

## 【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】	2021年11月16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】	リスクコントロール・オープン
【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】

- リスクコントロール・オープン（以下「ファンド」といいます。）  
・愛称として「みつぼしクルーズ」という名称を用いることがあります。

### （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】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.65%（税抜1.5%）が上限となっております。

### （６）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

2021年11月17日から2022年5月13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		不動産投信
	内外	その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

#### <商品分類の定義>

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

- (4)その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5)資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### 4. 独立した区分

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

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

###### (2)債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- 公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- 社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- 格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

###### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

###### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

###### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

##### 2. 決算頻度による属性区分

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

### 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 4. 投資形態による属性区分

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

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

### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

### ◆「保証契約」の表記について

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

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

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

### ◆「保証会社」の表記について

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

## 投資対象

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

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

## ファンドの特色

- 1** 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、信託財産の収益確保を目指します。
- 2** 基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。
- 3** 原則として、年4回の決算時に収益分配方針に基づいて分配を行います。
- 4** 以下の条件に該当した場合、ファンドは繰上償還\*します。このとき、ファンド設定時に締結するりそな銀行との保証契約の履行により「確保ライン」を下回ることなく繰上償還します。

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

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

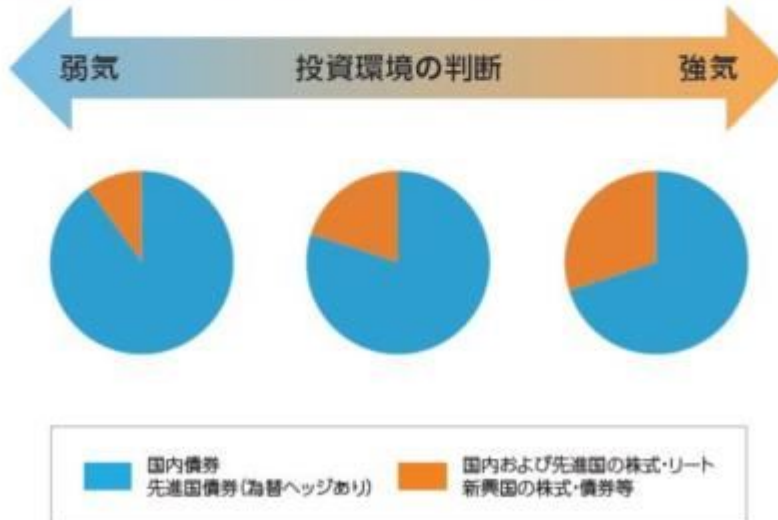


# 1 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、 信託財産の収益確保を目指します。

## Point

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

## 投資環境の判断と投資割合のイメージ



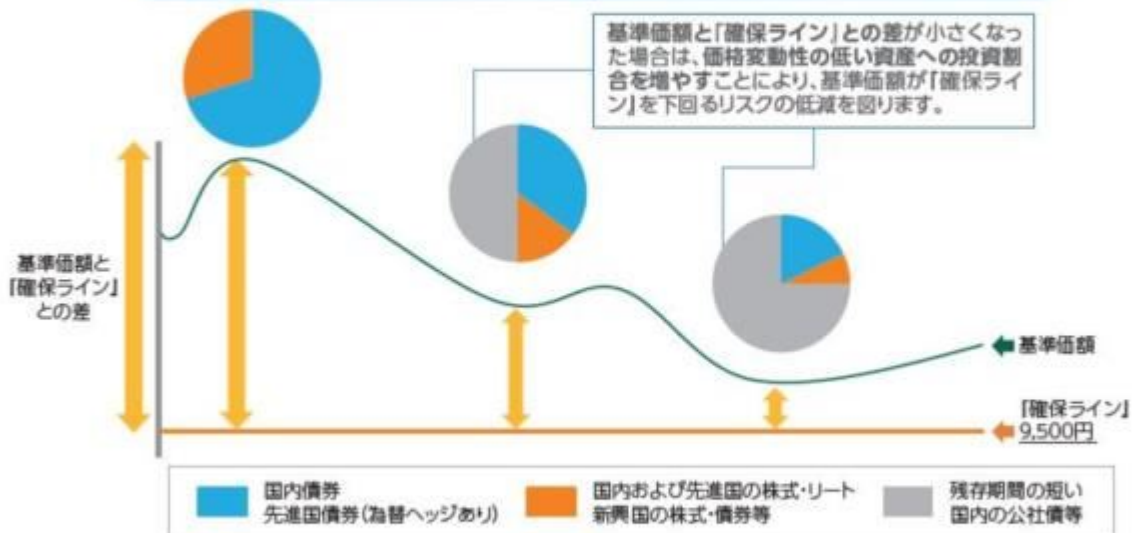
2

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

### Point

- 投資環境の悪化等により基準価額が『確保ライン』に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。
- 『確保ライン』は9,500円とし、信託期間を通じて変更は行いません。

### 「基準価額と『確保ライン』との差」と投資割合のイメージ



### ⚠️ ご注意ください

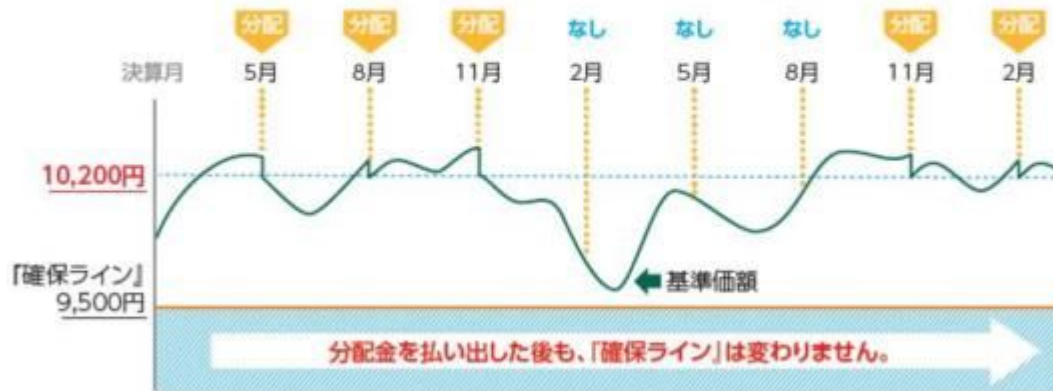
ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

### 3 原則として、年4回の決算時に収益分配方針に基づいて分配を行います。

#### Point

- ファンドの決算は毎年2月、5月、8月、11月の各月15日(休業日の場合は翌営業日)です。原則として、各決算日における収益分配前の基準価額\*1が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を用途として分配金額を決定します\*2。
- 分配金を払い出した後も、「確保ライン」は変わりません。

#### 収益分配と「確保ライン」のイメージ



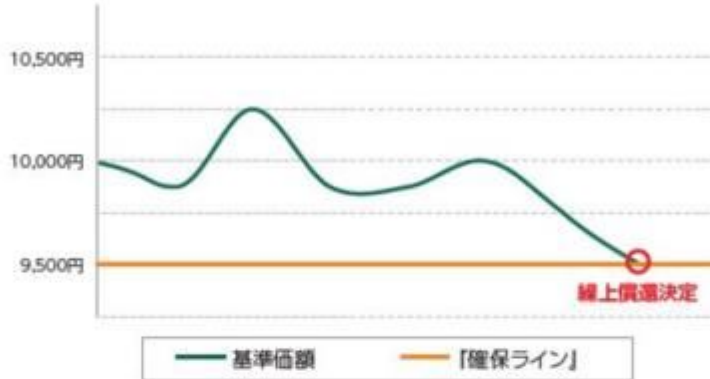
- \*1分配金額は各決算日の収益分配前の基準価額で決定されますので、それより前の基準価額水準は考慮されません。
- \*2決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額水準および市況動向により、委託会社の判断で、収益分配前の基準価額が10,200円を超過している額を必ずしも全額分配しない場合や、分配が行われない場合があります。
- \*投資者ごとに購入価額が異なるため、分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払い戻しに相当する場合があります。詳しくは後述の「収益分配金に関する留意事項」をご確認ください。

## 4

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

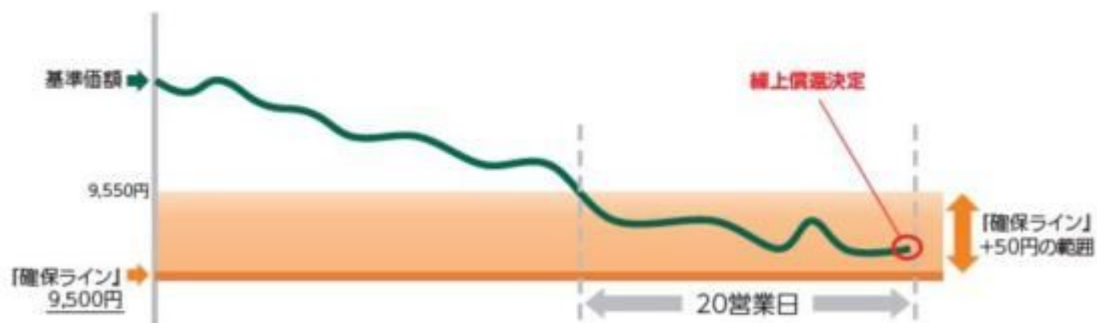
**条件①** 基準価額が「確保ライン」まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

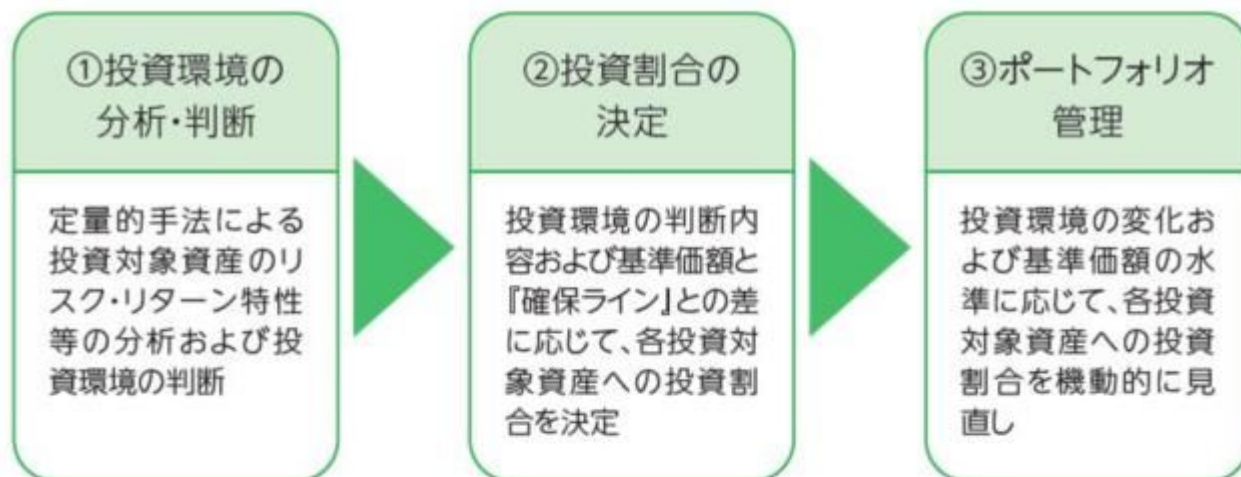


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

## 運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## 分配方針

原則、毎年2月、5月、8月、11月の15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、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、各決算日における収益分配前の基準価額が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を目的として分配金額を決定します。なお、決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額の動向等によっては実際の分配額がこれと異なる場合があります。
- ③分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ④留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 追加的記載事項

### 収益分配金に関する留意事項

●投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払されると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



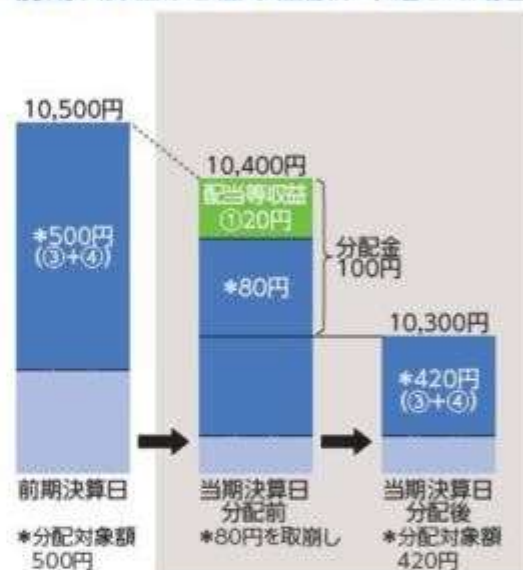
●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算日から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算日から基準価額が下落した場合

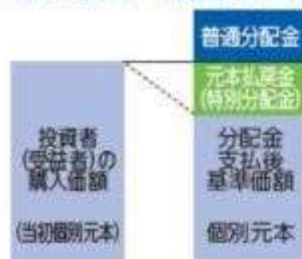


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益、②経費控除後の評価益を含む売買益、③分配準備積立金、④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

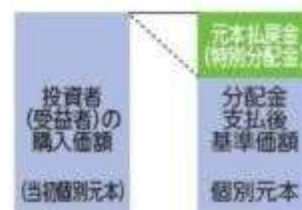
●投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合

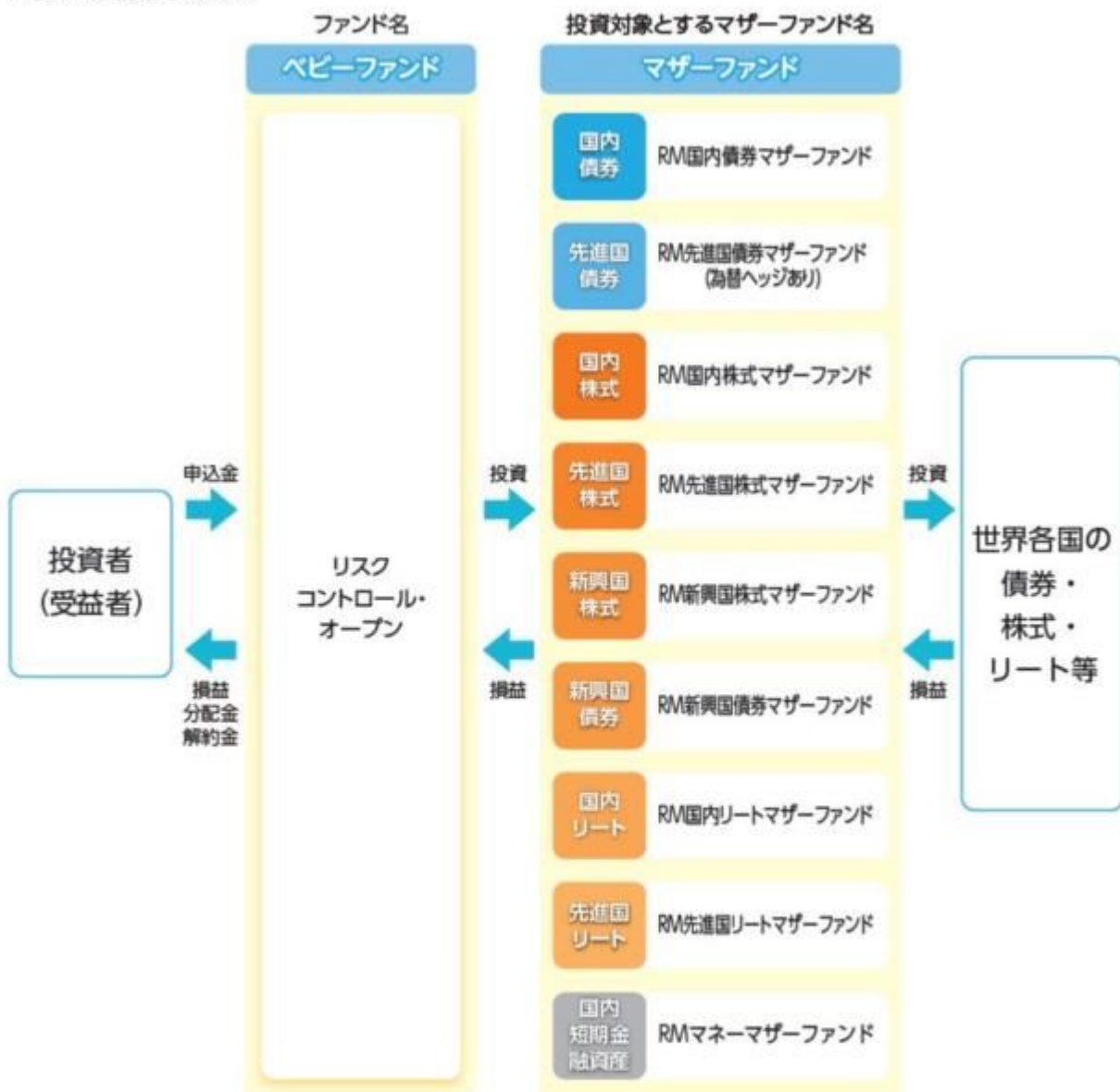


普通分配金：個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

## ファンドの仕組み

ファンドは各マザーファンドを通じて世界各国の債券、株式およびリートなど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。

## インデックスの著作権等について

### ●RM国内債券マザーファンド

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

### ●RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ●RM国内株式マザーファンド

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

### ●RM先進国株式マザーファンド

「MSCI-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新興国債券マザーファンド

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

### ●RM国内リートマザーファンド

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

### ●RM先進国リートマザーファンド

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

※RMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

### 信託金限度額

- ・500億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## (2)【ファンドの沿革】

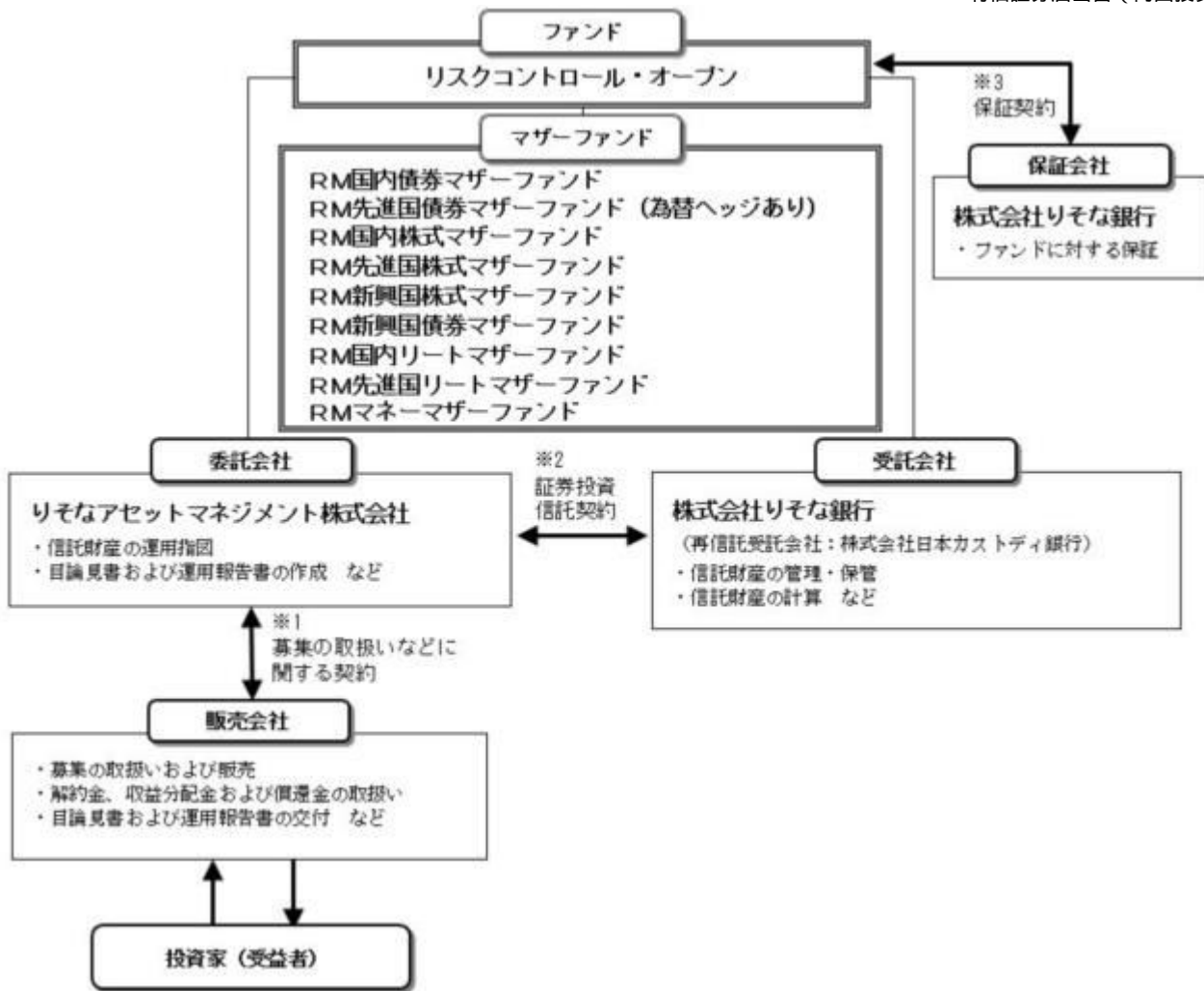
2020年3月31日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み





- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したもの。

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

委託会社の概況（2021年8月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

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

マザーファンド	実質的投資対象	インデックス
RM国内債券マザーファンド	国内債券	NOMURA - B P I 総合
RM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
RM国内株式マザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX、配当込み)
RM先進国株式マザーファンド	先進国株式	M S C I - K O K U S A I 指数(配当込み、円換算ベース)
RM新興国株式マザーファンド	新興国株式	M S C I エマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
RM新興国債券マザーファンド	新興国債券	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)
RM国内リートマザーファンド	国内リート	東証 R E I T 指数(配当込み)
RM先進国リートマザーファンド	先進国リート	S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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

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

『確保ライン』は9,500円とし、信託期間を通じて変更は行いません。

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

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものをいいます。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド >

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

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

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M国内株式マザーファンド &gt;

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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

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

主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li> <li>（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</li> <li>・先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行



## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

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

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

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

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

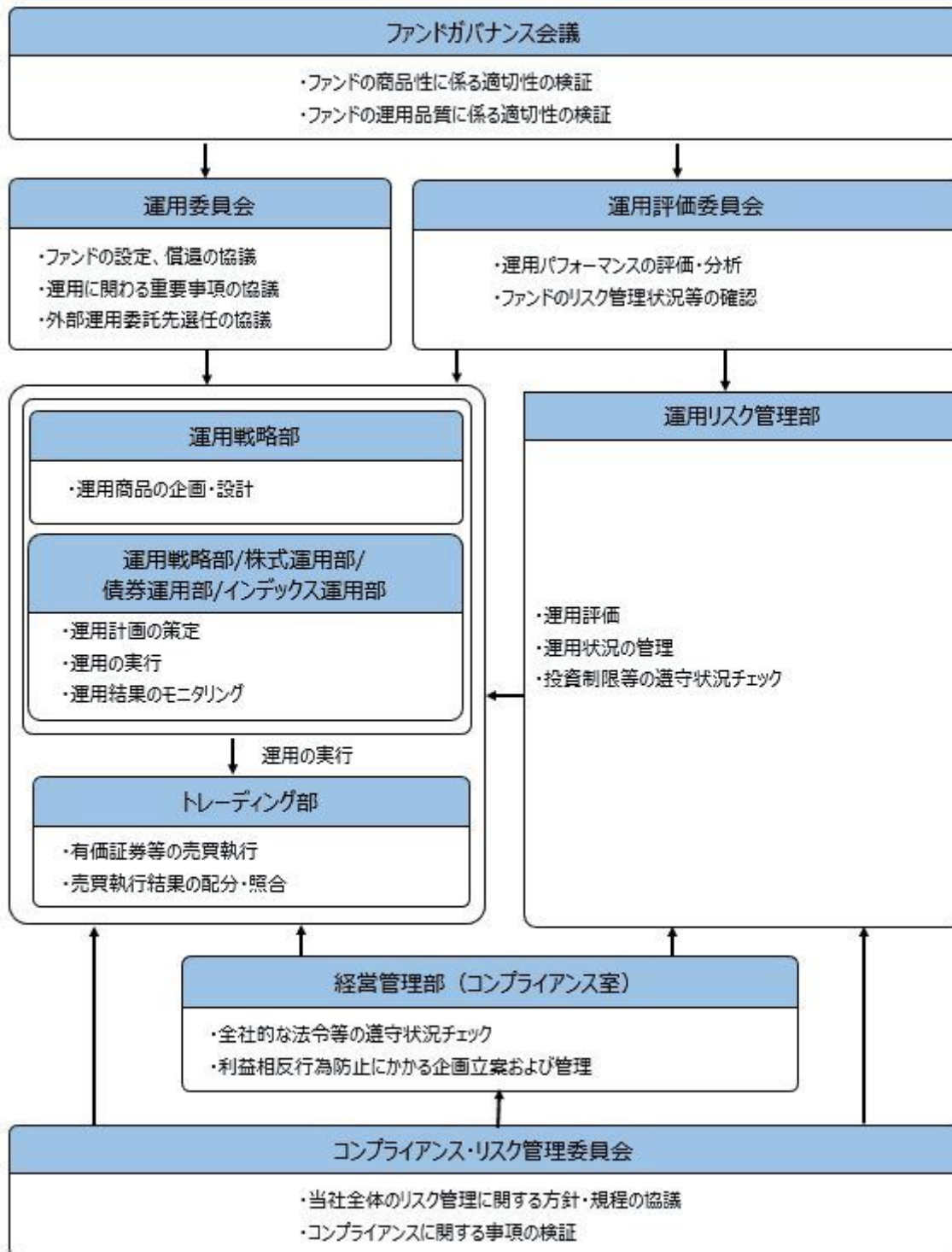
## &lt; RMマネーマザーファンド &gt;

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2021年8月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

#### （４）【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、各決算日における収益分配前の基準価額が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を目途として分配金額を決定します。なお、決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額の動向等によっては実際の分配額がこれと異なる場合があります。
- 3) 分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 4) 留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。  
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

##### 収益分配金の支払い

###### <分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>

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

###### <分配金受取りコース（一般コース）>

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

#### （５）【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

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



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け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

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

「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第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け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

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

### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

## 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

## 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

## 17) 資金の借入れ

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

## 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。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リス

クの一部低減を図ることとしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

#### 資産配分リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

#### （その他の留意点）

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

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

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

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

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

- ・信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき。
- ・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
- ・やむを得ない事情が発生したとき。

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

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

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準

を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

## (2) リスク管理体制

### 委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

運用評価委員会は、運用実績および主な投資制限等の遵守状況や運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。

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

上記体制は2021年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 【参考情報】

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2021年3月から2021年8月の各月末における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	6.3	42.1	59.8	62.7	6.2	11.4	19.3
最小値	5.2	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△11.4	△9.4
平均値	5.9	8.9	13.7	12.8	0.4	2.5	3.7

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2016年9月から2021年8月の5年間(当ファンドは2021年3月から2021年8月)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・・・東京株価指数(TOPIX, 配当込み)
  - 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)
  - 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)
  - 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
  - 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)
  - 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
- (注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## ○ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、信頼性、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利益について、何らの責任も負いません。

## 東京株価指数(TOPIX, 配当込み)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

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

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

## NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、著作権、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が開発・公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

- ・ 販売会社における申込手数料率は1.65%（税抜1.5%）が上限となっております。
- ・ 申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得

た額とします。

- ・ < 分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース） > の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。  
申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。1ヵ月に1度見直すものとし、前月末営業日における各マザーファンド（RMマネーマザーファンドを除きます。）の時価総額のうち当ファンドが保有する部分の合計が、純資産総額に占める割合（以下「リスク性資産割合」といいます。）に応じ、以下の表に掲げる率を毎月初第5営業日より適用するものとします。

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

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。

リスク性資産割合	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
	委託会社	販売会社	受託会社
50%以上	0.55%	0.55%	0.03%
25%以上50%未満	0.24%	0.24%	0.03%
25%未満	0.12%	0.12%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。



## 保証料

保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.25%を乗じて得た額とします。

信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。

上記の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.493%（税込）となります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

## （４）【その他の手数料等】

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末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

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

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

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

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金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）<sup>\*</sup>については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

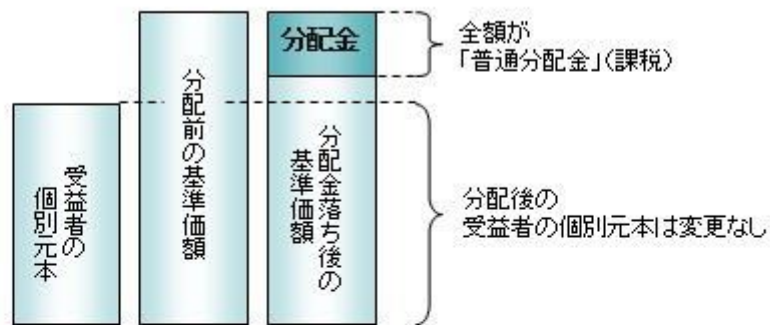
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

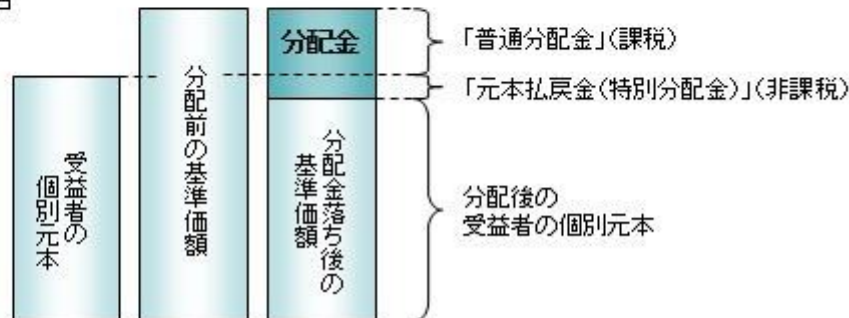
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2021年8月末現在のもので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【リスクコントロール・オープン】

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	590,222,184	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		467,448	0.08
合計(純資産総額)		590,689,632	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	340,776,517	1.0571	360,250,112	1.0567	360,098,545	60.96
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	46,496,190	1.9276	89,626,056	1.9516	90,741,964	15.36
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	85,356,315	1.0562	90,160,462	1.0556	90,102,126	15.25
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	8,755,422	1.6295	14,266,961	1.6416	14,372,900	2.43
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	9,857,598	1.3941	13,742,478	1.4208	14,005,675	2.37
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	10,194,984	1.3462	13,725,457	1.3638	13,903,919	2.35
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	2,271,304	1.5355	3,487,588	1.5471	3,513,934	0.59
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	3,156,145	1.0951	3,456,295	1.1036	3,483,121	0.59

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

### 【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特定期間末 (2020年 8月17日)	329	330	1.0202	1.0222
第2特定期間末 (2021年 2月15日)	402	411	1.0190	1.0405
第3特定期間末 (2021年 8月16日)	586	603	1.0202	1.0492
2020年 8月末日	338		1.0223	
9月末日	344		1.0206	
10月末日	358		1.0137	
11月末日	360		1.0255	
12月末日	382		1.0311	
2021年 1月末日	380		1.0325	
2月末日	398		1.0017	
3月末日	475		1.0171	

4月末日	497		1.0256
5月末日	546		1.0287
6月末日	579		1.0365
7月末日	595		1.0471
8月末日	590		1.0221

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	0.0020
第2特定期間	2020年 8月18日～2021年 2月15日	0.0325
第3特定期間	2021年 2月16日～2021年 8月16日	0.0295

#### 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	2.22
第2特定期間	2020年 8月18日～2021年 2月15日	3.07
第3特定期間	2021年 2月16日～2021年 8月16日	3.01

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	333,507,277	10,494,560
第2特定期間	2020年 8月18日～2021年 2月15日	100,025,572	28,037,005
第3特定期間	2021年 2月16日～2021年 8月16日	200,700,872	20,950,168

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

#### （参考）

#### R M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	93,745,851,930	83.51
地方債証券	日本	5,643,155,375	5.03
特殊債券	日本	6,674,789,450	5.95
社債券	日本	4,348,374,000	3.87
	フランス	200,462,000	0.18
	オーストラリア	100,071,000	0.09
	小計	4,648,907,000	4.14
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,537,666,510	1.37
合計（純資産総額）		112,250,370,265	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	1,680,000,000	100.71	1,691,999,800	100.60	1,690,080,000	0.100	2024/3/20	1.51
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	1,590,000,000	100.75	1,601,994,600	100.66	1,600,494,000	0.100	2024/6/20	1.43
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	1,280,000,000	100.38	1,284,966,400	100.23	1,283,033,600	0.100	2022/9/20	1.14
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	1,240,000,000	100.64	1,248,023,600	100.54	1,246,720,800	0.100	2023/12/20	1.11
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,180,000,000	100.98	1,191,672,200	100.87	1,190,360,400	0.100	2025/6/20	1.06
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	1,180,000,000	100.55	1,186,503,400	100.41	1,184,885,200	0.100	2023/6/20	1.06
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,150,000,000	101.21	1,163,999,800	101.22	1,164,122,000	0.100	2027/3/20	1.04
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	1,150,000,000	100.97	1,161,163,200	100.99	1,161,431,000	0.100	2025/12/20	1.03
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	1,070,000,000	100.59	1,076,368,200	100.48	1,075,168,100	0.100	2023/9/20	0.96
日本	国債証券	第423回利付国債(2年)	1,070,000,000	100.24	1,072,608,200	100.22	1,072,450,300	0.005	2023/4/1	0.96
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	1,050,000,000	100.84	1,058,880,800	100.76	1,058,001,000	0.100	2024/12/20	0.94
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,020,000,000	101.08	1,031,112,000	101.41	1,034,453,400	0.100	2029/9/20	0.92
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,020,000,000	101.00	1,030,225,300	100.93	1,029,547,200	0.100	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	1,010,000,000	100.93	1,019,456,400	100.81	1,018,271,900	0.100	2025/3/20	0.91
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	100.49	1,004,940,000	100.36	1,003,640,000	0.100	2023/3/20	0.89
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	990,000,000	100.77	997,680,600	101.28	1,002,681,900	0.100	2030/6/20	0.89
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	980,000,000	100.14	981,444,900	101.02	990,035,200	0.100	2030/12/20	0.88
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	970,000,000	101.17	981,389,200	101.17	981,378,100	0.100	2026/12/20	0.87

日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	960,000,000	101.16	971,222,100	101.47	974,121,600	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	960,000,000	101.16	971,181,100	101.11	970,732,800	0.100	2026/9/20	0.86
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	950,000,000	101.15	960,977,400	101.36	962,958,000	0.100	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	934,000,000	102.47	957,153,860	102.15	954,155,720	0.400	2025/9/20	0.85
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	930,000,000	101.28	941,954,000	101.38	942,880,500	0.100	2028/3/20	0.84
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	930,000,000	100.42	933,919,400	100.90	938,425,800	0.100	2031/3/20	0.84
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	830,000,000	101.24	840,355,900	101.45	842,084,800	0.100	2028/9/20	0.75
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	830,000,000	100.44	833,710,100	100.29	832,481,700	0.100	2022/12/20	0.74
日本	国債証券	第420回利付国債（2年）	820,000,000	100.38	823,138,000	100.32	822,624,000	0.100	2023/1/1	0.73
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	810,000,000	101.18	819,625,600	101.34	820,862,100	0.100	2027/9/20	0.73
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	790,000,000	100.49	793,938,100	100.59	794,692,600	0.005	2026/3/20	0.71
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	780,000,000	101.14	788,965,400	101.08	788,470,800	0.100	2026/6/20	0.70

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.51
地方債証券	5.03
特殊債券	5.95
社債券	4.14
合計	98.63

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	123,802,817,298	44.68
	カナダ	5,503,970,396	1.99

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

## その他の資産の投資状況

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,170,000	10,646.14	2,147,326,483	10,823.43	2,183,086,286	0.750	2028/1/31	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,650,000	10,466.95	1,638,077,778	10,426.33	1,631,721,081	0.625	2030/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,850,000	11,271.00	1,561,034,184	11,354.04	1,572,535,060	1.625	2031/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,450,000	10,977.79	1,476,512,974	10,979.48	1,476,740,257	0.125	2023/7/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,280,000	10,983.75	1,238,968,039	10,989.14	1,239,575,057	0.125	2023/2/28	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,910,000	11,648.11	1,154,328,359	12,198.04	1,208,825,819	2.375	2051/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	10,982.43	1,197,085,215	10,986.56	1,197,535,653	0.125	2023/3/31	0.43



アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,580,000	10,992.91	1,163,050,132	11,002.44	1,164,059,154	0.375	2024/4/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,450,000	10,581.40	1,105,756,701	10,641.84	1,112,072,290	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,890,000	10,567.71	1,045,146,673	10,866.36	1,074,683,251	1.125	2031/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	10,829.30	1,061,271,673	10,892.11	1,067,427,737	0.500	2026/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,586.91	1,071,395,827	10,456.38	1,058,186,045	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,518.91	1,050,337,031	12,339.27	1,035,265,563	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,190,000	10,867.56	998,729,033	11,155.27	1,025,170,104	1.250	2028/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,230,000	10,987.60	1,014,155,612	10,991.93	1,014,555,226	0.125	2022/12/31	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	24,162.59	1,034,159,098	23,136.66	990,249,145	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,890,000	10,995.75	977,522,854	10,988.28	976,858,293	0.375	2024/7/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,417.56	970,493,388	11,361.12	965,695,778	1.500	2024/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	10,990.00	962,724,825	10,997.41	963,373,839	0.125	2022/8/31	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,110,000	15,913.63	972,323,360	15,601.44	953,248,449	2.750	2027/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	10,077.77	866,688,330	10,909.29	938,199,081	1.875	2051/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,360,000	10,714.76	895,754,017	11,119.64	929,602,474	1.875	2041/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	10,946.60	919,515,139	10,995.36	923,610,687	0.750	2026/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	10,928.41	907,058,466	10,956.51	909,390,709	0.250	2024/6/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	10,083.49	877,264,318	10,218.98	889,051,456	1.375	2040/11/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,140,000	22,234.47	920,507,375	21,454.53	888,217,910	5.750	2032/10/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,310,000	14,083.82	888,689,339	14,042.05	886,053,675	0.750	2028/11/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	10,911.66	869,659,349	11,007.17	877,271,598	0.750	2026/3/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,110,000	10,667.31	865,118,977	10,654.71	864,097,644	0.375	2027/7/31	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,330,000	16,545.63	881,882,317	16,133.63	859,922,508	2.500	2030/5/25	0.31

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.58
合計	98.58

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	売建	1,133,559,000.00	124,404,710,454	124,528,937,638	44.94
	カナダドル	売建	63,344,000.00	5,508,307,607	5,517,680,470	1.99
	メキシコペソ	売建	364,917,000.00	1,971,862,132	1,980,769,476	0.71
	ユーロ	売建	862,865,000.00	111,890,530,473	111,936,801,568	40.40
	英ポンド	売建	115,954,000.00	17,531,694,163	17,535,120,459	6.33
	スウェーデンクローナ	売建	63,792,000.00	811,240,680	812,710,080	0.29
	ノルウェークローネ	売建	53,113,000.00	670,039,615	672,410,580	0.24
	デンマーククローネ	売建	78,425,000.00	1,367,598,677	1,367,865,322	0.49

ポーランドズロチ	売建	56,278,000.00	1,593,191,348	1,599,972,284	0.58
オーストラリアドル	売建	65,462,000.00	5,252,475,457	5,247,951,069	1.89
シンガポールドル	売建	14,936,000.00	1,217,042,036	1,220,641,612	0.44
マレーシアリングット	売建	48,310,000.00	1,252,519,357	1,277,389,269	0.46
イスラエルシュケル	売建	37,846,000.00	1,291,661,272	1,293,292,435	0.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	61,767,482,100	99.34
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		409,461,749	0.66
合計(純資産総額)		62,176,943,849	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	510,770,000	0.82

(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	232,800	8,144.01	1,895,925,796	9,592.00	2,233,017,600	3.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	144,000	10,680.70	1,538,021,138	11,360.00	1,635,840,000	2.63
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,600	56,266.59	1,271,625,108	66,130.00	1,494,538,000	2.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	178,900	8,653.68	1,548,144,717	6,181.00	1,105,780,900	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	157,300	4,994.86	785,692,807	6,500.00	1,022,450,000	1.64
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,550,600	525.48	814,816,851	594.40	921,676,640	1.48
日本	株式	ダイキン工業	機械	29,300	22,868.28	670,040,743	27,405.00	802,966,500	1.29
日本	株式	HOYA	精密機器	44,800	13,755.62	616,251,958	17,780.00	796,544,000	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	263,800	2,779.88	733,334,254	2,936.00	774,516,800	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	41,600	18,954.08	788,489,728	18,205.00	757,328,000	1.22

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	191,200	3,736.58	714,434,642	3,679.00	703,424,800	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	13,200	62,334.00	822,808,814	52,900.00	698,280,000	1.12
日本	株式	日本電産	電気機器	55,300	13,833.75	765,006,587	12,620.00	697,886,000	1.12
日本	株式	日立製作所	電気機器	110,500	4,902.88	541,768,861	6,085.00	672,392,500	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	13,500	44,530.81	601,166,022	47,240.00	637,740,000	1.03
日本	株式	村田製作所	電気機器	67,500	9,877.84	666,754,294	9,119.00	615,532,500	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	180,800	3,317.63	599,829,093	3,370.00	609,296,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	180,900	3,022.89	546,841,146	3,342.00	604,567,800	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	156,900	3,540.43	555,494,855	3,801.00	596,376,900	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	158,300	3,211.64	508,403,191	3,311.00	524,131,300	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	20,200	26,663.73	538,607,346	23,990.00	484,598,000	0.78
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	308,000	1,475.70	454,516,674	1,543.00	475,244,000	0.76
日本	株式	S M C	機械	6,700	66,677.73	446,740,850	70,510.00	472,417,000	0.76
日本	株式	第一三共	医薬品	180,600	3,235.52	584,336,149	2,614.50	472,178,700	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	137,800	2,855.73	393,520,845	3,311.00	456,255,800	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	180,600	2,176.12	393,007,628	2,429.00	438,677,400	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	88,500	4,264.05	377,368,542	4,815.00	426,127,500	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	20,700	17,054.16	353,021,186	20,300.00	420,210,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	74,700	5,346.40	399,376,174	5,377.00	401,661,900	0.65
日本	株式	デンソー	輸送用機器	50,600	6,516.74	329,747,488	7,710.00	390,126,000	0.63

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.27
		食料品	3.42
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.07
		医薬品	5.21
		石油・石炭製品	0.39
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.62
		機械	5.59
		電気機器	18.25
輸送用機器	7.71		

	精密機器	2.98
	その他製品	2.20
	電気・ガス業	1.17
	陸運業	3.19
	海運業	0.52
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.37
	卸売業	4.81
	小売業	4.40
	銀行業	4.88
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.91
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.95
	サービス業	5.91
合 計		99.34

## 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	26	日本円	504,004,300	510,770,000	0.82

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

## R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	69,010,640,426	61.05
	カナダ	3,525,664,476	3.12
	パナマ	37,099,842	0.03
	ドイツ	2,885,575,790	2.55
	イタリア	570,557,914	0.50
	フランス	3,254,667,273	2.88

	オランダ	2,118,891,324	1.87
	スペイン	753,532,155	0.67
	ベルギー	260,572,950	0.23
	オーストリア	66,007,487	0.06
	ルクセンブルク	101,462,706	0.09
	フィンランド	413,832,859	0.37
	アイルランド	1,923,450,262	1.70
	ポルトガル	50,130,283	0.04
	イギリス	4,166,976,102	3.69
	スイス	3,440,110,211	3.04
	スウェーデン	1,127,433,293	1.00
	ノルウェー	197,759,692	0.17
	デンマーク	873,236,333	0.77
	ケイマン	173,268,980	0.15
	リベリア	31,462,990	0.03
	オーストラリア	1,966,828,176	1.74
	バミューダ	223,390,219	0.20
	ニュージーランド	110,807,215	0.10
	パプアニューギニア	9,865,748	0.01
	香港	718,122,699	0.64
	シンガポール	275,043,665	0.24
	イスラエル	184,887,974	0.16
	キュラソー	71,293,770	0.06
	ジャージー	390,545,431	0.35
	マン島	30,904,068	0.03
	小計	98,964,022,313	87.55
投資証券	アメリカ	1,997,383,970	1.77
	カナダ	8,074,630	0.01
	フランス	46,750,573	0.04
	イギリス	54,359,158	0.05
	オーストラリア	137,707,144	0.12
	香港	39,288,801	0.03
	シンガポール	41,595,465	0.04
	小計	2,325,159,741	2.06
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,746,544,058	10.39
合計(純資産総額)		113,035,726,112	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,349,606,224	8.27
	買建	ドイツ	2,359,223,198	2.09

(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		560,784,210	0.50

(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	274,583	15,350.04	4,214,861,720	16,827.88	4,620,651,971	4.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	117,207	25,719.66	3,014,524,829	33,364.54	3,910,557,757	3.46
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	7,004	367,765.97	2,575,832,906	376,030.54	2,633,717,923	2.33
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	39,442	31,522.53	1,243,311,699	41,834.53	1,650,037,690	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,933	219,453.70	1,082,565,117	317,809.91	1,567,756,330	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,835	221,276.98	1,069,874,239	319,741.96	1,545,952,381	1.37
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	12,627	89,025.90	1,124,130,051	80,327.00	1,014,289,143	0.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	40,620	16,084.98	653,372,268	24,934.11	1,012,823,629	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	50,058	15,122.69	757,011,762	17,632.35	882,640,477	0.78
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	43,153	18,091.54	780,704,643	19,085.23	823,585,103	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	15,604	39,366.78	614,279,291	45,971.17	717,334,137	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	22,554	26,531.55	598,392,644	31,394.03	708,061,043	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	27,845	22,875.63	636,972,028	25,412.17	707,602,069	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	47,407	12,373.48	586,589,754	14,025.90	664,925,936	0.59
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	6,910	62,643.53	432,866,842	92,028.02	635,913,646	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	17,689	31,915.44	564,552,395	35,948.29	635,889,302	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	40,358	14,416.38	581,816,273	15,708.00	633,943,746	0.56
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	29,933	19,079.07	571,093,949	19,779.80	592,068,813	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	127,733	3,621.10	462,534,335	4,578.43	584,817,110	0.52

アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	18,289	28,398.16	519,374,063	31,702.85	579,813,479	0.51
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	7,875	54,066.47	425,773,470	73,192.30	576,389,370	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	14,571	36,954.56	538,464,935	38,800.19	565,357,641	0.50
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	11,592	38,723.01	448,877,198	43,859.42	508,418,397	0.45
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	75,524	5,522.18	417,057,608	6,562.12	495,598,231	0.44
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	91,947	4,081.34	375,267,848	5,138.92	472,508,645	0.42
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	16,008	25,051.58	401,025,741	29,120.20	466,156,210	0.41
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	7,330	61,382.64	449,934,759	62,223.18	456,095,924	0.40
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	69,587	5,083.77	353,764,614	6,498.38	452,203,256	0.40
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	69,779	5,448.68	380,203,762	6,062.08	423,006,159	0.37
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	67,469	5,451.40	367,801,154	6,174.18	416,565,885	0.37

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	2.65
		素材	3.83
		資本財	5.75
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.75
		消費者サービス	1.60
		メディア・娯楽	6.90
		小売	4.96
		食品・生活必需品小売り	1.27
		食品・飲料・タバコ	3.37
		家庭用品・パーソナル用品	1.52
		ヘルスケア機器・サービス	4.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.96
		銀行	5.30
各種金融	4.27		
保険	2.70		

	不動産	0.37
	ソフトウェア・サービス	11.28
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.50
	電気通信サービス	1.45
	公益事業	2.60
	半導体・半導体製造装置	4.29
投資証券		2.06
合計		89.61

## 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	SP500MIN2109	買建	376	米ドル	81,843,917.5	8,994,646,544	85,073,760	9,349,606,224	8.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002109	買建	770	ユーロ	17,684,770	2,293,537,825	18,191,250	2,359,223,198	2.09

(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	3,894,000.00	427,558,781	427,941,500	0.38
	カナダドル	買建	194,000.00	16,839,257	16,906,680	0.01
	ユーロ	買建	450,000.00	58,243,936	58,361,287	0.05
	英ポンド	買建	162,000.00	24,413,559	24,505,429	0.02
	スイスフラン	買建	113,000.00	13,600,233	13,548,975	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	423,000.00	5,366,860	5,389,020	0.00
	デンマーククローネ	買建	192,000.00	3,344,352	3,348,480	0.00
	オーストラリアドル	買建	97,000.00	7,749,249	7,777,409	0.01
	香港ドル	買建	213,000.00	3,000,957	3,005,430	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況



資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）	
株式	アメリカ	52,489,218	0.31	
	アルゼンチン	1,085,812	0.01	
	メキシコ	264,122,554	1.55	
	ブラジル	694,557,521	4.09	
	チリ	63,725,449	0.38	
	コロンビア	22,535,728	0.13	
	ペルー	2,666,921	0.02	
	オランダ	44,687,529	0.26	
	ルクセンブルク	39,807,812	0.23	
	ギリシャ	25,588,207	0.15	
	トルコ	39,259,188	0.23	
	チェコ	17,372,348	0.10	
	キプロス	21,986,750	0.13	
	ハンガリー	34,988,109	0.21	
	ポーランド	95,291,908	0.56	
	ロシア	407,647,668	2.40	
	ケイマン	2,878,319,760	16.94	
	バミューダ	84,127,212	0.50	
	香港	160,532,290	0.94	
	シンガポール	2,881,615	0.02	
	マレーシア	188,480,393	1.11	
	タイ	237,515,503	1.40	
	フィリピン	87,446,908	0.51	
	インドネシア	171,640,010	1.01	
	韓国	1,768,559,979	10.41	
	台湾	1,991,171,709	11.72	
	中国	1,511,241,347	8.89	
	インド	1,609,387,309	9.47	
	カタール	97,048,330	0.57	
	エジプト	8,926,130	0.05	
	南アフリカ	419,795,243	2.47	
	ジャージー	11,483,056	0.07	
	英ヴァージン諸島	3,612,747	0.02	
	アラブ首長国連邦	106,635,796	0.63	
	マン島	4,720,698	0.03	
	クウェート	80,599,944	0.47	
	サウジアラビア	436,819,014	2.57	
	小計		13,688,757,715	80.56
	投資証券	メキシコ	5,545,756	0.03
		南アフリカ	5,510,491	0.03
小計			11,056,247	0.07

コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,293,170,895	19.38
合計(純資産総額)		16,992,984,857	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,285,204,433	19.33

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		61,763,069	0.36

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	382,700	2,537.86	971,241,285	2,393.98	916,178,059	5.39
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	89,500	9,482.34	848,669,858	6,572.43	588,233,201	3.46
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	235,440	3,441.92	810,367,989	2,232.20	525,549,639	3.09
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	74,262	8,089.62	600,751,931	7,042.24	522,970,827	3.08
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	56,100	5,159.76	289,462,566	3,222.72	180,794,816	1.06
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	44,465	3,099.25	137,808,582	3,428.07	152,429,466	0.90
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	53,107	2,062.97	109,558,429	2,564.05	136,169,295	0.80
ブラジル	株式	VALE SA	素材	61,700	2,064.98	127,409,591	2,120.32	130,824,338	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,495,000	84.86	126,879,510	78.73	117,707,031	0.69
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	13,420	10,111.91	135,701,837	8,428.23	113,106,860	0.67
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	26,702	3,898.09	104,086,944	4,161.10	111,109,879	0.65
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	52,500	1,713.24	89,945,146	1,690.37	88,744,845	0.52
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	98,500	1,319.36	129,957,733	886.10	87,281,638	0.51
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	79,821	836.05	66,735,040	1,077.61	86,016,028	0.51
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	23,500	3,579.47	84,117,712	3,608.78	84,806,424	0.50

韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12,856	7,250.82	93,216,582	6,579.67	84,588,366	0.50
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,800	476.14	92,753,643	431.31	84,019,772	0.49
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	20,100	6,475.03	130,148,140	4,154.22	83,499,822	0.49
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	8,517	12,060.66	102,720,657	9,770.40	83,214,497	0.49
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	92,693	662.52	61,411,790	887.77	82,290,268	0.48
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	41,932	1,610.15	67,516,861	1,937.53	81,244,801	0.48
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	14,446	4,967.06	71,754,155	5,588.96	80,738,160	0.48
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	223,400	415.81	92,893,497	350.63	78,331,524	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,928	33,491.68	64,571,973	40,403.20	77,897,370	0.46
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	6,800	17,370.12	118,116,842	10,438.30	70,980,454	0.42
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,150	26,749.83	111,011,802	16,834.48	69,863,100	0.41
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	4,858	9,757.67	47,402,781	14,301.60	69,477,173	0.41
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	19,204	2,299.20	44,153,930	3,539.60	67,974,670	0.40
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	6,310	12,768.90	80,571,805	9,849.23	62,148,692	0.37
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	862	73,669.03	63,502,711	72,027.19	62,087,446	0.37

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2109	買建	467	米ドル	30,779,830	3,382,703,331	29,892,670	3,285,204,433	19.33

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	562,000.00	61,819,550	61,763,069	0.36

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

### R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,975,044,476	30.39
	アイルランド	4,512,287,226	69.43
	小計	6,487,331,702	99.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,746,573	0.18
合計(純資産総額)		6,499,078,275	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	746,647	6,322.54	4,720,710,750	6,043.40	4,512,287,226	69.43
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	579,532	3,525.35	2,043,053,631	3,407.99	1,975,044,476	30.39

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	32,236,934,330	98.51
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		488,630,581	1.49
合計(純資産総額)		32,725,564,911	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	458,602,000	1.40

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	3,129	632,068.07	1,977,740,996	715,000	2,237,235,000	6.84
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,761	631,738.12	1,744,228,958	681,000	1,880,241,000	5.75
日本	投資証券	G L P 投資法人	8,943	176,094.07	1,574,809,346	199,700	1,785,917,100	5.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,375	338,969.35	1,482,990,914	396,500	1,734,687,500	5.30
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,929	161,424.02	1,441,355,145	169,700	1,515,251,300	4.63
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,932	101,570.13	1,415,075,096	106,900	1,489,330,800	4.55
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,940	285,765.96	1,125,917,901	325,500	1,282,470,000	3.92
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,502	181,735.48	999,908,663	196,100	1,078,942,200	3.30
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,761	326,001.35	900,089,729	374,500	1,033,994,500	3.16
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,216	144,029.62	895,288,118	155,600	967,209,600	2.96
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,920	194,792.85	763,587,989	221,200	867,104,000	2.65
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,121	81,080.16	658,451,980	94,000	763,374,000	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,815	386,417.8	701,348,322	411,500	746,872,500	2.28
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	854	703,956.05	601,178,472	808,000	690,032,000	2.11
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,026	544,050.47	558,195,792	652,000	668,952,000	2.04
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,380	169,588.78	573,210,102	192,000	648,960,000	1.98
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,384	445,083.65	615,995,777	461,500	638,716,000	1.95
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,804	315,362.37	568,913,729	353,000	636,812,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	953	591,238.65	563,450,437	661,000	629,933,000	1.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,459	57,742.21	488,441,379	65,000	549,835,000	1.68
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,153	38,351.2	466,082,145	42,750	519,540,750	1.59
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,247	150,509.92	488,705,729	159,500	517,896,500	1.58
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,247	145,072.33	471,049,880	151,000	490,297,000	1.50
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	584	698,670.38	408,023,503	792,000	462,528,000	1.41
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	968	447,467.7	433,148,740	476,500	461,252,000	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,427	165,875.76	402,580,474	185,200	449,480,400	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,612	103,459.02	373,693,989	123,500	446,082,000	1.36
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,886	197,416.17	372,326,897	236,200	445,473,200	1.36
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,243	313,595.85	389,799,643	353,000	438,779,000	1.34
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	2,494	139,745.12	348,524,348	159,300	397,294,200	1.21

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.51

合 計	98.51
-----	-------

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	214	日本円	453,999,540	458,602,000	1.40

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

## RM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	69,820,569	0.26
	オーストラリア	24,785,610	0.09
	小計	94,606,179	0.36
投資証券	アメリカ	19,699,948,308	74.23
	カナダ	510,860,407	1.92
	ドイツ	75,436,080	0.28
	イタリア	3,506,738	0.01
	フランス	585,840,829	2.21
	オランダ	47,802,220	0.18
	スペイン	119,321,045	0.45
	ベルギー	376,163,590	1.42
	アイルランド	31,399,267	0.12
	イギリス	1,494,600,716	5.63
	オーストラリア	1,763,645,557	6.65
	ニュージーランド	112,303,306	0.42
	香港	373,210,910	1.41
	シンガポール	940,734,841	3.54
	韓国	40,169,877	0.15
	イスラエル	16,607,606	0.06
	ガーンジー	67,638,336	0.25
小計	26,259,189,633	98.94	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		186,142,971	0.70

合計(純資産総額)	26,539,938,783	100.00
-----------	----------------	--------

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		62,641,951	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	112,795	11,658.19	1,314,985,767	14,696.92	1,657,739,881	6.25
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,657	79,981.92	1,092,313,122	92,319.29	1,260,804,639	4.75
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,205	26,447.43	613,712,729	35,228.44	817,476,066	3.08
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,918	15,735.48	675,335,416	17,849.95	766,084,497	2.89
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,078	11,420.80	571,931,223	14,661.75	734,231,567	2.77
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	63,603	7,452.31	473,989,845	9,425.02	599,459,801	2.26
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,282	19,419.32	413,282,181	25,081.37	533,781,887	2.01
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	52,450	7,283.07	381,997,179	9,271.16	486,272,552	1.83
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,899	19,026.98	397,645,002	22,630.60	472,957,077	1.78
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	255,907	1,469.69	376,106,364	1,812.86	463,926,072	1.75
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	56,923	6,834.68	389,050,547	7,919.39	450,795,665	1.70
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,371	13,897.95	283,115,221	20,402.93	415,628,189	1.57
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	86,515	3,480.53	301,118,312	4,538.86	392,680,338	1.48
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,043	16,847.67	287,134,840	22,227.27	378,819,448	1.43
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,448	15,631.07	272,731,032	21,170.03	369,374,806	1.39
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,906	28,532.23	282,640,350	35,915.32	355,777,160	1.34
イギリス	投資証券	SEGO PLC	182,276	1,506.64	274,625,990	1,939.28	353,484,457	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	57,095	5,632.37	321,580,451	6,091.75	347,808,866	1.31
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	57,088	4,601.51	262,691,174	5,701.61	325,493,626	1.23
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,009	3,434.37	281,649,660	3,934.42	322,657,850	1.22
香港	投資証券	LINK REIT	316,600	988.82	313,063,197	1,015.21	321,416,910	1.21
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	81,735	3,005.76	245,676,202	3,379.42	276,217,302	1.04
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	21,619	10,651.50	230,274,951	12,305.50	266,032,669	1.00
アメリカ	投資証券	UDR INC	45,224	4,589.42	207,552,111	5,875.25	265,702,487	1.00
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,933	12,020.27	179,498,713	16,352.02	244,184,730	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,829	7,235.81	186,893,891	9,230.50	238,414,610	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	27,251	7,636.50	208,102,467	8,563.40	233,361,431	0.88
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	43,936	3,702.53	162,674,402	5,131.23	225,445,765	0.85
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	91,461	1,902.36	173,992,571	2,399.11	219,425,640	0.83
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,006	8,075.79	169,640,177	9,678.76	203,312,131	0.77



## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産	0.36
投資証券			98.94
合計			99.30

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

2021年8月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2020年8月17日	20円
2020年11月16日	110円
2021年2月15日	215円
2021年5月17日	5円
2021年8月16日	290円
設定来累計	640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	15.3
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	61.0
RM国内株式マザーファンド	2.4
RM先進国株式マザーファンド	15.4
RM新興国株式マザーファンド	2.4
RM新興国債券マザーファンド	0.6
RM国内リートマザーファンド	0.6
RM先進国リートマザーファンド	2.4
現金等	0.1
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。

## ■ 通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	79.3
米ドル	13.7
ユーロ	1.9
英ポンド	0.7
香港ドル	0.6
その他	3.8
合計	100.0

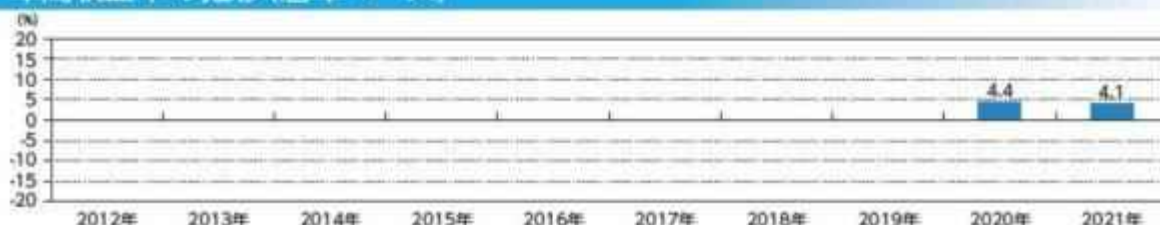
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。  
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

## ■ 各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産種別	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本 第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.5
	日本 第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.4
	日本 第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.1
先進国債券	アメリカ US TREASURY N/B	2028/1/31	0.8
	アメリカ US TREASURY N/B	2030/8/15	0.6
国内株式	日本 トヨタ自動車	—	3.6
	日本 ソニーグループ	—	2.6
先進国株式	アメリカ APPLE INC	—	4.1
	アメリカ MICROSOFT CORP	—	3.5
	アメリカ AMAZON.COM INC	—	2.3
新興国株式	台湾 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	5.4
	中国 TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.5
新興国債券	中国 ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	3.1
	アイルランド ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	69.4
国内リート	アメリカ VANECK VECTORS JP. MORGAN E	—	30.4
	日本 日本ビルファンド投資法人	—	6.8
	日本 ジャパコリアルエステイト投資法人	—	5.7
先進国リート	日本 GLP投資法人	—	5.5
	アメリカ PROLOGIS INC	—	6.2
	アメリカ EQUINIX INC	—	4.8
	アメリカ PUBLIC STORAGE	—	3.1

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。  
※2020年3月31日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は3月31日から12月末までの騰落率です。2021年は8月末までの騰落率です。  
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法  
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択  
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。  
＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞  
収益分配金を自動的に再投資するコースです。  
＜分配金受取りコース（一般コース）＞  
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (5) 取得申込不可日  
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
・ニューヨークの銀行の休業日  
・ニューヨーク証券取引所の休業日  
・ロンドンの銀行の休業日  
・ロンドン証券取引所の休業日
- (6) 申込金額  
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位  
最低単位を1円または1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い  
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消  
委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。  
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金（解約）手続等】

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日  
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
・ニューヨークの銀行の休業日  
・ニューヨーク証券取引所の休業日  
・ロンドンの銀行の休業日  
・ロンドン証券取引所の休業日
- (4) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

い。

#### (5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

#### (6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

#### (7) 解約単位

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

#### (8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

#### (9) 受付の中止および取消

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

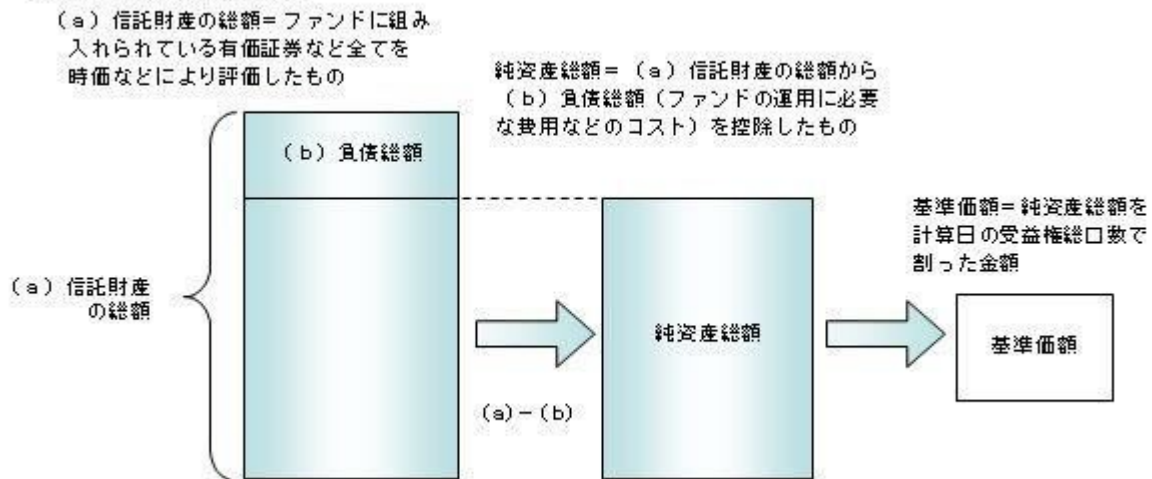
### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

### <基準価額算出の流れ>



#### 有価証券などの評価基準

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

#### <主な資産の評価方法>

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 外国株式

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

##### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

##### 国内上場不動産投信

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

##### 海外上場不動産投信

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

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

#### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

### （３）【信託期間】

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

### （４）【計算期間】

毎年2月16日から5月15日、5月16日から8月15日、8月16日から11月15日および11月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

### （５）【その他】

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

償還金について

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

信託約款の変更など

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

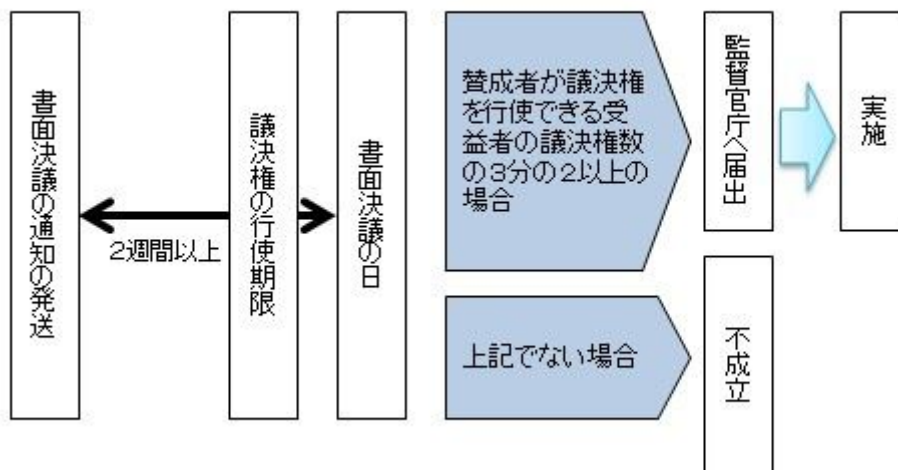
書面決議

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

ます。

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

#### <書面決議の主な流れ>



#### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

#### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（2月、8月）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、原則として知っ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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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3特定期間(2021年 2月16日から2021年 8月16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】

## 【リスクコントロール・オープン】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2特定期間 2021年 2月15日現在	第3特定期間 2021年 8月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,708,363	2,464,223
親投資信託受益証券	399,624,009	581,416,215
未収入金	11,101,000	21,293,000
流動資産合計	412,433,372	605,173,438
資産合計	412,433,372	605,173,438
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	8,492,527	16,667,807
未払受託者報酬	31,149	47,446
未払委託者報酬	1,141,928	1,739,628
未払利息	4	6
その他未払費用	243,949	371,674
流動負債合計	9,909,557	18,826,561
負債合計	9,909,557	18,826,561
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	395,001,284	574,751,988
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	7,522,531	11,594,889
( 分配準備積立金 )	4,273,606	4,647,657
元本等合計	402,523,815	586,346,877
純資産合計	402,523,815	586,346,877
負債純資産合計	412,433,372	605,173,438

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2特定期間		第3特定期間	
	自	2020年 8月18日	自	2021年 2月16日
	至	2021年 2月15日	至	2021年 8月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		14,074,842		21,468,206
営業収益合計		14,074,842		21,468,206
営業費用				
支払利息		471		773
受託者報酬		59,669		85,564
委託者報酬		2,187,498		3,137,323
その他費用		467,310		670,277
営業費用合計		2,714,948		3,893,937
営業利益又は営業損失（ ）		11,359,894		17,574,269
経常利益又は経常損失（ ）		11,359,894		17,574,269
当期純利益又は当期純損失（ ）		11,359,894		17,574,269
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（ ）		147,711		79,542
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,526,368		7,522,531
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,752,471		3,888,438
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,752,471		3,888,438
剰余金減少額又は欠損金増加額		573,723		393,862
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		573,723		393,862
分配金		12,394,768		16,916,945
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,522,531		11,594,889

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドは、原則として毎年2月15日及び8月15日を特定期間の末日としております。ただし、当特定期間末日が休業日のため、当特定期間は2021年2月16日から2021年8月16日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2特定期間 2021年 2月15日現在		第3特定期間 2021年 8月16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	323,012,717円	期首元本額	395,001,284円
期中追加設定元本額	100,025,572円	期中追加設定元本額	200,700,872円
期中一部解約元本額	28,037,005円	期中一部解約元本額	20,950,168円
2. 特定期間の末日における受益権の総数	395,001,284口	2. 特定期間の末日における受益権の総数	574,751,988口
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0190円	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0202円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,190円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,202円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2特定期間 自 2020年 8月18日 至 2021年 2月15日		第3特定期間 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月16日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
第3期		第5期	
2020年 8月18日		2021年 2月16日	
2020年11月16日		2021年 5月17日	
A 費用控除後の配当等収益額	1,038,458円	A 費用控除後の配当等収益額	918,792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	2,802,718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	514,774円
C 収益調整金額	1,633,840円	C 収益調整金額	4,625,496円
D 分配準備積立金額	5,650,266円	D 分配準備積立金額	4,136,970円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	11,125,282円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	10,196,032円
F 当ファンドの期末残存口数	354,749,196口	F 当ファンドの期末残存口数	498,276,039口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F × 10,000)	313円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F × 10,000)	204円

H	10,000口当たり分配金額	110円	H	10,000口当たり分配金額	5円
I	収益分配金金額(I=F×H/10,000)	3,902,241円	I	収益分配金金額(I=F×H/10,000)	249,138円
	第4期			第6期	
	2020年11月17日			2021年 5月18日	
	2021年 2月15日			2021年 8月16日	
A	費用控除後の配当等収益額	1,183,694円	A	費用控除後の配当等収益額	1,864,975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	6,187,313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	14,196,186円
C	収益調整金額	3,248,925円	C	収益調整金額	6,947,232円
D	分配準備積立金額	5,395,126円	D	分配準備積立金額	5,254,303円
E	当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	16,015,058円	E	当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	28,262,696円
F	当ファンドの期末残存口数	395,001,284口	F	当ファンドの期末残存口数	574,751,988口
G	10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	405円	G	10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	491円
H	10,000口当たり分配金額	215円	H	10,000口当たり分配金額	290円
I	収益分配金金額(I=F×H/10,000)	8,492,527円	I	収益分配金金額(I=F×H/10,000)	16,667,807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2特定期間 自 2020年 8月18日 至 2021年 2月15日	第3特定期間 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月16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2特定期間 2021年 2月15日現在	第3特定期間 2021年 8月16日現在
<p>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。</p> <p>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。</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 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 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 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第2特定期間 自 2020年 8月18日 至 2021年 2月15日	第3特定期間 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月16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2特定期間 自 2020年 8月18日 至 2021年 2月15日	第3特定期間 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月16日
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の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	8,443,773	17,438,420

合計	8,443,773	17,438,420
----	-----------	------------

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

### (4) 【附属明細表】

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	82,512,982	87,158,462	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	329,691,716	348,517,112	
	R M国内株式マザーファンド	10,351,416	14,436,084	
	R M先進国株式マザーファンド	49,287,432	95,021,240	
	R M新興国株式マザーファンド	8,772,334	14,304,167	
	R M新興国債券マザーファンド	3,333,132	3,650,446	
	R M国内リートマザーファンド	2,380,427	3,655,383	
	R M先進国リートマザーファンド	10,898,189	14,673,321	
合計		497,227,628	581,416,215	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2021年 8月16日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	960,540
コール・ローン	963,287,807
国債証券	91,784,461,980
地方債証券	5,647,733,925
特殊債券	6,579,567,459
社債券	4,249,869,000
未収利息	196,532,472
前払費用	14,704,464
流動資産合計	109,437,117,647
資産合計	109,437,117,647
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	221,162,400
未払解約金	29,679,000
未払利息	2,612
流動負債合計	250,844,012
負債合計	250,844,012
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	103,370,339,844
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,815,933,791
元本等合計	109,186,273,635
純資産合計	109,186,273,635
負債純資産合計	109,437,117,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）



