90	350,023.20
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,900	95.60	181,640.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	800	376.20	300,960.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	21.73	26,293.30
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	45.93	59,709.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	32.37	69,142.32
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	50.20	20,080.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.99	211,991.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.56	85,272.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	8.11	60,825.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	14.41	21,615.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.12	104,832.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.78	179,250.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.57	84,506.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.83	101,767.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.00	89,000.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	39.73	313,867.00

BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.22	98,264.20
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	6.08	55,936.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	3.41	191,983.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	24,600	51.85	1,275,510.00
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	3.95	33,575.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.73	70,479.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.70	363,780.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	24,500	22.06	540,470.00
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	17.20	395,600.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	39,000	5.73	223,470.00
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.94	20,882.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	8.69	318,054.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.92	3,528.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	12.57	37,710.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.27	15,405.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.34	49,912.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.95	30,660.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	12.59	37,770.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	47.05	56,460.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	11,400	17.11	195,054.00
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	25.70	285,270.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	27.89	139,450.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	11.17	69,254.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	12,604	32.59	410,764.36
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	14.50	46,400.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.85	3,425.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	7.78	56,016.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	22.25	131,275.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	3,240	8.56	27,734.40
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	14.73	32,406.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.49	52,854.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	11,400	18.37	209,418.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.57	3,785.00

HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.18	108,402.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	129.71	64,855.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	11,600	18.33	212,628.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.69	2,907.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	9.07	60,769.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	9.56	15,296.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.76	26,280.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	13.35	69,420.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	7.87	43,064.64	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.06	10,150.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.10	2,440.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	5.00	136,000.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	10.73	46,139.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	8.26	80,122.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.07	19,266.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	3.86	16,598.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	7.82	3,910.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.99	16,887.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	9.16	96,180.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	29.19	72,975.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.85	186,595.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	39.60	75,240.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.68	16,380.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,400	53.13	658,812.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	13.95	111,600.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	21.70	277,760.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	35.49	85,176.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	13.28	43,824.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.51	67,244.10	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	5.29	3,703.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	15.99	204,672.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.71	2,826.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	15.02	25,233.60	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	14.68	13,212.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.86	21,266.00	

ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.69	60,970.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	12,200	12.05	147,010.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	33.54	16,099.20
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	271.99	163,194.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	32.73	4,582.20
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	15.90	11,130.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	15.30	10,710.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	8.26	3,304.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	2,364	61.23	144,747.72
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	48.24	120,600.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	29.20	23,360.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	176.00	70,400.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,920	61.87	118,790.40
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	149.81	44,943.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	4,908	39.18	192,295.44
ADDSINO CO LTD -A	1,700	15.74	26,758.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	38.62	88,826.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	36.92	18,460.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	163.79	32,758.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	50,500	4.97	250,985.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	39.07	70,326.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	14.73	38,298.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.93	54,230.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	900	119.12	107,208.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	17.87	19,657.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.49	81,579.00
GOERTEK INC -A	3,300	50.17	165,561.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	13.05	28,710.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.54	45,126.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.81	2,943.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	75.58	37,790.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	14.56	53,872.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	25.53	25,530.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	36.53	21,918.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	18.80	86,480.00

LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	9.47	21,781.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	8,633	49.29	425,520.57
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	276.24	99,446.40
NINESTAR CORP-A	1,800	51.95	93,510.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	8.56	3,424.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	69.14	48,398.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	200	364.89	72,978.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,600	21.58	99,268.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	115.38	32,306.40
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	14.46	14,460.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	36.08	28,864.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	22.90	20,610.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	143.96	143,960.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	24.70	17,290.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	39.20	27,440.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	12.69	30,456.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	23.88	44,798.88
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	14.50	18,850.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	45.69	59,397.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	119.00	142,800.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	23.05	43,887.20
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	11.54	28,850.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	17.81	31,345.60
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	74.22	47,500.80
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	196.83	78,732.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	82.55	74,295.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	20.10	48,240.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	38.92	19,460.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	82.05	57,435.00
ZTE CORP-A	3,800	31.88	121,144.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.97	184,605.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	9.94	64,610.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	5.37	42,423.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	26,400	7.54	199,056.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	28,400	22.85	648,940.00

	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.80	33,820.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	2.84	88,040.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.59	5,967.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	8.51	96,163.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	10.24	67,584.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	7.49	4,494.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.55	60,060.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	121.00	114,103.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	51.30	56,430.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.38	14,534.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	155.50	117,558.00	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	123.30	147,960.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	52.45	104,900.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	114.76	45,904.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	2,200	95.65	210,430.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	28.05	53,295.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,240	76.54	477,609.60	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	76.14	54,363.96	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	26.45	95,220.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	300.00	150,000.00	
	SG MICRO CORP-A	450	290.78	130,851.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	92.70	23,175.00	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	89.04	26,712.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	300	339.98	101,994.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	4,300	41.72	179,396.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	12.14	23,066.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	18.18	14,544.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	226.19	180,952.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,100	289.01	317,911.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	61.40	55,260.00	
	オフショア人民元 小計	2,514,413		49,360,973.17 (888,882,532)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	23.88	93,872.28	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	42,866	36.30	1,556,035.80	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	71.90	135,100.10	

NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	6,762	22.14	149,710.68	
NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	42.50	85,000.00	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	4,247	181.00	768,707.00	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	44.00	293,656.00	
SAUDI ARABIAN MINING CO	8,428	90.90	766,105.20	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	17,420	125.00	2,177,500.00	
SAUDI CEMENT	1,265	55.70	70,460.50	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	4,366	33.00	144,078.00	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	18.02	249,216.60	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	68.30	309,672.20	
JARIR MARKETING CO	1,096	200.40	219,638.40	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	973	108.60	105,667.80	
ALMARAI CO	4,232	48.40	204,828.80	
SAVOLA	4,558	33.85	154,288.30	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	166.80	131,104.80	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	193.00	184,315.00	
AL RAJHI BANK	23,662	147.40	3,487,778.80	
ALINMA BANK	18,025	27.60	497,490.00	
ARAB NATIONAL BANK	11,172	27.00	301,644.00	
BANK AL-JAZIRA	7,856	21.82	171,417.92	
BANK ALBILAD	6,762	54.70	369,881.40	
BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	49.50	537,273.00	
RIYAD BANK	26,595	32.90	874,975.50	
SAUDI BRITISH BANK	16,283	40.85	665,160.55	
THE SAUDI NATIONAL BANK	42,437	71.60	3,038,489.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	135.00	157,680.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,298	76.40	99,167.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	12,836	10.12	129,900.32	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	12.52	103,853.40	
ETIHAD ETISALAT CO	7,054	32.00	225,728.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	12.42	112,835.70	
SAUDI TELECOM CO	11,658	118.80	1,384,970.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	25.80	401,422.20	
サウジアラビアリアル 小計	361,401		20,358,625.05	(619,716,546)

合計	49,637,684		17,055,235,912 (17,055,235,912)
----	------------	--	------------------------------------

(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	1,282,842.00	
	メキシコペソ 小計		58,900	1,282,842.00 (7,098,477)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	882,490.95	
	南アフリカランド 小計		63,261	882,490.95 (6,609,857)	
合計				13,708,334 (13,708,334)	