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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	79,895,842,435円
期中追加設定元本額	30,398,874,754円
期中一部解約元本額	6,924,377,345円
期末元本額	103,370,339,844円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,760,970,086円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,919,500,843円
りそなラップ型ファンド(成長型)	190,979,232円
DCりそな グローバルバランス	569,776,560円
つみたてバランスファンド	3,057,584,790円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,587,456,040円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	599,210,538円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	175,486,457円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	151,704,284円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	46,929,157円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,082,013円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,181,747円
リスクコントロール・オープン	82,512,982円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,042,802,434円
FWりそな国内債券インデックスファンド	59,340,403,199円
Smart-i 国内債券インデックス	1,241,635,490円
Smart-i 8資産バランス 安定型	846,652,526円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	582,584,232円
Smart-i 8資産バランス 成長型	224,635,938円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,308,505,378円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	4,319,260,949円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	2,556,341,506円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,862,303,915円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,114,552,536円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	363,454,496円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	13,743,326円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,018,273,318円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,375,645,713円
りそなVE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)	127,595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)	37,136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)	5,428円
2. 計算日における受益権の総数	103,370,339,844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	1.0563円
(10,000口当たり純資産額)	(10,563円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

#### (関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月16日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	191,068,600
地方債証券	4,748,005
特殊債券	1,432,001
社債券	12,776,000
合計	210,024,606

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 4 1 6 回利付国債（ 2 年 ）	120,000,000	120,306,000	
	第 4 1 7 回利付国債（ 2 年 ）	350,000,000	350,983,500	
	第 4 1 8 回利付国債（ 2 年 ）	440,000,000	441,328,800	
	第 4 2 0 回利付国債（ 2 年 ）	820,000,000	822,820,800	
	第 4 2 1 回利付国債（ 2 年 ）	600,000,000	602,190,000	
	第 4 2 3 回利付国債（ 2 年 ）	880,000,000	882,217,600	
	第 4 2 4 回利付国債（ 2 年 ）	600,000,000	601,584,000	
	第 4 2 5 回利付国債（ 2 年 ）	350,000,000	350,941,500	
	第 4 2 6 回利付国債（ 2 年 ）	470,000,000	471,320,700	
	第 1 3 3 回利付国債（ 5 年 ）	1,280,000,000	1,283,289,600	
	第 1 3 4 回利付国債（ 5 年 ）	830,000,000	832,672,600	
	第 1 3 5 回利付国債（ 5 年 ）	1,000,000,000	1,003,900,000	
	第 1 3 6 回利付国債（ 5 年 ）	1,180,000,000	1,185,227,400	
	第 1 3 7 回利付国債（ 5 年 ）	1,070,000,000	1,075,382,100	
	第 1 3 8 回利付国債（ 5 年 ）	1,240,000,000	1,246,993,600	
	第 1 3 9 回利付国債（ 5 年 ）	1,680,000,000	1,690,684,800	
	第 1 4 0 回利付国債（ 5 年 ）	1,420,000,000	1,429,712,800	
	第 1 4 1 回利付国債（ 5 年 ）	680,000,000	685,066,000	
	第 1 4 2 回利付国債（ 5 年 ）	800,000,000	806,440,000	
	第 1 4 3 回利付国債（ 5 年 ）	1,010,000,000	1,018,736,500	
	第 1 4 4 回利付国債（ 5 年 ）	1,080,000,000	1,090,000,800	
	第 1 4 5 回利付国債（ 5 年 ）	1,020,000,000	1,030,077,600	
	第 1 4 6 回利付国債（ 5 年 ）	1,150,000,000	1,162,052,000	
	第 1 4 7 回利付国債（ 5 年 ）	790,000,000	795,103,400	
	第 1 4 8 回利付国債（ 5 年 ）	280,000,000	281,839,600	
	第 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	40,000,000	58,315,200	
	第 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	100,000,000	141,215,000	
	第 3 回利付国債（ 4 0 年 ）	110,000,000	155,800,700	
	第 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	170,000,000	241,379,600	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年 ）	170,000,000	233,319,900	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年 ）	210,000,000	283,626,000	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	230,000,000	298,963,200	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年 ）	250,000,000	304,207,500	

第9回利付国債(40年)	390,000,000	355,929,600	
第10回利付国債(40年)	370,000,000	394,453,300	
第11回利付国債(40年)	300,000,000	310,092,000	
第12回利付国債(40年)	300,000,000	280,059,000	
第13回利付国債(40年)	350,000,000	325,272,500	
第14回利付国債(40年)	90,000,000	89,307,000	
第325回利付国債(10年)	330,000,000	333,375,900	
第326回利付国債(10年)	280,000,000	283,141,600	
第327回利付国債(10年)	387,000,000	391,864,590	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	415,841,580	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	302,123,250	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	262,042,340	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,387,800	
第332回利付国債(10年)	652,000,000	663,260,040	
第333回利付国債(10年)	225,000,000	229,295,250	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	266,507,100	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	351,858,600	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	214,512,900	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,510,900	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	643,285,570	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	393,027,250	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	954,762,820	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	448,456,800	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	384,123,000	
第343回利付国債(10年)	780,000,000	788,931,000	
第344回利付国債(10年)	810,000,000	819,549,900	
第345回利付国債(10年)	970,000,000	981,998,900	
第346回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,164,881,000	
第347回利付国債(10年)	500,000,000	506,765,000	
第348回利付国債(10年)	810,000,000	821,437,200	
第349回利付国債(10年)	950,000,000	963,965,000	
第350回利付国債(10年)	930,000,000	943,894,200	
第351回利付国債(10年)	260,000,000	264,035,200	
第352回利付国債(10年)	830,000,000	843,363,000	
第353回利付国債(10年)	810,000,000	823,194,900	
第354回利付国債(10年)	490,000,000	497,874,300	

第355回利付国債(10年)	580,000,000	589,164,000	
第356回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,035,789,600	
第357回利付国債(10年)	670,000,000	680,123,700	
第358回利付国債(10年)	480,000,000	487,046,400	
第359回利付国債(10年)	990,000,000	1,003,632,300	
第360回利付国債(10年)	710,000,000	718,740,100	
第361回利付国債(10年)	980,000,000	991,005,400	
第362回利付国債(10年)	810,000,000	818,156,700	
第363回利付国債(10年)	260,000,000	262,298,400	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	74,045,400	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,681,600	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,501,000	
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,618,000	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	110,847,600	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,108,400	
第15回利付国債(30年)	160,000,000	208,288,000	
第16回利付国債(30年)	100,000,000	130,595,000	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,885,500	
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,282,400	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	129,153,000	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	132,250,000	
第21回利付国債(30年)	90,000,000	116,839,800	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,537,500	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	213,656,000	
第24回利付国債(30年)	170,000,000	227,618,100	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	131,259,000	
第26回利付国債(30年)	145,000,000	193,079,100	
第27回利付国債(30年)	215,000,000	290,963,800	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	149,541,700	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,438,400	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	254,337,800	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	172,389,100	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	290,198,400	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	376,646,200	
第34回利付国債(30年)	315,000,000	422,216,550	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	413,103,640	

第36回利付国債(30年)	365,000,000	478,821,600	
第37回利付国債(30年)	380,000,000	492,791,600	
第38回利付国債(30年)	250,000,000	320,190,000	
第39回利付国債(30年)	250,000,000	325,977,500	
第40回利付国債(30年)	205,000,000	263,525,450	
第41回利付国債(30年)	195,000,000	246,737,400	
第42回利付国債(30年)	250,000,000	316,672,500	
第43回利付国債(30年)	130,000,000	164,851,700	
第44回利付国債(30年)	210,000,000	266,584,500	
第45回利付国債(30年)	290,000,000	355,824,200	
第46回利付国債(30年)	320,000,000	392,908,800	
第47回利付国債(30年)	270,000,000	337,945,500	
第48回利付国債(30年)	283,000,000	341,807,400	
第49回利付国債(30年)	290,000,000	350,441,800	
第50回利付国債(30年)	280,000,000	299,376,000	
第51回利付国債(30年)	300,000,000	285,480,000	
第52回利付国債(30年)	270,000,000	269,098,200	
第53回利付国債(30年)	260,000,000	264,953,000	
第54回利付国債(30年)	270,000,000	287,722,800	
第55回利付国債(30年)	180,000,000	191,698,200	
第56回利付国債(30年)	280,000,000	297,670,800	
第57回利付国債(30年)	280,000,000	297,474,800	
第58回利付国債(30年)	420,000,000	445,905,600	
第59回利付国債(30年)	280,000,000	289,822,400	
第60回利付国債(30年)	230,000,000	249,274,000	
第61回利付国債(30年)	260,000,000	268,312,200	
第62回利付国債(30年)	260,000,000	254,446,400	
第63回利付国債(30年)	280,000,000	266,322,000	
第64回利付国債(30年)	260,000,000	246,607,400	
第65回利付国債(30年)	220,000,000	208,080,400	
第66回利付国債(30年)	260,000,000	245,512,800	
第67回利付国債(30年)	190,000,000	189,069,000	
第68回利付国債(30年)	310,000,000	308,090,400	
第69回利付国債(30年)	280,000,000	285,205,200	
第70回利付国債(30年)	370,000,000	375,990,300	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	121,803,600	

第58回利付国債(20年)	100,000,000	102,227,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	40,986,800	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,619,200	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	50,907,500	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,380,000	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,142,600	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	125,125,200	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	398,122,200	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,054,600	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	95,446,800	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	63,475,800	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	117,951,900	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	106,659,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	224,578,200	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	192,902,400	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	108,060,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	107,339,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,539,800	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	53,928,500	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,648,600	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	97,766,100	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,636,100	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	185,638,300	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,976,200	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	131,190,000	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	165,480,000	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	111,243,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	99,703,800	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	206,950,250	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	133,653,600	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	190,308,200	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	89,966,400	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	285,592,350	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	89,568,000	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	157,532,200	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	211,395,800	



第96回利付国債(20年)	70,000,000	79,164,400	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	148,557,500	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	79,562,700	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	97,090,400	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	174,266,080	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,347,200	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	170,203,900	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	116,692,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,531,200	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,905,720	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,638,800	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	93,156,000	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	252,918,600	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	92,305,600	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	227,978,400	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,088,500	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	240,641,300	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	100,175,900	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	189,292,800	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	119,148,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	167,461,000	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	267,187,500	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	154,916,670	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	174,720,000	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	275,287,200	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	241,184,550	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	221,804,100	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	317,583,950	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	237,814,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	145,383,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	119,235,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	153,757,500	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	266,807,250	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	282,235,200	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	259,443,800	
第131回利付国債(20年)	210,000,000	245,536,200	

第132回利付国債(20年)	170,000,000	199,270,600	
第133回利付国債(20年)	305,000,000	360,659,450	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,379,000	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,026,000	
第136回利付国債(20年)	410,000,000	477,691,000	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	200,351,800	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,127,300	
第139回利付国債(20年)	280,000,000	326,972,800	
第140回利付国債(20年)	420,000,000	496,175,400	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	219,056,650	
第142回利付国債(20年)	310,000,000	370,558,500	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	393,692,000	
第144回利付国債(20年)	190,000,000	221,106,800	
第145回利付国債(20年)	445,000,000	529,558,900	
第146回利付国債(20年)	460,000,000	548,596,000	
第147回利付国債(20年)	495,000,000	585,520,650	
第148回利付国債(20年)	515,000,000	603,883,850	
第149回利付国債(20年)	470,000,000	552,019,700	
第150回利付国債(20年)	530,000,000	616,655,000	
第151回利付国債(20年)	535,000,000	609,274,050	
第152回利付国債(20年)	580,000,000	661,101,400	
第153回利付国債(20年)	410,000,000	473,287,600	
第154回利付国債(20年)	308,000,000	351,662,080	
第155回利付国債(20年)	480,000,000	535,027,200	
第156回利付国債(20年)	520,000,000	535,121,600	
第157回利付国債(20年)	450,000,000	449,671,500	
第158回利付国債(20年)	250,000,000	260,605,000	
第159回利付国債(20年)	430,000,000	454,247,700	
第160回利付国債(20年)	460,000,000	492,535,800	
第161回利付国債(20年)	410,000,000	432,521,300	
第162回利付国債(20年)	360,000,000	379,490,400	
第163回利付国債(20年)	360,000,000	379,184,400	
第164回利付国債(20年)	600,000,000	621,414,000	
第165回利付国債(20年)	430,000,000	444,856,500	
第166回利付国債(20年)	610,000,000	650,729,700	
第167回利付国債(20年)	380,000,000	392,201,800	

	第168回利付国債(20年)	410,000,000	415,805,600	
	第169回利付国債(20年)	370,000,000	368,127,800	
	第170回利付国債(20年)	470,000,000	466,794,600	
	第171回利付国債(20年)	330,000,000	327,155,400	
	第172回利付国債(20年)	450,000,000	453,528,000	
	第173回利付国債(20年)	450,000,000	452,776,500	
	第174回利付国債(20年)	400,000,000	401,780,000	
	第175回利付国債(20年)	420,000,000	429,080,400	
	第176回利付国債(20年)	460,000,000	469,204,600	
	第177回利付国債(20年)	160,000,000	160,145,600	
	国債証券合計	85,971,000,000	91,784,461,980	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	114,939,000	
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,592,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	101,918,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,305,000	
	第789回東京都公募公債	100,000,000	100,292,000	
	第808回東京都公募公債	100,000,000	100,452,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,181,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,461,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,389,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,986,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	111,896,400	
	第444回大阪府公募公債	100,000,000	100,325,000	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	100,025,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,526,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,963,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,931,000	
	令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	100,464,000	
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,722,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,768,000	
	平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	116,526,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,326,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,174,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,701,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,138,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	117,245,000	

	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	113,293,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,724,000	
	平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	116,348,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,231,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	112,689,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,349,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,976,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,611,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,865,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,482,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,021,000	
	第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,470,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,711,000	
	第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,879,000	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,551,000	
	第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,172,000	
	第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,089,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,050,000	
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	118,845,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,915,000	
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	115,375,925	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,376,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	116,970,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,719,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,044,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,371,600	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,024,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	101,049,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,288,000	
	地方債証券合計	5,444,500,000	5,647,733,925	
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,607,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,409,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,247,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,771,000	

第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,139,000	
第 1 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,023,000	
第 2 7 回道路債券	100,000,000	106,230,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	174,057,000	
第 2 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,115,840	
第 2 2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,157,730	
第 2 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,563,000	
第 2 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,873,000	
第 2 5 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,269,090	
第 2 6 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	134,896,580	
第 3 0 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,572,000	
第 3 3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,974,000	
第 3 3 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,241,000	
第 3 4 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,784,000	
第 3 7 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,564,000	
第 3 8 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,928,000	
第 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,093,000	
第 1 3 回公営企業債券	100,000,000	108,240,000	
第 5 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,916,430	
第 7 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,635,000	
F 8 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,456,000	
第 9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,012,100	
第 9 7 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,758,000	
第 1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,570,700	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,247,000	
F 2 2 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,144,000	
F 3 0 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,849,000	
第 1 0 回株式会社日本政策金融公庫社債（一般	100,000,000	117,843,000	

担保付)			
第97回都市再生債券	100,000,000	107,576,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	112,159,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	75,818,000	75,646,651	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	81,134,000	81,182,680	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,473,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,237,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,322,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,189,000	83,557,446	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,314,000	83,461,457	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,722,000	84,763,501	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,959,000	84,107,982	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,298,000	87,321,494	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,420,000	88,967,334	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,651,000	92,616,719	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,475,000	95,053,187	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,097,000	98,094,186	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,047,000	100,444,553	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,910,000	100,974,041	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,588,000	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	51,971,000	51,967,362	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	53,629,000	53,657,959	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	57,386,000	57,455,437	
第340回信金中金債	100,000,000	100,144,000	
第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,953,000	
第372回信金中金債	100,000,000	100,144,000	
第376回信金中金債	100,000,000	100,113,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,064,000	
第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,091,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,210,000	
第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,984,000	
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,052,000	
	特殊債券合計	6,320,020,000	6,579,567,459
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	100,334,000

第3回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債	100,000,000	100,147,000	
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	99,919,000	
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	99,531,000	
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	99,994,000	
第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,989,000	
第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,438,000	
第12回Zホールディングス株式会社無担保社 債	100,000,000	100,004,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,394,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,772,000	
第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,953,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	100,291,000	
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	100,091,000	
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保 社債	100,000,000	101,556,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,026,000	
第14回NTTファイナンス株式会社無担保社 債	100,000,000	99,942,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,026,000	
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	100,485,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,424,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	101,785,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	101,486,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	108,558,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,259,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,050,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,468,000	

第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,137,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,236,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,481,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,411,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,236,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,998,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,786,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,494,000	
第493回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,197,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,497,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,243,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,073,000	
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	101,640,000	
社債券合計	4,200,000,000	4,249,869,000	
合計		108,261,632,364	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,936,172,610
コール・ローン	1,221,162,092
国債証券	268,092,763,947
派生商品評価勘定	1,112,714,112



2021年 8月16日現在

未収入金	203,417
未収利息	1,266,168,139
前払費用	171,892,186
流動資産合計	273,801,076,503
資産合計	273,801,076,503
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,530,737
未払金	1,856,468,947
未払解約金	16,381,000
未払利息	3,312
流動負債合計	1,888,383,996
負債合計	1,888,383,996
純資産の部	
元本等	
元本	257,224,505,680
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,688,186,827
元本等合計	271,912,692,507
純資産合計	271,912,692,507
負債純資産合計	273,801,076,503

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	196,943,946,160円

期中追加設定元本額	91,088,069,875円
期中一部解約元本額	30,807,510,355円
期末元本額	257,224,505,680円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	25,678,903,483円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	14,142,767,839円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,111,798,163円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,584,939,938円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	598,619,595円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	175,307,830円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	151,274,385円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	46,881,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,086,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,185,342円
リスクコントロール・オープン	329,691,716円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,328,237,987円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,256,183,310円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	139,637,510,384円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	1,065,234,743円
Smart-i 8資産バランス 安定型	846,009,528円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	582,863,313円
Smart-i 8資産バランス 成長型	224,410,439円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	9,237,685,771円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	17,272,465,321円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	10,199,195,983円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	7,432,974,633円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,461,570,316円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,452,432,807円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	7,660,853,530円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	13,737,353円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	2,937,472,287円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	777,412,863円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	501,800円
りそな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）	283,964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）	13,323円
2. 計算日における受益権の総数	257,224,505,680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	1.0571円
(10,000口当たり純資産額)	(10,571円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2021年 8月16日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		3,655,917,875
合計		3,655,917,875

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 8月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	270,689,463,264	-	-	269,592,279,889	1,097,183,375
	米ドル	122,349,971,366	-	-	122,095,964,706	254,006,660
	カナダドル	5,454,728,794	-	-	5,438,986,555	15,742,239
	メキシコペソ	1,950,291,503	-	-	1,954,455,558	4,164,055
	ユーロ	110,421,359,508	-	-	109,718,553,520	702,805,988
	英ポンド	17,404,592,741	-	-	17,306,996,980	97,595,761
	スウェーデンクローナ	756,024,746	-	-	750,684,830	5,339,916
	ノルウェークローネ	604,723,835	-	-	602,382,420	2,341,415
	デンマーククローネ	1,371,037,346	-	-	1,362,242,250	8,795,096
	ポーランドズロチ	1,555,991,196	-	-	1,556,843,238	852,042
	オーストラリアドル	5,179,781,582	-	-	5,162,939,360	16,842,222
	シンガポールドル	1,182,035,240	-	-	1,181,010,800	1,024,440

	マレーシアリン ギット	1,223,409,213	-	1,216,704,489	6,704,724
	イスラエルシュケ ル	1,235,516,194	-	1,244,515,183	8,998,989
	合計	270,689,463,264	-	269,592,279,889	1,097,183,375

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,464,546.87	
		US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,000,845.90	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,002,865.00	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,792,247.97	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,535,477.25	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,383,632.57	
		US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,716,469.25	
		US TREASURY N/B	8,760,000.00	8,763,877.17	

US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,472,235.02	
US TREASURY N/B	5,230,000.00	5,328,062.50	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,775,037.85	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,802,718.46	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,516,618.68	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,553,222.50	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,896,989.92	
US TREASURY N/B	7,180,000.00	7,315,185.75	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,281,642.55	
US TREASURY N/B	6,470,000.00	6,470,631.47	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,620,930.42	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,561,319.44	
US TREASURY N/B	9,230,000.00	9,229,278.21	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,374,961.54	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,415,312.50	
US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,954,399.93	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,758,771.87	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,546,191.25	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,347,706.83	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,557,099.60	
US TREASURY N/B	11,280,000.00	11,275,152.98	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,518,935.35	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,186,352.61	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,438,996.85	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,892,973.86	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,504,989.95	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,690,766.55	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,903,843.79	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,530,758.14	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,896,343.75	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,112,908.01	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,882,406.16	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,297,214.70	
US TREASURY N/B	7,750,000.00	7,757,416.75	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,229,618.59	

US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,320,073.38	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,082,268.13	
US TREASURY N/B	13,450,000.00	13,427,408.03	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,142,574.14	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	4,082,524.26	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,658,456.90	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,987,812.20	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,373,921.67	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,239,079.21	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,189,663.80	
US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,409,607.64	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,037,976.36	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,913,702.84	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,903,218.66	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,783,754.20	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,997,070.00	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,521,620.88	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,367,694.41	
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,573,702.96	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,008,687.48	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,848,183.56	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,444,999.91	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,571,575.34	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,192,214.79	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,175,659.19	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,921,295.41	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,881,914.04	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,533,512.41	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,985,702.59	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,598,063.98	
US TREASURY N/B	10,580,000.00	10,581,652.59	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,422,542.14	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,088,894.83	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,180,019.98	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	6,037,275.00	

US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,280,502.44	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,264,983.96	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,488,540.85	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,637,928.68	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,790,859.18	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,554,346.76	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,157,812.40	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,465,382.04	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,754,675.00	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,540,885.73	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,650,970.95	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,850,400.76	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,557,070.25	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,779,570.10	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,771,390.35	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,369,494.10	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,041,459.19	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,539,874.88	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,959,273.20	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,797,566.30	
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,385,743.93	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,146,156.25	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,478,788.89	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,224,255.21	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,717,378.12	
US TREASURY N/B	7,640,000.00	7,623,884.18	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,753,617.81	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,614,852.51	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,174,887.32	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,681,011.11	
US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,249,135.47	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,293,160.75	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,584,790.72	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,447,885.70	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,649,384.08	



US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,639,978.24	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,048,730.32	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,888,437.50	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,661,134.55	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,918,177.11	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,412,910.06	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,088,835.86	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,938,903.32	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,879,637.50	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,722,968.46	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,841,511.57	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,520,265.52	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,056,835.72	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,095,457.03	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,135,766.76	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,835,236.19	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,699,893.98	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,854,083.95	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,971,867.37	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,687,988.25	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,698,796.49	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,638,810.82	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,873,496.06	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,392,781.04	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,842,382.61	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,530,468.75	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,738,429.46	
US TREASURY N/B	5,830,000.00	6,031,772.21	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,962,574.78	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,457,119.42	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,623,950.00	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	6,086,642.03	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,655,087.79	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,850,156.08	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,348,297.06	

US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,942,805.65	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,014,062.50	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,761,500.00	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,088,725.52	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,004,217.68	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,470,062.08	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,178,015.30	
US TREASURY N/B	8,110,000.00	7,848,325.17	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,978,281.84	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	4,176,716.97	
US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,630,623.09	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,866,549.17	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,647,737.50	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,965,132.66	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,981,663.68	
US TREASURY N/B	20,170,000.00	19,841,448.85	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,493,271.26	
US TREASURY N/B	9,190,000.00	9,318,515.71	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,821,513.13	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,584,296.55	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,287,750.00	
US TREASURY N/B	220,000.00	286,352.33	
US TREASURY N/B	8,390,000.00	9,414,497.02	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,397,325.00	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	7,323,931.55	
US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,557,942.51	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,176,855.00	
US TREASURY N/B	3,460,000.00	3,618,605.70	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,452,577.81	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,109,763.25	
US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,615,580.74	
US TREASURY N/B	15,650,000.00	14,828,985.35	
US TREASURY N/B	10,450,000.00	10,102,210.40	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,410,991.32	
US TREASURY N/B	9,890,000.00	9,761,738.56	

US TREASURY N/B	13,850,000.00	14,289,303.99
US TREASURY N/B	540,000.00	755,346.06
US TREASURY N/B	130,000.00	193,156.63
US TREASURY N/B	690,000.00	970,096.87
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,738,617.12
US TREASURY N/B	960,000.00	1,228,800.00
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,804,639.43
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,930,280.45
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,274,687.36
US TREASURY N/B	780,000.00	1,143,431.25
US TREASURY N/B	950,000.00	1,355,568.30
US TREASURY N/B	4,640,000.00	4,123,074.76
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,894,962.87
US TREASURY N/B	8,140,000.00	7,205,966.74
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,719,151.53
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,032,546.44
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,696,132.70
US TREASURY N/B	6,910,000.00	6,943,469.96
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,621,704.47
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,402,187.20
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,434,881.19
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,269,246.78
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,637,469.41
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,282,829.63
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,893,238.96
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,147,282.76
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,740,674.94
US TREASURY N/B	2,960,000.00	3,487,018.52
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,201,050.17
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,035,727.14
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,153,140.46
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,459,272.45
US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,831,903.95
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,376,515.52
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,752,724.09

	US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,022,753.75	
	US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,068,239.35	
	US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,205,754.63	
	US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,414,295.58	
	US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,462,378.12	
	US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,516,288.85	
	US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,647,003.01	
	US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,586,455.43	
	US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,896,036.63	
	US TREASURY N/B	3,430,000.00	4,011,224.13	
	US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,737,392.32	
	US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,956,978.46	
	US TREASURY N/B	3,940,000.00	4,933,002.92	
	US TREASURY N/B	5,090,000.00	6,240,617.91	
	US TREASURY N/B	5,530,000.00	7,246,891.91	
	US TREASURY N/B	5,280,000.00	6,495,431.18	
	US TREASURY N/B	5,190,000.00	6,245,232.35	
	US TREASURY N/B	5,670,000.00	6,045,194.10	
	US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,543,439.09	
	US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,261,813.28	
	US TREASURY N/B	6,850,000.00	5,774,067.76	
	US TREASURY N/B	7,600,000.00	6,611,702.84	
	US TREASURY N/B	7,120,000.00	6,591,006.07	
	US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,450,843.32	
	US TREASURY N/B	9,910,000.00	10,892,483.32	
	米ドル 小計	1,061,900,000.00	1,105,789,779.51 (121,095,038,754)	
カナダドル	GOV OF CANADA	2,050,000.00	2,050,330.05	
	GOV OF CANADA	2,110,000.00	2,126,953.85	
	GOV OF CANADA	2,600,000.00	2,599,355.20	
	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,247,840.00	
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,849,633.57	
	GOV OF CANADA	2,300,000.00	2,294,871.00	
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,193,264.28	
	GOV OF CANADA	2,020,000.00	2,012,277.54	

	GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,661,030.06
	GOV OF CANADA	840,000.00	876,319.92
	GOV OF CANADA	2,630,000.00	2,608,060.54
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,242,565.96
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,139,063.13
	GOV OF CANADA	600,000.00	601,385.40
	GOV OF CANADA	730,000.00	744,018.92
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,321,687.50
	GOV OF CANADA	3,490,000.00	3,452,112.56
	GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,200,225.26
	GOV OF CANADA	850,000.00	875,972.60
	GOV OF CANADA	1,640,000.00	1,647,593.20
	GOV OF CANADA	920,000.00	923,921.04
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,066,231.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	472,570.00
	GOV OF CANADA	1,340,000.00	1,460,937.68
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,635,442.00
	GOV OF CANADA	3,750,000.00	3,522,300.00
	GOV OF CANADA	2,610,000.00	2,671,246.26
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,402,437.50
	GOV OF CANADA	690,000.00	1,030,448.76
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,347,866.88
	GOV OF CANADA	1,270,000.00	1,722,747.38
	GOV OF CANADA	1,190,000.00	1,451,302.58
	GOV OF CANADA	4,680,000.00	4,939,613.64
	GOV OF CANADA	500,000.00	634,699.50
	カナダドル 小計	59,280,000.00	62,026,324.76 (5,418,619,731)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	27,030,000.00	27,491,942.70
	UNITED MEXICAN STATE	29,990,000.00	31,370,289.75
	UNITED MEXICAN STATE	28,480,000.00	29,972,067.20
	UNITED MEXICAN STATE	28,740,000.00	32,027,249.58
	UNITED MEXICAN STATE	41,180,000.00	40,032,597.53
	UNITED MEXICAN STATE	32,110,000.00	33,343,373.99
	UNITED MEXICAN STATE	33,010,000.00	36,212,791.94
	UNITED MEXICAN STATE	26,246,000.00	27,714,463.70

	UNITED MEXICAN STATE	9,600,000.00	10,079,904.00	
	UNITED MEXICAN STATE	7,500,000.00	9,337,785.00	
	UNITED MEXICAN STATE	24,200,000.00	26,395,644.22	
	UNITED MEXICAN STATE	20,500,000.00	20,783,732.30	
	UNITED MEXICAN STATE	22,280,000.00	23,115,290.55	
	メキシコペソ 小計	330,866,000.00	347,877,132.46 (1,915,689,793)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	695,451.00	
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,052,559.00	
	GOV OF AUSTRIA	920,000.00	931,009.64	
	GOV OF AUSTRIA	1,290,000.00	1,308,425.07	
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,403,322.90	
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,235,921.83	
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,077,244.00	
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	717,630.90	
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,448,873.66	
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,296,100.50	
	GOV OF AUSTRIA	1,430,000.00	1,534,042.51	
	GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,435,526.55	
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,724,867.72	
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,323,091.22	
	GOV OF AUSTRIA	1,230,000.00	1,315,210.71	
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,367,670.92	
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	931,162.05	
	GOV OF AUSTRIA	1,180,000.00	1,553,569.12	
	GOV OF AUSTRIA	1,450,000.00	2,382,593.60	
	GOV OF AUSTRIA	420,000.00	403,533.48	
	GOV OF AUSTRIA	740,000.00	1,232,727.15	
	GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,272,982.76	
	GOV OF AUSTRIA	610,000.00	676,488.17	
	GOV OF AUSTRIA	410,000.00	915,390.60	
	GOV OF AUSTRIA	420,000.00	439,191.90	
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	1,268,054.40	
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	406,491.96	
	GOV OF BELGIUM	1,590,000.00	1,678,833.30	

GOV OF BELGIUM	1,570,000.00	1,657,120.87
GOV OF BELGIUM	1,280,000.00	1,306,407.68
GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,556,517.38
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,839,764.55
GOV OF BELGIUM	2,300,000.00	2,433,901.40
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,156,462.25
GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,182,153.48
GOV OF BELGIUM	1,500,000.00	1,621,750.50
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	1,043,568.36
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,495,692.92
GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,428,200.17
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,696,048.20
GOV OF BELGIUM	1,740,000.00	1,801,664.73
GOV OF BELGIUM	1,840,000.00	2,061,591.20
GOV OF BELGIUM	1,600,000.00	1,622,763.20
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,636,050.16
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,388,964.00
GOV OF BELGIUM	700,000.00	969,541.30
GOV OF BELGIUM	2,090,000.00	3,507,741.05
GOV OF BELGIUM	600,000.00	718,644.00
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,249,246.18
GOV OF BELGIUM	640,000.00	644,553.92
GOV OF BELGIUM	2,120,000.00	3,688,702.48
GOV OF BELGIUM	1,060,000.00	1,843,439.64
GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,586,550.04
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,465,492.80
GOV OF BELGIUM	680,000.00	1,012,339.12
GOV OF BELGIUM	730,000.00	1,103,635.17
GOV OF BELGIUM	590,000.00	544,017.81
GOV OF FINLAND	530,000.00	543,450.34
GOV OF FINLAND	660,000.00	685,082.90
GOV OF FINLAND	660,000.00	670,378.50
GOV OF FINLAND	510,000.00	548,017.95
GOV OF FINLAND	460,000.00	470,427.28
GOV OF FINLAND	520,000.00	617,276.34

GOV OF FINLAND	670,000.00	713,457.20	
GOV OF FINLAND	840,000.00	886,967.76	
GOV OF FINLAND	740,000.00	789,471.22	
GOV OF FINLAND	470,000.00	578,938.48	
GOV OF FINLAND	510,000.00	545,897.37	
GOV OF FINLAND	1,240,000.00	1,331,913.76	
GOV OF FINLAND	360,000.00	370,203.84	
GOV OF FINLAND	490,000.00	540,238.72	
GOV OF FINLAND	410,000.00	424,406.58	
GOV OF FINLAND	390,000.00	451,487.40	
GOV OF FINLAND	580,000.00	590,680.12	
GOV OF FINLAND	470,000.00	482,412.70	
GOV OF FINLAND	490,000.00	750,356.60	
GOV OF FINLAND	410,000.00	535,364.47	
GOV OF FINLAND	400,000.00	384,190.80	
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,644,150.40	
GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,143,093.16	
GOV OF FRANCE	5,720,000.00	5,785,213.72	
GOV OF FRANCE	5,910,000.00	6,168,692.52	
GOV OF FRANCE	4,030,000.00	4,472,142.18	
GOV OF FRANCE	3,690,000.00	3,754,538.10	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,520,177.29	
GOV OF FRANCE	3,670,000.00	3,974,929.29	
GOV OF FRANCE	3,820,000.00	4,129,458.58	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,551,494.62	
GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,483,068.50	
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	4,171,716.25	
GOV OF FRANCE	4,190,000.00	4,487,658.00	
GOV OF FRANCE	4,970,000.00	5,108,215.70	
GOV OF FRANCE	4,590,000.00	5,492,118.60	
GOV OF FRANCE	4,540,000.00	4,783,284.98	
GOV OF FRANCE	4,310,000.00	4,499,295.20	
GOV OF FRANCE	1,230,000.00	1,265,731.50	
GOV OF FRANCE	4,150,000.00	4,522,055.80	
GOV OF FRANCE	5,710,000.00	6,887,002.30	



GOV OF FRANCE	5,560,000.00	6,016,931.92	
GOV OF FRANCE	6,310,000.00	6,845,554.94	
GOV OF FRANCE	4,240,000.00	6,195,975.60	
GOV OF FRANCE	4,730,000.00	5,046,332.94	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	5,465,115.50	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	6,653,199.15	
GOV OF FRANCE	5,650,000.00	5,763,734.50	
GOV OF FRANCE	5,390,000.00	6,291,186.44	
GOV OF FRANCE	2,720,000.00	2,755,368.16	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,888,107.16	
GOV OF FRANCE	4,420,000.00	5,100,556.24	
GOV OF FRANCE	2,910,000.00	4,789,755.24	
GOV OF FRANCE	4,900,000.00	5,688,762.80	
GOV OF FRANCE	2,780,000.00	4,568,159.94	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	4,405,502.52	
GOV OF FRANCE	2,400,000.00	2,466,590.40	
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	7,526,633.40	
GOV OF FRANCE	1,460,000.00	1,477,225.08	
GOV OF FRANCE	2,720,000.00	4,446,498.24	
GOV OF FRANCE	3,370,000.00	4,600,225.24	
GOV OF FRANCE	3,360,000.00	4,168,153.92	
GOV OF FRANCE	3,560,000.00	3,664,201.20	
GOV OF FRANCE	900,000.00	918,071.10	
GOV OF FRANCE	2,110,000.00	4,246,575.45	
GOV OF FRANCE	1,780,000.00	3,761,828.86	
GOV OF FRANCE	1,480,000.00	2,024,154.56	
GOV OF FRANCE	900,000.00	776,530.80	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,068,156.80	
GOV OF GERMANY	1,550,000.00	1,562,307.00	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,813,768.01	
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,191,774.04	
GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,420,202.79	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,155,027.50	
GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,491,278.15	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,402,099.93	

GOV OF GERMANY	1,810,000.00	1,834,859.79	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,799,037.32	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	2,827,788.20	
GOV OF GERMANY	3,520,000.00	3,747,274.43	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,583,785.27	
GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,680,826.40	
GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,963,645.74	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,830,512.74	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,075,833.88	
GOV OF GERMANY	2,120,000.00	2,182,170.05	
GOV OF GERMANY	3,000,000.00	3,218,931.00	
GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,430,393.32	
GOV OF GERMANY	350,000.00	362,259.55	
GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,609,725.40	
GOV OF GERMANY	2,660,000.00	2,755,815.86	
GOV OF GERMANY	3,770,000.00	3,914,334.45	
GOV OF GERMANY	3,490,000.00	3,681,941.96	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,416,496.88	
GOV OF GERMANY	3,790,000.00	4,070,914.80	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,840,264.80	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,451,295.82	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,377,841.22	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,580,274.84	
GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,432,185.12	
GOV OF GERMANY	1,080,000.00	1,130,837.42	
GOV OF GERMANY	2,860,000.00	3,056,381.90	
GOV OF GERMANY	3,150,000.00	3,307,138.04	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,836,441.90	
GOV OF GERMANY	3,310,000.00	3,477,555.51	
GOV OF GERMANY	4,020,000.00	4,222,748.70	
GOV OF GERMANY	700,000.00	739,863.60	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,291,983.10	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,927,736.72	
GOV OF GERMANY	870,000.00	911,398.08	
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,814,980.07	

GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,060,598.80	
GOV OF GERMANY	1,060,000.00	1,097,266.84	
GOV OF GERMANY	3,010,000.00	5,068,240.10	
GOV OF GERMANY	2,360,000.00	4,324,974.94	
GOV OF GERMANY	2,180,000.00	4,299,254.30	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	3,760,443.56	
GOV OF GERMANY	3,270,000.00	5,310,748.14	
GOV OF GERMANY	3,350,000.00	5,576,941.30	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	4,243,638.35	
GOV OF GERMANY	4,300,000.00	4,323,529.60	
GOV OF IRELAND	510,000.00	513,809.70	
GOV OF IRELAND	730,000.00	783,415.41	
GOV OF IRELAND	820,000.00	906,751.90	
GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,645,070.85	
GOV OF IRELAND	1,530,000.00	1,646,922.60	
GOV OF IRELAND	710,000.00	738,784.11	
GOV OF IRELAND	810,000.00	882,738.00	
GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,400,275.80	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,026,504.99	
GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,367,564.88	
GOV OF IRELAND	530,000.00	609,050.03	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,059,027.90	
GOV OF IRELAND	420,000.00	484,640.94	
GOV OF IRELAND	590,000.00	612,683.73	
GOV OF IRELAND	650,000.00	800,524.40	
GOV OF IRELAND	350,000.00	360,717.28	
GOV OF IRELAND	980,000.00	1,324,283.80	
GOV OF IRELAND	780,000.00	965,927.82	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,723,099.43	
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,774,817.55	
GOV OF ITALY	2,500,000.00	2,553,429.50	
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,244,177.48	
GOV OF ITALY	3,020,000.00	3,038,802.82	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,804,452.46	
GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,871,028.60	

GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,728,663.82	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,106,724.57	
GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,366,632.69	
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,536,919.09	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,364,567.88	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,102,073.33	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,648,359.86	
GOV OF ITALY	4,870,000.00	4,915,120.55	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,227,082.22	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	1,907,282.16	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,485,395.80	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,141,705.00	
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,361,799.00	
GOV OF ITALY	1,960,000.00	2,204,420.23	
GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,166,886.90	
GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,217,373.06	
GOV OF ITALY	3,110,000.00	3,177,636.28	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,375,906.60	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,637,740.72	
GOV OF ITALY	2,710,000.00	2,889,126.11	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,868,358.48	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,972,411.89	
GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,242,080.90	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,375,888.13	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,225,473.44	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,242,174.68	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,597,155.20	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,016,123.20	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,403,027.52	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,386,211.52	
GOV OF ITALY	1,990,000.00	2,241,424.56	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,947,634.20	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,338,429.21	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,602,557.20	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,612,978.50	

GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,054,234.09	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,205,016.00	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,505,348.00	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	3,026,855.10	
GOV OF ITALY	2,640,000.00	3,202,143.12	
GOV OF ITALY	2,750,000.00	3,856,767.75	
GOV OF ITALY	3,390,000.00	4,288,634.76	
GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,998,915.57	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	1,997,787.42	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,525,574.24	
GOV OF ITALY	2,810,000.00	2,916,144.94	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,870,587.80	
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,312,532.01	
GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,149,545.97	
GOV OF ITALY	2,790,000.00	3,088,066.86	
GOV OF ITALY	2,830,000.00	4,410,877.62	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,495,460.00	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	4,142,986.86	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,061,789.15	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,601,632.50	
GOV OF ITALY	1,810,000.00	2,133,204.46	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,896,726.62	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	1,569,562.14	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,707,792.11	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	3,685,969.25	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,365,230.60	
GOV OF ITALY	2,320,000.00	3,816,685.36	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,865,781.00	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	3,185,985.43	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,239,062.99	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	2,092,968.56	
GOV OF ITALY	2,420,000.00	3,051,849.90	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	2,400,034.56	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	2,433,353.49	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,998,230.85	

GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,385,352.30	
GOV OF ITALY	1,020,000.00	1,277,548.98	
GOV OF ITALY	540,000.00	565,102.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,745,850.52	
GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,024,527.54	
GOV OF NETHERLANDS	1,620,000.00	1,650,954.96	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,774,243.84	
GOV OF NETHERLANDS	2,200,000.00	2,287,230.00	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	2,131,327.62	
GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,977,950.16	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,103,004.62	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,567,395.20	
GOV OF NETHERLANDS	1,990,000.00	2,175,477.95	
GOV OF NETHERLANDS	1,070,000.00	1,133,660.72	
GOV OF NETHERLANDS	1,610,000.00	1,671,180.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,438,166.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,790,000.00	2,374,313.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,860,000.00	3,075,759.24	
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	881,780.67	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,331,070.00	
GOV OF NETHERLANDS	2,190,000.00	3,921,030.75	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	3,436,533.18	
GOV OF NETHERLANDS	920,000.00	900,250.36	
GOV OF SPAIN	1,940,000.00	1,966,089.12	
GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,470,833.71	
GOV OF SPAIN	2,600,000.00	2,627,469.00	
GOV OF SPAIN	2,690,000.00	2,740,615.04	
GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,878,759.10	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,745,953.44	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,798,060.25	
GOV OF SPAIN	1,880,000.00	1,907,792.04	
GOV OF SPAIN	1,840,000.00	1,883,416.64	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,446,447.90	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,380,020.93	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,385,341.40	

GOV OF SPAIN	2,390,000.00	2,883,989.10	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,680,582.75	
GOV OF SPAIN	1,910,000.00	1,946,268.60	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,194,067.48	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,278,514.02	
GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,334,355.00	
GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,953,698.18	
GOV OF SPAIN	3,140,000.00	3,342,909.94	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,668,207.40	
GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,266,565.00	
GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,547,868.24	
GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,320,392.01	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,465,656.00	
GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,858,555.36	
GOV OF SPAIN	2,730,000.00	3,055,836.42	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,493,871.72	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,000,039.04	
GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,599,707.69	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,178,186.34	
GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,428,458.80	
GOV OF SPAIN	1,210,000.00	1,244,475.32	
GOV OF SPAIN	2,650,000.00	4,242,014.00	
GOV OF SPAIN	2,010,000.00	2,487,865.44	
GOV OF SPAIN	2,340,000.00	2,774,268.90	
GOV OF SPAIN	2,340,000.00	3,622,109.40	
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,184,283.22	
GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,625,591.95	
GOV OF SPAIN	2,130,000.00	2,280,399.30	
GOV OF SPAIN	2,330,000.00	4,027,479.09	
GOV OF SPAIN	1,700,000.00	3,231,217.20	
GOV OF SPAIN	1,970,000.00	2,828,544.51	
GOV OF SPAIN	1,480,000.00	2,071,920.08	
GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,264,962.64	
GOV OF SPAIN	1,660,000.00	2,731,732.52	
GOV OF SPAIN	590,000.00	568,283.28	

	ユーロ 小計	719,440,000.00	846,820,372.21 (109,366,851,070)
英ポンド	UK TREASURY	2,530,000.00	2,574,398.20
	UK TREASURY	3,920,000.00	3,919,423.76
	UK TREASURY	2,330,000.00	2,357,857.48
	UK TREASURY	1,840,000.00	1,919,832.08
	UK TREASURY	3,280,000.00	3,273,604.00
	UK TREASURY	1,750,000.00	1,788,701.25
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,735,096.02
	UK TREASURY	250,000.00	249,982.50
	UK TREASURY	880,000.00	1,029,123.04
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,537,709.50
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,339,025.00
	UK TREASURY	2,160,000.00	2,143,495.44
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,556,387.49
	UK TREASURY	1,230,000.00	1,230,221.40
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,693,220.90
	UK TREASURY	1,480,000.00	1,836,359.13
	UK TREASURY	2,130,000.00	2,089,125.30
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,648,252.73
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,537,437.00
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,634,443.04
	UK TREASURY	2,240,000.00	2,194,335.36
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,969,711.74
	UK TREASURY	2,370,000.00	2,275,602.90
	UK TREASURY	2,060,000.00	2,825,929.82
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,828,050.00
	UK TREASURY	2,870,000.00	2,781,563.82
	UK TREASURY	1,820,000.00	2,675,105.16
	UK TREASURY	2,510,000.00	2,829,093.27
	UK TREASURY	1,710,000.00	2,771,742.42
	UK TREASURY	600,000.00	616,512.00
	UK TREASURY	1,680,000.00	2,615,793.60
	UK TREASURY	1,470,000.00	2,330,922.25
UK TREASURY	2,950,000.00	3,103,621.25	



	UK TREASURY	1,900,000.00	3,201,188.40
	UK TREASURY	2,510,000.00	3,660,545.84
	UK TREASURY	2,030,000.00	3,103,703.54
	UK TREASURY	1,120,000.00	1,089,905.60
	UK TREASURY	1,860,000.00	3,223,321.96
	UK TREASURY	1,660,000.00	1,858,098.59
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,781,067.00
	UK TREASURY	1,260,000.00	2,287,809.21
	UK TREASURY	1,810,000.00	1,652,845.30
	UK TREASURY	1,110,000.00	1,187,975.28
	UK TREASURY	1,350,000.00	2,362,932.00
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,898,847.00
	UK TREASURY	1,700,000.00	3,373,565.00
	UK TREASURY	2,130,000.00	2,686,419.90
	UK TREASURY	1,320,000.00	2,671,437.12
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,324,491.30
	UK TREASURY	1,630,000.00	2,624,626.00
	UK TREASURY	1,690,000.00	3,454,698.00
	UK TREASURY	1,130,000.00	1,539,319.90
	英bond 小計	92,190,000.00	113,894,475.79 (17,282,347,756)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,350,000.00	10,769,989.54
	GOV OF SWEDEN	7,810,000.00	8,616,638.66
	GOV OF SWEDEN	9,470,000.00	10,037,347.70
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,432,945.42
	GOV OF SWEDEN	7,090,000.00	7,500,830.05
	GOV OF SWEDEN	5,340,000.00	5,331,946.21
	GOV OF SWEDEN	3,350,000.00	4,093,281.25
	GOV OF SWEDEN	4,640,000.00	7,025,949.24
	スウェーデンクローナ 小計	53,210,000.00	58,808,928.07 (745,109,118)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	8,740,000.00	8,948,326.64
	GOV OF NORWAY	5,470,000.00	5,765,981.70
	GOV OF NORWAY	5,390,000.00	5,534,371.15
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,444,176.73
	GOV OF NORWAY	7,630,000.00	7,879,501.00

	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,505,123.36	
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,632,680.80	
	GOV OF NORWAY	4,170,000.00	4,206,946.20	
	GOV OF NORWAY	2,900,000.00	2,889,125.00	
	ノルウェークローネ 小計	46,430,000.00	47,806,232.58	(593,753,408)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	8,580,000.00	8,668,727.49	
	GOV OF DENMARK	5,770,000.00	6,045,748.30	
	GOV OF DENMARK	2,600,000.00	2,650,908.00	
	GOV OF DENMARK	7,130,000.00	7,839,064.24	
	GOV OF DENMARK	8,370,000.00	8,869,655.52	
	GOV OF DENMARK	10,730,000.00	11,479,544.15	
	GOV OF DENMARK	3,800,000.00	3,864,383.78	
	GOV OF DENMARK	13,350,000.00	24,331,643.25	
	GOV OF DENMARK	4,170,000.00	4,206,612.60	
	デンマーククローネ 小計	64,500,000.00	77,956,287.33	(1,354,100,710)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,540,460.06	
	GOV OF POLAND	5,650,000.00	5,830,803.95	
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,463,748.00	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,058,130.05	
	GOV OF POLAND	3,560,000.00	3,734,758.61	
	GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,446,081.14	
	GOV OF POLAND	3,860,000.00	4,206,992.38	
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	6,208,795.20	
	GOV OF POLAND	5,090,000.00	5,443,454.69	
	GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,820,231.00	
	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,471,120.00	
	GOV OF POLAND	4,970,000.00	5,443,392.50	
	GOV OF POLAND	3,810,000.00	3,686,276.34	
	ポーランドズロチ 小計	51,190,000.00	54,354,243.92	(1,537,453,272)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	3,100,000.00	3,187,634.50	
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	2,346,971.81	
	GOV OF AUSTRALIA	1,460,000.00	1,565,560.04	

	GOV OF AUSTRALIA	3,100,000.00	3,094,541.51
	GOV OF AUSTRALIA	2,380,000.00	2,628,474.85
	GOV OF AUSTRALIA	2,760,000.00	2,730,056.20
	GOV OF AUSTRALIA	1,850,000.00	2,165,470.32
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,690,684.74
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,376,573.51
	GOV OF AUSTRALIA	2,090,000.00	2,339,328.64
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,116,667.45
	GOV OF AUSTRALIA	1,360,000.00	1,535,426.94
	GOV OF AUSTRALIA	2,390,000.00	2,795,292.13
	GOV OF AUSTRALIA	2,440,000.00	2,773,273.72
	GOV OF AUSTRALIA	3,510,000.00	3,928,095.05
	GOV OF AUSTRALIA	3,750,000.00	3,701,044.50
	GOV OF AUSTRALIA	3,010,000.00	3,099,682.64
	GOV OF AUSTRALIA	3,370,000.00	3,300,127.76
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,069,719.72
	GOV OF AUSTRALIA	1,800,000.00	1,888,231.32
	GOV OF AUSTRALIA	1,440,000.00	1,943,231.61
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,159,282.40
	GOV OF AUSTRALIA	1,290,000.00	1,667,809.91
	GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,380,825.64
	GOV OF AUSTRALIA	1,450,000.00	1,650,364.91
	GOV OF AUSTRALIA	1,540,000.00	1,828,585.36
	GOV OF AUSTRALIA	1,710,000.00	1,577,047.84
	オーストラリアドル 小計	58,740,000.00	63,540,005.02 (5,116,876,604)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	720,000.00	740,807.42
	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,122,517.00
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	950,565.34
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	508,865.00
	GOV OF SINGAPORE	1,090,000.00	1,172,295.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	575,640.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	297,690.00
	GOV OF SINGAPORE	750,000.00	796,537.50
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	988,494.00
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	547,850.00

	GOV OF SINGAPORE	730,000.00	817,746.00	
	GOV OF SINGAPORE	1,010,000.00	1,137,866.00	
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	335,444.90	
	GOV OF SINGAPORE	640,000.00	760,960.00	
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	925,849.65	
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	412,811.10	
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	711,140.00	
	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	803,160.00	
	GOV OF SINGAPORE	740,000.00	748,214.00	
	シンガポールドル 小計	13,280,000.00	14,354,452.91 (1,160,126,884)	
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	823,263.02	
	GOV OF MALAYSIA	1,000,000.00	1,021,074.40	
	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,661,932.51	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,451,990.50	
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	859,975.78	
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,607,403.25	
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,545,261.79	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,322,827.88	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	763,786.00	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,187,865.12	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,623,206.36	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,255,562.33	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,599,854.66	
	GOV OF MALAYSIA	700,000.00	738,699.43	
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,846,008.20	
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,425,719.07	
	GOV OF MALAYSIA	2,130,000.00	2,217,684.00	
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,101,729.60	
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,240,145.16	
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,760,221.72	
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,863,308.43	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,423,701.67	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,190,947.56	
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,097,389.27	

	GOV OF MALAYSIA	1,380,000.00	1,442,157.68	
	GOV OF MALAYSIA	1,290,000.00	1,428,731.63	
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	995,826.51	
	GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,620,225.60	
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	804,382.36	
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,250,150.64	
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,367,400.19	
	GOV OF MALAYSIA	1,500,000.00	1,443,193.35	
	マレーシアリングット 小計	47,190,000.00	48,981,625.67 (1,264,250,045)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	2,110,000.00	2,125,930.50	
	GOV OF ISRAEL	1,120,000.00	1,147,888.00	
	GOV OF ISRAEL	1,910,000.00	2,071,204.00	
	GOV OF ISRAEL	2,310,000.00	2,313,580.50	
	GOV OF ISRAEL	1,820,000.00	1,897,441.00	
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,628,804.00	
	GOV OF ISRAEL	3,390,000.00	3,429,493.50	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,980,484.00	
	GOV OF ISRAEL	400,000.00	405,280.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	2,175,110.00	
	GOV OF ISRAEL	2,100,000.00	2,290,365.00	
	GOV OF ISRAEL	1,990,000.00	2,234,272.50	
	GOV OF ISRAEL	2,770,000.00	2,775,263.00	
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,052,574.50	
	GOV OF ISRAEL	2,000,000.00	3,263,900.00	
	GOV OF ISRAEL	2,790,000.00	3,663,409.50	
		イスラエルシュケル 小計	32,660,000.00	36,455,000.00 (1,242,546,802)
合計			268,092,763,947 (268,092,763,947)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 243銘柄	100.0%	45.2%
カナダドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 343銘柄	100.0%	40.8%
英ポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	718,400,129
株式	58,642,457,810
未収配当金	62,447,369
差入委託証拠金	27,540,000

2021年 8月16日現在

流動資産合計	59,450,845,308
資産合計	59,450,845,308
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,684,800
前受金	2,935,000
未払金	128,591,354
未払解約金	28,040,000
未払利息	1,948
流動負債合計	169,253,102
負債合計	169,253,102
純資産の部	
元本等	
元本	42,508,666,188
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,772,926,018
元本等合計	59,281,592,206
純資産合計	59,281,592,206
負債純資産合計	59,450,845,308

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	34,885,495,332円
期中追加設定元本額	25,448,186,816円
期中一部解約元本額	17,825,015,960円
期末元本額	42,508,666,188円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	4,025,014,651円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,190,994,261円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,012,907,745円
DCりそな グローバルバランス	71,225,210円
つみたてバランスファンド	3,457,121,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	339,916,909円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	183,047,316円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	116,053,508円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	31,202,196円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	20,616,838円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,907,755円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	15,738,548円
リスクコントロール・オープン	10,351,416円
FWりそな国内株式アクティブファンド	278,702,081円
FWりそな国内株式インデックスファンド	21,450,403,369円
Smart-i TOPIXインデックス	1,561,811,955円
Smart-i 8資産バランス 安定型	61,525,411円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	157,901,651円
Smart-i 8資産バランス 成長型	181,521,380円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	290,038,976円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	542,652,211円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	323,415,819円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	236,647,726円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	265,677,898円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	45,873,393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)	5,152,667円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,246,310,790円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	751,399,936円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,084,365,755円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	539,849,640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)	85,626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)	93,608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)	138,017円
2. 計算日における受益権の総数	42,508,666,188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	1.3946円
(10,000口当たり純資産額)	(13,946円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在



## 1.金融商品に対する取組方針

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

## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2.時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

2021年 8月16日現在

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,194,464,050
合計		1,194,464,050

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

## (株式関連)

(2021年 8月16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	701,604,800	-	691,920,000	9,684,800
合計		701,604,800	-	691,920,000	9,684,800

(注) 時価の算定方法

## 先物取引

## 国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,000	3,000.00	3,000,000	
日本水産	28,000	578.00	16,184,000	

マルハニチロ	4,700	2,351.00	11,049,700	
雪国まいたけ	2,500	1,593.00	3,982,500	
カネコ種苗	900	1,481.00	1,332,900	
サカタのタネ	3,600	3,625.00	13,050,000	
ホクト	2,500	1,895.00	4,737,500	
ホクリヨウ	500	739.00	369,500	
住石ホールディングス	5,200	132.00	686,400	
日鉄鉱業	700	6,640.00	4,648,000	
三井松島ホールディングス	1,300	1,182.00	1,536,600	
I N P E X	121,100	779.00	94,336,900	
石油資源開発	3,900	1,822.00	7,105,800	
K & O エナジーグループ	1,500	1,301.00	1,951,500	
ヒノキヤグループ	700	2,284.00	1,598,800	
ショーボンドホールディングス	4,300	4,840.00	20,812,000	
ミライト・ホールディングス	10,500	2,075.00	21,787,500	
タマホーム	1,800	2,370.00	4,266,000	
サンヨーホームズ	300	720.00	216,000	
日本アクア	1,200	547.00	656,400	
ファーストコーポレーション	900	762.00	685,800	
ベステラ	600	1,446.00	867,600	
Robot Home	5,000	194.00	970,000	
キャンディル	500	580.00	290,000	
スペースバリューホールディングス	3,700	811.00	3,000,700	
ダイセキ環境ソリューション	600	1,200.00	720,000	
第一カッター興業	700	1,271.00	889,700	
安藤・間	19,400	821.00	15,927,400	
東急建設	8,800	746.00	6,564,800	
コムシスホールディングス	10,700	2,980.00	31,886,000	
ビーアールホールディングス	4,000	484.00	1,936,000	
高松コンストラクショングループ	1,900	2,023.00	3,843,700	
東建コーポレーション	900	10,040.00	9,036,000	
ソネック	300	1,167.00	350,100	
ヤマウラ	1,300	940.00	1,222,000	
オリエンタル白石	10,100	274.00	2,767,400	
大成建設	21,700	3,580.00	77,686,000	
大林組	69,700	922.00	64,263,400	

清水建設	65,300	822.00	53,676,600
飛島建設	2,000	1,080.00	2,160,000
長谷工コーポレーション	22,800	1,503.00	34,268,400
松井建設	2,700	774.00	2,089,800
銭高組	300	4,025.00	1,207,500
鹿島建設	51,100	1,435.00	73,328,500
不動テトラ	1,700	1,747.00	2,969,900
大末建設	900	971.00	873,900
鉄建建設	1,400	1,813.00	2,538,200
西松建設	5,000	3,395.00	16,975,000
三井住友建設	16,800	471.00	7,912,800
大豊建設	1,500	4,040.00	6,060,000
前田建設工業	17,500	830.00	14,525,000
佐田建設	1,600	477.00	763,200
ナカノフドー建設	1,700	364.00	618,800
奥村組	3,800	2,990.00	11,362,000
東鉄工業	3,000	2,395.00	7,185,000
イチケン	500	1,899.00	949,500
富士ピー・エス	900	568.00	511,200
浅沼組	800	4,465.00	3,572,000
戸田建設	28,900	776.00	22,426,400
熊谷組	3,200	2,727.00	8,726,400
北野建設	400	2,234.00	893,600
植木組	600	1,493.00	895,800
矢作建設工業	3,100	706.00	2,188,600
ピーエス三菱	2,300	650.00	1,495,000
日本ハウスホールディングス	4,800	404.00	1,939,200
大東建託	7,600	12,110.00	92,036,000
新日本建設	3,000	822.00	2,466,000
N I P P O	5,800	3,035.00	17,603,000
東亜道路工業	400	4,525.00	1,810,000
前田道路	4,300	1,885.00	8,105,500
日本道路	700	8,060.00	5,642,000
東亜建設工業	1,900	2,290.00	4,351,000
日本国土開発	6,800	567.00	3,855,600
若築建設	1,300	1,899.00	2,468,700

東洋建設	7,800	552.00	4,305,600	
五洋建設	29,600	690.00	20,424,000	
世紀東急工業	3,300	835.00	2,755,500	
福田組	700	4,800.00	3,360,000	
住友林業	17,800	2,012.00	35,813,600	
日本基礎技術	2,100	607.00	1,274,700	
巴コーポレーション	3,100	405.00	1,255,500	
大和ハウス工業	64,400	3,324.00	214,065,600	
ライト工業	4,000	1,913.00	7,652,000	
積水ハウス	75,600	2,158.50	163,182,600	
日特建設	1,700	737.00	1,252,900	
北陸電気工事	1,200	1,199.00	1,438,800	
ユアテック	4,000	685.00	2,740,000	
日本リーテック	1,500	1,600.00	2,400,000	
四電工	400	3,220.00	1,288,000	
中電工	3,200	2,232.00	7,142,400	
関電工	11,300	930.00	10,509,000	
きんでん	14,200	1,790.00	25,418,000	
東京エネシス	2,300	1,011.00	2,325,300	
トーエネック	700	3,615.00	2,530,500	
住友電設	2,000	2,020.00	4,040,000	
日本電設工業	3,800	1,806.00	6,862,800	
協和エクシオ	10,600	2,689.00	28,503,400	
新日本空調	1,800	2,274.00	4,093,200	
九電工	4,900	3,795.00	18,595,500	
三機工業	4,900	1,458.00	7,144,200	
日揮ホールディングス	23,300	944.00	21,995,200	
中外炉工業	800	1,820.00	1,456,000	
ヤマト	2,200	752.00	1,654,400	
太平電業	1,500	2,653.00	3,979,500	
高砂熱学工業	6,300	1,993.00	12,555,900	
三晃金属工業	300	2,205.00	661,500	
朝日工業社	500	3,310.00	1,655,000	
明星工業	4,500	747.00	3,361,500	
大気社	3,400	3,390.00	11,526,000	
ダイダン	1,500	2,627.00	3,940,500	

日比谷総合設備	2,200	1,864.00	4,100,800
フィル・カンパニー	400	2,807.00	1,122,800
テスホールディングス	1,300	1,897.00	2,466,100
東洋エンジニアリング	2,900	1,031.00	2,989,900
レイズネクスト	3,700	1,091.00	4,036,700
ニッポン	6,500	1,608.00	10,452,000
日清製粉グループ本社	25,200	1,768.00	44,553,600
日東富士製粉	200	6,700.00	1,340,000
昭和産業	1,900	2,814.00	5,346,600
鳥越製粉	2,000	794.00	1,588,000
中部飼料	2,700	1,104.00	2,980,800
フィード・ワン	3,000	737.00	2,211,000
東洋精糖	400	1,184.00	473,600
日本甜菜製糖	1,200	1,626.00	1,951,200
D M三井製糖ホールディングス	1,800	1,953.00	3,515,400
塩水港精糖	2,600	220.00	572,000
日新製糖	1,100	1,693.00	1,862,300
森永製菓	5,200	3,895.00	20,254,000
中村屋	500	3,750.00	1,875,000
江崎グリコ	6,100	4,090.00	24,949,000
名糖産業	1,000	1,667.00	1,667,000
井村屋グループ	1,300	2,256.00	2,932,800
不二家	1,200	2,238.00	2,685,600
山崎製パン	16,700	1,617.00	27,003,900
第一屋製パン	400	857.00	342,800
モロゾフ	400	5,370.00	2,148,000
亀田製菓	1,300	4,510.00	5,863,000
寿スピリッツ	2,100	6,370.00	13,377,000
カルビー	10,200	2,594.00	26,458,800
森永乳業	4,100	6,870.00	28,167,000
六甲バター	1,600	1,550.00	2,480,000
ヤクルト本社	15,300	6,520.00	99,756,000
明治ホールディングス	14,700	6,600.00	97,020,000
雪印メグミルク	5,400	2,245.00	12,123,000
プリマハム	3,100	2,933.00	9,092,300
日本ハム	8,500	4,150.00	35,275,000

林兼産業	700	580.00	406,000	
丸大食品	2,200	1,731.00	3,808,200	
S Foods	2,000	3,250.00	6,500,000	
柿安本店	800	2,490.00	1,992,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	14,400	738.00	10,627,200	
サッポロホールディングス	7,600	2,309.00	17,548,400	
アサヒグループホールディングス	52,500	5,056.00	265,440,000	
キリンホールディングス	82,000	1,917.50	157,235,000	
宝ホールディングス	16,500	1,342.00	22,143,000	
オエノンホールディングス	6,300	368.00	2,318,400	
養命酒製造	700	1,791.00	1,253,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	15,700	1,490.00	23,393,000	
サントリー食品インターナショナル	14,900	4,180.00	62,282,000	
ダイドーグループホールディングス	1,300	5,330.00	6,929,000	
伊藤園	6,800	6,570.00	44,676,000	
キーコーヒー	2,200	2,138.00	4,703,600	
ユニカフェ	700	995.00	696,500	
ジャパンフーズ	300	1,223.00	366,900	
日清オイリオグループ	2,800	3,015.00	8,442,000	
不二製油グループ本社	5,400	2,436.00	13,154,400	
かどや製油	200	3,990.00	798,000	
J - オイルミルズ	2,100	1,790.00	3,759,000	
キッコーマン	16,100	7,010.00	112,861,000	
味の素	53,100	2,992.50	158,901,750	
ブルドックソース	1,000	2,056.00	2,056,000	
キューピー	12,400	2,469.00	30,615,600	
ハウス食品グループ本社	8,300	3,300.00	27,390,000	
カゴメ	8,500	2,850.00	24,225,000	
焼津水産化学工業	1,100	953.00	1,048,300	
アリアケジャパン	2,000	6,070.00	12,140,000	
ピエトロ	300	1,737.00	521,100	
エバラ食品工業	500	2,570.00	1,285,000	
やまみ	200	2,029.00	405,800	
ニチレイ	10,600	2,562.00	27,157,200	
東洋水産	11,500	4,120.00	47,380,000	

イトアンドホールディングス	800	2,046.00	1,636,800	
大冷	200	1,975.00	395,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,200	741.00	889,200	
日清食品ホールディングス	8,800	7,990.00	70,312,000	
永谷園ホールディングス	1,100	2,096.00	2,305,600	
一正蒲鉾	900	906.00	815,400	
フジッコ	2,400	1,903.00	4,567,200	
ロック・フィールド	2,400	1,466.00	3,518,400	
日本たばこ産業	119,600	2,148.50	256,960,600	
ケンコーマヨネーズ	1,400	1,508.00	2,111,200	
わらべや日洋ホールディングス	1,500	2,174.00	3,261,000	
なとり	1,200	1,933.00	2,319,600	
イフジ産業	300	950.00	285,000	
ピクルスコーポレーション	500	3,540.00	1,770,000	
ファーマフーズ	2,100	2,841.00	5,966,100	
北の達人コーポレーション	7,800	519.00	4,048,200	
ユーグレナ	11,400	938.00	10,693,200	
紀文食品	1,300	1,250.00	1,625,000	
ミヨシ油脂	900	1,256.00	1,130,400	
理研ビタミン	2,100	1,763.00	3,702,300	
片倉工業	2,400	1,461.00	3,506,400	
グンゼ	1,600	4,500.00	7,200,000	
東洋紡	8,600	1,378.00	11,850,800	
ユニチカ	6,400	342.00	2,188,800	
富士紡ホールディングス	1,100	4,040.00	4,444,000	
倉敷紡績	1,900	1,959.00	3,722,100	
シキボウ	1,200	931.00	1,117,200	
日本毛織	6,600	970.00	6,402,000	
ダイトウボウ	3,400	101.00	343,400	
トーア紡コーポレーション	800	429.00	343,200	
ダイドーリミテッド	2,800	173.00	484,400	
帝国繊維	2,500	1,916.00	4,790,000	
帝人	20,500	1,618.00	33,169,000	
東レ	157,600	730.00	115,048,000	
サカイオーベックス	600	3,805.00	2,283,000	
住江織物	500	1,871.00	935,500	



日本フェルト	1,200	451.00	541,200	
イチカワ	300	1,326.00	397,800	
日東製網	200	1,505.00	301,000	
アツギ	1,700	628.00	1,067,600	
ダイニック	800	743.00	594,400	
セーレン	5,400	2,030.00	10,962,000	
ソトー	900	792.00	712,800	
東海染工	300	1,117.00	335,100	
小松マテーレ	3,600	958.00	3,448,800	
ワコールホールディングス	5,400	2,395.00	12,933,000	
ホギメディカル	2,900	3,395.00	9,845,500	
クラウディアホールディングス	500	286.00	143,000	
T S Iホールディングス	6,600	338.00	2,230,800	
マツオカコーポレーション	700	1,473.00	1,031,100	
ワールド	2,800	1,346.00	3,768,800	
三陽商会	1,100	841.00	925,100	
ナイガイ	800	334.00	267,200	
オンワードホールディングス	13,100	292.00	3,825,200	
ルックホールディングス	700	1,282.00	897,400	
キムラタン	11,600	23.00	266,800	
ゴールドウイン	3,600	6,520.00	23,472,000	
デサント	3,700	3,435.00	12,709,500	
キング	1,200	484.00	580,800	
ヤマトインターナショナル	1,900	338.00	642,200	
特種東海製紙	1,300	4,565.00	5,934,500	
王子ホールディングス	98,000	603.00	59,094,000	
日本製紙	9,600	1,265.00	12,144,000	
三菱製紙	3,100	350.00	1,085,000	
北越コーポレーション	15,600	600.00	9,360,000	
中越パルプ工業	800	1,201.00	960,800	
巴川製紙所	700	882.00	617,400	
大王製紙	10,500	1,997.00	20,968,500	
阿波製紙	600	391.00	234,600	
レンゴー	22,400	926.00	20,742,400	
トーモク	1,300	1,870.00	2,431,000	
ザ・バック	1,600	2,896.00	4,633,600	

クラレ	31,800	1,040.00	33,072,000	
旭化成	144,300	1,172.00	169,119,600	
共和レザー	1,200	688.00	825,600	
昭和電工	15,500	3,280.00	50,840,000	
住友化学	171,300	558.00	95,585,400	
住友精化	1,100	3,490.00	3,839,000	
日産化学	11,900	5,420.00	64,498,000	
ラサ工業	700	1,814.00	1,269,800	
クレハ	1,900	7,570.00	14,383,000	
多木化学	800	5,960.00	4,768,000	
テイカ	1,600	1,267.00	2,027,200	
石原産業	3,900	1,254.00	4,890,600	
片倉コープアグリ	600	1,200.00	720,000	
日本曹達	3,000	3,460.00	10,380,000	
東ソー	33,600	1,922.00	64,579,200	
トクヤマ	6,500	2,317.00	15,060,500	
セントラル硝子	4,200	2,150.00	9,030,000	
東亜合成	12,400	1,202.00	14,904,800	
大阪ソーダ	2,200	2,519.00	5,541,800	
関東電化工業	5,200	1,062.00	5,522,400	
デンカ	7,900	3,785.00	29,901,500	
信越化学工業	40,300	17,590.00	708,877,000	
日本カーバイド工業	800	1,297.00	1,037,600	
堺化学工業	1,500	2,076.00	3,114,000	
第一稀元素化学工業	2,200	1,712.00	3,766,400	
エア・ウォーター	22,200	1,802.00	40,004,400	
日本酸素ホールディングス	17,900	2,530.00	45,287,000	
日本化学工業	600	3,510.00	2,106,000	
東邦アセチレン	300	1,285.00	385,500	
日本パーカライジング	11,000	1,136.00	12,496,000	
高压ガス工業	3,500	720.00	2,520,000	
チタン工業	300	1,790.00	537,000	
四国化成工業	2,800	1,274.00	3,567,200	
戸田工業	500	3,405.00	1,702,500	
ステラ ケミファ	1,200	2,785.00	3,342,000	
保土谷化学工業	600	4,515.00	2,709,000	

日本触媒	3,900	5,780.00	22,542,000	
大日精化工業	1,800	2,429.00	4,372,200	
カネカ	5,600	4,365.00	24,444,000	
三菱瓦斯化学	21,800	2,104.00	45,867,200	
三井化学	18,800	3,760.00	70,688,000	
J S R	21,800	3,535.00	77,063,000	
東京応化工業	3,700	7,030.00	26,011,000	
大阪有機化学工業	1,900	3,610.00	6,859,000	
三菱ケミカルホールディングス	145,500	936.70	136,289,850	
K Hネオケム	3,600	2,888.00	10,396,800	
ダイセル	29,300	883.00	25,871,900	
住友ベークライト	3,400	4,840.00	16,456,000	
積水化学工業	45,500	1,908.00	86,814,000	
日本ゼオン	19,600	1,521.00	29,811,600	
アイカ工業	6,100	3,635.00	22,173,500	
宇部興産	11,000	2,213.00	24,343,000	
積水樹脂	3,300	2,137.00	7,052,100	
タキロンシーアイ	4,700	608.00	2,857,600	
旭有機材	1,200	1,419.00	1,702,800	
ニチバン	1,100	1,777.00	1,954,700	
リケンテクノス	5,300	574.00	3,042,200	
大倉工業	1,100	2,250.00	2,475,000	
積水化成成品工業	2,900	583.00	1,690,700	
群栄化学工業	500	2,588.00	1,294,000	
タイガースポリマー	1,100	438.00	481,800	
ミライアル	700	1,245.00	871,500	
ダイキアクシス	800	863.00	690,400	
ダイキョーニシカワ	4,600	679.00	3,123,400	
竹本容器	800	919.00	735,200	
森六ホールディングス	1,200	2,077.00	2,492,400	
恵和	500	3,840.00	1,920,000	
日本化薬	13,500	1,203.00	16,240,500	
カーリットホールディングス	2,200	824.00	1,812,800	
日本精化	1,600	1,897.00	3,035,200	
扶桑化学工業	1,700	4,220.00	7,174,000	
トリケミカル研究所	2,000	3,230.00	6,460,000	