(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%		6.3%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.9%		1.9%
	投資証券 1銘柄		2.1%	0.0%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	100.0%		4.3%
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	205銘柄	100.0%		24.4%
マレーシアリングット	株式	35銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		1.7%
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%		12.2%
新台湾ドル	株式	86銘柄	100.0%		16.4%
インドルピー	株式	106銘柄	100.0%		12.3%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式	37銘柄	98.8%		3.3%
	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%		1.1%
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%		5.2%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%		3.6%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 1月25日現在

資産の部

流動資産

2022年 1月25日現在

コール・ローン	315,505,313
投資証券	28,510,196,850
未収入金	9,270,000
未収配当金	150,995,493
前払金	18,785,900
差入委託証拠金	16,390,000
流動資産合計	29,021,143,556
資産合計	29,021,143,556
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,366,790
未払解約金	197,953,000
未払利息	855
流動負債合計	218,320,645
負債合計	218,320,645
純資産の部	
元本等	
元本	20,977,046,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,825,776,146
元本等合計	28,802,822,911
純資産合計	28,802,822,911
負債純資産合計	29,021,143,556

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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	19,216,952,787円
期中追加設定元本額	17,962,516,760円

期中一部解約元本額	16,202,422,782円
期末元本額	20,977,046,765円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	918,821,717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）	799,576,998円
DCりそな グローバルバランス	19,129,517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	118,220,631円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	79,208,937円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	27,242,204円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	17,311,312円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,161,534円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,247,660円
リスクコントロール・オープン	2,485,168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	42,092,792円
りそな国内リートインデックス（ラップ専用）	667,246円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,137,575,103円
FWりそな国内リートインデックスファンド	4,316,001,294円
Smart-i Jリートインデックス	2,491,845,960円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,853,920円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	106,680,327円
Smart-i 8資産バランス 成長型	122,510,763円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	86,703,629円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	139,720,663円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	85,641,683円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	51,539,989円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	107,582,370円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	18,488,113円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,753,904,238円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,705,652円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	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）	2,927,185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）	1,952,086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）	144,744,799円
2. 計算日における受益権の総数	20,977,046,765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	1.3731円
(10,000口当たり純資産額)	(13,731円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		841,757,920
合計		841,757,920

(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 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	298,549,790	-	278,183,000	20,366,790
合計		298,549,790	-	278,183,000	20,366,790

(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	553	74,212,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	869	97,067,300	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,277	196,785,700	
	東海道リート投資法人	210	21,924,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	948	565,956,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,227	449,843,800	
	産業ファンド投資法人	3,896	739,850,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,744	932,960,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,875	371,250,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,463	543,504,500	
	G L P 投資法人	8,889	1,646,242,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,236	377,598,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,491	1,585,323,000	
	星野リゾート・リート投資法人	460	282,900,000	
	O n e リート投資法人	476	136,992,800	
	イオンリート投資法人	3,228	458,376,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,560	415,232,000	
	日本リート投資法人	847	318,048,500	
	積水ハウス・リート投資法人	8,331	635,655,300	
	トーセイ・リート投資法人	573	71,854,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,096	277,288,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	585	76,752,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	622	73,831,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8,876	1,315,423,200	
	いちごホテルリート投資法人	455	33,670,000	
	ラサールロジポート投資法人	3,360	595,056,000	
スターアジア不動産投資法人	2,836	170,443,600		
マリモ地方創生リート投資法人	321	39,258,300		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,020	582,420,000		

大江戸温泉リート投資法人	443	26,137,000	
投資法人みらい	3,325	155,111,250	
森トラスト・ホテルリート投資法人	644	71,677,200	
三菱地所物流リート投資法人	698	313,053,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,063	207,710,200	
ザイマックス・リート投資法人	398	45,212,800	
タカラレーベン不動産投資法人	1,082	123,131,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,070	169,381,000	
日本ビルファンド投資法人	3,200	2,057,600,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,745	1,674,450,000	
日本都市ファンド投資法人	13,848	1,256,013,600	
オリックス不動産投資法人	5,469	869,024,100	
日本プライムリアルティ投資法人	1,875	672,187,500	
N T T 都市開発リート投資法人	2,631	381,231,900	
東急リアル・エステート投資法人	1,840	333,408,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,906	205,276,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,179	800,798,400	
森トラスト総合リート投資法人	1,962	261,927,000	
インヴィンシブル投資法人	12,080	420,384,000	
フロンティア不動産投資法人	962	444,444,000	
平和不動産リート投資法人	1,778	243,052,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,793	556,726,500	
福岡リート投資法人	1,419	219,519,300	
ケネディクス・オフィス投資法人	849	555,246,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,249	176,771,400	
大和証券オフィス投資法人	580	389,760,000	
阪急阪神リート投資法人	1,240	177,940,000	
スターツプロシード投資法人	427	88,260,900	
大和ハウスリート投資法人	4,121	1,359,930,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,408	457,395,200	
大和証券リビング投資法人	3,709	395,379,400	
ジャパンエクセレント投資法人	2,547	316,337,400	
合計	159,864	28,510,196,850	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2022年 1月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	5,559,909
コール・ローン	297,574,074
株式	87,180,845
投資証券	27,054,166,655
派生商品評価勘定	24,248
未収入金	143,237,294
未収配当金	24,729,011
流動資産合計	27,612,472,036
資産合計	27,612,472,036
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,763
未払金	4,730,056
未払解約金	346,343,500
未払利息	807
流動負債合計	351,134,126
負債合計	351,134,126
純資産の部	
元本等	
元本	19,224,785,743
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,036,552,167
元本等合計	27,261,337,910
純資産合計	27,261,337,910
負債純資産合計	27,612,472,036

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 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	21,976,415,392円
期中追加設定元本額	16,984,745,384円
期中一部解約元本額	19,736,375,033円
期末元本額	19,224,785,743円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,334,825,469円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,327,298,879円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,106,566,227円
DCりそな グローバルバランス	20,420,800円
つみたてバランスファンド	654,664,447円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	391,752,294円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	230,641,588円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	153,769,864円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	52,961,430円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	33,379,326円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,805,771円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	31,409,711円
リスクコントロール・オープン	9,487,428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	80,707,460円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,189,762,193円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,238,707,039円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,052,843,142円
Smart-i 8資産バランス 安定型	73,243,068円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	207,487,244円
Smart-i 8資産バランス 成長型	238,177,948円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	166,284,733円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	267,903,885円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	164,218,959円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	98,805,007円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	200,757,251円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,176,196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)	4,579,533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)	3,197,595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)	78,225,097円
2. 計算日における受益権の総数	19,224,785,743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	1.4180円
(10,000口当たり純資産額)	(14,180円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2022年 1月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月25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 1月25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 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	586,672	
投資証券	3,413,849,480	
合計	3,413,262,808	

(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 1月25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	79,657,247	-	79,692,762	35,515
	米ドル	34,155,000	-	34,202,610	47,610
	ユーロ	33,553,530	-	33,556,080	2,550
	英ポンド	4,475,367	-	4,457,224	18,143
	オーストラリアドル	4,087,750	-	4,082,500	5,250
	シンガポールドル	3,385,600	-	3,394,348	8,748
	合計	79,657,247	-	79,692,762	35,515