A D E K A	10,000	2,301.00	23,010,000	
日油	8,200	6,050.00	49,610,000	
新日本理化	3,600	273.00	982,800	
ハリマ化成グループ	1,600	900.00	1,440,000	
花王	49,200	6,640.00	326,688,000	
第一工業製薬	700	3,280.00	2,296,000	
石原ケミカル	500	2,529.00	1,264,500	
日華化学	700	1,038.00	726,600	
ニイタカ	500	2,183.00	1,091,500	
三洋化成工業	1,300	5,980.00	7,774,000	
有機合成薬品工業	1,700	324.00	550,800	
大日本塗料	2,500	850.00	2,125,000	
日本ペイントホールディングス	81,800	1,341.00	109,693,800	
関西ペイント	24,500	2,780.00	68,110,000	
神東塗料	1,700	191.00	324,700	
中国塗料	5,200	916.00	4,763,200	
日本特殊塗料	1,600	1,026.00	1,641,600	
藤倉化成	2,900	520.00	1,508,000	
太陽ホールディングス	1,600	5,770.00	9,232,000	
D I C	9,200	2,982.00	27,434,400	
サカタインクス	4,300	1,129.00	4,854,700	
東洋インキS Cホールディングス	4,600	2,017.00	9,278,200	
T & K T O K A	1,500	815.00	1,222,500	
富士フイルムホールディングス	39,100	8,517.00	333,014,700	
資生堂	41,400	7,424.00	307,353,600	
ライオン	26,800	1,802.00	48,293,600	
高砂香料工業	1,400	2,837.00	3,971,800	
マンダム	4,700	1,671.00	7,853,700	
ミルボン	2,700	6,570.00	17,739,000	
ファンケル	8,100	3,585.00	29,038,500	
コーセー	4,200	13,870.00	58,254,000	
コタ	1,400	1,543.00	2,160,200	
シーボン	300	1,920.00	576,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,500	2,559.00	24,310,500	
ノエビアホールディングス	1,900	5,670.00	10,773,000	
アジュバンコスメジャパン	500	1,053.00	526,500	

新日本製薬	600	1,819.00	1,091,400	
エステー	1,400	1,730.00	2,422,000	
アグロ カネショウ	700	1,384.00	968,800	
コニシ	3,700	1,631.00	6,034,700	
長谷川香料	3,800	2,680.00	10,184,000	
星光P M C	1,300	869.00	1,129,700	
小林製薬	6,200	8,350.00	51,770,000	
荒川化学工業	1,900	1,247.00	2,369,300	
メック	1,700	3,300.00	5,610,000	
日本高純度化学	600	2,859.00	1,715,400	
タカラバイオ	5,800	2,950.00	17,110,000	
J C U	2,500	3,925.00	9,812,500	
新田ゼラチン	1,400	625.00	875,000	
O A Tアグリオ	500	1,589.00	794,500	
デクセリアルズ	6,200	2,128.00	13,193,600	
アース製薬	1,800	6,260.00	11,268,000	
北興化学工業	2,100	1,029.00	2,160,900	
大成ラミック	700	2,800.00	1,960,000	
クミアイ化学工業	8,300	839.00	6,963,700	
日本農薬	4,000	524.00	2,096,000	
アキレス	1,500	1,337.00	2,005,500	
有沢製作所	3,100	921.00	2,855,100	
日東電工	13,400	8,230.00	110,282,000	
レック	2,600	1,093.00	2,841,800	
三光合成	2,300	465.00	1,069,500	
きもと	3,400	242.00	822,800	
藤森工業	2,000	4,165.00	8,330,000	
前澤化成工業	1,400	1,238.00	1,733,200	
未来工業	800	1,641.00	1,312,800	
ウェーブロックホールディングス	800	682.00	545,600	
J S P	1,300	1,620.00	2,106,000	
エフピコ	4,100	4,235.00	17,363,500	
天馬	1,700	2,674.00	4,545,800	
信越ポリマー	3,400	994.00	3,379,600	
東リ	5,500	236.00	1,298,000	
ニフコ	8,200	3,510.00	28,782,000	

バルカー	1,800	2,136.00	3,844,800	
ユニ・チャーム	42,800	4,692.00	200,817,600	
ショーエイコーポレーション	500	788.00	394,000	
協和キリン	26,100	3,425.00	89,392,500	
武田薬品工業	184,900	3,638.00	672,666,200	
アステラス製薬	192,700	1,747.00	336,646,900	
大日本住友製薬	16,500	1,909.00	31,498,500	
塩野義製薬	28,000	6,481.00	181,468,000	
わかもと製薬	2,600	311.00	808,600	
日本新薬	6,300	8,350.00	52,605,000	
中外製薬	69,500	4,016.00	279,112,000	
科研製薬	3,800	4,995.00	18,981,000	
エーザイ	24,600	9,032.00	222,187,200	
ロート製薬	10,600	3,250.00	34,450,000	
小野薬品工業	51,000	2,480.50	126,505,500	
久光製薬	6,500	4,465.00	29,022,500	
持田製薬	3,100	3,490.00	10,819,000	
参天製薬	38,700	1,584.00	61,300,800	
扶桑薬品工業	700	2,349.00	1,644,300	
日本ケミファ	300	2,200.00	660,000	
ツムラ	7,400	3,640.00	26,936,000	
日医工	6,300	836.00	5,266,800	
キッセイ薬品工業	3,900	2,318.00	9,040,200	
生化学工業	3,900	1,088.00	4,243,200	
栄研化学	3,900	2,134.00	8,322,600	
日水製薬	800	1,005.00	804,000	
鳥居薬品	1,200	2,724.00	3,268,800	
JCRファーマ	6,300	2,946.00	18,559,800	
東和薬品	3,200	3,080.00	9,856,000	
富士製薬工業	1,400	1,121.00	1,569,400	
ゼリア新薬工業	4,000	2,074.00	8,296,000	
第一三共	174,700	2,350.00	410,545,000	
キョーリン製薬ホールディングス	4,900	1,815.00	8,893,500	
大幸薬品	3,400	912.00	3,100,800	
ダイト	1,400	3,375.00	4,725,000	
大塚ホールディングス	46,200	4,632.00	213,998,400	

大正製薬ホールディングス	5,500	6,030.00	33,165,000	
ペプチドリーム	11,700	4,125.00	48,262,500	
あすか製薬ホールディングス	2,500	981.00	2,452,500	
サワイグループホールディングス	4,900	4,875.00	23,887,500	
日本コークス工業	18,700	116.00	2,169,200	
ニチレキ	2,600	1,248.00	3,244,800	
ユシロ化学工業	1,200	1,200.00	1,440,000	
ビーピー・カストロール	800	1,350.00	1,080,000	
富士石油	5,400	234.00	1,263,600	
MORESCO	800	1,152.00	921,600	
出光興産	24,700	2,592.00	64,022,400	
ENEOSホールディングス	334,300	445.00	148,763,500	
コスモエネルギーホールディングス	7,000	2,435.00	17,045,000	
横浜ゴム	12,900	2,017.00	26,019,300	
TOYO TIRE	11,700	2,021.00	23,645,700	
ブリヂストン	64,000	5,084.00	325,376,000	
住友ゴム工業	20,000	1,374.00	27,480,000	
藤倉コンポジット	1,900	635.00	1,206,500	
オカモト	1,300	4,125.00	5,362,500	
フコク	1,000	1,044.00	1,044,000	
ニッタ	2,300	2,685.00	6,175,500	
住友理工	4,300	713.00	3,065,900	
三ツ星ベルト	2,700	1,896.00	5,119,200	
バンドー化学	3,900	930.00	3,627,000	
日東紡績	3,300	3,215.00	10,609,500	
A G C	20,400	4,895.00	99,858,000	
日本板硝子	11,300	558.00	6,305,400	
石塚硝子	400	1,968.00	787,200	
日本山村硝子	900	930.00	837,000	
日本電気硝子	8,900	2,384.00	21,217,600	
オハラ	900	1,311.00	1,179,900	
住友大阪セメント	4,000	3,075.00	12,300,000	
太平洋セメント	12,600	2,632.00	33,163,200	
日本ヒューム	2,000	733.00	1,466,000	
日本コンクリート工業	4,800	299.00	1,435,200	
三谷セキサン	1,000	4,805.00	4,805,000	

アジアパイルホールディングス	3,400	476.00	1,618,400	
東海カーボン	18,600	1,616.00	30,057,600	
日本カーボン	1,100	4,290.00	4,719,000	
東洋炭素	1,400	2,789.00	3,904,600	
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	4,150.00	4,980,000	
TOTO	15,900	5,800.00	92,220,000	
日本碍子	24,500	1,782.00	43,659,000	
日本特殊陶業	16,900	1,656.00	27,986,400	
ダントーホールディングス	1,400	242.00	338,800	
MARUWA	800	10,480.00	8,384,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,015.00	2,007,500	
黒崎播磨	400	4,930.00	1,972,000	
ヨータイ	1,600	1,230.00	1,968,000	
イソライト工業	1,000	663.00	663,000	
東京窯業	2,800	326.00	912,800	
ニッカトー	1,000	663.00	663,000	
フジミインコーポレーテッド	1,800	5,800.00	10,440,000	
クニミネ工業	700	1,103.00	772,100	
エーアンドエーマテリアル	400	995.00	398,000	
ニチアス	5,600	2,800.00	15,680,000	
ニチハ	3,100	2,966.00	9,194,600	
日本製鉄	104,900	2,192.00	229,940,800	
神戸製鋼所	40,200	728.00	29,265,600	
中山製鋼所	3,000	432.00	1,296,000	
合同製鐵	1,200	1,526.00	1,831,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	63,600	1,676.00	106,593,600	
東京製鐵	8,600	1,185.00	10,191,000	
共英製鋼	2,500	1,489.00	3,722,500	
大和工業	4,700	4,060.00	19,082,000	
東京鐵鋼	800	1,567.00	1,253,600	
大阪製鐵	1,200	1,231.00	1,477,200	
淀川製鋼所	2,900	2,357.00	6,835,300	
丸一鋼管	7,100	2,657.00	18,864,700	
モリ工業	600	2,334.00	1,400,400	
大同特殊鋼	3,600	5,170.00	18,612,000	
日本高周波鋼業	800	410.00	328,000	



日本冶金工業	1,700	2,846.00	4,838,200
山陽特殊製鋼	2,600	1,783.00	4,635,800
愛知製鋼	1,200	2,804.00	3,364,800
日立金属	19,400	2,124.00	41,205,600
日本金属	600	1,021.00	612,600
大太平洋金属	1,500	1,653.00	2,479,500
新日本電工	14,200	324.00	4,600,800
栗本鐵工所	1,000	1,624.00	1,624,000
虹技	300	1,101.00	330,300
日本鑄鉄管	200	1,180.00	236,000
三菱製鋼	1,600	1,495.00	2,392,000
日垂鋼業	3,200	291.00	931,200
日本精線	300	5,200.00	1,560,000
エンビプロ・ホールディングス	900	1,608.00	1,447,200
シンニッタン	2,600	248.00	644,800
新家工業	500	1,542.00	771,000
大紀アルミニウム工業所	3,300	1,465.00	4,834,500
日本軽金属ホールディングス	6,000	1,942.00	11,652,000
三井金属鉱業	5,900	3,535.00	20,856,500
東邦亜鉛	1,200	2,094.00	2,512,800
三菱マテリアル	14,500	2,342.00	33,959,000
住友金属鉱山	28,100	4,262.00	119,762,200
DOWAホールディングス	5,600	4,785.00	26,796,000
古河機械金属	3,600	1,256.00	4,521,600
エス・サイエンス	10,000	34.00	340,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,300	826.00	1,899,800
東邦チタニウム	3,900	1,179.00	4,598,100
UACJ	3,300	2,829.00	9,335,700
CKサンエツ	500	3,200.00	1,600,000
古河電気工業	6,800	2,492.00	16,945,600
住友電気工業	76,700	1,498.00	114,896,600
フジクラ	26,500	600.00	15,900,000
昭和電線ホールディングス	2,100	2,041.00	4,286,100
東京特殊電線	300	2,683.00	804,900
タツタ電線	3,900	528.00	2,059,200
カナレ電気	300	1,695.00	508,500

平河ヒューテック	1,200	1,168.00	1,401,600	
リョービ	2,700	1,360.00	3,672,000	
アーレスティ	2,700	449.00	1,212,300	
アサヒホールディングス	8,300	2,122.00	17,612,600	
稲葉製作所	1,200	1,404.00	1,684,800	
宮地エンジニアリンググループ	700	2,534.00	1,773,800	
トーカロ	5,700	1,322.00	7,535,400	
アルファC o	800	1,210.00	968,000	
SUMCO	28,000	2,268.00	63,504,000	
川田テクノロジーズ	400	3,765.00	1,506,000	
RS Technologies	700	5,360.00	3,752,000	
ジェイテックコーポレーション	200	2,861.00	572,200	
信和	1,200	723.00	867,600	
東洋製罐グループホールディングス	14,000	1,531.00	21,434,000	
ホッカンホールディングス	1,100	1,449.00	1,593,900	
コロナ	1,200	908.00	1,089,600	
横河ブリッジホールディングス	3,800	2,090.00	7,942,000	
駒井ハルテック	400	1,655.00	662,000	
高田機工	200	2,766.00	553,200	
三和ホールディングス	20,700	1,397.00	28,917,900	
文化シャッター	6,500	1,115.00	7,247,500	
三協立山	2,800	739.00	2,069,200	
アルインコ	1,500	998.00	1,497,000	
東洋シャッター	500	640.00	320,000	
LIXIL	30,300	3,160.00	95,748,000	
日本フィルコン	1,500	499.00	748,500	
ノーリツ	4,200	1,830.00	7,686,000	
長府製作所	2,200	1,999.00	4,397,800	
リンナイ	4,300	10,980.00	47,214,000	
ダイニチ工業	1,100	768.00	844,800	
日東精工	2,800	673.00	1,884,400	
三洋工業	300	1,852.00	555,600	
岡部	4,500	653.00	2,938,500	
ジーテクト	2,700	1,464.00	3,952,800	
東プレ	4,100	1,449.00	5,940,900	
高周波熱錬	4,200	631.00	2,650,200	

東京製綱	1,600	996.00	1,593,600
サンコール	1,900	452.00	858,800
モリテック スチール	1,700	453.00	770,100
パイオラックス	3,300	1,523.00	5,025,900
エイチワン	2,200	707.00	1,555,400
日本発條	21,900	838.00	18,352,200
中央発條	1,100	1,094.00	1,203,400
アドバネクス	300	1,200.00	360,000
立川ブラインド工業	1,000	1,302.00	1,302,000
三益半導体工業	1,700	2,285.00	3,884,500
日本ドライケミカル	500	1,870.00	935,000
日本製綱所	6,700	2,650.00	17,755,000
三浦工業	9,500	4,880.00	46,360,000
タクマ	7,400	1,652.00	12,224,800
ツガミ	4,600	1,551.00	7,134,600
オークマ	2,600	5,150.00	13,390,000
芝浦機械	2,300	2,619.00	6,023,700
アマダ	32,200	1,106.00	35,613,200
アイダエンジニアリング	5,800	1,037.00	6,014,600
滝澤鉄工所	600	1,133.00	679,800
F U J I	8,800	2,780.00	24,464,000
牧野フライス製作所	2,600	4,100.00	10,660,000
オーエスジー	10,200	1,961.00	20,002,200
ダイジェット工業	200	1,209.00	241,800
旭ダイヤモンド工業	5,800	522.00	3,027,600
D M G 森精機	13,000	1,836.00	23,868,000
ソディック	4,900	992.00	4,860,800
ディスコ	3,000	31,200.00	93,600,000
日東工器	1,100	1,909.00	2,099,900
日進工具	1,700	1,427.00	2,425,900
パンチ工業	1,800	550.00	990,000
富士ダイス	1,100	653.00	718,300
豊和工業	1,200	845.00	1,014,000
O K K	800	409.00	327,200
石川製作所	600	1,701.00	1,020,600
東洋機械金属	1,600	484.00	774,400

津田駒工業	400	864.00	345,600
エンシュウ	500	838.00	419,000
島精機製作所	3,200	2,019.00	6,460,800
オプトラン	2,800	2,155.00	6,034,000
NCホールディングス	700	1,189.00	832,300
イワキポンプ	1,400	885.00	1,239,000
フリュー	2,100	1,611.00	3,383,100
ヤマシンフィルタ	4,400	640.00	2,816,000
日阪製作所	2,700	812.00	2,192,400
やまびこ	4,300	1,246.00	5,357,800
野村マイクロ・サイエンス	500	4,890.00	2,445,000
平田機工	1,000	6,340.00	6,340,000
ペガサスミシン製造	2,200	452.00	994,400
マルマエ	900	1,986.00	1,787,400
タツモ	1,000	1,483.00	1,483,000
ナブテスコ	13,000	4,375.00	56,875,000
三井海洋開発	2,300	1,699.00	3,907,700
レオン自動機	2,200	1,522.00	3,348,400
S M C	6,500	69,520.00	451,880,000
ホソカワミクロン	800	6,590.00	5,272,000
ユニオンツール	800	3,955.00	3,164,000
オイレス工業	3,100	1,600.00	4,960,000
日精エー・エス・ビー機械	700	4,370.00	3,059,000
サトーホールディングス	2,900	2,727.00	7,908,300
技研製作所	1,900	4,490.00	8,531,000
日本エアータック	1,000	1,138.00	1,138,000
カワタ	600	885.00	531,000
日精樹脂工業	1,700	1,207.00	2,051,900
オカダアイヨン	700	1,382.00	967,400
ワイエイシイホールディングス	900	919.00	827,100
小松製作所	100,700	2,743.50	276,270,450
住友重機械工業	12,700	3,010.00	38,227,000
日立建機	10,400	3,065.00	31,876,000
日工	3,300	679.00	2,240,700
巴工業	900	2,277.00	2,049,300
井関農機	2,100	1,694.00	3,557,400

T O W A	2,100	2,654.00	5,573,400	
丸山製作所	500	1,652.00	826,000	
北川鉄工所	1,000	1,601.00	1,601,000	
ローツェ	1,000	7,960.00	7,960,000	
タカキタ	800	596.00	476,800	
クボタ	108,400	2,227.00	241,406,800	
荏原実業	1,000	2,557.00	2,557,000	
三菱化工機	700	2,362.00	1,653,400	
月島機械	4,100	1,153.00	4,727,300	
帝国電機製作所	1,600	1,264.00	2,022,400	
東京機械製作所	900	1,067.00	960,300	
新東工業	5,300	783.00	4,149,900	
澁谷工業	1,900	2,908.00	5,525,200	
アイチ コーポレーション	3,800	765.00	2,907,000	
小森コーポレーション	5,600	828.00	4,636,800	
鶴見製作所	1,700	1,713.00	2,912,100	
住友精密工業	300	2,457.00	737,100	
日本ギア工業	900	316.00	284,400	
酒井重工業	400	2,471.00	988,400	
荏原製作所	9,200	5,800.00	53,360,000	
石井鐵工所	300	3,025.00	907,500	
西島製作所	2,200	880.00	1,936,000	
北越工業	2,300	1,074.00	2,470,200	
ダイキン工業	28,300	25,925.00	733,677,500	
オルガノ	700	6,140.00	4,298,000	
トーヨーカネツ	800	2,478.00	1,982,400	
栗田工業	12,000	4,930.00	59,160,000	
椿本チエイン	3,200	3,395.00	10,864,000	
大同工業	1,100	1,092.00	1,201,200	
木村化工機	1,800	739.00	1,330,200	
アネスト岩田	3,700	990.00	3,663,000	
ダイフク	12,200	9,510.00	116,022,000	
サムコ	600	2,911.00	1,746,600	
加藤製作所	1,200	905.00	1,086,000	
油研工業	400	1,726.00	690,400	
タダノ	10,700	1,168.00	12,497,600	

フジテック	7,700	2,610.00	20,097,000	
C K D	5,200	2,181.00	11,341,200	
キトー	1,900	1,674.00	3,180,600	
平和	6,200	1,966.00	12,189,200	
理想科学工業	1,600	2,301.00	3,681,600	
S A N K Y O	5,300	2,768.00	14,670,400	
日本金銭機械	2,500	557.00	1,392,500	
マースグループホールディングス	1,400	1,717.00	2,403,800	
フクシマガリレイ	1,500	4,530.00	6,795,000	
オーイズミ	900	390.00	351,000	
ダイコク電機	1,000	917.00	917,000	
竹内製作所	3,700	2,735.00	10,119,500	
アマノ	5,800	2,683.00	15,561,400	
J U K I	3,100	808.00	2,504,800	
サンデンホールディングス	3,100	297.00	920,700	
蛇の目マシン工業	2,000	685.00	1,370,000	
マックス	3,000	1,868.00	5,604,000	
グローリー	5,700	2,298.00	13,098,600	
新晃工業	2,100	2,159.00	4,533,900	
大和冷機工業	3,200	1,164.00	3,724,800	
セガサミーホールディングス	20,200	1,386.00	27,997,200	
日本ピストンリング	800	1,460.00	1,168,000	
リケン	1,000	2,636.00	2,636,000	
T P R	3,000	1,557.00	4,671,000	
ツバキ・ナカシマ	4,900	1,580.00	7,742,000	
ホシザキ	6,500	9,670.00	62,855,000	
大豊工業	1,800	898.00	1,616,400	
日本精工	45,600	828.00	37,756,800	
N T N	51,400	261.00	13,415,400	
ジェイテクト	21,300	1,019.00	21,704,700	
不二越	1,900	4,425.00	8,407,500	
日本トムソン	6,100	608.00	3,708,800	
T H K	12,900	2,761.00	35,616,900	
ユーシン精機	1,500	847.00	1,270,500	
前澤給装工業	1,500	1,007.00	1,510,500	
イーグル工業	2,700	1,284.00	3,466,800	

前澤工業	1,300	690.00	897,000	
日本ピラー工業	2,200	2,557.00	5,625,400	
キット	7,500	826.00	6,195,000	
マキタ	29,000	5,760.00	167,040,000	
日立造船	17,600	830.00	14,608,000	
三菱重工業	34,900	2,983.00	104,106,700	
I H I	14,900	2,574.00	38,352,600	
スター精密	3,400	1,522.00	5,174,800	
日清紡ホールディングス	13,600	943.00	12,824,800	
イビデン	10,700	5,750.00	61,525,000	
コニカミノルタ	45,100	567.00	25,571,700	
ブラザー工業	27,100	2,329.00	63,115,900	
ミネベアミツミ	38,300	2,850.00	109,155,000	
日立製作所	106,900	6,225.00	665,452,500	
東芝	44,000	4,395.00	193,380,000	
三菱電機	222,200	1,494.00	331,966,800	
富士電機	13,400	4,690.00	62,846,000	
東洋電機製造	900	1,108.00	997,200	
安川電機	23,900	5,430.00	129,777,000	
シンフォニアテクノロジー	2,900	1,192.00	3,456,800	
明電舎	3,800	2,485.00	9,443,000	
オリジン	600	1,270.00	762,000	
山洋電気	1,100	6,910.00	7,601,000	
デンヨー	1,900	2,004.00	3,807,600	
東芝テック	2,400	4,440.00	10,656,000	
芝浦メカトロニクス	400	6,680.00	2,672,000	
マブチモーター	5,200	3,915.00	20,358,000	
日本電産	53,500	12,340.00	660,190,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	842.00	1,010,400	
トレックス・セミコンダクター	1,200	2,681.00	3,217,200	
東光高岳	1,100	1,482.00	1,630,200	
ダブル・スコープ	6,400	631.00	4,038,400	
宮越ホールディングス	800	1,200.00	960,000	
ダイヘン	2,400	4,715.00	11,316,000	
ヤーマン	3,600	1,076.00	3,873,600	
JVCケンウッド	19,200	213.00	4,089,600	

ミマキエンジニアリング	2,000	917.00	1,834,000	
I - P E X	1,000	2,074.00	2,074,000	
日新電機	5,200	1,241.00	6,453,200	
大崎電気工業	4,400	564.00	2,481,600	
オムロン	18,500	9,660.00	178,710,000	
日東工業	3,300	1,726.00	5,695,800	
I D E C	3,000	2,230.00	6,690,000	
正興電機製作所	700	1,433.00	1,003,100	
不二電機工業	400	1,273.00	509,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,000	2,580.00	20,640,000	
サクサホールディングス	500	1,343.00	671,500	
メルコホールディングス	800	5,680.00	4,544,000	
テクノメディカ	500	1,595.00	797,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	700	2,441.00	1,708,700	
日本電気	28,200	5,600.00	157,920,000	
富士通	20,000	19,175.00	383,500,000	
沖電気工業	9,000	994.00	8,946,000	
岩崎通信機	1,000	940.00	940,000	
電気興業	1,100	2,275.00	2,502,500	
サンケン電気	2,600	4,990.00	12,974,000	
ナカヨ	400	1,412.00	564,800	
アイホン	1,300	1,971.00	2,562,300	
ルネサスエレクトロニクス	120,000	1,140.00	136,800,000	
セイコーエプソン	27,600	2,080.00	57,408,000	
ワコム	16,100	738.00	11,881,800	
アルバック	4,100	5,810.00	23,821,000	
アクセル	900	783.00	704,700	
E I Z O	1,900	4,265.00	8,103,500	
ジャパンディスプレイ	75,900	36.00	2,732,400	
日本信号	5,200	915.00	4,758,000	
京三製作所	4,800	425.00	2,040,000	
能美防災	2,900	2,030.00	5,887,000	
ホーチキ	1,600	1,094.00	1,750,400	
星和電機	1,000	515.00	515,000	
エレコム	5,100	1,693.00	8,634,300	



パナソニック	237,000	1,325.50	314,143,500
シャープ	29,600	1,520.00	44,992,000
アンリツ	13,400	1,874.00	25,111,600
富士通ゼネラル	6,800	2,786.00	18,944,800
ソニーグループ	139,200	10,915.00	1,519,368,000
T D K	10,700	11,740.00	125,618,000
帝国通信工業	1,000	1,293.00	1,293,000
タムラ製作所	8,000	748.00	5,984,000
アルプスアルパイン	18,200	1,095.00	19,929,000
池上通信機	700	804.00	562,800
日本電波工業	2,100	780.00	1,638,000
鈴木	1,000	840.00	840,000
メイコー	1,700	2,797.00	4,754,900
日本トリム	500	3,835.00	1,917,500
ローランド ディー . ジー .	1,300	3,035.00	3,945,500
フォスター電機	2,200	867.00	1,907,400
S M K	600	2,281.00	1,368,600
ヨコオ	1,800	2,548.00	4,586,400
ティアック	1,300	118.00	153,400
ホシデン	5,800	926.00	5,370,800
ヒロセ電機	3,400	16,760.00	56,984,000
日本航空電子工業	5,100	1,612.00	8,221,200
T O A	2,600	815.00	2,119,000
マクセルホールディングス	4,400	1,338.00	5,887,200
古野電気	2,900	1,079.00	3,129,100
ユニデンホールディングス	500	2,627.00	1,313,500
スミダコーポレーション	2,100	1,389.00	2,916,900
アイコム	900	2,375.00	2,137,500
リオン	900	2,575.00	2,317,500
本多通信工業	1,700	479.00	814,300
横河電機	22,200	1,735.00	38,517,000
新電元工業	900	4,370.00	3,933,000
アズビル	15,000	4,365.00	65,475,000
東亜ディーケーケー	1,100	840.00	924,000
日本光電工業	9,200	3,400.00	31,280,000
チノー	700	1,454.00	1,017,800

共和電業	2,100	375.00	787,500	
日本電子材料	900	1,851.00	1,665,900	
堀場製作所	4,100	8,000.00	32,800,000	
アドバンテスト	16,500	9,230.00	152,295,000	
小野測器	900	552.00	496,800	
エスベック	2,000	2,171.00	4,342,000	
キーエンス	21,800	62,730.00	1,367,514,000	
日置電機	1,100	8,360.00	9,196,000	
シスメックス	17,300	11,820.00	204,486,000	
日本マイクロニクス	3,900	1,376.00	5,366,400	
メガチップス	2,200	3,120.00	6,864,000	
O B A R A G R O U P	1,000	3,855.00	3,855,000	
澤藤電機	200	1,992.00	398,400	
原田工業	900	926.00	833,400	
コーセル	2,700	1,009.00	2,724,300	
イリソ電子工業	1,900	4,895.00	9,300,500	
オブテックスグループ	3,600	1,470.00	5,292,000	
千代田インテグレ	900	1,854.00	1,668,600	
アイ・オー・データ機器	800	906.00	724,800	
レーザーテック	9,800	19,990.00	195,902,000	
スタンレー電気	15,600	2,925.00	45,630,000	
岩崎電気	800	1,998.00	1,598,400	
ウシオ電機	11,400	1,903.00	21,694,200	
岡谷電機産業	1,600	344.00	550,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	2,000	329.00	658,000	
エノモト	600	1,624.00	974,400	
日本セラミック	2,100	2,897.00	6,083,700	
遠藤照明	1,100	822.00	904,200	
古河電池	1,600	1,506.00	2,409,600	
双信電機	1,100	798.00	877,800	
山一電機	1,400	1,646.00	2,304,400	
図研	1,400	3,300.00	4,620,000	
日本電子	4,000	7,190.00	28,760,000	
カシオ計算機	17,900	1,809.00	32,381,100	
ファナック	19,500	23,770.00	463,515,000	
日本シイエムケイ	4,800	400.00	1,920,000	

エンプラス	1,000	3,110.00	3,110,000	
大真空	700	3,300.00	2,310,000	
ローム	9,200	10,040.00	92,368,000	
浜松ホトニクス	15,900	6,100.00	96,990,000	
三井ハイテック	2,200	6,520.00	14,344,000	
新光電気工業	7,500	3,460.00	25,950,000	
京セラ	33,900	6,647.00	225,333,300	
太陽誘電	9,900	5,810.00	57,519,000	
村田製作所	65,300	8,911.00	581,888,300	
双葉電子工業	3,800	788.00	2,994,400	
北陸電気工業	800	1,071.00	856,800	
ニチコン	7,000	1,013.00	7,091,000	
日本ケミコン	2,200	2,094.00	4,606,800	
K O A	3,100	1,690.00	5,239,000	
市光工業	2,700	651.00	1,757,700	
小糸製作所	13,300	6,900.00	91,770,000	
ミツバ	4,100	669.00	2,742,900	
S C R E E Nホールディングス	3,900	9,600.00	37,440,000	
キヤノン電子	2,000	1,565.00	3,130,000	
キヤノン	110,400	2,585.50	285,439,200	
リコー	56,500	1,109.00	62,658,500	
象印マホービン	6,000	1,541.00	9,246,000	
M U T O Hホールディングス	300	1,589.00	476,700	
東京エレクトロン	13,000	44,930.00	584,090,000	
トヨタ紡織	6,500	2,135.00	13,877,500	
芦森工業	400	1,036.00	414,400	
ユニプレス	3,600	970.00	3,492,000	
豊田自動織機	18,000	9,390.00	169,020,000	
モリタホールディングス	3,600	1,493.00	5,374,800	
三櫻工業	3,100	1,320.00	4,092,000	
デンソー	48,900	7,728.00	377,899,200	
東海理化電機製作所	5,900	1,679.00	9,906,100	
三井E & Sホールディングス	8,600	530.00	4,558,000	
川崎重工業	17,400	2,424.00	42,177,600	
名村造船所	6,700	279.00	1,869,300	
サノヤスホールディングス	2,700	147.00	396,900	

日本車輛製造	800	2,099.00	1,679,200
三菱ロジスネクスト	2,900	913.00	2,647,700
近畿車輛	400	1,157.00	462,800
日産自動車	262,100	593.50	155,556,350
いすゞ自動車	59,000	1,494.00	88,146,000
トヨタ自動車	225,200	9,813.00	2,209,887,600
日野自動車	27,800	925.00	25,715,000
三菱自動車工業	82,300	299.00	24,607,700
エフテック	1,500	666.00	999,000
レシップホールディングス	900	584.00	525,600
G M B	400	915.00	366,000
ファルテック	400	717.00	286,800
武蔵精密工業	5,000	2,045.00	10,225,000
日産車体	3,300	701.00	2,313,300
新明和工業	6,300	930.00	5,859,000
極東開発工業	3,800	1,615.00	6,137,000
トピー工業	1,800	1,180.00	2,124,000
ティラド	700	3,235.00	2,264,500
曙ブレーキ工業	12,100	186.00	2,250,600
タチエス	3,400	1,402.00	4,766,800
N O K	10,800	1,386.00	14,968,800
フタバ産業	5,600	485.00	2,716,000
K Y B	2,500	3,235.00	8,087,500
大同メタル工業	4,600	592.00	2,723,200
プレス工業	11,000	355.00	3,905,000
ミクニ	2,800	311.00	870,800
太平洋工業	4,700	1,218.00	5,724,600
河西工業	3,000	398.00	1,194,000
アイシン	16,300	4,310.00	70,253,000
マツダ	69,800	984.00	68,683,200
今仙電機製作所	1,900	694.00	1,318,600
本田技研工業	175,000	3,518.00	615,650,000
スズキ	44,100	4,805.00	211,900,500
S U B A R U	63,700	2,157.50	137,432,750
安永	1,100	1,114.00	1,225,400
ヤマハ発動機	29,000	2,796.00	81,084,000

T B K	2,600	403.00	1,047,800	
エクセディ	3,000	1,686.00	5,058,000	
豊田合成	7,200	2,404.00	17,308,800	
愛三工業	3,500	886.00	3,101,000	
盟和産業	300	990.00	297,000	
日本プラスト	1,900	630.00	1,197,000	
ヨロズ	1,900	1,213.00	2,304,700	
エフ・シー・シー	3,600	1,518.00	5,464,800	
シマノ	9,000	30,630.00	275,670,000	
テイ・エス テック	10,300	1,559.00	16,057,700	
ジャムコ	1,300	1,034.00	1,344,200	
テルモ	68,100	4,311.00	293,579,100	
クリエートメディック	700	972.00	680,400	
日機装	6,700	952.00	6,378,400	
日本エム・ディ・エム	1,300	2,165.00	2,814,500	
島津製作所	28,600	4,690.00	134,134,000	
J M S	1,900	747.00	1,419,300	
クボテック	600	299.00	179,400	
長野計器	1,600	1,091.00	1,745,600	
ブイ・テクノロジー	1,000	4,665.00	4,665,000	
東京計器	1,400	988.00	1,383,200	
愛知時計電機	300	4,740.00	1,422,000	
インターアクション	1,100	2,578.00	2,835,800	
オーバル	2,000	269.00	538,000	
東京精密	3,800	4,705.00	17,879,000	
マニー	8,900	2,236.00	19,900,400	
ニコン	33,900	1,152.00	39,052,800	
トプコン	11,200	1,694.00	18,972,800	
オリンパス	116,500	2,206.50	257,057,250	
理研計器	2,000	2,561.00	5,122,000	
タムロン	1,700	2,583.00	4,391,100	
H O Y A	43,400	17,200.00	746,480,000	
シード	900	712.00	640,800	
ノーリツ鋼機	2,000	2,360.00	4,720,000	
エー・アンド・デイ	1,900	1,049.00	1,993,100	
朝日インテック	23,900	3,105.00	74,209,500	

シチズン時計	28,200	481.00	13,564,200	
リズム	700	1,177.00	823,900	
大研医器	1,800	528.00	950,400	
メニコン	3,400	8,120.00	27,608,000	
シンシア	200	552.00	110,400	
松風	1,000	2,004.00	2,004,000	
セイコーホールディングス	3,100	2,234.00	6,925,400	
ニプロ	16,600	1,240.00	20,584,000	
中本パックス	600	1,682.00	1,009,200	
スノーピーク	1,400	5,360.00	7,504,000	
パラマウントベッドホールディングス	4,300	1,973.00	8,483,900	
トランザクション	1,200	1,095.00	1,314,000	
粧美堂	600	412.00	247,200	
ニホンフラッシュ	1,900	1,227.00	2,331,300	
前田工織	2,400	3,625.00	8,700,000	
永大産業	2,900	294.00	852,600	
アートネイチャー	2,100	697.00	1,463,700	
バンダイナムコホールディングス	18,400	7,224.00	132,921,600	
アイフィスジャパン	600	663.00	397,800	
共立印刷	3,700	161.00	595,700	
S H O E I	2,100	4,595.00	9,649,500	
フランスベッドホールディングス	2,900	920.00	2,668,000	
パイロットコーポレーション	3,800	4,160.00	15,808,000	
萩原工業	1,400	1,475.00	2,065,000	
トッパン・フォームズ	4,000	1,002.00	4,008,000	
フジシールインターナショナル	4,600	2,438.00	11,214,800	
タカラトミー	10,000	1,038.00	10,380,000	
廣済堂	1,500	795.00	1,192,500	
エステールホールディングス	600	653.00	391,800	
タカノ	800	723.00	578,400	
プロネクサス	1,800	1,025.00	1,845,000	
ホクシン	1,300	158.00	205,400	
ウッドワン	700	1,125.00	787,500	
大建工業	1,500	2,400.00	3,600,000	
凸版印刷	33,800	1,871.00	63,239,800	
大日本印刷	26,300	2,494.00	65,592,200	

共同印刷	700	2,647.00	1,852,900
N I S S H A	4,600	1,764.00	8,114,400
光村印刷	200	1,627.00	325,400
T A K A R A & C O M P A N Y	1,100	1,726.00	1,898,600
アシックス	19,700	2,623.00	51,673,100
ツツミ	600	2,383.00	1,429,800
ローランド	1,500	5,190.00	7,785,000
小松ウオール工業	700	1,937.00	1,355,900
ヤマハ	13,200	6,220.00	82,104,000
河合楽器製作所	600	4,005.00	2,403,000
クリナップ	2,100	554.00	1,163,400
ピジョン	13,400	3,225.00	43,215,000
オリバー	400	3,755.00	1,502,000
兼松サステック	100	1,804.00	180,400
キングジム	1,800	841.00	1,513,800
リンテック	4,800	2,454.00	11,779,200
イトーキ	4,100	374.00	1,533,400
任天堂	12,700	51,940.00	659,638,000
三菱鉛筆	3,700	1,409.00	5,213,300
タカラスタANDARD	4,600	1,694.00	7,792,400
コクヨ	10,700	1,878.00	20,094,600
ナカバヤシ	2,200	571.00	1,256,200
グローブライド	1,100	7,870.00	8,657,000
オカムラ	7,600	1,716.00	13,041,600
美津濃	2,200	2,670.00	5,874,000
東京電力ホールディングス	188,500	289.00	54,476,500
中部電力	68,000	1,348.00	91,664,000
関西電力	84,200	1,101.00	92,704,200
中国電力	32,100	1,028.00	32,998,800
北陸電力	20,300	584.00	11,855,200
東北電力	52,000	851.00	44,252,000
四国電力	18,500	749.00	13,856,500
九州電力	49,100	848.00	41,636,800
北海道電力	20,800	501.00	10,420,800
沖縄電力	4,300	1,421.00	6,110,300
電源開発	17,700	1,646.00	29,134,200

エフオン	1,300	903.00	1,173,900	
イーレックス	3,300	2,348.00	7,748,400	
レノバ	3,800	4,440.00	16,872,000	
東京瓦斯	42,700	2,138.50	91,313,950	
大阪瓦斯	40,300	2,080.00	83,824,000	
東邦瓦斯	10,900	5,250.00	57,225,000	
北海道瓦斯	1,200	1,545.00	1,854,000	
広島ガス	4,600	372.00	1,711,200	
西部ガスホールディングス	2,500	2,419.00	6,047,500	
静岡ガス	5,800	1,210.00	7,018,000	
メタウォーター	2,500	1,850.00	4,625,000	
SBSホールディングス	1,600	3,675.00	5,880,000	
東武鉄道	23,200	2,815.00	65,308,000	
相鉄ホールディングス	7,600	2,149.00	16,332,400	
東急	56,100	1,464.00	82,130,400	
京浜急行電鉄	28,500	1,325.00	37,762,500	
小田急電鉄	35,600	2,541.00	90,459,600	
京王電鉄	12,400	6,010.00	74,524,000	
京成電鉄	16,700	3,245.00	54,191,500	
富士急行	3,000	4,555.00	13,665,000	
新京成電鉄	600	2,111.00	1,266,600	
東日本旅客鉄道	39,100	7,221.00	282,341,100	
西日本旅客鉄道	19,800	5,834.00	115,513,200	
東海旅客鉄道	18,500	15,925.00	294,612,500	
西武ホールディングス	26,800	1,240.00	33,232,000	
鴻池運輸	3,500	1,310.00	4,585,000	
西日本鉄道	6,200	2,733.00	16,944,600	
ハマキョウレックス	1,700	3,175.00	5,397,500	
サカイ引越センター	1,000	4,820.00	4,820,000	
近鉄グループホールディングス	21,000	3,630.00	76,230,000	
阪急阪神ホールディングス	28,100	3,265.00	91,746,500	
南海電気鉄道	10,000	2,303.00	23,030,000	
京阪ホールディングス	9,400	2,923.00	27,476,200	
神戸電鉄	500	3,450.00	1,725,000	
名古屋鉄道	17,300	1,826.00	31,589,800	
山陽電気鉄道	1,500	1,928.00	2,892,000	



アルプス物流	1,500	928.00	1,392,000	
日本通運	7,300	7,380.00	53,874,000	
ヤマトホールディングス	29,500	2,862.00	84,429,000	
山九	5,400	4,925.00	26,595,000	
丸運	1,200	276.00	331,200	
丸全昭和運輸	1,700	3,230.00	5,491,000	
センコーグループホールディングス	11,600	1,040.00	12,064,000	
トナミホールディングス	500	4,600.00	2,300,000	
ニッコンホールディングス	7,100	2,327.00	16,521,700	
日本石油輸送	200	2,610.00	522,000	
福山通運	2,700	4,350.00	11,745,000	
セイノーホールディングス	15,800	1,358.00	21,456,400	
エスライン	600	903.00	541,800	
神奈川中央交通	500	3,465.00	1,732,500	
日立物流	4,300	4,350.00	18,705,000	
丸和運輸機関	4,400	1,379.00	6,067,600	
C & F ロジホールディングス	2,100	1,651.00	3,467,100	
九州旅客鉄道	16,300	2,437.00	39,723,100	
S Gホールディングス	39,800	3,040.00	120,992,000	
日本郵船	17,600	8,310.00	146,256,000	
商船三井	12,500	7,350.00	91,875,000	
川崎汽船	6,500	4,985.00	32,402,500	
N S ユナイテッド海運	1,000	3,325.00	3,325,000	
明治海運	2,200	690.00	1,518,000	
飯野海運	9,800	512.00	5,017,600	
共栄タンカー	400	1,013.00	405,200	
乾汽船	1,400	2,116.00	2,962,400	
日本航空	51,300	2,285.00	117,220,500	
A N A ホールディングス	56,800	2,575.50	146,288,400	
パスコ	400	1,367.00	546,800	
トランコム	600	8,420.00	5,052,000	
日新	1,700	1,446.00	2,458,200	
三菱倉庫	7,300	3,080.00	22,484,000	
三井倉庫ホールディングス	2,200	2,616.00	5,755,200	
住友倉庫	7,400	1,689.00	12,498,600	
澁澤倉庫	1,200	2,162.00	2,594,400	

東陽倉庫	3,500	321.00	1,123,500	
日本トランスシティ	4,600	563.00	2,589,800	
ケイヒン	400	1,397.00	558,800	
中央倉庫	1,300	990.00	1,287,000	
川西倉庫	400	1,085.00	434,000	
安田倉庫	1,700	951.00	1,616,700	
ファイズホールディングス	400	700.00	280,000	
東洋埠頭	600	1,473.00	883,800	
宇徳	1,500	540.00	810,000	
上組	11,600	2,211.00	25,647,600	
サンリツ	500	777.00	388,500	
キムラユニティー	600	1,348.00	808,800	
キューソー流通システム	500	1,684.00	842,000	
近鉄エクスプレス	4,000	2,508.00	10,032,000	
東海運	1,200	348.00	417,600	
エーアイティー	1,300	1,091.00	1,418,300	
内外トランスライン	800	2,072.00	1,657,600	
日本コンセプト	700	2,010.00	1,407,000	
NEC ネットズエスアイ	7,200	1,900.00	13,680,000	
クロスキャット	600	987.00	592,200	
システナ	7,800	2,010.00	15,678,000	
デジタルアーツ	1,300	8,050.00	10,465,000	
日鉄ソリューションズ	3,200	3,610.00	11,552,000	
キューブシステム	1,100	1,015.00	1,116,500	
WOW WORLD	300	1,503.00	450,900	
コア	900	1,514.00	1,362,600	
ラクーンホールディングス	1,500	2,370.00	3,555,000	
ソリトンシステムズ	1,100	1,370.00	1,507,000	
ソフトクリエイトホールディングス	900	2,838.00	2,554,200	
T I S	21,800	2,836.00	61,824,800	
J N S ホールディングス	1,100	496.00	545,600	
グリー	13,400	617.00	8,267,800	
G M O ペパボ	200	3,435.00	687,000	
コーエーテクモホールディングス	5,800	4,620.00	26,796,000	
三菱総合研究所	900	4,000.00	3,600,000	
ボルテージ	600	439.00	263,400	

電算	200	2,241.00	448,200
A G S	1,100	867.00	953,700
ファインデックス	1,800	997.00	1,794,600
ブレインパッド	600	4,625.00	2,775,000
K L a b	4,000	627.00	2,508,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,900	1,060.00	3,074,000
イーブুকイニシアティブジャパン	400	3,725.00	1,490,000
ネクソン	49,100	2,176.00	106,841,600
アイスタイル	6,700	419.00	2,807,300
エムアップホールディングス	600	2,940.00	1,764,000
エイチーム	1,500	1,432.00	2,148,000
エニグモ	2,100	1,446.00	3,036,600
テクノスジャパン	1,700	602.00	1,023,400
e n i s h	1,300	542.00	704,600
コロプラ	7,200	797.00	5,738,400
オルトプラス	1,700	439.00	746,300
ブロードリーフ	10,800	503.00	5,432,400
クロス・マーケティンググループ	800	790.00	632,000
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,670.00	1,670,000
システム情報	1,600	903.00	1,444,800
メディアドゥ	800	4,605.00	3,684,000
じげん	5,400	422.00	2,278,800
ブイキューブ	2,200	1,753.00	3,856,600
エンカレッジ・テクノロジー	400	624.00	249,600
サイバーリンクス	700	1,343.00	940,100
ディー・エル・イー	1,700	332.00	564,400
フィックスターズ	2,300	671.00	1,543,300
C A R T A H O L D I N G S	900	1,905.00	1,714,500
オブティム	1,500	1,843.00	2,764,500
セレス	800	2,680.00	2,144,000
S H I F T	1,100	20,950.00	23,045,000
ティーガイア	2,300	1,948.00	4,480,400
セック	300	2,415.00	724,500
日本アジアグループ	2,100	964.00	2,024,400
テクマトリックス	3,400	1,625.00	5,525,000

プロシップ	600	1,504.00	902,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,900	2,205.00	13,009,500	
GMOペイメントゲートウェイ	4,200	13,110.00	55,062,000	
ザッパラス	800	552.00	441,600	
システムリサーチ	600	1,873.00	1,123,800	
インターネットイニシアティブ	5,800	3,445.00	19,981,000	
さくらインターネット	2,300	592.00	1,361,600	
ヴィンクス	600	928.00	556,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	3,955.00	1,977,500	
SRAホールディングス	1,200	2,702.00	3,242,400	
システムインテグレータ	600	615.00	369,000	
朝日ネット	1,800	736.00	1,324,800	
eBASE	2,600	788.00	2,048,800	
アバント	2,300	1,557.00	3,581,100	
アドソル日進	800	1,951.00	1,560,800	
ODKソリューションズ	500	724.00	362,000	
フリービット	1,300	798.00	1,037,400	
コムチュア	2,000	2,445.00	4,890,000	
サイバーコム	300	1,282.00	384,600	
アステリア	1,600	628.00	1,004,800	
アイル	1,200	1,598.00	1,917,600	
マークライنز	1,100	2,505.00	2,755,500	
メディカル・データ・ビジョン	2,800	1,645.00	4,606,000	
gumi	3,000	784.00	2,352,000	
ショーケース	500	658.00	329,000	
モバイルファクトリー	500	1,044.00	522,000	
テラスカイ	700	1,835.00	1,284,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,857.00	1,857,000	
PCIホールディングス	1,000	1,073.00	1,073,000	
パイブドHD	400	2,125.00	850,000	
アイビーシー	400	898.00	359,200	
ネオジャパン	400	1,364.00	545,600	
PR TIMES	500	2,899.00	1,449,500	
ラクス	6,600	3,300.00	21,780,000	
ランドコンピュータ	300	1,099.00	329,700	

ダブルスタンダード	300	6,230.00	1,869,000	
オープンドア	1,300	2,044.00	2,657,200	
マイネット	800	606.00	484,800	
アカツキ	900	3,035.00	2,731,500	
ベネフィットジャパン	200	2,349.00	469,800	
U b i c o mホールディングス	600	2,927.00	1,756,200	
カナミックネットワーク	2,300	599.00	1,377,700	
ノムラシステムコーポレーション	1,100	285.00	313,500	
チェンジ	4,000	2,067.00	8,268,000	
シンクロ・フード	1,300	361.00	469,300	
オークネット	1,200	1,756.00	2,107,200	
キャピタル・アセット・プランニング	400	972.00	388,800	
セグエグループ	600	854.00	512,400	
エイトレッド	400	2,205.00	882,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	500	898.00	449,000	
マクロミル	4,500	734.00	3,303,000	
ビーグリー	500	1,349.00	674,500	
オロ	700	3,385.00	2,369,500	
ユーザーローカル	700	1,800.00	1,260,000	
テモナ	500	814.00	407,000	
ニーズウェル	400	654.00	261,600	
マネーフォワード	3,000	7,320.00	21,960,000	
サインポスト	500	645.00	322,500	
電算システムホールディングス	900	2,603.00	2,342,700	
ソルクシーズ	900	895.00	805,500	
フェイス	700	694.00	485,800	
プロトコーポレーション	2,600	1,401.00	3,642,600	
ハイマックス	600	1,076.00	645,600	
野村総合研究所	37,900	3,665.00	138,903,500	
サイバネットシステム	1,500	688.00	1,032,000	
C Eホールディングス	1,200	531.00	637,200	
日本システム技術	400	1,854.00	741,600	
インテージホールディングス	2,700	1,325.00	3,577,500	
東邦システムサイエンス	600	954.00	572,400	
ソースネクスト	10,300	242.00	2,492,600	
インフォコム	2,000	2,294.00	4,588,000	

HEROZ	600	1,865.00	1,119,000
ラクスル	2,400	5,090.00	12,216,000
I P S	500	2,145.00	1,072,500
F I G	2,300	276.00	634,800
システムサポート	600	1,326.00	795,600
イーソル	1,300	952.00	1,237,600
アルテリア・ネットワークス	2,400	1,751.00	4,202,400
E d u L a b	200	2,930.00	586,000
東海ソフト	300	1,235.00	370,500
ウイングアーク1 s t	1,200	1,911.00	2,293,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	1,891.00	945,500
サーバーワークス	200	3,345.00	669,000
東名	200	1,146.00	229,200
ヴィッツ	200	1,595.00	319,000
トピラシステムズ	400	1,190.00	476,000
S a n s a n	1,900	9,170.00	17,423,000
L i n k - U	400	1,387.00	554,800
ギフトィ	1,900	2,921.00	5,549,900
ベース	400	4,335.00	1,734,000
フォーカスシステムズ	1,500	933.00	1,399,500
クレスコ	1,400	1,853.00	2,594,200
フジ・メディア・ホールディングス	22,600	1,151.00	26,012,600
オービック	6,900	20,090.00	138,621,000
ジャストシステム	3,100	5,770.00	17,887,000
T D C ソフト	1,900	1,278.00	2,428,200
Zホールディングス	299,600	622.40	186,471,040
トレンドマイクロ	11,700	5,780.00	67,626,000
I Dホールディングス	1,200	913.00	1,095,600
日本オラクル	4,400	8,670.00	38,148,000
アルファシステムズ	600	3,660.00	2,196,000
フューチャー	2,300	2,080.00	4,784,000
C A C H o l d i n g s	1,300	1,474.00	1,916,200
S Bテクノロジー	800	2,780.00	2,224,000
トーセ	600	789.00	473,400
オービックビジネスコンサルタント	2,100	5,550.00	11,655,000

伊藤忠テクノソリューションズ	9,900	3,270.00	32,373,000	
アイティフォー	2,800	800.00	2,240,000	
東計電算	300	4,730.00	1,419,000	
エクスネット	300	1,006.00	301,800	
大塚商会	11,800	5,730.00	67,614,000	
サイボウズ	2,900	2,131.00	6,179,900	
電通国際情報サービス	3,100	4,120.00	12,772,000	
A C C E S S	2,700	893.00	2,411,100	
デジタルガレージ	3,600	4,465.00	16,074,000	
E Mシステムズ	3,600	791.00	2,847,600	
ウェザーニューズ	700	5,700.00	3,990,000	
C I J	1,400	841.00	1,177,400	
ビジネスエンジニアリング	200	3,350.00	670,000	
日本エンタープライズ	2,200	198.00	435,600	
WOWOW	1,000	2,351.00	2,351,000	
スカラ	1,900	716.00	1,360,400	
インテリジェント ウェイブ	1,300	590.00	767,000	
I M A G I C A G R O U P	1,900	495.00	940,500	
ネットワンシステムズ	8,900	3,355.00	29,859,500	
システムソフト	4,500	201.00	904,500	
アルゴグラフィックス	1,700	3,110.00	5,287,000	
マーベラス	3,400	681.00	2,315,400	
エイベックス	3,800	1,482.00	5,631,600	
日本ユニシス	7,600	2,887.00	21,941,200	
兼松エレクトロニクス	1,200	3,565.00	4,278,000	
都築電気	1,000	1,652.00	1,652,000	
T B S ホールディングス	14,500	1,628.00	23,606,000	
日本テレビホールディングス	18,200	1,206.00	21,949,200	
朝日放送グループホールディングス	2,200	700.00	1,540,000	
テレビ朝日ホールディングス	6,700	1,677.00	11,235,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	14,400	404.00	5,817,600	
テレビ東京ホールディングス	1,600	2,084.00	3,334,400	
日本BS放送	700	1,124.00	786,800	
ビジョン	3,700	1,168.00	4,321,600	
スマートバリュー	600	686.00	411,600	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,100	2,745.00	5,764,500	

ワイヤレスゲート	900	418.00	376,200
コネクシオ	1,200	1,525.00	1,830,000
日本通信	19,200	203.00	3,897,600
クロップス	400	960.00	384,000
日本電信電話	255,100	2,888.00	736,728,800
K D D I	174,900	3,335.00	583,291,500
ソフトバンク	198,200	1,470.50	291,453,100
光通信	2,600	18,690.00	48,594,000
エムティーアイ	2,100	669.00	1,404,900
G M Oインターネット	7,700	2,705.00	20,828,500
ファイバーゲート	700	1,545.00	1,081,500
アйдママーケティングコミュニケーション	600	390.00	234,000
K A D O K A W A	5,600	5,010.00	28,056,000
学研ホールディングス	3,100	1,208.00	3,744,800
ゼンリン	4,000	1,042.00	4,168,000
昭文社ホールディングス	900	492.00	442,800
インプレスホールディングス	1,800	232.00	417,600
アイネット	1,100	1,369.00	1,505,900
松竹	1,400	12,080.00	16,912,000
東宝	12,900	4,620.00	59,598,000
東映	700	19,490.00	13,643,000
エヌ・ティ・ティ・データ	58,100	1,787.00	103,824,700
ピー・シー・エー	300	5,250.00	1,575,000
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,753.00	1,227,100
D T S	4,500	2,491.00	11,209,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,300	6,290.00	58,497,000
シーイーシー	2,300	1,556.00	3,578,800
カブコン	18,700	2,887.00	53,986,900
アイ・エス・ビー	1,000	1,179.00	1,179,000
ジャステック	1,300	1,201.00	1,561,300
S C S K	5,000	6,620.00	33,100,000
日本システムウエア	700	2,256.00	1,579,200
アイネス	2,100	1,382.00	2,902,200
T K C	3,700	3,660.00	13,542,000
富士ソフト	2,300	5,680.00	13,064,000
N S D	7,000	1,874.00	13,118,000



コナミホールディングス	7,900	6,520.00	51,508,000	
福井コンピュータホールディングス	1,000	3,925.00	3,925,000	
J B C Cホールディングス	1,500	1,435.00	2,152,500	
ミロク情報サービス	2,200	1,447.00	3,183,400	
ソフトバンクグループ	173,100	6,505.00	1,126,015,500	
ハウスイ	200	927.00	185,400	
高千穂交易	800	1,171.00	936,800	
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,636.00	654,400	
伊藤忠食品	500	5,140.00	2,570,000	
エレマテック	1,800	1,107.00	1,992,600	
J A L U X	600	1,607.00	964,200	
あらた	1,700	4,295.00	7,301,500	
トーメンデバイス	300	4,855.00	1,456,500	
東京エレクトロン デバイス	700	5,210.00	3,647,000	
フィールズ	1,900	523.00	993,700	
双日	120,900	322.00	38,929,800	
アルフレッサ ホールディングス	22,700	1,688.00	38,317,600	
横浜冷凍	6,100	907.00	5,532,700	
神栄	300	1,010.00	303,000	
ラサ商事	1,200	894.00	1,072,800	
アルコニックス	2,300	1,621.00	3,728,300	
神戸物産	17,000	4,095.00	69,615,000	
ハイパー	500	535.00	267,500	
あい ホールディングス	3,100	2,051.00	6,358,100	
ディーブイエックス	700	1,018.00	712,600	
ダイワボウホールディングス	10,000	1,999.00	19,990,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,200	2,607.00	13,556,400	
ラクト・ジャパン	800	2,572.00	2,057,600	
グリムス	600	2,730.00	1,638,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,800	769.00	2,922,200	
八洲電機	1,700	957.00	1,626,900	
メディアスホールディングス	1,200	889.00	1,066,800	
レスターホールディングス	2,300	1,912.00	4,397,600	
ジューテックホールディングス	500	1,093.00	546,500	
大光	800	677.00	541,600	
O C H Iホールディングス	600	1,260.00	756,000	

TO K A Iホールディングス	10,600	897.00	9,508,200	
黒谷	600	849.00	509,400	
C o m i n i x	400	716.00	286,400	
三洋貿易	2,200	1,149.00	2,527,800	
ビューティガレージ	400	4,140.00	1,656,000	
ウイン・パートナーズ	1,600	1,000.00	1,600,000	
ミタチ産業	600	768.00	460,800	
シップヘルスケアホールディングス	7,700	2,651.00	20,412,700	
明治電機工業	700	1,330.00	931,000	
デリカフーズホールディングス	800	661.00	528,800	
スターティアホールディングス	400	1,965.00	786,000	
コメダホールディングス	4,800	2,028.00	9,734,400	
ピーバンドットコム	300	721.00	216,300	
アセンテック	600	1,048.00	628,800	
富士興産	700	1,004.00	702,800	
富士興産(新)	600	0.00	0	
協栄産業	200	1,410.00	282,000	
小野建	2,000	1,545.00	3,090,000	
南陽	400	2,110.00	844,000	
佐鳥電機	1,400	820.00	1,148,000	
エコートレーディング	500	631.00	315,500	
伯東	1,300	1,668.00	2,168,400	
コンドーテック	1,700	985.00	1,674,500	
中山福	1,300	414.00	538,200	
ナガイレーベン	2,900	2,554.00	7,406,600	
三菱食品	2,400	2,781.00	6,674,400	
松田産業	1,600	2,612.00	4,179,200	
第一興商	4,200	3,725.00	15,645,000	
メディバルホールディングス	21,900	2,117.00	46,362,300	
S P K	900	1,322.00	1,189,800	
萩原電気ホールディングス	800	2,252.00	1,801,600	
アズワン	1,600	15,240.00	24,384,000	
スズデン	800	1,516.00	1,212,800	
尾家産業	600	1,139.00	683,400	
シモジマ	1,300	1,065.00	1,384,500	
ドウシシャ	2,100	1,696.00	3,561,600	

小津産業	500	1,905.00	952,500
高速	1,200	1,576.00	1,891,200
たけびし	800	1,544.00	1,235,200
リックス	500	1,547.00	773,500
丸文	1,900	714.00	1,356,600
ハピネット	1,800	1,443.00	2,597,400
橋本総業ホールディングス	400	2,737.00	1,094,800
日本ライフライン	7,100	1,345.00	9,549,500
タカショー	1,400	991.00	1,387,400
マルカ	800	2,515.00	2,012,000
I D O M	7,400	943.00	6,978,200
進和	1,300	2,309.00	3,001,700
エスケイジャパン	500	441.00	220,500
ダイトロン	900	2,178.00	1,960,200
シークス	3,100	1,255.00	3,890,500
田中商事	700	651.00	455,700
オーハシテクニカ	1,100	1,488.00	1,636,800
白銅	800	2,513.00	2,010,400
ダイコー通産	300	1,180.00	354,000
伊藤忠商事	153,100	3,350.00	512,885,000
丸紅	215,900	905.70	195,540,630
高島	300	1,761.00	528,300
長瀬産業	12,000	1,765.00	21,180,000
蝶理	1,400	1,927.00	2,697,800
豊田通商	22,000	5,340.00	117,480,000
三共生興	3,300	514.00	1,696,200
兼松	8,700	1,417.00	12,327,900
ツカモトコーポレーション	400	1,423.00	569,200
三井物産	174,600	2,558.50	446,714,100
日本紙パルプ商事	1,100	3,660.00	4,026,000
カメイ	2,900	1,159.00	3,361,100
東都水産	300	4,560.00	1,368,000
O U Gホールディングス	300	2,880.00	864,000
スターゼン	1,600	2,228.00	3,564,800
山善	8,500	1,051.00	8,933,500
椿本興業	400	3,680.00	1,472,000

住友商事	138,100	1,556.50	214,952,650
内田洋行	900	5,140.00	4,626,000
三菱商事	133,300	3,256.00	434,024,800
第一実業	1,000	4,730.00	4,730,000
キヤノンマーケティングジャパン	5,400	2,454.00	13,251,600
西華産業	1,200	1,638.00	1,965,600
佐藤商事	1,800	1,174.00	2,113,200
菱洋エレクトロ	1,700	2,256.00	3,835,200
東京産業	2,000	712.00	1,424,000
ユアサ商事	2,200	2,952.00	6,494,400
神鋼商事	500	3,135.00	1,567,500
トルク	1,100	223.00	245,300
阪和興業	4,400	3,470.00	15,268,000
正栄食品工業	1,400	3,995.00	5,593,000
カナデン	1,800	1,038.00	1,868,400
菱電商事	1,600	1,751.00	2,801,600
フルサト工業	1,100	1,943.00	2,137,300
岩谷産業	5,300	6,220.00	32,966,000
ナイス	900	1,861.00	1,674,900
ニチモウ	300	2,037.00	611,100
極東貿易	600	2,364.00	1,418,400
アステナホールディングス	3,000	572.00	1,716,000
三愛石油	5,400	1,288.00	6,955,200
稲畑産業	5,300	1,688.00	8,946,400
G S Iクレオス	1,100	1,002.00	1,102,200
明和産業	2,000	463.00	926,000
クワザワホールディングス	800	612.00	489,600
ヤマエ久野	1,600	1,089.00	1,742,400
ワキタ	4,300	998.00	4,291,400
東邦ホールディングス	7,000	1,837.00	12,859,000
サンゲツ	5,900	1,548.00	9,133,200
ミツウロコグループホールディングス	3,200	1,266.00	4,051,200
シナネンホールディングス	800	3,400.00	2,720,000
伊藤忠エネクス	4,800	977.00	4,689,600
サンリオ	6,100	2,125.00	12,962,500
サンワテクノス	1,400	1,297.00	1,815,800

リョーサン	2,400	2,126.00	5,102,400	
新光商事	3,000	763.00	2,289,000	
トーホー	1,000	1,579.00	1,579,000	
三信電気	1,200	1,731.00	2,077,200	
東陽テクニカ	2,200	1,158.00	2,547,600	
モスフードサービス	3,100	3,100.00	9,610,000	
加賀電子	2,000	2,823.00	5,646,000	
ソーダニッカ	2,100	532.00	1,117,200	
立花エレテック	1,600	1,447.00	2,315,200	
フォーバル	800	971.00	776,800	
PALTA C	3,500	4,825.00	16,887,500	
三谷産業	2,900	374.00	1,084,600	
太平洋興発	900	635.00	571,500	
西本Wismettacホールディングス	500	3,520.00	1,760,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,816.00	363,200	
コア商事ホールディングス	1,600	643.00	1,028,800	
国際紙パルプ商事	4,700	362.00	1,701,400	
ヤマタネ	900	1,559.00	1,403,100	
丸紅建材リース	200	1,845.00	369,000	
日鉄物産	1,600	5,020.00	8,032,000	
泉州電業	600	3,870.00	2,322,000	
トラスコ中山	4,600	2,805.00	12,903,000	
オートバックスセブン	7,900	1,515.00	11,968,500	
モリト	1,600	633.00	1,012,800	
加藤産業	3,200	3,300.00	10,560,000	
北恵	600	998.00	598,800	
イノテック	1,200	1,427.00	1,712,400	
イエローハット	4,100	1,900.00	7,790,000	
J Kホールディングス	2,000	782.00	1,564,000	
日伝	1,800	2,288.00	4,118,400	
北沢産業	1,400	240.00	336,000	
杉本商事	1,100	2,441.00	2,685,100	
因幡電機産業	5,800	2,638.00	15,300,400	
東テク	700	2,454.00	1,717,800	
ミスミグループ本社	27,500	4,160.00	114,400,000	
アルテック	1,500	319.00	478,500	

タキヒヨー	700	1,823.00	1,276,100	
蔵王産業	400	1,590.00	636,000	
スズケン	9,300	3,225.00	29,992,500	
ジェコス	1,500	863.00	1,294,500	
グローセル	2,400	415.00	996,000	
ローソン	5,500	5,640.00	31,020,000	
サンエー	1,700	4,030.00	6,851,000	
カワチ薬品	1,500	2,224.00	3,336,000	
エービーシー・マート	3,400	6,080.00	20,672,000	
ハードオフコーポレーション	1,000	787.00	787,000	
アスクル	3,500	1,563.00	5,470,500	
ゲオホールディングス	2,900	1,153.00	3,343,700	
アダストリア	3,000	1,813.00	5,439,000	
ジーフット	1,300	413.00	536,900	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	410.00	123,000	
くら寿司	2,300	4,200.00	9,660,000	
キャンドウ	1,000	1,911.00	1,911,000	
アイケイ	600	603.00	361,800	
パルグループホールディングス	1,900	1,530.00	2,907,000	
エディオン	9,300	1,030.00	9,579,000	
サーラコーポレーション	4,400	598.00	2,631,200	
ワッツ	1,100	910.00	1,001,000	
ハローズ	900	2,906.00	2,615,400	
フジオフードグループ本社	1,800	1,347.00	2,424,600	
あみやき亭	500	2,863.00	1,431,500	
ひらまつ	4,000	185.00	740,000	
大黒天物産	700	6,390.00	4,473,000	
ハニーズホールディングス	1,700	1,063.00	1,807,100	
ファーマライズホールディングス	500	739.00	369,500	
アルペン	1,700	3,770.00	6,409,000	
ハブ	700	672.00	470,400	
クオールホールディングス	3,000	1,527.00	4,581,000	
ジーンズホールディングス	1,500	6,940.00	10,410,000	
ビックカメラ	13,000	1,080.00	14,040,000	
D C Mホールディングス	13,500	1,082.00	14,607,000	
ペッパーフードサービス	3,000	365.00	1,095,000	

MonotaRO	27,700	2,300.00	63,710,000	
東京一番フーズ	600	587.00	352,200	
DDホールディングス	1,100	445.00	489,500	
きちりホールディングス	600	596.00	357,600	
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,227.00	3,563,200	
J.フロント リテイリング	26,100	952.00	24,847,200	
ドトール・日レスホールディングス	3,500	1,641.00	5,743,500	
マツモトキヨシホールディングス	9,000	4,935.00	44,415,000	
ブロンコピラー	1,200	2,395.00	2,874,000	
ZOZO	12,900	4,160.00	53,664,000	
トレジャー・ファクトリー	600	876.00	525,600	
物語コーポレーション	1,200	6,090.00	7,308,000	
ココカラファイン	2,000	8,370.00	16,740,000	
三越伊勢丹ホールディングス	38,300	736.00	28,188,800	
Hamee	600	1,577.00	946,200	
マーケットエンタープライズ	100	735.00	73,500	
ウエルシアホールディングス	11,600	3,760.00	43,616,000	
クリエイティブSDホールディングス	3,200	3,710.00	11,872,000	
丸善CHIホールディングス	2,600	386.00	1,003,600	
ミサワ	400	651.00	260,400	
ティーライフ	300	1,443.00	432,900	
エー・ピーホールディングス	400	460.00	184,000	
チムニー	700	1,431.00	1,001,700	
シュッピン	1,500	1,159.00	1,738,500	
オイシックス・ラ・大地	2,900	3,990.00	11,571,000	
ネクステージ	4,400	2,127.00	9,358,800	
ジョイフル本田	6,400	1,454.00	9,305,600	
鳥貴族ホールディングス	800	1,695.00	1,356,000	
ホットランド	1,600	1,261.00	2,017,600	
すかいらーくホールディングス	28,300	1,530.00	43,299,000	
SFPホールディングス	1,100	1,428.00	1,570,800	
綿半ホールディングス	1,600	1,220.00	1,952,000	
ヨシックスホールディングス	400	2,045.00	818,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,400	1,080.00	6,912,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,100	1,579.00	1,736,900	

BEENOS	1,100	3,495.00	3,844,500	
あさひ	1,600	1,302.00	2,083,200	
日本調剤	1,300	1,693.00	2,200,900	
コスモス薬品	2,200	18,820.00	41,404,000	
トーエル	1,100	853.00	938,300	
オンリー	400	535.00	214,000	
セブン&アイ・ホールディングス	85,600	4,829.00	413,362,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,800	907.00	10,702,600	
ツルハホールディングス	4,800	13,480.00	64,704,000	
サンマルクホールディングス	1,700	1,525.00	2,592,500	
フェリシモ	500	1,447.00	723,500	
トリドールホールディングス	5,400	2,078.00	11,221,200	
TOKYO BASE	2,000	623.00	1,246,000	
ウイルプラスホールディングス	300	1,025.00	307,500	
JMホールディングス	1,500	2,095.00	3,142,500	
サツドラホールディングス	300	2,103.00	630,900	
アレンザホールディングス	1,700	1,351.00	2,296,700	
串カツ田中ホールディングス	600	1,856.00	1,113,600	
パロックジャパンリミテッド	1,500	855.00	1,282,500	
クスリのアオキホールディングス	2,200	7,590.00	16,698,000	
力の源ホールディングス	1,000	602.00	602,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	12,800	4,130.00	52,864,000	
メディカルシステムネットワーク	1,900	806.00	1,531,400	
はるやまホールディングス	1,000	583.00	583,000	
ノジマ	3,900	2,715.00	10,588,500	
カップ・クリエイト	3,100	1,353.00	4,194,300	
ライトオン	1,600	755.00	1,208,000	
良品計画	25,200	2,301.00	57,985,200	
三城ホールディングス	2,700	269.00	726,300	
アドヴァングループ	2,200	884.00	1,944,800	
アルビス	700	2,339.00	1,637,300	
コナカ	2,600	349.00	907,400	
ハウス オブ ローゼ	300	1,640.00	492,000	
G-7ホールディングス	1,100	2,911.00	3,202,100	
イオン北海道	2,900	1,080.00	3,132,000	



コジマ	3,800	684.00	2,599,200	
ヒマラヤ	800	1,266.00	1,012,800	
コーナン商事	3,100	3,790.00	11,749,000	
エコス	800	1,908.00	1,526,400	
ワタミ	2,900	914.00	2,650,600	
マルシェ	600	479.00	287,400	
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	43,800	2,283.00	99,995,400	
西松屋チェーン	4,800	1,412.00	6,777,600	
ゼンショーホールディングス	11,800	2,701.00	31,871,800	
幸楽苑ホールディングス	1,400	1,466.00	2,052,400	
ハークスレイ	500	1,059.00	529,500	
サイゼリヤ	3,200	2,482.00	7,942,400	
V Tホールディングス	8,200	506.00	4,149,200	
魚力	700	2,120.00	1,484,000	
ポブラ	500	228.00	114,000	
フジ・コーポレーション	1,200	1,171.00	1,405,200	
ユナイテッドアローズ	2,500	1,804.00	4,510,000	
ハイデイ日高	3,200	1,687.00	5,398,400	
京都きもの友禅	1,400	255.00	357,000	
コロワイド	7,300	2,050.00	14,965,000	
ピーシーデポコーポレーション	2,500	474.00	1,185,000	
壱番屋	1,500	4,860.00	7,290,000	
トップカルチャー	800	337.00	269,600	
P L A N T	600	713.00	427,800	
スギホールディングス	4,400	8,400.00	36,960,000	
薬王堂ホールディングス	1,000	2,456.00	2,456,000	
ヴィア・ホールディングス	2,700	188.00	507,600	
スクロール	3,100	847.00	2,625,700	
ヨンドシーホールディングス	2,000	1,800.00	3,600,000	
木曽路	2,900	2,312.00	6,704,800	
S R Sホールディングス	2,900	814.00	2,360,600	
千趣会	3,900	372.00	1,450,800	
タカキュー	1,600	128.00	204,800	
リテールパートナーズ	2,700	1,206.00	3,256,200	
ケーヨー	4,000	831.00	3,324,000	