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

			評価額
--	--	--	-----

通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
米ドル	BROADSTONE NET LEASE INC-A	24,377	22.58	550,432.66	
米ドル 小計		24,377		550,432.66 (62,754,827)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	99,058	3.02	299,155.16	
オーストラリアドル 小計		99,058		299,155.16 (24,426,018)	
合 計		123,435		87,180,845 (87,180,845)	

(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	270,901.81	
		AGREE REALTY CORP	10,530	683,397.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,055	253,380.60	
		ALEXANDER'S INC	312	79,881.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,402	4,178,954.52	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	31,398.06	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,003	283,226.17	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,117	1,091,326.56	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,329	160,044.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,064	1,675,620.24	
		AMERICOLD REALTY TRUST	40,445	1,136,100.05	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,825	1,231,752.50	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,755	159,158.50	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,958	510,688.84	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,843	120,795.38	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,318	35,148.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,161	5,086,892.79	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,936	104,304.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,562	2,480,276.86	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,084	42,279.32	
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,447	343,282.06	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,050	1,102,373.50	
BRT APARTMENTS CORP	1,668	36,746.04	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,515	2,451,214.85	
CARETRUST REIT INC	14,733	312,192.27	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	46,628.90	
CENTERSPACE	2,173	205,956.94	
CHATHAM LODGING TRUST	7,087	92,414.48	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	14,300.00	
CITY OFFICE REIT INC	6,494	115,658.14	
CLIPPER REALTY INC	1,350	12,339.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,398	153,759.50	
COREPOINT LODGING INC	6,315	98,766.60	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,016	433,737.84	
COUSINS PROPERTIES INC	22,528	865,300.48	
CTO REALTY GROWTH INC	900	53,379.00	
CUBESMART	32,857	1,660,921.35	
CYRUSONE INC	19,264	1,716,037.12	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,493	288,475.88	
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,989	6,616,436.99	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	77,384	567,998.56	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	34,590	104,807.70	
DOUGLAS EMMETT INC	26,557	845,309.31	
DUKE REALTY CORP	57,807	3,296,733.21	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,347	286,159.68	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,169	1,228,247.90	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,071	197,535.45	
EPR PROPERTIES	11,533	508,835.96	
EQUINIX INC	13,642	9,970,119.28	
EQUITY COMMONWEALTH	18,314	471,219.22	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,952	1,982,213.76	
EQUITY RESIDENTIAL	51,672	4,564,704.48	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,752	477,800.96	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,883	3,290,050.70	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,318	3,962,010.00	
FARMLAND PARTNERS INC	4,291	48,102.11	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,622	1,306,718.44	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,755	1,180,558.80	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,950	322,530.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,910	80,260.70	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,369	1,483,022.35	
GEO GROUP INC/THE	18,320	133,003.20	
GETTY REALTY CORP	5,766	168,021.24	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,758	132,837.06	
GLADSTONE LAND CORP	4,670	138,512.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,087	151,480.29	
GLOBAL NET LEASE INC	15,387	215,571.87	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,241	693,919.20	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,492	1,064,375.76	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,829	2,852,558.94	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	52,960.78	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,739	681,026.53	
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,290	1,840,930.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,963	540,549.02	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,821	350,593.36	
INDUS REALTY TRUST INC	935	71,060.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,982	224,794.64	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,669	714,097.47	
INVITATION HOMES INC	90,613	3,777,655.97	
IRON MOUNTAIN INC	43,954	1,950,238.98	
JBG SMITH PROPERTIES	17,595	477,880.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	111,100	86,658.00	
KILROY REALTY CORP	15,871	1,005,110.43	
KIMCO REALTY CORP	93,563	2,223,992.51	
KITE REALTY GROUP TRUST	33,050	689,423.00	
LIFE STORAGE INC	12,432	1,661,288.16	
LTC PROPERTIES INC	5,856	206,892.48	

LXP INDUSTRIAL TRUST	42,633	596,435.67	
MACERICH CO/THE	32,808	536,082.72	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	142,978.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	90,497	2,080,526.03	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,482	3,545,349.60	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,862	310,021.32	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,641	1,166,875.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,355	756,249.55	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,063	414,174.32	
NETSTREIT CORP	5,746	127,446.28	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,447	270,520.56	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	179,165.95	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,245	1,098,585.95	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	66,728.00	
ORION OFFICE REIT INC	7,881	131,927.94	
PARAMOUNT GROUP INC	25,119	217,279.35	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,773	649,279.95	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,748	433,666.08	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	8,573.16	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,825	88,224.75	
PHYSICIANS REALTY TRUST	33,270	601,521.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,554	331,559.98	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,087	135,873.77	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,959	33,675.21	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,897	132,669.60	
PRIME US REIT	91,700	75,652.50	
PROLOGIS INC	112,035	17,176,085.85	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,101	515,324.18	
PUBLIC STORAGE	23,112	8,138,428.56	
REALTY INCOME CORP	85,707	5,863,215.87	
REGENCY CENTERS CORP	23,384	1,657,691.76	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,142	328,370.20	
RETAIL VALUE INC	2,135	6,703.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,979	1,649,662.41	
RLJ LODGING TRUST	25,353	354,434.94	

	RPT REALTY	12,721	160,411.81	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,332	713,469.16	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,191	465,576.93	
	SAFEHOLD INC	2,155	129,989.60	
	SAUL CENTERS INC	2,026	101,847.02	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,971	52,046.37	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	25,323	216,005.19	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	49,787	7,273,880.70	
	SITE CENTERS CORP	27,707	401,474.43	
	SL GREEN REALTY CORP	10,239	776,218.59	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,625	856,191.25	
	STAG INDUSTRIAL INC	26,440	1,103,605.60	
	STORE CAPITAL CORP	37,204	1,151,091.76	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,489	156,810.39	
	SUN COMMUNITIES INC	17,608	3,288,822.24	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,352	369,540.16	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,831	278,308.98	
	TERRENO REALTY CORP	11,291	829,323.95	
	UDR INC	44,124	2,479,327.56	
	UMH PROPERTIES INC	6,767	161,528.29	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,860	106,764.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	16,468	301,199.72	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,380	84,884.40	
	VENTAS INC	60,595	3,133,973.40	
	VERIS RESIDENTIAL INC	12,245	204,491.50	
	VICI PROPERTIES INC	95,488	2,625,920.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,075	997,186.50	
	WASHINGTON REIT	12,665	315,738.45	
	WELLTOWER INC	65,931	5,671,384.62	
	WHITESTONE REIT	6,335	65,567.25	
	WP CAREY INC	28,264	2,144,954.96	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,080	298,558.40	
	米ドル 小計	3,866,836	181,252,872.99	(20,664,640,049)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,579	415,728.60	

	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,169	107,919.13
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	49,245.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,332	177,695.56
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	23,046.24
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,790	689,892.60
	CHOICE PROPERTIES REIT	24,984	353,773.44
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,741	160,357.47
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,887	119,489.45
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,649	125,673.07
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,317	269,798.86
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	93,789.12
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	29,740.62
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,666	291,988.32
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,963	468,457.57
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	22,135	279,122.35
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	24,489.09
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	159,132.60
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	170,035.20
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	63,229.74
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	40,079.93
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,635	30,302.50
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	16,650	218,947.50
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	46,000.00
	PRIMARIS REIT	5,227	73,439.35
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,368	507,552.96
	SLATE GROCERY REIT	4,386	62,237.34
	SLATE OFFICE REIT	4,169	20,970.07
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,042	332,805.88
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,713	265,066.05
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	38,413.40
	カナダドル 小計	291,182	5,708,419.01 (515,070,647)
ユーロ	AEDIFICA	5,499	579,044.70
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,809	152,275.50
	ALTAREA	616	95,233.60

	BEFIMMO	3,898	126,100.30
	CARE PROPERTY INVEST	3,794	95,798.50
	CARMILA	6,580	89,619.60
	COFINIMMO	4,458	583,998.00
	COIMA RES SPA	3,638	25,829.80
	COVIVIO	7,280	534,206.40
	CROMWELL REIT EUR	43,440	108,165.60
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,881	114,973.55
	GECINA SA	8,239	957,783.75
	HAMBORNER REIT AG	11,706	112,705.36
	HIBERNIA REIT PLC	99,303	127,306.44
	ICADE	4,788	304,516.80
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	27,595.47
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	41,362	318,694.21
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,446	91,491.30
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	63,839	107,249.52
	KLEPIERRE	30,360	698,583.60
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	40,405.68
	MERCIALYS	7,777	71,781.71
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,533	484,813.60
	MONTEA NV	1,535	180,823.00
	NSI NV	2,616	94,045.20
	RETAIL ESTATES	1,787	126,877.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,667	1,088,110.53
	VASTNED RETAIL NV	2,828	68,437.60
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,262	784,567.80
	WERELDHAVE NV	6,589	84,470.98
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,764	130,046.20
	ユーロ 小計	486,262	8,405,551.30 (1,084,820,450)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	22,720.00
	ASSURA PLC	441,362	293,064.36
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,546	391,288.04
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	125,514	141,579.79
	BRITISH LAND CO PLC	141,969	750,448.13
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	130,732	224,466.84

	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	88,659.03	
	CUSTODIAN REIT PLC	60,787	65,163.66	
	DERWENT LONDON PLC	16,941	577,688.10	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	87,550	75,117.90	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	38,050	285,565.25	
	HAMMERSON PLC	652,218	226,189.20	
	HOME REIT PLC	87,702	104,365.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,490	66,144.08	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	113,773	881,058.11	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	136,832	362,604.80	
	LXI REIT PLC	108,442	157,891.55	
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	36,344.60	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	79,142	81,991.11	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205,608	292,785.79	
	PRS REIT PLC/THE	86,720	90,622.40	
	REGIONAL REIT LTD	63,471	57,758.61	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,359	398,662.88	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	86,166	47,822.13	
	SEGREO PLC	182,425	2,335,952.12	
	SHAFTESBURY PLC	43,170	269,596.65	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,875	46,182.50	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	148,459	182,604.57	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	54,115.86	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	282,592	649,961.60	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	123,935	97,908.65	
	UNITE GROUP PLC	60,426	618,460.11	
	WORKSPACE GROUP PLC	19,933	174,613.08	
	英bond 小計	4,023,871	10,149,396.88 (1,559,962,300)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	60,535	212,477.85	
	ARENA REIT	52,273	248,819.48	
	AVENTUS GROUP	60,193	202,248.48	
	BWP TRUST	74,391	298,307.91	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,812	316,341.84	

	CENTURIA OFFICE REIT	63,819	141,678.18
	CHARTER HALL GROUP	70,569	1,247,659.92
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	90,932	442,838.84
	CHARTER HALL RETAIL REIT	81,252	329,883.12
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	48,631	187,229.35
	CROMWELL PROPERTY GROUP	221,920	184,193.60
	DEXUS INDUSTRIA REIT	32,499	103,996.80
	DEXUS/AU	163,223	1,757,911.71
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	70,646.77
	GOODMAN GROUP	258,210	6,049,860.30
	GPT GROUP	290,936	1,509,957.84
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	42,930	171,290.70
	HOME CONSORTIUM LTD	26,532	188,377.20
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	81,478	115,291.37
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	29,868	103,343.28
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	54,932	310,915.12
	IRONGATE GROUP	80,328	135,352.68
	MIRVAC GROUP	598,808	1,652,710.08
	NATIONAL STORAGE REIT	162,171	400,562.37
	RURAL FUNDS GROUP	55,568	164,481.28
	SCENTRE GROUP	788,646	2,342,278.62
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,439	469,357.98
	STOCKLAND	362,562	1,468,376.10
	VICINITY CENTRES	595,938	995,216.46
	WAYPOINT REIT	111,621	298,028.07
	オーストラリアドル 小計	4,876,351	22,119,633.30 (1,806,068,058)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	134,637	201,955.50
	GOODMAN PROPERTY TRUST	159,358	402,378.95
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	244,365	274,910.62
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	201,503	323,412.31
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,632	189,171.84
	ニュージーランドドル 小計	800,495	1,391,829.22 (106,266,160)
香港ドル	CHAMPION REIT	300,000	1,218,000.00
	FORTUNE REIT	219,000	1,765,140.00

	LINK REIT	317,000	21,793,750.00	
	PROSPERITY REIT	198,000	613,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	141,000	609,120.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	350,000	1,169,000.00	
	香港ドル 小計	1,525,000	27,168,810.00 (397,751,378)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	70,900	100,678.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	207,400	184,586.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	507,500	1,451,450.00	
	ASCOTT TRUST	285,996	297,435.84	
	CAPITALAND CHINA TRUST	167,700	199,563.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	755,232	1,518,016.32	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,100	131,157.00	
	EC WORLD REIT	50,000	36,500.00	
	ESR REIT	428,400	194,922.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	91,314.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	51,863.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	161,900	370,751.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	437,179	629,537.76	
	IREIT GLOBAL	95,000	61,750.00	
	KEPPEL DC REIT	199,900	449,775.00	
	KEPPEL REIT	296,500	343,940.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	118,930.50	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	330,100	607,384.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	292,600	766,612.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	450,600	793,056.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	330,500	360,245.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	156,145.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	60,500	298,870.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	85,600	70,192.00	
	SPH REIT	135,800	131,726.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	211,700	134,429.50	
	SUNTEC REIT	329,700	504,441.00	
	シンガポールドル 小計	6,836,807	10,055,269.92 (853,290,205)	

韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,100	127,655,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,640,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	95,400,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	26,747,630.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,693	109,465,970.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	46,358,935.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	40,462,980.00	
韓国ウォン 小計		83,117	468,730,515.00	(44,716,891)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	27,424	598,391.68	
	イスラエルシェケル 小計	27,424	598,391.68	(21,580,517)
合計			27,054,166,655	(27,054,166,655)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 1銘柄	0.3%		0.2%
	投資証券 155銘柄		99.7%	76.1%
カナダドル	投資証券 31銘柄		100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄		100.0%	4.0%
英ポンド	投資証券 34銘柄		100.0%	5.7%
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%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 27銘柄		100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄		100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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7期中間計算期間(2022年 1月26日から2022年 7月25日まで)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る中間監査を受けております。