上新電機	2,500	2,442.00	6,105,000
日本瓦斯	10,600	1,571.00	16,652,600
ロイヤルホールディングス	3,800	1,948.00	7,402,400
東天紅	200	1,126.00	225,200
いなげや	2,400	1,427.00	3,424,800
チヨダ	2,100	848.00	1,780,800
ライフコーポレーション	2,000	4,125.00	8,250,000
リンガーハット	2,700	2,257.00	6,093,900
MrMaxHD	3,000	648.00	1,944,000
テンアライド	2,000	345.00	690,000
AOKIホールディングス	4,200	627.00	2,633,400
オークワ	3,400	1,113.00	3,784,200
コメリ	3,400	2,599.00	8,836,600
青山商事	4,900	679.00	3,327,100
しまむら	2,500	10,500.00	26,250,000
はせがわ	1,100	274.00	301,400
高島屋	15,900	1,117.00	17,760,300
松屋	4,800	866.00	4,156,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	10,400	805.00	8,372,000
近鉄百貨店	800	2,731.00	2,184,800
丸井グループ	18,500	1,912.00	35,372,000
アクシアル リテイリング	1,800	3,910.00	7,038,000
井筒屋	1,100	212.00	233,200
イオン	84,200	3,004.00	252,936,800
イズミ	4,500	3,630.00	16,335,000
平和堂	4,000	2,133.00	8,532,000
フジ	2,600	1,947.00	5,062,200
ヤオコー	2,500	6,800.00	17,000,000
ゼビオホールディングス	2,600	1,132.00	2,943,200
ケーズホールディングス	18,600	1,134.00	21,092,400
Olympicグループ	1,100	752.00	827,200
日産東京販売ホールディングス	3,200	242.00	774,400
シルバーライフ	400	1,848.00	739,200
一家ダイニングプロジェクト	400	543.00	217,200
Genky DrugStores	1,000	4,300.00	4,300,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	986.00	394,400

ブックオフグループホールディングス	1,300	959.00	1,246,700	
ギフト	300	2,191.00	657,300	
アインホールディングス	3,200	7,090.00	22,688,000	
元気寿司	600	2,523.00	1,513,800	
ヤマダホールディングス	73,400	491.00	36,039,400	
アークランドサカモト	3,400	1,569.00	5,334,600	
ニトリホールディングス	8,700	21,605.00	187,963,500	
グルメ杵屋	1,600	978.00	1,564,800	
愛眼	1,700	222.00	377,400	
ケーユーホールディングス	1,100	985.00	1,083,500	
吉野家ホールディングス	7,200	2,048.00	14,745,600	
松屋フーズホールディングス	1,100	3,560.00	3,916,000	
サガミホールディングス	3,200	1,054.00	3,372,800	
関西スーパーマーケット	1,700	1,293.00	2,198,100	
王将フードサービス	1,400	5,860.00	8,204,000	
プレナス	2,500	2,026.00	5,065,000	
ミニストップ	1,600	1,427.00	2,283,200	
アークス	4,200	2,281.00	9,580,200	
パローホールディングス	4,500	2,387.00	10,741,500	
藤久	500	706.00	353,000	
ベルク	1,100	5,850.00	6,435,000	
大庄	1,200	1,010.00	1,212,000	
ファーストリテイリング	2,900	73,220.00	212,338,000	
サンドラッグ	8,200	3,500.00	28,700,000	
サクスパー ホールディングス	1,900	555.00	1,054,500	
ヤマザワ	500	1,726.00	863,000	
やまや	400	2,420.00	968,000	
ペルーナ	4,700	838.00	3,938,600	
島根銀行	800	590.00	472,000	
じもとホールディングス	1,500	669.00	1,003,500	
めぶきフィナンシャルグループ	113,900	243.00	27,677,700	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,700	1,635.00	4,414,500	
九州フィナンシャルグループ	44,800	399.00	17,875,200	
ゆうちょ銀行	62,100	955.00	59,305,500	
富山第一銀行	5,200	286.00	1,487,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	133,500	435.00	58,072,500	

西日本フィナンシャルホールディングス	14,300	676.00	9,666,800
三十三フィナンシャルグループ	1,900	1,465.00	2,783,500
第四北越フィナンシャルグループ	3,600	2,538.00	9,136,800
ひろぎんホールディングス	32,300	608.00	19,638,400
新生銀行	17,900	1,427.00	25,543,300
あおぞら銀行	13,100	2,625.00	34,387,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,499,500	600.80	900,899,600
りそなホールディングス	250,300	429.90	107,603,970
三井住友トラスト・ホールディングス	41,400	3,660.00	151,524,000
三井住友フィナンシャルグループ	151,700	3,814.00	578,583,800
千葉銀行	73,200	680.00	49,776,000
群馬銀行	45,100	358.00	16,145,800
武蔵野銀行	3,300	1,719.00	5,672,700
千葉興業銀行	5,600	263.00	1,472,800
筑波銀行	9,000	170.00	1,530,000
七十七銀行	6,900	1,204.00	8,307,600
青森銀行	1,700	2,038.00	3,464,600
秋田銀行	1,300	1,432.00	1,861,600
山形銀行	2,500	855.00	2,137,500
岩手銀行	1,400	1,662.00	2,326,800
東邦銀行	19,600	211.00	4,135,600
東北銀行	1,000	999.00	999,000
みちのく銀行	1,400	918.00	1,285,200
ふくおかフィナンシャルグループ	19,800	2,049.00	40,570,200
静岡銀行	53,400	859.00	45,870,600
十六銀行	2,700	2,119.00	5,721,300
スルガ銀行	19,200	360.00	6,912,000
八十二銀行	49,400	363.00	17,932,200
山梨中央銀行	2,500	818.00	2,045,000
大垣共立銀行	4,300	1,863.00	8,010,900
福井銀行	1,900	1,449.00	2,753,100
北國銀行	2,000	2,045.00	4,090,000
清水銀行	900	1,590.00	1,431,000
富山銀行	400	1,935.00	774,000
滋賀銀行	4,400	1,835.00	8,074,000
南都銀行	3,200	1,974.00	6,316,800

百五銀行	19,700	309.00	6,087,300	
京都銀行	7,800	4,795.00	37,401,000	
紀陽銀行	7,800	1,514.00	11,809,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	14,600	801.00	11,694,600	
山陰合同銀行	13,800	564.00	7,783,200	
中国銀行	18,900	853.00	16,121,700	
鳥取銀行	700	1,114.00	779,800	
伊予銀行	29,000	567.00	16,443,000	
百十四銀行	2,300	1,577.00	3,627,100	
四国銀行	3,100	717.00	2,222,700	
阿波銀行	3,400	2,058.00	6,997,200	
大分銀行	1,300	1,770.00	2,301,000	
宮崎銀行	1,400	2,026.00	2,836,400	
佐賀銀行	1,200	1,414.00	1,696,800	
沖縄銀行	2,000	2,488.00	4,976,000	
琉球銀行	4,800	758.00	3,638,400	
セブン銀行	73,200	246.00	18,007,200	
みずほフィナンシャルグループ	297,900	1,605.50	478,278,450	
高知銀行	800	796.00	636,800	
山口フィナンシャルグループ	27,400	641.00	17,563,400	
長野銀行	700	1,124.00	786,800	
名古屋銀行	1,800	2,434.00	4,381,200	
北洋銀行	33,000	242.00	7,986,000	
愛知銀行	700	3,365.00	2,355,500	
中京銀行	800	1,382.00	1,105,600	
大光銀行	800	1,331.00	1,064,800	
愛媛銀行	3,100	765.00	2,371,500	
トマト銀行	800	1,043.00	834,400	
京葉銀行	9,300	423.00	3,933,900	
栃木銀行	10,500	171.00	1,795,500	
北日本銀行	700	1,600.00	1,120,000	
東和銀行	3,800	499.00	1,896,200	
福島銀行	2,500	243.00	607,500	
大東銀行	1,100	631.00	694,100	
トモニホールディングス	16,900	304.00	5,137,600	
フィデアホールディングス	21,300	123.00	2,619,900	

池田泉州ホールディングス	25,100	166.00	4,166,600	
F P G	7,400	694.00	5,135,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,700	1,404.00	2,386,800	
マーキュリアホールディングス	700	735.00	514,500	
S B Iホールディングス	27,000	2,708.00	73,116,000	
日本アジア投資	1,800	291.00	523,800	
ジャフコ グループ	2,800	6,410.00	17,948,000	
大和証券グループ本社	164,200	593.60	97,469,120	
野村ホールディングス	334,700	545.40	182,545,380	
岡三証券グループ	18,700	399.00	7,461,300	
丸三証券	6,500	615.00	3,997,500	
東洋証券	7,200	149.00	1,072,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	23,400	402.00	9,406,800	
光世証券	500	546.00	273,000	
水戸証券	5,800	294.00	1,705,200	
いちよし証券	4,400	604.00	2,657,600	
松井証券	10,700	793.00	8,485,100	
マネックスグループ	19,700	699.00	13,770,300	
極東証券	2,900	789.00	2,288,100	
岩井コスモホールディングス	2,200	1,392.00	3,062,400	
藍澤証券	3,900	1,013.00	3,950,700	
マネーパートナーズグループ	2,300	202.00	464,600	
スパークス・グループ	10,100	249.00	2,514,900	
小林洋行	600	267.00	160,200	
かんぽ生命保険	27,200	1,905.00	51,816,000	
S O M P Oホールディングス	38,600	4,674.00	180,416,400	
アニコム ホールディングス	6,200	876.00	5,431,200	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	53,200	3,485.00	185,402,000	
第一生命ホールディングス	107,900	2,182.50	235,491,750	
東京海上ホールディングス	72,200	5,340.00	385,548,000	
T & Dホールディングス	65,500	1,416.00	92,748,000	
アドバンスクリエイト	1,100	939.00	1,032,900	
全国保証	5,700	5,120.00	29,184,000	
あんしん保証	700	305.00	213,500	
ジェイリース	700	1,760.00	1,232,000	

イントラスト	600	636.00	381,600	
日本モーゲージサービス	1,100	1,046.00	1,150,600	
C a s a	600	929.00	557,400	
アルヒ	3,200	1,249.00	3,996,800	
プレミアグループ	1,000	3,215.00	3,215,000	
クレディセゾン	12,800	1,265.00	16,192,000	
芙蓉総合リース	2,300	7,120.00	16,376,000	
みずほリース	3,400	3,475.00	11,815,000	
東京センチュリー	5,100	5,870.00	29,937,000	
日本証券金融	9,300	808.00	7,514,400	
アイフル	36,800	345.00	12,696,000	
リコーリース	1,700	3,475.00	5,907,500	
イオンフィナンシャルサービス	13,400	1,329.00	17,808,600	
アコム	43,200	429.00	18,532,800	
ジャックス	2,400	2,657.00	6,376,800	
オリエントコーポレーション	59,200	145.00	8,584,000	
オリックス	133,100	2,033.00	270,592,300	
三菱H C キャピタル	75,800	592.00	44,873,600	
九州リースサービス	1,100	556.00	611,600	
日本取引所グループ	59,200	2,549.00	150,900,800	
イー・ギャランティ	2,600	2,191.00	5,696,600	
アサックス	1,100	686.00	754,600	
N E C キャピタルソリューション	900	2,106.00	1,895,400	
いちご	24,400	336.00	8,198,400	
日本駐車場開発	24,000	160.00	3,840,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,200	1,225.00	1,470,000	
S R E ホールディングス	300	6,910.00	2,073,000	
A D ワークスグループ	4,200	154.00	646,800	
ヒューリック	46,500	1,266.00	58,869,000	
三栄建築設計	900	1,920.00	1,728,000	
野村不動産ホールディングス	12,600	2,856.00	35,985,600	
三重交通グループホールディングス	4,400	477.00	2,098,800	
サムティ	3,100	2,187.00	6,779,700	
ディア・ライフ	2,800	483.00	1,352,400	
コーセーアールイー	600	634.00	380,400	
日本商業開発	1,400	1,650.00	2,310,000	

プレサンスコーポレーション	3,600	1,663.00	5,986,800
THEグローバル社	1,300	209.00	271,700
ハウスコム	400	1,186.00	474,400
日本管理センター	1,100	1,281.00	1,409,100
サンセイランディック	600	824.00	494,400
エストラスト	300	668.00	200,400
フージャースホールディングス	3,600	678.00	2,440,800
オープンハウス	7,000	5,440.00	38,080,000
東急不動産ホールディングス	59,600	611.00	36,415,600
飯田グループホールディングス	18,300	2,610.00	47,763,000
イーランド	400	1,264.00	505,600
ムゲンエステート	1,300	481.00	625,300
ビーロッド	1,500	556.00	834,000
ファーストブラザーズ	500	985.00	492,500
ハウスドゥ	1,100	964.00	1,060,400
シーアールイー	600	1,574.00	944,400
プロパティエージェント	400	2,721.00	1,088,400
ケイアイスター不動産	700	6,200.00	4,340,000
アグレ都市デザイン	400	995.00	398,000
グッドコムアセット	900	1,417.00	1,275,300
ジェイ・エス・ビー	400	3,395.00	1,358,000
テンポイノベーション	600	870.00	522,000
グローバル・リンク・マネジメント	400	890.00	356,000
フェイスネットワーク	200	1,342.00	268,400
パーク24	11,800	2,048.00	24,166,400
パラカ	600	1,701.00	1,020,600
三井不動産	99,900	2,469.00	246,653,100
三菱地所	144,000	1,707.00	245,808,000
平和不動産	3,800	3,955.00	15,029,000
東京建物	21,600	1,672.00	36,115,200
ダイビル	5,600	1,395.00	7,812,000
京阪神ビルディング	3,800	1,435.00	5,453,000
住友不動産	49,300	3,510.00	173,043,000
テオーシー	4,300	628.00	2,700,400
東京楽天地	400	3,970.00	1,588,000
レオパレス21	18,100	190.00	3,439,000



スターツコーポレーション	2,600	2,789.00	7,251,400
フジ住宅	2,500	659.00	1,647,500
空港施設	2,200	562.00	1,236,400
明和地所	1,000	602.00	602,000
ゴールドクレスト	2,000	1,622.00	3,244,000
エスリード	900	1,569.00	1,412,100
日神グループホールディングス	3,200	496.00	1,587,200
日本エスコン	4,100	757.00	3,103,700
タカラレーベン	9,200	313.00	2,879,600
A V A N T I A	1,100	919.00	1,010,900
イオンモール	11,000	1,662.00	18,282,000
毎日コムネット	700	737.00	515,900
ファースト住建	800	1,215.00	972,000
ランド	118,100	11.00	1,299,100
カチタス	5,400	3,555.00	19,197,000
トーセイ	3,000	1,142.00	3,426,000
穴吹興産	500	1,916.00	958,000
サンフロンティア不動産	2,700	1,105.00	2,983,500
エフ・ジェー・ネクスト	2,200	1,019.00	2,241,800
インテリックス	500	707.00	353,500
ランドビジネス	900	271.00	243,900
サンネクスタグループ	700	970.00	679,000
グランディハウス	1,500	457.00	685,500
日本空港ビルデング	7,600	4,985.00	37,886,000
明豊ファシリティワークス	1,000	950.00	950,000
日本工営	1,200	3,100.00	3,720,000
L I F U L L	6,500	324.00	2,106,000
ミクシィ	5,400	2,456.00	13,262,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,700	1,645.00	2,796,500
日本M&Aセンター	34,800	3,100.00	107,880,000
メンバーズ	600	2,863.00	1,717,800
中広	300	378.00	113,400
UTグループ	3,100	3,060.00	9,486,000
アイティメディア	700	2,025.00	1,417,500
タケエイ	2,400	1,686.00	4,046,400
E・Jホールディングス	1,100	1,260.00	1,386,000

夢真ビーネックスグループ	5,700	1,117.00	6,366,900
コシダカホールディングス	5,700	560.00	3,192,000
アルトナー	500	803.00	401,500
パソナグループ	2,300	2,227.00	5,122,100
C D S	500	1,618.00	809,000
リンクアンドモチベーション	4,700	963.00	4,526,100
G C A	3,100	1,377.00	4,268,700
エス・エム・エス	7,200	3,320.00	23,904,000
サニーサイドアップグループ	700	742.00	519,400
パーソルホールディングス	21,200	2,581.00	54,717,200
リニカル	1,200	876.00	1,051,200
クックパッド	6,600	227.00	1,498,200
エスクリ	700	418.00	292,600
アイ・ケイ・ケイ	1,000	658.00	658,000
学情	900	1,159.00	1,043,100
スタジオアリス	1,100	2,352.00	2,587,200
シミックホールディングス	1,200	1,422.00	1,706,400
エプコ	400	798.00	319,200
N J S	500	1,923.00	961,500
総合警備保障	8,400	5,130.00	43,092,000
カカクコム	15,700	3,235.00	50,789,500
アイロムグループ	800	1,939.00	1,551,200
セントケア・ホールディング	1,600	890.00	1,424,000
サイネックス	400	667.00	266,800
ルネサンス	1,300	1,131.00	1,470,300
ディップ	3,300	3,250.00	10,725,000
デジタルホールディングス	1,500	1,817.00	2,725,500
新日本科学	2,600	846.00	2,199,600
キャリアデザインセンター	500	1,085.00	542,500
ベネフィット・ワン	7,700	3,710.00	28,567,000
エムスリー	37,500	6,970.00	261,375,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	302.00	392,600
プラス	300	503.00	150,900
アウトソーシング	12,200	1,809.00	22,069,800
ウェルネット	2,100	481.00	1,010,100
ワールドホールディングス	800	2,540.00	2,032,000

ディー・エヌ・エー	9,000	1,972.00	17,748,000
博報堂D Yホールディングス	29,600	1,710.00	50,616,000
ぐるなび	3,700	450.00	1,665,000
タカミヤ	2,600	450.00	1,170,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	1,158.00	1,621,200
ファンコミュニケーションズ	5,300	405.00	2,146,500
ライク	600	1,798.00	1,078,800
ビジネス・ブレークスルー	900	412.00	370,800
エスプール	6,000	859.00	5,154,000
WDBホールディングス	1,000	3,295.00	3,295,000
手間いらず	300	5,120.00	1,536,000
ティア	1,200	507.00	608,400
C D G	200	1,583.00	316,600
アドウェイズ	3,500	646.00	2,261,000
バリューコマース	1,700	4,025.00	6,842,500
インフォマート	23,300	888.00	20,690,400
J Pホールディングス	6,000	269.00	1,614,000
エコナックホールディングス	3,700	87.00	321,900
E P Sホールディングス	900	1,796.00	1,616,400
レッグス	400	2,068.00	827,200
プレステージ・インターナショナル	8,000	711.00	5,688,000
アミューズ	1,200	2,253.00	2,703,600
ドリームインキュベータ	600	875.00	525,000
クイック	1,300	1,296.00	1,684,800
T A C	1,100	230.00	253,000
電通グループ	21,900	4,095.00	89,680,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,000	1,113.00	1,113,000
ぴあ	600	3,155.00	1,893,000
イオンファンタジー	800	1,853.00	1,482,400
シーティーエス	2,400	758.00	1,819,200
ネクシィーズグループ	700	840.00	588,000
H . U . グループホールディングス	5,900	3,130.00	18,467,000
アルプス技研	1,900	1,910.00	3,629,000
サニックス	3,400	331.00	1,125,400
ダイオーズ	400	1,047.00	418,800
日本空調サービス	2,200	705.00	1,551,000

オリエンタルランド	22,600	15,625.00	353,125,000
ダスキン	4,900	2,548.00	12,485,200
明光ネットワークジャパン	2,500	601.00	1,502,500
ファルコホールディングス	1,000	1,780.00	1,780,000
秀英予備校	500	412.00	206,000
田谷	400	560.00	224,000
ラウンドワン	7,200	1,180.00	8,496,000
リゾートトラスト	9,700	1,813.00	17,586,100
ビー・エム・エル	2,700	4,805.00	12,973,500
りらいあコミュニケーションズ	3,200	1,165.00	3,728,000
リソー教育	10,800	389.00	4,201,200
早稲田アカデミー	900	914.00	822,600
ユー・エス・エス	23,800	1,836.00	43,696,800
東京個別指導学院	1,900	601.00	1,141,900
サイバーエージェント	52,300	1,910.00	99,893,000
楽天グループ	108,900	1,209.00	131,660,100
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,725.00	1,897,500
モーニングスター	3,100	462.00	1,432,200
テー・オー・ダブリュー	3,700	311.00	1,150,700
山田コンサルティンググループ	1,200	1,023.00	1,227,600
セントラルスポーツ	800	2,349.00	1,879,200
フルキャストホールディングス	1,800	2,145.00	3,861,000
エン・ジャパン	3,800	3,825.00	14,535,000
リソルホールディングス	200	3,955.00	791,000
テクノプロ・ホールディングス	12,700	2,679.00	34,023,300
アトラグループ	500	311.00	155,500
インターワークス	600	392.00	235,200
アイ・アールジャパンホールディングス	900	12,030.00	10,827,000
K e e P e r 技研	1,400	3,860.00	5,404,000
ファーストロジック	400	758.00	303,200
三機サービス	400	1,061.00	424,400
G u n o s y	1,300	646.00	839,800
デザインワン・ジャパン	500	227.00	113,500
イー・ガーディアン	900	3,000.00	2,700,000
リブセンス	1,100	204.00	224,400
ジャパンマテリアル	6,500	1,237.00	8,040,500

ベクトル	2,600	951.00	2,472,600	
ウチヤマホールディングス	1,000	346.00	346,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,600	1,551.00	2,481,600	
キャリアリンク	700	1,863.00	1,304,100	
I B J	1,700	943.00	1,603,100	
アサント	800	1,723.00	1,378,400	
バリューHR	800	1,593.00	1,274,400	
M & A キャピタルパートナーズ	1,800	4,805.00	8,649,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,496.00	1,196,800	
E R I ホールディングス	600	938.00	562,800	
アピスト	300	2,934.00	880,200	
シグマクシス	1,200	2,014.00	2,416,800	
ウィルグループ	1,600	1,194.00	1,910,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,100	203.00	629,300	
メドピア	1,600	3,550.00	5,680,000	
レアジョブ	400	1,366.00	546,400	
リクルートホールディングス	152,100	6,061.00	921,878,100	
エラン	2,900	1,076.00	3,120,400	
土木管理総合試験所	1,000	376.00	376,000	
ネットマーケティング	1,000	398.00	398,000	
日本郵政	160,700	940.10	151,074,070	
ベルシステム24ホールディングス	3,600	1,567.00	5,641,200	
鎌倉新書	2,100	994.00	2,087,400	
S M N	500	646.00	323,000	
一蔵	300	389.00	116,700	
グローバルキッズCOMPANY	400	741.00	296,400	
エアトリ	1,300	2,409.00	3,131,700	
アトラエ	1,500	2,669.00	4,003,500	
ストライク	800	3,720.00	2,976,000	
ソラスト	5,200	1,353.00	7,035,600	
セラク	700	1,870.00	1,309,000	
インソース	2,100	1,849.00	3,882,900	
ベйкаレント・コンサルティング	1,400	47,150.00	66,010,000	
Orchestra Holdings	400	2,962.00	1,184,800	
アイモバイル	600	1,336.00	801,600	
キャリアインデックス	900	980.00	882,000	

MS - J a p a n	900	1,012.00	910,800	
船場	400	812.00	324,800	
グレイステクノロジー	2,200	894.00	1,966,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,100	2,437.00	14,865,700	
フルテック	300	1,285.00	385,500	
グリーンズ	800	505.00	404,000	
ツナググループ・ホールディングス	500	298.00	149,000	
GameWith	600	530.00	318,000	
ソウルドアウト	500	1,884.00	942,000	
MS&Consulting	300	575.00	172,500	
ウェルビー	800	1,340.00	1,072,000	
エル・ティー・エス	300	3,325.00	997,500	
ミダック	900	4,370.00	3,933,000	
日総工産	1,700	792.00	1,346,400	
キュービーネットホールディングス	1,000	1,697.00	1,697,000	
RPAホールディングス	2,600	599.00	1,557,400	
スプリックス	600	910.00	546,000	
マネジメントソリューションズ	1,000	2,441.00	2,441,000	
プロレド・パートナーズ	500	2,268.00	1,134,000	
and factory	500	612.00	306,000	
テノ・ホールディングス	300	882.00	264,600	
フロンティア・マネジメント	600	882.00	529,200	
ピアラ	300	776.00	232,800	
コプロ・ホールディングス	300	1,146.00	343,800	
ギークス	400	1,378.00	551,200	
カーブスホールディングス	5,800	790.00	4,582,000	
フォーラムエンジニアリング	1,500	876.00	1,314,000	
ダイレクトマーケティングミックス	1,100	3,550.00	3,905,000	
ポピンズホールディングス	500	2,894.00	1,447,000	
LITALICO	900	4,405.00	3,964,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,100	1,051.00	1,156,100	
リログループ	11,600	2,496.00	28,953,600	
東祥	1,300	1,742.00	2,264,600	
エイチ・アイ・エス	4,700	2,371.00	11,143,700	
ラックランド	600	2,734.00	1,640,400	

共立メンテナンス	3,500	3,590.00	12,565,000	
イチネンホールディングス	2,200	1,209.00	2,659,800	
建設技術研究所	1,300	2,429.00	3,157,700	
スペース	1,500	900.00	1,350,000	
長大	800	1,899.00	1,519,200	
燦ホールディングス	900	1,425.00	1,282,500	
スバル興業	100	7,900.00	790,000	
東京テアトル	800	1,240.00	992,000	
タナベ経営	400	1,505.00	602,000	
ナガワ	700	9,010.00	6,307,000	
東京都競馬	1,600	3,925.00	6,280,000	
常磐興産	900	1,411.00	1,269,900	
カナモト	3,700	2,533.00	9,372,100	
西尾レントオール	2,000	2,865.00	5,730,000	
アゴラ ホスピタリティィー グループ	11,000	24.00	264,000	
トランス・コスモス	2,000	3,150.00	6,300,000	
乃村工藝社	9,100	867.00	7,889,700	
藤田観光	900	2,293.00	2,063,700	
KNT - CTホールディングス	1,100	1,266.00	1,392,600	
日本管財	2,300	2,577.00	5,927,100	
トーカイ	2,100	2,337.00	4,907,700	
白洋舎	200	2,112.00	422,400	
セコム	20,900	8,315.00	173,783,500	
セントラル警備保障	1,000	2,736.00	2,736,000	
丹青社	4,000	832.00	3,328,000	
メイテック	2,600	6,250.00	16,250,000	
応用地質	2,400	1,284.00	3,081,600	
船井総研ホールディングス	4,300	2,565.00	11,029,500	
進学会ホールディングス	800	429.00	343,200	
オオバ	1,500	775.00	1,162,500	
いであ	600	1,877.00	1,126,200	
学究社	600	1,375.00	825,000	
ベネッセホールディングス	7,800	2,326.00	18,142,800	
イオンディライト	2,600	3,495.00	9,087,000	
ナック	1,000	925.00	925,000	
ダイセキ	3,600	4,930.00	17,748,000	

ステップ	800	1,733.00	1,386,400	
合計	23,572,200		58,642,457,810	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,650,368,955
コール・ローン	359,640,677
株式	97,787,432,221
投資証券	2,288,427,363
派生商品評価勘定	344,041,030
未収入金	161,758
未収配当金	109,540,850
差入委託証拠金	3,018,209,359
流動資産合計	110,557,822,213
資産合計	
110,557,822,213	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,825,634
未払解約金	107,011,000
未払利息	975
流動負債合計	108,837,609
負債合計	
108,837,609	
純資産の部	
元本等	
元本	57,290,704,264



2021年 8月16日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,158,280,340
元本等合計	110,448,984,604
純資産合計	110,448,984,604
負債純資産合計	110,557,822,213

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	51,179,155,054円

期中追加設定元本額	28,396,902,801円
期中一部解約元本額	22,285,353,591円
期末元本額	57,290,704,264円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,380,515,288円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,082,272,980円
りそなラップ型ファンド(成長型)	5,539,330,720円
DCりそな グローバルバランス	24,173,740円
つみたてバランスファンド	1,694,161,055円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,505,848,620円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	813,624,405円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	512,716,737円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	138,198,796円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	91,195,025円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	48,178,734円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	69,491,300円
リスクコントロール・オープン	49,287,432円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	245,339,301円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	94,024,514円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	23,143,148,526円
Smart-i 先進国株式インデックス	6,136,351,765円
Smart-i 8資産バランス 安定型	273,362,803円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	703,596,854円
Smart-i 8資産バランス 成長型	798,733,268円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,274,055,521円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,384,168,951円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,420,570,594円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,035,008,872円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,167,125,754円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	201,651,802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)	4,862,505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)	238,307,845円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	798,878,474円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	422,022,110円
りそなVEI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)	54,036円
りそなVEI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)	183,277円
りそなVEI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)	262,660円
2. 計算日における受益権の総数	57,290,704,264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	1.9279円
(10,000口当たり純資産額)	(19,279円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月16日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		11,127,843,574
投資証券		370,371,332
合計		11,498,214,906

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2021年 8月16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	10,217,767,232	-	10,561,760,737	343,993,505
	合計	10,217,767,232	-	10,561,760,737	343,993,505

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

（通貨関連）

（2021年 8月16日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	457,281,011	-	455,502,902	1,778,109
	米ドル	344,156,696	-	342,760,104	1,396,592
	カナダドル	19,031,846	-	18,956,507	75,339
	ユーロ	43,350,578	-	43,266,166	84,412
	英ポンド	24,444,256	-	24,278,159	166,097
	スイスフラン	15,675,811	-	15,670,656	5,155
	スウェーデンクローナ	5,741,004	-	5,739,510	1,494
	オーストラリアドル	4,880,820	-	4,831,800	49,020
合計	457,281,011	-	455,502,902	1,778,109	

(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	11,112	21.66	240,685.92	
	CHENIERE ENERGY INC	3,671	87.13	319,854.23	
	CHEVRON CORP	31,823	101.96	3,244,673.08	
	CONOCOPHILLIPS	21,904	55.97	1,225,966.88	

DEVON ENERGY CORP	11,449	28.01	320,686.49
EOG RESOURCES INC	9,546	68.00	649,128.00
EXXON MOBIL CORP	69,779	56.77	3,961,353.83
HALLIBURTON CO	15,912	20.13	320,308.56
HESS CORP	4,079	69.94	285,285.26
KINDER MORGAN INC	33,577	17.21	577,860.17
MARATHON PETROLEUM CORP	10,725	59.15	634,383.75
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	25.79	426,205.54
ONEOK INC	7,921	52.45	415,456.45
PHILLIPS 66	7,210	73.89	532,746.90
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,602	151.60	546,063.20
SCHLUMBERGER LTD	22,939	28.35	650,320.65
VALERO ENERGY CORP	6,797	66.25	450,301.25
WILLIAMS COS INC	20,127	24.83	499,753.41
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,597	279.74	1,006,224.78
ALBEMARLE CORP	2,101	235.22	494,197.22
AMCOR PLC	23,330	12.15	283,459.50
AVERY DENNISON CORP	1,280	215.53	275,878.40
BALL CORP	5,460	88.68	484,192.80
CELANESE CORP	1,759	162.38	285,626.42
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	48.38	143,059.66
CORTEVA INC	12,364	45.99	568,620.36
CROWN HOLDINGS INC	2,078	108.27	224,985.06
DOW INC	12,199	63.69	776,954.31
DUPONT DE NEMOURS INC	8,853	77.08	682,389.24
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	115.70	217,400.30
ECOLAB INC	4,194	221.58	929,306.52
FMC CORP	1,927	94.32	181,754.64
FREEMPORT-MCMORAN INC	23,826	38.10	907,770.60
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	59.22	327,723.48
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	156.75	675,749.25
LINDE PLC	8,676	309.40	2,684,354.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	105.07	470,818.67
MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	385.44	356,917.44
MOSAIC CO/THE	5,552	33.56	186,325.12

NEWMONT CORP	13,087	58.84	770,039.08
NUCOR CORP	5,308	126.17	669,710.36
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	146.42	192,103.04
PPG INDUSTRIES INC	3,899	169.78	661,972.22
RPM INTERNATIONAL INC	2,344	87.06	204,068.64
SEALED AIR CORP	2,628	60.42	158,783.76
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,143	305.66	1,266,349.38
STEEL DYNAMICS INC	3,569	73.12	260,965.28
VULCAN MATERIALS CO	2,241	189.79	425,319.39
WESTROCK CO	3,862	51.22	197,811.64
3M CO	9,675	200.58	1,940,611.50
ALLEGION PLC	1,523	138.01	210,189.23
AMETEK INC	3,808	137.24	522,609.92
BOEING CO/THE	9,242	234.46	2,166,879.32
CARRIER GLOBAL CORP	13,521	56.15	759,204.15
CATERPILLAR INC	9,113	218.57	1,991,828.41
CUMMINS INC	2,428	237.72	577,184.16
DEERE & CO	4,788	384.00	1,838,592.00
DOVER CORP	2,606	171.64	447,293.84
EATON CORP PLC	6,455	167.62	1,081,987.10
EMERSON ELECTRIC CO	9,737	103.74	1,010,116.38
FASTENAL CO	9,489	55.27	524,457.03
FORTIVE CORP	4,937	75.96	375,014.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	102.51	192,923.82
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	414.10	465,448.40
GENERAL DYNAMICS CORP	3,970	198.37	787,528.90
GENERAL ELECTRIC CO	17,606	104.92	1,847,221.52
HEICO CORP	647	131.02	84,769.94
HEICO CORP-CLASS A	819	120.15	98,402.85
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,550	231.76	2,676,828.00
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	32.12	188,030.48
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	205.94	124,387.76
IDEX CORP	1,126	223.99	252,212.74
ILLINOIS TOOL WORKS	5,119	233.01	1,192,778.19
INGERSOLL-RAND INC	6,884	52.43	360,928.12

JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	57.00	233,700.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	11,727	72.82	853,960.14
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,426	229.83	787,397.58
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	340.48	160,025.60
LOCKHEED MARTIN CORP	4,057	357.98	1,452,324.86
MASCO CORP	4,315	62.60	270,119.00
NORDSON CORP	746	228.59	170,528.14
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,570	363.11	933,192.70
OTIS WORLDWIDE CORP	6,779	90.66	614,584.14
OWENS CORNING	1,611	96.18	154,945.98
PACCAR INC	5,737	81.14	465,500.18
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	293.00	658,371.00
PENTAIR PLC	2,474	79.50	196,683.00
PLUG POWER INC	8,433	24.99	210,740.67
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	25,312	87.25	2,208,472.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,913	316.53	605,521.89
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,708	480.76	821,138.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	60.61	101,946.02
SMITH (A.O.) CORP	1,507	71.96	108,443.72
SNAP-ON INC	772	230.14	177,668.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	200.12	568,140.68
SUNRUN INC	2,890	46.69	134,934.10
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	718	455.35	326,941.30
TEXTRON INC	3,103	73.83	229,094.49
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,892	191.18	744,072.56
TRANSDIGM GROUP INC	855	605.97	518,104.35
UNITED RENTALS INC	1,210	353.11	427,263.10
WABTEC CORP	2,696	88.91	239,701.36
WW GRAINGER INC	677	438.69	296,993.13
XYLEM INC	3,290	131.53	432,733.70
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	80.58	196,615.20
CINTAS CORP	1,623	389.41	632,012.43
CLARIVATE PLC	5,086	22.70	115,452.20
COPART INC	3,522	141.50	498,363.00
COSTAR GROUP INC	6,493	84.45	548,333.85