【DCりそな グローバルバランス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年 1月25日現在	第7期中間計算期間末 2022年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,554,316	9,100,692
親投資信託受益証券	967,291,158	1,189,472,334
未収入金	6,000,000	-
流動資産合計	979,845,474	1,198,573,026
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,496,673	6,236
未払受託者報酬	210,527	231,056
未払委託者報酬	2,947,319	3,234,700
未払利息	17	24
その他未払費用	40,962	35,145
流動負債合計	9,695,498	3,507,161
負債合計	9,695,498	3,507,161
純資産の部		
元本等		
元本	889,515,166	1,090,283,300
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	80,634,810	104,782,565
（分配準備積立金）	31,908,393	29,852,178
元本等合計	970,149,976	1,195,065,865
純資産合計	970,149,976	1,195,065,865
負債純資産合計	979,845,474	1,198,573,026

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日	第7期中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	26,236,709	9,631,176
営業収益合計	26,236,709	9,631,176
営業費用		
支払利息	2,336	3,496
受託者報酬	177,536	231,056
委託者報酬	2,485,429	3,234,700
その他費用	34,531	35,373
営業費用合計	2,699,832	3,504,625
営業利益又は営業損失（ ）	23,536,877	6,126,551
経常利益又は経常損失（ ）	23,536,877	6,126,551
中間純利益又は中間純損失（ ）	23,536,877	6,126,551
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,206,260	249,821
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	45,054,337	80,634,810
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,636,182	23,571,128
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,636,182	23,571,128
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,918,350	5,799,745
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,918,350	5,799,745
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	78,102,786	104,782,565

(3) 【中間注記表】

(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。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

第6期 2022年 1月25日現在	第7期中間計算期間末 2022年 7月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 695,424,256円	期首元本額 889,515,166円
期中追加設定元本額 331,098,576円	期中追加設定元本額 264,903,970円
期中一部解約元本額 137,007,666円	期中一部解約元本額 64,135,836円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 889,515,166口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,090,283,300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 1.0907円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0961円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,907円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,961円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第6期 2022年 1月25日現在	第7期中間計算期間末 2022年 7月25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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記) に記載しております。	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	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

<p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
<p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（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）

デリバティブ取引に関する注記

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」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式マザーファンド」、「RM先進国株式マザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内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、中間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 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	109,490
コール・ローン	982,442,713
国債証券	119,996,140,560
地方債証券	6,837,815,930
特殊債券	7,614,595,000
社債券	5,764,796,000
未収入金	997,234,800
未収利息	190,540,136
前払費用	18,556,840
流動資産合計	142,402,231,469
資産合計	142,402,231,469
負債の部	

2022年 7月25日現在

流動負債	
未払金	299,876,000
未払解約金	1,183,430,900
未払利息	2,664
流動負債合計	1,483,309,564
負債合計	1,483,309,564
純資産の部	
元本等	
元本	137,316,275,841
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,602,646,064
元本等合計	140,918,921,905
純資産合計	140,918,921,905
負債純資産合計	142,402,231,469

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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	118,230,260,033円
期中追加設定元本額	39,127,056,274円
期中一部解約元本額	20,041,040,466円
期末元本額	137,316,275,841円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,852,858,036円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	10,704,259,537円
りそなラップ型ファンド(成長型)	3,139,352,466円
DCりそな グローバルバランス	771,318,362円
つみたてバランスファンド	4,712,398,480円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,946,358,163円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,042,770,674円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	322,581,421円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	425,723,373円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	127,972,511円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	29,119,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	27,935,271円
FWりそな円建債券アクティブファンド	165,933,851円

FWりそな国内債券インデックスファンド	77,792,741,204円
Smart-i 国内債券インデックス	1,684,595,992円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,328,689,858円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,056,472,691円
Smart-i 8資産バランス 成長型	414,349,933円
りそなFT 国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	9,053,205,221円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	5,000,147,149円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	18,382,334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）	69,483,896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）	88,214,319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）	1,541,411,549円
2. 計算日における受益権の総数	137,316,275,841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	1.0262円
(10,000口当たり純資産額)	(10,262円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。	

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	63,840,692
コール・ローン	142,567,227
国債証券	47,397,570,356
派生商品評価勘定	1,029,789
未収入金	96,214,033
未収利息	269,928,555
前払費用	16,750,995
流動資産合計	47,987,901,647
資産合計	47,987,901,647
負債の部	
流動負債	
未払解約金	235,000,000
未払利息	386
流動負債合計	235,000,386
負債合計	235,000,386
純資産の部	
元本等	
元本	41,861,413,400
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,891,487,861
元本等合計	47,752,901,261
純資産合計	47,752,901,261
負債純資産合計	47,987,901,647

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>

5. その他財務諸表作成のための重要な事項	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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	43,461,502,818円
期中追加設定元本額	4,349,924,074円
期中一部解約元本額	5,950,013,492円
期末元本額	41,861,413,400円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,529,514,868円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	917,494,444円
りそなラップ型ファンド(成長型)	531,539,662円
DCりそな グローバルバランス	76,557,894円
つみたてバランスファンド	1,039,606,055円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	789,577,557円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	205,191,102円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	61,945,063円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	85,240,915円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	25,649,365円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,850,746円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,254,731円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	330,838,088円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	25,054,339円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	22,652,074円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	31,489,554,098円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	1,221,102,622円
Smart-i 8資産バランス 安定型	265,658,139円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	207,539,531円
Smart-i 8資産バランス 成長型	81,554,934円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	916,274,979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)	4,658,406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)	6,243,890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)	16,859,898円
2. 計算日における受益権の総数	41,861,413,400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	1.1407円

(10,000口当たり純資産額)

(11,407円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2022年 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	198,564,228	-	198,569,362	5,134
	米ドル	111,951,895	-	111,951,895	-
	カナダドル	5,932,584	-	5,933,253	669
	ユーロ	80,679,749	-	80,684,214	4,465

売建	119,473,956	-	118,449,301	1,024,655
米ドル	67,539,770	-	66,995,304	544,466
カナダドル	2,674,115	-	2,639,427	34,688
メキシコペソ	996,824	-	982,882	13,942
ユーロ	39,820,784	-	39,479,365	341,419
スウェーデンク ローナ	7,265,927	-	7,188,480	77,447
デンマーククロー ネ	322,335	-	317,900	4,435
ポーランドズロチ	532,767	-	528,211	4,556
イスラエルシケ ル	321,434	-	317,732	3,702
合計	318,038,184	-	317,018,663	1,029,789

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	115,970,290
コール・ローン	22,835,039
投資信託受益証券	8,836,286,002
未収入金	17,753,800
未収配当金	183,802,587
流動資産合計	9,176,647,718
資産合計	9,176,647,718
負債の部	
流動負債	
未払金	109,869,145

2022年 7月25日現在

未払解約金	45,340,000
未払利息	61
流動負債合計	155,209,206
負債合計	155,209,206
純資産の部	
元本等	
元本	8,250,061,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	771,377,233
元本等合計	9,021,438,512
純資産合計	9,021,438,512
負債純資産合計	9,176,647,718

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重要な事項	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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	6,592,999,606円
期中追加設定元本額	2,944,486,903円
期中一部解約元本額	1,287,425,230円
期末元本額	8,250,061,279円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	979,326,164円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	955,062,647円
りそなラップ型ファンド(成長型)	553,548,538円
DCりそな グローバルバランス	21,213,621円
つみたてバランスファンド	1,078,073,355円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	289,676,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	178,911,842円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	120,826,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	50,790,725円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	33,275,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,749,384円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	32,633,283円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	124,770,667円
九州SDGs・グローバルバランス	47,813,108円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	15,518,715円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	3,271,710,156円
Smart-i 8資産バランス 安定型	56,347,018円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	175,289,853円
Smart-i 8資産バランス 成長型	205,978,764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)	1,299,311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)	6,492,419円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	17,554,389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)	16,198,723円
2. 計算日における受益権の総数	8,250,061,279口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0935円
(10,000口当たり純資産額)	(10,935円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	378,702,380
株式	56,375,849,950
未収入金	1,133,030,200
未収配当金	97,747,819
差入委託証拠金	19,080,000
流動資産合計	58,004,410,349
資産合計	58,004,410,349
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,173,200
前受金	1,200,000
未払金	1,327,649,568
未払解約金	64,773,000
未払利息	1,027
流動負債合計	1,395,796,795
負債合計	1,395,796,795
純資産の部	
元本等	
元本	39,273,926,119
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,334,687,435
元本等合計	56,608,613,554
純資産合計	56,608,613,554
負債純資産合計	58,004,410,349

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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	47,369,957,599円
期中追加設定元本額	21,667,581,934円
期中一部解約元本額	29,763,613,414円
期末元本額	39,273,926,119円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,009,396,563円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,764,788,187円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,128,306,287円
DCりそな グローバルバランス	86,989,456円
つみたてバランスファンド	5,050,240,790円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	442,880,292円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	283,815,465円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	191,125,047円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	77,880,996円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	51,186,745円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	27,343,191円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	50,860,901円
FWりそな国内株式アクティブファンド	160,884,445円
FWりそな国内株式インデックスファンド	16,639,061,112円
Smart-i TOPIXインデックス	2,159,062,450円
Smart-i 8資産バランス 安定型	90,917,801円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	273,876,801円
Smart-i 8資産バランス 成長型	325,387,382円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	519,546,868円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	1,027,451,430円

りそなD A Aファンド（適格機関投資家専用）	171,345,372円
りそなF T R Cバランスファンド（適格機関投資家専用）	451,492,178円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	5,299,650円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	26,328,315円
りそなV Iグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	100,380,512円
りそなD A Aマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	60,372,114円
りそなD A Aファンド2 0 2 2 0 5（適格機関投資家専用）	97,705,769円
2. 計算日における受益権の総数	39,273,926,119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	1.4414円
(10,000口当たり純資産額)	(14,414円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。	

（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）

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2022年 7月25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	468,613,200	-	466,440,000	2,173,200
	合計	468,613,200	-	466,440,000	2,173,200

(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。

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	6,042,191,416
コール・ローン	264,721,345
株式	122,758,655,063
投資証券	3,155,888,793
派生商品評価勘定	280,976,547
未収入金	1,651,575,061
未収配当金	90,763,793
差入委託証拠金	2,998,657,284
流動資産合計	137,243,429,302
資産合計	137,243,429,302
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,255,908
未払金	29,210,186
未払解約金	525,784,900
未払利息	718
流動負債合計	573,251,712
負債合計	573,251,712
純資産の部	
元本等	
元本	65,729,431,517
剰余金	
剰余金又は欠損金()	70,940,746,073
元本等合計	136,670,177,590
純資産合計	136,670,177,590
負債純資産合計	137,243,429,302

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	61,552,790,809円
期中追加設定元本額	31,071,726,834円
期中一部解約元本額	26,895,086,126円
期末元本額	65,729,431,517円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,484,452,491円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,626,165,106円

りそなラップ型ファンド（成長型）	6,840,911,472円
DCりそな グローバルバランス	32,191,510円
つみたてバランスファンド	2,321,848,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,880,915,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,188,704,093円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	797,665,613円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	328,318,604円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	215,324,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	115,129,340円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	211,181,642円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	63,829,190円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	46,349,346円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	28,655,322,109円
Smart-i 先進国株式インデックス	10,487,315,585円
Smart-i 8資産バランス 安定型	392,337,544円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	1,153,799,468円
Smart-i 8資産バランス 成長型	1,365,785,494円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	56,338,101円
Smart-i Select 全世界株式インデックス（除く日本）	56,136,662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）	342,925,764円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	117,689,242円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	314,198,188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）	1,982,071円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	54,477,310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）	226,390,091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）	284,637,654円
りそなDAAファンド202205（適格機関投資家専用）	67,109,582円
2. 計算日における受益権の総数	65,729,431,517口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0793円
(10,000口当たり純資産額)	(20,793円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2022年 7月25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	10,977,371,115	-	11,249,524,094	272,152,979
	合計	10,977,371,115	-	11,249,524,094	272,152,979

（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 7月25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	為替予約取引				

の取引	買建	1,901,889,484	-	1,892,457,144	9,432,340
	米ドル	1,457,271,433	-	1,450,777,700	6,493,733
	カナダドル	75,619,004	-	74,957,053	661,951
	ユーロ	144,181,377	-	143,333,370	848,007
	英ポンド	78,949,780	-	78,462,341	487,439
	スイスフラン	55,389,136	-	55,259,100	130,036
	スウェーデンク ローナ	17,806,028	-	17,581,758	224,270
	ノルウェークロー ネ	3,863,664	-	3,838,436	25,228
	デンマーククロー ネ	12,611,946	-	12,529,000	82,946
	オーストラリアド ル	35,176,941	-	34,798,695	378,246
	香港ドル	13,121,175	-	13,056,075	65,100
	シンガポールドル	7,899,000	-	7,863,616	35,384
	合計	1,901,889,484	-	1,892,457,144	9,432,340

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,224,609,015
コール・ローン	31,795,332
株式	16,476,547,056
投資証券	17,806,517

2022年 7月25日現在

派生商品評価勘定	4,136,961
未収入金	87,817,302
未収配当金	109,103,146
差入委託証拠金	906,070,777
流動資産合計	18,857,886,106
資産合計	18,857,886,106
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,904,856
未払解約金	20,112,100
未払利息	86
流動負債合計	58,017,042
負債合計	58,017,042
純資産の部	
元本等	
元本	11,723,887,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,075,981,199
元本等合計	18,799,869,064
純資産合計	18,799,869,064
負債純資産合計	18,857,886,106

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重要な	外貨建取引等の処理基準

事項	外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
----	--

(貸借対照表に関する注記)

2022年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	11,528,471,845円
期中追加設定元本額	2,565,950,567円
期中一部解約元本額	2,370,534,547円
期末元本額	11,723,887,865円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	667,774,054円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,644,634,655円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,844,150,728円
DCりそな グローバルバランス	14,459,817円
つみたてバランスファンド	736,777,997円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	391,954,726円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	251,209,081円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	169,146,750円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	68,923,603円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	45,297,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	24,197,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	45,010,818円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	145,236,475円
九州SDGs・グローバルバランス	101,188,019円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	29,263,148円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,885,506,754円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,900,031,488円
Smart-i 8資産バランス 安定型	79,043,751円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	242,389,771円
Smart-i 8資産バランス 成長型	287,962,863円
Smart-i Select 全世界株式インデックス	9,781,543円
Smart-i Select 全世界株式インデックス(除く日本)	9,725,929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)	885,568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)	12,741,320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)	62,386,207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)	54,207,501円
2. 計算日における受益権の総数	11,723,887,865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	1.6036円
(10,000口当たり純資産額)	(16,036円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2022年 7月25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	2,334,850,258	-	2,301,794,679	33,055,579
	合計	2,334,850,258	-	2,301,794,679	33,055,579

(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 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	97,286,882	-	96,569,979	716,903
	米ドル	97,286,882	-	96,569,979	716,903
	売建	259,463	-	254,876	4,587
	チリペソ	121,850	-	117,797	4,053
	オフショア人民元	137,613	-	137,079	534
合計		97,546,345	-	96,824,855	712,316

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在

資産の部

流動資産

2022年 7月25日現在

コール・ローン	208,074,000
投資証券	29,932,680,150
派生商品評価勘定	1,911,500
未収入金	370,759,800
未収配当金	149,645,308
差入委託証拠金	20,495,500
流動資産合計	30,683,566,258
資産合計	30,683,566,258
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	543,090
前受金	851,100
未払金	372,706,600
未払解約金	274,000
未払利息	564
流動負債合計	374,375,354
負債合計	374,375,354
純資産の部	
元本等	
元本	20,399,310,082
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,909,880,822
元本等合計	30,309,190,904
純資産合計	30,309,190,904
負債純資産合計	30,683,566,258

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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	20,977,046,765円

期中追加設定元本額	8,759,444,696円
期中一部解約元本額	9,337,181,379円
期末元本額	20,399,310,082円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,102,461,193円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,174,977,499円
りそなラップ型ファンド(成長型)	998,329,958円
DCりそな グローバルバランス	23,892,680円
つみたてバランスファンド	1,632,484,323円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	216,351,716円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	133,618,304円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	90,417,509円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	37,941,241円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	24,856,909円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	13,257,442円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	24,375,467円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	92,208,086円
九州SDGs・グローバルバランス	44,099,078円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	78,011,558円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,150,604,347円
FWりそな国内リートインデックスファンド	4,354,645,839円
Smart-i Jリートインデックス	2,743,849,369円
Smart-i 8資産バランス 安定型	43,428,014円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	131,562,866円
Smart-i 8資産バランス 成長型	154,908,815円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,699,214,651円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	151,541,625円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,462,321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)	8,429,817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)	32,032,370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)	11,967,510円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	141,966,363円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	86,413,212円
2. 計算日における受益権の総数	20,399,310,082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	1.4858円
(10,000口当たり純資産額)	(14,858円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

（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）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2022年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	353,499,090	-	354,867,500	1,368,410
合計		353,499,090	-	354,867,500	1,368,410

（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。

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	152,683,893
コール・ローン	42,909,129
株式	275,723,464
投資証券	29,183,416,266
未収入金	458,882,861
未収配当金	72,313,810
流動資産合計	30,185,929,423
資産合計	30,185,929,423
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,361,211
未払金	536,398,670
未払解約金	42,402,000
未払利息	116
流動負債合計	581,161,997
負債合計	581,161,997
純資産の部	
元本等	
元本	19,526,755,514
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,078,011,912
元本等合計	29,604,767,426
純資産合計	29,604,767,426
負債純資産合計	30,185,929,423

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重要な事項	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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月26日
期首元本額	19,224,785,743円
期中追加設定元本額	9,556,877,828円
期中一部解約元本額	9,254,908,057円
期末元本額	19,526,755,514円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,108,148,523円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,279,007,188円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,438,161,880円
DCりそな グローバルバランス	24,014,799円
つみたてバランスファンド	790,435,821円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	426,210,048円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	270,919,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	182,420,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	74,340,245円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	48,858,788円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	26,100,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	48,546,059円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	178,909,575円
九州SDGs・グローバルバランス	86,429,535円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,774,486,831円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,501,124,735円
Smart-i 先進国リートインデックス	2,274,903,085円
Smart-i 8資産バランス 安定型	86,322,842円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	261,399,143円
Smart-i 8資産バランス 成長型	310,563,874円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	139,323,592円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,469,576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)	3,548,016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)	53,748,771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)	57,917,152円
りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	79,445,914円
2. 計算日における受益権の総数	19,526,755,514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	1,5161円
(10,000口当たり純資産額)	(15,161円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25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。

(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)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2022年 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	415,223,771	-	412,862,560	2,361,211
	米ドル	312,366,372	-	310,787,750	1,578,622
	カナダドル	5,862,983	-	5,806,564	56,419

	ユーロ	14,434,543	-	14,333,346	101,197
	英ポンド	26,331,936	-	26,154,224	177,712
	オーストラリアドル	33,255,495	-	32,917,395	338,100
	ニュージーランドドル	771,466	-	764,872	6,594
	香港ドル	6,298,164	-	6,266,916	31,248
	シンガポールドル	15,304,312	-	15,235,756	68,556
	イスラエルシケル	598,500	-	595,737	2,763
	合計	415,223,771	-	412,862,560	2,361,211

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 7月29日現在です。

【DCりそな グローバルバランス】

【純資産額計算書】

資産総額	1,214,783,946円
負債総額	716,561円
純資産総額（ - ）	1,214,067,385円
発行済口数	1,103,999,574口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0997円

（参考）

RM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	141,793,443,470円
負債総額	5,578,819円
純資産総額（ - ）	141,787,864,651円
発行済口数	137,844,994,360口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0286円

RM先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	47,975,118,594円
負債総額	52,111,173円
純資産総額（ - ）	47,923,007,421円
発行済口数	42,206,310,594口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1354円

RM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,160,854,326円
負債総額	47,714,541円
純資産総額（ - ）	9,113,139,785円
発行済口数	8,311,331,424口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0965円

R M国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	48,537,407,852円
負債総額	352,607,089円
純資産総額（ - ）	48,184,800,763円
発行済口数	33,477,325,106口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4393円

R M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	159,095,393,020円
負債総額	11,461,837,086円
純資産総額（ - ）	147,633,555,934円
発行済口数	70,236,622,222口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1019円

R M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	18,921,766,030円
負債総額	10,037,615円
純資産総額（ - ）	18,911,728,415円
発行済口数	11,838,451,676口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5975円

R M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,500,718,751円
負債総額	201,186,245円
純資産総額（ - ）	31,299,532,506円
発行済口数	20,780,703,909口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5062円

R M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	30,194,319,836円
負債総額	2,199,454円
純資産総額（ - ）	30,192,120,382円
発行済口数	19,484,159,910口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5496円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2022年7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

過去5年間における主な資本金の増減
該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構（2022年7月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

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

CHECK：検証 ACTION：改善

- ・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
- ・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	117	1,320,128
単体型株式投資信託	3	10,255
単体型公社債投資信託	2	3,146
合計	122	1,333,531

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- (2) 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期事業年度（自2021年4月1日至2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	4,261,664	7,480,501
前払費用	245,658	270,287
未収入金	8,551	247
未収委託者報酬	768,778	972,599
未収運用受託報酬	2,597,734	3,009,122
未収投資助言報酬	437,046	507,363
流動資産計	8,319,433	12,240,121
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 5,302	8,415
器具備品	1 18,218	15,450
有形固定資産計	23,520	23,866
無形固定資産		
ソフトウェア	8,588	3,919
ソフトウェア仮勘定	-	3,100
無形固定資産計	8,588	7,019
投資その他の資産		
投資有価証券	19,301	37,596
繰延税金資産	128,654	118,572
投資その他の資産計	147,956	156,168

固定資産計	180,065	187,054
資産合計	8,499,498	12,427,176

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	256,287	274,374
その他未払金	1,255,082	1,568,028
未払費用	99,584	105,943
未払法人税等	269,609	250,779
未払消費税等	352,528	276,917
預り金	1,387	2,465
賞与引当金	224,862	253,537
流動負債計	2,459,343	2,732,047
負債合計	2,459,343	2,732,047
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	4,548,350	8,203,810
利益剰余金計	4,548,350	8,203,810
株主資本計	6,038,350	9,693,810
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,804	1,318
評価・換算差額等計	1,804	1,318
純資産合計	6,040,155	9,695,129
負債・純資産合計	8,499,498	12,427,176

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,539,887	4,788,765
運用受託報酬	4,624,333	5,438,177
投資助言報酬	839,669	982,472
その他営業収益	261	-
営業収益計	9,004,153	11,209,415
営業費用		
支払手数料	1,166,440	1,460,131
広告宣伝費	37,315	49,322
調査費		

調査費		1,297,321	1,502,951
委託調査費		98,375	137,291
委託計算費		207,635	269,116
事務委託費		23,815	23,751
営業雑経費			
印刷費		75,269	95,519
協会費		9,101	12,887
販売促進費		3,264	2,277
その他		55,514	64,110
営業費用計		2,974,056	3,617,359
一般管理費			
給料			
役員報酬		110,648	127,995
給料・手当		1,104,231	1,260,284
賞与		143,217	169,303
賞与引当金繰入額		224,862	253,537
旅費交通費		4,372	6,944
租税公課		73,538	92,204
不動産賃借料		97,751	99,813
固定資産減価償却費		21,729	15,365
諸経費		256,552	270,995
一般管理費計		2,036,904	2,296,443
営業利益		3,993,191	5,295,612
営業外収益			
受取配当金		189	506
投資有価証券売却益		-	866
雑収入		1,694	3,244
営業外収益計		1,883	4,617
営業外費用			
投資有価証券売却損		277	-
為替差損		-	170
雑損失		273	1,455
営業外費用計		550	1,625
経常利益		3,994,525	5,298,604
税引前当期純利益		3,994,525	5,298,604
法人税、住民税及び事業税	1	1,281,563	1,632,846
法人税等調整額		57,337	10,297
法人税等計		1,224,226	1,643,143
当期純利益		2,770,298	3,655,460

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298

株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	3,655,460	3,655,460	3,655,460
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,655,460	3,655,460	3,655,460
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	8,203,810	8,203,810	9,693,810

	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
当期変動額			
当期純利益	-	-	3,655,460
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	486	486	486
当期変動額合計	486	486	3,654,974
当期末残高	1,318	1,318	9,695,129

（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．収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

当該業務より発生する委託者報酬は、信託期間にわたり収益として認識しております。

投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

当該業務より発生する運用受託報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

当該業務より発生する投資助言報酬は、契約期間にわたり収益として認識しております。

5．その他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、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首より、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）を適用する予定であります。

（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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。

（未適用の会計基準等）

「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 2021年6月17日）

（1）概要

「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）の2021年6月17日の改正は、2019年7月4日の公表時において、「投資信託の時価の算定」に関する検討には、関係者との協議等に一定の期間が必要と考えられるため、また、「貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資」の時価の注記についても、一定の検討を要するため、時価算定会計基準公表後、概ね1年をかけて検討を行うこととされていたものが、改正され、公表されたものです。

（2）適用日

2023年3月期の期首から適用します。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	1,346千円	2,073千円
器具備品	22,447千円	32,416千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
流動負債		
その他未払金	1,030,722千円	1,311,908千円

（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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
法人税、住民税及び事業税	1,029,080千円	1,311,417千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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。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。

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	19,301	19,301	-
資産計	19,301	19,301	-

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 （円）	1年超 5年以内 （円）	5年超 10年以内 （円）	10年超 （円）
預金	4,261,664	-	-	-
未収入金	8,551	-	-	-
未収委託者報酬	768,778	-	-	-
未収運用受託報酬	2,597,734	-	-	-
未収投資助言報酬	437,046	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満 期があるもの その他	-	12,169	-	-
合計	8,073,775	12,169	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	37,596	37,596	-
資産計	37,596	37,596	-

（注）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 （千円）	1年超 5年以内 （千円）	5年超 10年以内 （千円）	10年超 （千円）
預金	7,480,501	-	-	-
未収入金	247	-	-	-
未収委託者報酬	972,599	-	-	-
未収運用受託報酬	3,009,122	-	-	-
未収投資助言報酬	507,363	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満 期があるもの その他	-	19,725	2,959	-
合計	11,969,834	19,725	2,959	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「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）第26項の経過措置を適用した投資信託については注記を省略しております。当該投資信託の貸借対照表計上額は37,596千円であります。

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	15,870	13,100	2,770
	小計	15,870	13,100	2,770
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	3,430	3,600	169
	小計	3,430	3,600	169
合計		19,301	16,700	2,601

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	17,169	14,100	3,069
	小計	17,169	14,100	3,069

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	20,427	21,596	1,169
	小計	20,427	21,596	1,169
合計		37,596	35,696	1,900

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	1,723	-	277
合計	1,723	-	277

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	7,866	866	-
合計	7,866	866	-

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	68,830千円	77,607千円
未払事業所税	1,246千円	1,363千円
未払事業税	54,775千円	36,333千円
未確定債務	757千円	757千円
減価償却超過額	3,840千円	3,090千円
その他有価証券評価差額金	51千円	357千円
繰延税金資産小計	129,502千円	119,511千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	129,502千円	119,511千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	848千円	939千円
繰延税金負債合計	848千円	939千円
繰延税金資産の純額	128,654千円	118,572千円

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 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%

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	0.02%

住民税均等割	0.07%
その他	0.31%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.01%

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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。

2．収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の「4．収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3．当事業年度及び翌事業年度以降の収益の金額を理解するための情報

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）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,964,710

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 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)
	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1)	4,459,201	未収運用受託報酬	2,531,968

親会社 の子会社				-		投資助言 報酬 (注2)	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2) 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 2021年4月1日 至 2022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	50,552	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)	1,311,417	その他 未払金	1,311,908

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1) 投資助言 報酬(注2) 支払手数料 (注3)	5,202,291 762,418 922,420	未収運用 受託報酬 未収投資 助言報酬 未払 手数料	2,880,437 432,666 175,773

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 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2) 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,525円29銭	2,448円26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()	699円57銭	923円09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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()(千円)	2,770,298	3,655,460
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)	2,770,298	3,655,460
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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、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 (2022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(2022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 (2022年3月末現在)	事業の内容
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を用いることがあります。

(2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載するこ

とがあります。

- (3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
 - ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
 - 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
 - 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
 - ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年5月20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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年3月15日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCりそな グローバルバランスの2021年1月26日から2022年1月25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、DCりそな グローバルバランスの2022年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月6日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCりそな グローバルバランスの2022年1月26日から2022年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DCりそな グローバルバランスの2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年1月26日から2022年7月25日まで）の損益の状況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、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、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。

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な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、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。

- ・ 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、経営者に対して、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。

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。