EQUIFAX INC	2,015	260.10	524,101.50
IHS MARKIT LTD	6,159	119.54	736,246.86
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	138.07	245,074.25
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	95.64	187,741.32
REPUBLIC SERVICES INC	3,720	120.57	448,520.40
ROBERT HALF INTL INC	1,565	103.58	162,102.70
ROLLINS INC	3,021	37.15	112,230.15
TRANSUNION	3,373	119.31	402,432.63
VERISK ANALYTICS INC	2,566	191.24	490,721.84
WASTE CONNECTIONS INC	4,328	126.89	549,179.92
WASTE MANAGEMENT INC	6,862	150.61	1,033,485.82
AMERCO	106	659.72	69,930.32
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	91.90	211,737.60
CSX CORP	37,234	33.87	1,261,115.58
DELTA AIR LINES INC	1,316	39.90	52,508.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	123.91	381,147.16
FEDEX CORP	4,101	277.18	1,136,715.18
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	175.61	204,761.26
KANSAS CITY SOUTHERN	1,637	292.66	479,084.42
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	50.52	124,279.20
LYFT INC-A	4,003	53.39	213,720.17
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,110	268.92	1,105,261.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,525	281.00	428,525.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	50.41	111,154.05
UBER TECHNOLOGIES INC	19,720	42.22	832,578.40
UNION PACIFIC CORP	11,130	227.80	2,535,414.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	11,963	193.98	2,320,582.74
APTIV PLC	4,393	164.93	724,537.49
AUTOLIV INC	1,547	97.91	151,466.77
BORGWARNER INC	3,548	45.61	161,824.28
FORD MOTOR CO	63,205	13.59	858,955.95
GENERAL MOTORS CO	20,887	53.65	1,120,587.55
LEAR CORP	775	170.18	131,889.50
TESLA INC	12,627	717.17	9,055,705.59
DR HORTON INC	5,761	97.78	563,310.58

GARMIN LTD	2,605	167.52	436,389.60
HASBRO INC	1,788	100.26	179,264.88
LENNAR CORP-A	4,608	108.17	498,447.36
LULULEMON ATHLETICA INC	2,034	408.72	831,336.48
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	209.16	191,590.56
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	25.67	142,057.78
NIKE INC -CL B	21,083	171.69	3,619,740.27
NVR INC	54	5,252.49	283,634.46
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,183	110.88	463,811.04
PULTEGROUP INC	3,683	54.34	200,134.22
VF CORP	5,597	80.81	452,293.57
WHIRLPOOL CORP	966	232.50	224,595.00
AIRBNB INC-CLASS A	758	152.76	115,792.08
ARAMARK	2,216	35.40	78,446.40
BOOKING HOLDINGS INC	665	2,203.42	1,465,274.30
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,166	91.02	288,169.32
CARNIVAL CORP	14,286	22.86	326,577.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	466	1,887.81	879,719.46
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	141.99	338,362.17
DOMINO'S PIZZA INC	590	517.02	305,041.80
DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	53.50	136,532.00
EXPEDIA GROUP INC	2,522	148.63	374,844.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,654	122.21	568,765.34
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	39.96	204,795.00
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,599	134.38	618,013.62
MCDONALD'S CORP	12,358	238.82	2,951,337.56
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	12.41	44,676.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	40.41	283,961.07
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,496	78.89	275,799.44
STARBUCKS CORP	19,579	116.76	2,286,044.04
VAIL RESORTS INC	557	298.71	166,381.47
WYNN RESORTS LTD	1,490	95.52	142,324.80
YUM! BRANDS INC	5,025	134.96	678,174.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,635	83.85	1,059,444.75
ALPHABET INC-CL A	4,933	2,754.55	13,588,195.15

ALPHABET INC-CL C	4,835	2,768.12	13,383,860.20
ALTICE USA INC- A	4,447	28.24	125,583.28
CABLE ONE INC	68	2,039.01	138,652.68
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,196	771.71	1,694,675.16
COMCAST CORP-CLASS A	75,524	59.32	4,480,083.68
DISCOVERY INC - A	1,722	28.42	48,939.24
DISCOVERY INC-C	3,336	26.99	90,038.64
DISH NETWORK CORP-A	3,674	42.74	157,026.76
ELECTRONIC ARTS INC	4,781	138.68	663,029.08
FACEBOOK INC-A	39,442	363.18	14,324,545.56
FOX CORP - CLASS A	6,194	37.00	229,178.00
FOX CORP- CLASS B	1,836	34.07	62,552.52
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	124.28	139,939.28
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	37.52	220,392.48
LIBERTY BROADBAND-A	223	176.98	39,466.54
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	183.38	491,275.02
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	48.78	105,023.34
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	47.70	83,808.90
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	47.66	45,086.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	81.58	200,278.90
MATCH GROUP INC	4,252	136.25	579,335.00
NETFLIX INC	7,330	515.92	3,781,693.60
NEWS CORP - CLASS A	5,861	23.52	137,850.72
OMNICOM GROUP	3,237	75.45	244,231.65
PINTEREST INC- CLASS A	8,848	56.06	496,018.88
ROKU INC	1,804	357.59	645,092.36
SEA LTD-ADR	300	306.71	92,013.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.03	62,633.61
SNAP INC - A	15,397	74.62	1,148,924.14
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,134	160.35	342,186.90
TWITTER INC	13,122	64.82	850,568.04
VIACOMCBS INC - CLASS B	9,721	39.16	380,674.36
WALT DISNEY CO/THE	29,933	181.08	5,420,267.64
ZILLOW GROUP INC - A	904	99.33	89,794.32
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	96.41	259,728.54

ADVANCE AUTO PARTS INC	937	206.43	193,424.91
AMAZON.COM INC	7,004	3,293.97	23,070,965.88
AUTOZONE INC	373	1,612.61	601,503.53
BATH & BODY WORKS INC	4,700	60.80	285,760.00
BEST BUY CO INC	3,865	113.78	439,759.70
BURLINGTON STORES INC	1,107	342.85	379,534.95
CARMAX INC	2,885	128.09	369,539.65
CARVANA CO	1,176	360.98	424,512.48
CHEWY INC - CLASS A	1,090	95.70	104,313.00
DOLLAR GENERAL CORP	3,974	236.76	940,884.24
DOLLAR TREE INC	3,916	101.77	398,531.32
EBAY INC	11,068	74.02	819,253.36
ETSY INC	2,096	192.08	402,599.68
GENUINE PARTS CO	2,564	124.64	319,576.96
HOME DEPOT INC	17,689	331.32	5,860,719.48
LKQ CORP	4,394	50.48	221,809.12
LOWE'S COS INC	12,106	190.51	2,306,314.06
MERCADOLIBRE INC	725	1,851.60	1,342,410.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,161	594.03	689,668.83
POOL CORP	578	485.21	280,451.38
ROSS STORES INC	5,808	124.66	724,025.28
TARGET CORP	8,031	261.54	2,100,427.74
TJX COMPANIES INC	19,344	70.49	1,363,558.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	193.92	325,203.84
ULTA BEAUTY INC	950	371.85	353,257.50
WAYFAIR INC- CLASS A	1,109	311.88	345,874.92
COSTCO WHOLESALE CORP	7,277	447.82	3,258,786.14
KROGER CO	10,508	42.81	449,847.48
SYSCO CORP	8,562	79.44	680,165.28
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,077	49.29	595,275.33
WALMART INC	25,544	149.53	3,819,594.32
ALTRIA GROUP INC	30,116	48.60	1,463,637.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,327	62.40	582,004.80
BOSTON BEER COMPANY INC-A	139	633.86	88,106.54
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	69.23	365,672.86

BUNGE LTD	2,145	79.17	169,819.65
CAMPBELL SOUP CO	1,995	43.18	86,144.10
COCA-COLA CO/THE	67,469	57.23	3,861,250.87
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,797	60.27	168,575.19
CONAGRA BRANDS INC	8,705	34.05	296,405.25
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,822	213.64	602,892.08
GENERAL MILLS INC	10,536	59.84	630,474.24
HERSHEY CO/THE	2,482	179.40	445,270.80
HORMEL FOODS CORP	4,355	46.00	200,330.00
JM SMUCKER CO/THE	1,878	132.68	249,173.04
KELLOGG CO	4,596	65.57	301,359.72
KEURIG DR PEPPER INC	10,616	34.45	365,721.20
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	37.87	430,619.77
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	66.49	141,956.15
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	86.68	369,516.84
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	50.54	141,259.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	22,873	63.36	1,449,233.28
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	98.12	668,491.56
PEPSICO INC	22,751	156.52	3,560,986.52
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	25,777	101.59	2,618,685.43
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	81.91	413,563.59
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	85.10	356,228.60
CLOROX COMPANY	2,061	168.45	347,175.45
COLGATE-PALMOLIVE CO	12,951	79.44	1,028,827.44
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,687	326.60	1,204,174.20
KIMBERLY-CLARK CORP	5,649	136.48	770,975.52
PROCTER & GAMBLE CO/THE	40,358	143.64	5,797,023.12
ABBOTT LABORATORIES	29,290	123.06	3,604,427.40
ABIOMED INC	756	321.65	243,167.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,220	691.19	843,251.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	119.57	269,630.35
ANTHEM INC	3,939	367.49	1,447,543.11
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,249	74.56	615,045.44
BECTON DICKINSON AND CO	4,690	246.79	1,157,445.10
BOSTON SCIENTIFIC CORP	22,936	44.33	1,016,752.88

CARDINAL HEALTH INC	4,308	51.70	222,723.60
CENTENE CORP	9,487	63.07	598,345.09
CERNER CORP	5,093	79.63	405,555.59
CIGNA CORP	5,669	210.61	1,193,948.09
COOPER COS INC/THE	727	436.99	317,691.73
CVS HEALTH CORP	21,065	84.36	1,777,043.40
DANAHER CORP	10,615	315.26	3,346,484.90
DAVITA INC	1,175	130.28	153,079.00
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	58.69	188,864.42
DEXCOM INC	1,662	491.41	816,723.42
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,094	113.15	1,142,136.10
HCA HEALTHCARE INC	4,405	242.98	1,070,326.90
HENRY SCHEIN INC	2,103	75.68	159,155.04
HOLOGIC INC	3,815	76.92	293,449.80
HUMANA INC	2,088	410.77	857,687.76
IDEXX LABORATORIES INC	1,385	672.10	930,858.50
INSULET CORP	967	287.57	278,080.19
INTUITIVE SURGICAL INC	1,965	1,003.04	1,970,973.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	302.04	487,794.60
MASIMO CORP	701	264.22	185,218.22
MCKESSON CORP	2,622	198.43	520,283.46
MEDTRONIC PLC	22,333	128.34	2,866,217.22
MOLINA HEALTHCARE INC	807	248.28	200,361.96
NOVOCURE LTD	1,677	139.28	233,572.56
OAK STREET HEALTH INC	1,457	51.00	74,307.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	148.22	293,179.16
RESMED INC	2,384	275.10	655,838.40
STERIS PLC	1,666	218.85	364,604.10
STRYKER CORP	5,449	263.15	1,433,904.35
TELADOC HEALTH INC	2,048	144.00	294,912.00
TELEFLEX INC	849	366.08	310,801.92
UNITEDHEALTH GROUP INC	15,604	409.67	6,392,490.68
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	149.39	158,054.62
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,223	321.80	715,361.40
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,226	434.28	532,427.28

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,416	146.09	499,043.44
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	160.28	209,485.96
ABBVIE INC	29,143	116.48	3,394,576.64
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,984	159.23	793,602.32
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	196.54	330,973.36
AMGEN INC	9,576	229.68	2,199,415.68
AVANTOR INC	8,797	38.62	339,740.14
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	778.30	291,862.50
BIO-TECHNE CORP	598	466.94	279,230.12
BIOGEN INC	2,479	342.25	848,437.75
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	75.03	197,629.02
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	37,111	67.51	2,505,363.61
CATALENT INC	2,865	120.56	345,404.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	773	411.22	317,873.06
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	31.00	235,228.00
ELI LILLY & CO	13,451	264.21	3,553,888.71
EXACT SCIENCES CORP	3,021	92.94	280,771.74
GILEAD SCIENCES INC	20,271	71.16	1,442,484.36
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	106.72	341,504.00
ILLUMINA INC	2,362	517.32	1,221,909.84
INCYTE CORP	2,513	73.47	184,630.11
IQVIA HOLDINGS INC	3,128	248.14	776,181.92
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	142.16	107,046.48
JOHNSON & JOHNSON	43,153	176.25	7,605,716.25
MERCK & CO. INC.	41,782	76.72	3,205,515.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	386	1,537.49	593,471.14
MODERNA INC	5,123	389.78	1,996,842.94
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	89.12	85,911.68
NOVAVAX INC	1,081	257.27	278,108.87
PERKINELMER INC	1,624	183.11	297,370.64
PFIZER INC	91,947	48.48	4,457,590.56
PPD INC	1,772	45.99	81,494.28
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,708	624.79	1,067,141.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	38.73	63,981.96
SEAGEN INC	2,093	156.44	327,428.92

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	9.83	205,859.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,499	544.64	3,539,615.36
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,234	194.36	822,920.24
VIATRIS INC	17,737	14.95	265,168.15
WATERS CORP	1,044	405.27	423,101.88
ZOETIS INC	7,656	201.48	1,542,530.88
BANK OF AMERICA CORP	127,733	41.63	5,317,524.79
CITIGROUP INC	34,448	73.11	2,518,493.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	44.77	335,819.77
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	38.48	478,498.80
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,832	198.85	563,143.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.15	394,415.10
JPMORGAN CHASE & CO	50,058	159.98	8,008,278.84
KEYCORP	17,095	20.68	353,524.60
M & T BANK CORP	1,846	139.94	258,329.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,798	190.38	1,294,203.24
REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	20.50	347,495.50
SVB FINANCIAL GROUP	909	581.73	528,792.57
TRUIST FINANCIAL CORP	21,635	57.38	1,241,416.30
US BANCORP	22,895	58.22	1,332,946.90
WELLS FARGO & CO	68,196	50.37	3,435,032.52
ALLY FINANCIAL INC	5,678	54.49	309,394.22
AMERICAN EXPRESS CO	11,433	166.08	1,898,792.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	272.17	565,024.92
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,618	59.37	155,430.66
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	13,731	53.87	739,688.97
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	22,554	287.89	6,493,071.06
BLACKROCK INC	2,543	916.86	2,331,574.98
BLACKSTONE INC	11,101	114.80	1,274,394.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,447	177.73	1,323,555.31
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	48.78	131,706.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	127.00	248,412.00
CME GROUP INC	5,816	207.03	1,204,086.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,068	135.38	686,105.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	32.06	179,471.88



FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	368.12	192,526.76
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	32.77	149,529.51
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	100.60	80,480.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,763	410.78	2,367,325.14
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,122	116.88	1,066,179.36
INVESCO LTD	5,927	24.85	147,285.95
KKR & CO INC	8,634	66.04	570,189.36
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	463.42	321,150.06
MOODY'S CORP	2,737	380.65	1,041,839.05
MORGAN STANLEY	23,502	103.94	2,442,797.88
MSCI INC	1,354	630.02	853,047.08
NASDAQ INC	1,746	190.99	333,468.54
NORTHERN TRUST CORP	2,987	116.37	347,597.19
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,262	138.94	314,282.28
S&P GLOBAL INC	3,880	441.74	1,713,951.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	23,253	74.01	1,720,954.53
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	61.52	106,798.72
STATE STREET CORP	5,873	90.79	533,209.67
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	51.81	505,561.98
T ROWE PRICE GROUP INC	3,735	214.85	802,464.75
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	88.06	134,731.80
VOYA FINANCIAL INC	1,741	67.06	116,751.46
AFLAC INC	10,863	57.26	622,015.38
ALLEGHANY CORP	197	685.61	135,065.17
ALLSTATE CORP	5,002	135.06	675,570.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	134.39	104,286.64
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,280	54.61	779,830.80
AON PLC	3,696	277.24	1,024,679.04
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	41.78	254,899.78
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,256	140.30	456,816.80
ASSURANT INC	896	165.00	147,840.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,286	65.48	149,687.28
BROWN & BROWN INC	4,086	55.75	227,794.50
CHUBB LTD	7,310	182.73	1,335,756.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,376	121.39	288,422.64

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	172.95	66,066.90
EVEREST RE GROUP LTD	550	272.92	150,106.00
FNF GROUP	4,754	49.06	233,231.24
GLOBE LIFE INC	1,521	96.40	146,624.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	68.04	445,253.76
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	70.41	235,239.81
LOEWS CORP	2,906	55.64	161,689.84
MARKEL CORP	207	1,275.69	264,067.83
MARSH & MCLENNAN COS	8,253	151.64	1,251,484.92
METLIFE INC	12,373	62.49	773,188.77
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	66.94	334,298.36
PROGRESSIVE CORP	9,562	96.12	919,099.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,559	108.01	708,437.59
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	118.96	121,458.16
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	160.66	90,290.92
TRAVELERS COS INC/THE	4,173	156.31	652,281.63
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	219.24	473,119.92
WR BERKLEY CORP	2,140	74.56	159,558.40
CBRE GROUP INC - A	5,718	95.38	545,382.84
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.32	86,832.00
ACCENTURE PLC-CL A	10,464	323.45	3,384,580.80
ADOBE INC	7,875	637.31	5,018,816.25
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	116.29	337,241.00
ANSYS INC	1,440	362.59	522,129.60
AUTODESK INC	3,568	332.78	1,187,359.04
AUTOMATIC DATA PROCESSING	6,908	215.17	1,486,394.36
AVALARA INC	1,520	165.17	251,058.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	64.15	166,212.65
BLACK KNIGHT INC	2,282	76.90	175,485.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	174.36	291,704.28
CADENCE DESIGN SYS INC	4,589	152.67	700,602.63
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	106.38	205,207.02
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	123.73	205,886.72
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	102.11	174,097.55
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,402	121.75	414,193.50

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	8,746	77.63	678,951.98
COUPA SOFTWARE INC	1,218	213.83	260,444.94
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,923	243.82	712,685.86
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	157.94	112,453.28
DATADOG INC - CLASS A	3,110	135.49	421,373.90
DOCUSIGN INC	3,040	295.97	899,748.80
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	32.13	171,317.16
DYNATRACE INC	2,449	63.65	155,878.85
EPAM SYSTEMS INC	933	607.85	567,124.05
FAIR ISAAC CORP	389	451.65	175,691.85
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,020	134.06	1,343,281.20
FISERV INC	9,774	111.62	1,090,973.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	262.49	370,110.90
FORTINET INC	2,384	309.33	737,442.72
GARTNER INC	1,494	304.87	455,475.78
GLOBAL PAYMENTS INC	4,805	171.41	823,625.05
GODADDY INC - CLASS A	2,217	71.30	158,072.10
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	112.48	102,131.84
HUBSPOT INC	774	667.33	516,513.42
INTL BUSINESS MACHINES CORP	14,357	143.18	2,055,635.26
INTUIT INC	4,536	540.74	2,452,796.64
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	177.12	227,422.08
MASTERCARD INC-CLASS A	14,571	362.75	5,285,630.25
MICROSOFT CORP	117,207	292.85	34,324,069.95
MONGODB INC	916	377.78	346,046.48
NORTONLIFELOCK INC	8,787	26.29	231,010.23
OKTA INC	2,109	235.84	497,386.56
ORACLE CORP	31,635	90.38	2,859,171.30
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	7,937	24.90	197,631.30
PALO ALTO NETWORKS INC	1,601	374.04	598,838.04
PAYCHEX INC	5,355	117.17	627,445.35
PAYCOM SOFTWARE INC	910	463.73	421,994.30
PAYPAL HOLDINGS INC	18,289	274.91	5,027,828.99
PTC INC	1,603	132.01	211,612.03
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	252.76	321,005.20

SALESFORCE.COM INC	16,008	251.56	4,026,972.48
SERVICENOW INC	3,155	587.83	1,854,603.65
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	291.52	110,777.60
SPLUNK INC	2,723	147.46	401,533.58
SQUARE INC - A	6,284	267.88	1,683,357.92
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	77.20	318,527.20
SYNOPSYS INC	2,499	293.12	732,506.88
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,048	80.91	570,253.68
TWILIO INC - A	2,599	364.94	948,479.06
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	477.78	279,501.30
UNITY SOFTWARE INC	839	128.87	108,121.93
VERISIGN INC	1,710	209.44	358,142.40
VISA INC-CLASS A SHARES	27,845	232.65	6,478,139.25
VMWARE INC-CLASS A	1,126	157.66	177,525.16
WESTERN UNION CO	5,513	22.49	123,987.37
WIX.COM LTD	998	205.49	205,079.02
WORKDAY INC-CLASS A	2,951	236.68	698,442.68
ZENDESK INC	1,677	123.72	207,478.44
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,307	355.24	1,174,778.68
ZSCALER INC	1,359	245.15	333,158.85
AMPHENOL CORP-CL A	9,809	73.99	725,767.91
APPLE INC	274,583	149.10	40,940,325.30
ARISTA NETWORKS INC	1,021	364.07	371,715.47
ARROW ELECTRONICS INC	902	116.48	105,064.96
CDW CORP/DE	2,130	198.32	422,421.60
CISCO SYSTEMS INC	69,587	56.47	3,929,577.89
COGNEX CORP	2,959	82.09	242,904.31
CORNING INC	12,703	40.31	512,057.93
DELL TECHNOLOGIES -C	3,945	100.03	394,618.35
F5 NETWORKS INC	916	204.37	187,202.92
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	14.98	288,424.92
HP INC	19,172	29.01	556,179.72
IPG PHOTONICS CORP	558	169.12	94,368.96
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	28.89	130,958.37
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	166.10	512,584.60

MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,775	233.03	646,658.25
NETAPP INC	3,390	82.28	278,929.20
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,159	90.34	285,384.06
TE CONNECTIVITY LTD	5,405	152.57	824,640.85
TRIMBLE INC	4,462	88.90	396,671.80
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	63.15	324,906.75
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	571.07	533,379.38
AT&T INC	117,540	28.19	3,313,452.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	29.26	38,213.56
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	29.32	182,751.56
LUMEN TECHNOLOGIES INC	12,971	12.09	156,819.39
T-MOBILE US INC	10,055	144.94	1,457,371.70
VERIZON COMMUNICATIONS INC	68,124	55.87	3,806,087.88
AES CORP	9,870	24.79	244,677.30
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	61.07	226,203.28
AMEREN CORPORATION	4,330	88.84	384,677.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,198	89.69	735,278.62
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,044	178.92	544,632.48
ATMOS ENERGY CORP	2,000	101.47	202,940.00
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	26.90	266,659.70
CMS ENERGY CORP	5,193	63.46	329,547.78
CONSOLIDATED EDISON INC	5,799	77.74	450,814.26
DOMINION ENERGY INC	13,150	77.71	1,021,886.50
DTE ENERGY COMPANY	3,309	120.30	398,072.70
DUKE ENERGY CORP	12,477	106.00	1,322,562.00
EDISON INTERNATIONAL	6,481	57.00	369,417.00
ENERGY CORP	3,422	109.88	376,009.36
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	49.27	196,193.14
EVERGY INC	3,540	68.10	241,074.00
EVERSOURCE ENERGY	5,222	90.44	472,277.68
EXELON CORP	16,097	48.35	778,289.95
FIRSTENERGY CORP	8,044	38.64	310,820.16
NEXTERA ENERGY INC	32,489	83.45	2,711,207.05
NISOURCE INC	7,043	25.47	179,385.21
NRG ENERGY INC	3,312	43.65	144,568.80

P G & E CORP	21,589	9.12	196,891.68	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	79.78	121,744.28	
PPL CORP	13,143	29.41	386,535.63	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,469	64.72	548,113.68	
SEMPRA ENERGY	5,230	133.77	699,617.10	
SOUTHERN CO/THE	17,217	65.53	1,128,230.01	
UGI CORP	3,091	48.09	148,646.19	
VISTRA CORP	4,854	18.40	89,313.60	
WEC ENERGY GROUP INC	5,298	96.21	509,720.58	
XCEL ENERGY INC	9,302	69.04	642,210.08	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,422	110.55	2,147,102.10	
ANALOG DEVICES INC	5,956	170.08	1,012,996.48	
APPLIED MATERIALS INC	14,699	129.90	1,909,400.10	
BROADCOM INC	6,735	486.16	3,274,287.60	
ENPHASE ENERGY INC	2,171	175.00	379,925.00	
INTEL CORP	66,964	53.49	3,581,904.36	
KLA CORP	2,499	327.88	819,372.12	
LAM RESEARCH CORP	2,296	580.41	1,332,621.36	
MARVELL TECHNOLOGY INC	12,993	60.39	784,647.27	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	4,691	99.73	467,833.43	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,387	151.57	664,937.59	
MICRON TECHNOLOGY INC	17,977	70.92	1,274,928.84	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	464.85	283,093.65	
NVIDIA CORP	40,620	201.88	8,200,365.60	
NXP SEMICONDUCTORS NV	4,480	215.26	964,364.80	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	43.45	235,716.25	
QORVO INC	1,631	188.36	307,215.16	
QUALCOMM INC	18,778	148.64	2,791,161.92	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	183.39	495,703.17	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	716	284.37	203,608.92	
TERADYNE INC	2,952	118.75	350,550.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	15,201	188.70	2,868,428.70	
XILINX INC	4,011	146.63	588,132.93	
米ドル 小計	5,063,352		644,563,469.96	(70,586,145,595)

カナダドル	CAMECO CORP	6,660	20.98	139,726.80
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	19,669	41.30	812,329.70
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	10.29	226,771.02
	ENBRIDGE INC	32,985	49.05	1,617,914.25
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	34.18	98,335.86
	INTER PIPELINE LTD	3,471	19.95	69,246.45
	KEYERA CORP	2,259	31.15	70,367.85
	PARKLAND CORP	1,790	37.76	67,590.40
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	40.49	349,671.64
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	24.02	615,272.30
	TC ENERGY CORP	15,580	60.12	936,669.60
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,733	74.05	350,478.65
	B2GOLD CORP	10,119	4.89	49,481.91
	BARRICK GOLD CORP	29,830	25.38	757,085.40
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	71.53	222,029.12
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	26.58	244,881.54
	FRANCO-NEVADA CORP	3,254	193.73	630,397.42
	IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	9.94	102,968.46
	KINROSS GOLD CORP	19,092	7.60	145,099.20
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,057	50.66	256,187.62
	LUNDIN MINING CORP	7,300	11.29	82,417.00
	NUTRIEN LTD	9,609	79.63	765,164.67
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	33.19	68,039.50
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	28.59	211,680.36
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,300	92.08	119,704.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	55.63	438,698.18
	YAMANA GOLD INC	9,288	5.48	50,898.24
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	18.91	50,565.34
	CAE INC	5,971	35.99	214,896.29
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	107.20	151,795.20
	WSP GLOBAL INC	1,908	159.34	304,020.72
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	44.55	139,664.25
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	77.00	139,293.00	
THOMSON REUTERS CORP	2,714	143.48	389,404.72	
AIR CANADA	840	24.13	20,269.20	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,656	134.50	1,567,732.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,094	90.82	1,007,557.08
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	107.58	581,900.22
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	48.02	181,899.76
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	81.74	433,140.26
QUEBECOR INC -CL B	1,274	30.63	39,022.62
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	36.47	317,361.94
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	198.07	184,799.31
DOLLARAMA INC	5,287	58.06	306,963.22
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	14,242	51.09	727,623.78
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	41.05	107,879.40
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	86.88	281,751.84
METRO INC	4,107	63.87	262,314.09
WESTON (GEORGE) LTD	817	132.34	108,121.78
SAPUTO INC	3,667	36.15	132,562.05
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	34.45	211,454.10
CANOPY GROWTH CORP	3,659	22.58	82,620.22
BANK OF MONTREAL	10,497	128.73	1,351,278.81
BANK OF NOVA SCOTIA	19,615	80.97	1,588,226.55
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,311	149.13	1,090,289.43
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	96.74	546,194.04
ROYAL BANK OF CANADA	23,657	131.06	3,100,486.42
TORONTO-DOMINION BANK	29,178	86.12	2,512,809.36
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,038	70.97	1,493,066.86
IGM FINANCIAL INC	81	46.11	3,734.91
ONEX CORPORATION	908	88.97	80,784.76
TMX GROUP LTD	540	138.24	74,649.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	561.23	255,920.88
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	39.50	170,956.00
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	74.97	94,012.38
INTACT FINANCIAL CORP	2,773	173.93	482,307.89
MANULIFE FINANCIAL CORP	32,652	25.46	831,319.92
POWER CORP OF CANADA	10,869	42.40	460,845.60
SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	66.71	666,432.90
FIRSTSERVICE CORP	671	237.00	159,027.00



	BLACKBERRY LTD	7,347	12.38	90,955.86	
	CGI INC	3,488	112.37	391,946.56	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,057.07	701,460.87	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	118.95	189,487.35	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	130.21	107,944.09	
	OPEN TEXT CORP	4,289	67.01	287,405.89	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,863	1,874.65	3,492,472.95	
	BCE INC	2,440	63.98	156,111.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	63.60	329,002.80	
	TELUS CORP	4,085	28.56	116,667.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	19.54	174,843.92	
	ALTAGAS LTD	2,930	25.90	75,887.00	
	ATCO LTD -CLASS I	863	43.04	37,143.52	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	51.63	106,151.28	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.76	35,295.12	
	EMERA INC	4,109	59.17	243,129.53	
	FORTIS INC	8,232	58.21	479,184.72	
	HYDRO ONE LTD	4,991	31.32	156,318.12	
	NORTHLAND POWER INC	3,252	40.05	130,242.60	
	カナダドル 小計	642,868		39,707,713.82	(3,468,865,879)
ユーロ	ENI SPA	42,914	10.51	451,369.45	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.61	63,859.38	
	NESTE OYJ	7,057	50.16	353,979.12	
	OMV AG	2,574	47.62	122,573.88	
	REPSOL SA	21,728	9.65	209,783.84	
	TENARIS SA	5,062	8.78	44,444.36	
	TOTALENERGIES SE	40,333	38.22	1,541,527.26	
	VOPAK	762	35.93	27,378.66	
	AIR LIQUIDE SA	7,694	148.78	1,144,713.32	
	AKZO NOBEL	3,222	107.35	345,881.70	
	ARCELORMITTAL	12,348	30.88	381,306.24	
	ARKEMA	822	111.10	91,324.20	
	BASF SE	14,987	69.00	1,034,103.00	
	COVESTRO AG	2,528	56.06	141,719.68	

CRH PLC	13,125	44.96	590,100.00
EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	29.49	115,659.78
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	43.70	47,414.50
HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	76.50	165,546.00
KONINKLIJKE DSM NV	2,864	177.65	508,789.60
LANXESS AG	745	60.82	45,310.90
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	49.08	195,142.08
SOLVAY SA	1,489	118.00	175,702.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	17.00	148,215.58
SYMRISE AG	2,370	124.00	293,880.00
UMICORE	3,883	60.00	232,980.00
UPM-KYMMENE OYJ	9,909	35.05	347,310.45
VOESTALPINE AG	2,425	40.36	97,873.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	23.48	67,505.00
AIRBUS SE	9,541	115.44	1,101,413.04
ALSTOM	5,811	35.50	206,290.50
BOUYGUES SA	3,499	34.98	122,395.02
BRENTAG SE	2,419	85.88	207,743.72
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	14.70	239,286.60
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8,413	64.60	543,479.80
DASSAULT AVIATION SA	11	994.50	10,939.50
EIFFAGE	1,313	87.38	114,729.94
FERROVIAL SA	7,014	25.18	176,612.52
GEA GROUP AG	1,676	38.65	64,777.40
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	94.74	194,217.00
KION GROUP AG	740	92.12	68,168.80
KNORR-BREMSE AG	1,136	98.44	111,827.84
KONE OYJ-B	5,617	70.28	394,762.76
LEGRAND SA	4,481	97.54	437,076.74
MTU AERO ENGINES AG	831	207.20	172,183.20
PRYSMIAN SPA	4,594	32.24	148,110.56
RATIONAL AG	80	934.80	74,784.00
SAFRAN SA	5,615	109.74	616,190.10
SCHNEIDER ELECTRIC SE	8,718	153.00	1,333,854.00
SIEMENS AG-REG	12,784	141.90	1,814,049.60

SIEMENS ENERGY AG	5,006	23.90	119,643.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	24.55	101,342.40
THALES SA	1,768	87.28	154,311.04
VINCI SA	8,693	91.46	795,061.78
WARTSILA OYJ ABP	8,128	12.59	102,372.16
BUREAU VERITAS SA	4,564	28.05	128,020.20
RANDSTAD NV	1,871	62.32	116,600.72
TELEPERFORMANCE	1,061	362.10	384,188.10
WOLTERS KLUWER	4,447	96.12	427,445.64
ADP	314	101.70	31,933.80
AENA SME SA	1,497	137.50	205,837.50
ATLANTIA SPA	8,066	15.76	127,120.16
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	9.28	13,065.40
DEUTSCHE POST AG-REG	16,274	58.09	945,356.66
GETLINK	9,276	14.01	130,003.14
INPOST SA	3,195	16.07	51,343.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,485	82.91	454,761.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	71.45	44,227.55
CONTINENTAL AG	1,647	117.76	193,950.72
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	13,868	75.83	1,051,610.44
FAURECIA	1,292	38.43	49,651.56
FERRARI NV	2,135	192.10	410,133.50
MICHELIN (CGDE)	2,826	144.05	407,085.30
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	90.56	217,253.44
RENAULT SA	3,099	33.66	104,327.83
STELLANTIS NV	33,623	18.61	625,724.03
VALEO SA	3,692	25.85	95,438.20
VOLKSWAGEN AG	462	309.20	142,850.40
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,043	207.35	630,966.05
ADIDAS AG	3,112	318.80	992,105.60
ESSILORLUXOTTICA	4,703	164.92	775,618.76
HERMES INTERNATIONAL	524	1,347.50	706,090.00
KERING	1,227	788.90	967,980.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,615	709.80	3,275,727.00
MONCLER SPA	3,302	61.88	204,327.76

PUMA SE	1,586	108.65	172,318.90
SEB SA	609	137.70	83,859.30
ACCOR SA	2,330	28.95	67,453.50
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	166.85	466,846.30
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	44.55	35,907.30
SODEXO	1,088	72.26	78,618.88
BOLLORE	14,850	4.92	73,121.40
PUBLICIS GROUPE	3,613	54.98	198,642.74
SCOUT24 AG	1,621	70.06	113,567.26
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	51.52	56,414.40
VIVENDI	11,862	30.45	361,197.90
DELIVERY HERO SE	2,411	116.40	280,640.40
HELLOFRESH SE	3,031	81.78	247,875.18
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,187	29.98	545,246.26
JUST EAT TAKEAWAY	2,552	72.74	185,632.48
PROSUS NV	7,939	75.94	602,887.66
ZALANDO SE	3,598	93.50	336,413.00
CARREFOUR SA	10,978	16.99	186,571.11
COLRUYT SA	290	48.01	13,922.90
JERONIMO MARTINS	5,217	17.54	91,532.26
KESKO OYJ-B SHS	4,478	37.00	165,686.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,272	27.80	480,247.96
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	12,812	52.67	674,808.04
DANONE	10,826	64.48	698,060.48
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	12.21	110,106.01
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	80.30	146,146.00
HEINEKEN NV	4,350	94.12	409,422.00
JDE PEET'S BV	1,184	29.32	34,714.88
KERRY GROUP PLC-A	2,701	123.25	332,898.25
PERNOD RICARD SA	3,480	185.70	646,236.00
REMY COINTREAU	264	176.50	46,596.00
BEIERSDORF AG	1,716	105.90	181,724.40
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	78.40	122,460.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	85.80	205,576.80
L'OREAL	4,043	403.10	1,629,733.30

AMPLIFON SPA	2,059	42.82	88,166.38
BIOMERIEUX	402	101.85	40,943.70
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	185.95	117,148.50
DIASORIN SPA	256	177.85	45,529.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	68.78	266,728.84
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	46.19	329,242.32
KONINKLIJKE PHILIPS NV	14,872	37.68	560,376.96
ORPEA	1,093	103.20	112,797.60
SARTORIUS AG-VORZUG	502	536.40	269,272.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	59.68	278,526.56
ARGENX SE	674	266.60	179,688.40
BAYER AG-REG	16,071	47.85	769,077.70
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	113.76	244,470.24
GRIFOLS SA	3,329	20.59	68,544.11
IPSEN	158	80.50	12,719.00
MERCK KGAA	2,192	195.00	427,440.00
ORION OYJ-CLASS B	739	34.88	25,776.32
QIAGEN N.V.	4,271	43.36	185,190.56
RECORDATI SPA	1,969	56.84	111,917.96
SANOFI	18,960	87.45	1,658,052.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	479.40	212,853.60
UCB SA	2,009	98.16	197,203.44
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	11.76	44,766.17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	109,886	5.86	644,041.84
BANCO SANTANDER SA	282,095	3.26	920,617.03
BNP PARIBAS	18,170	54.38	988,084.60
CAIXABANK S.A	78,740	2.64	208,503.52
COMMERZBANK AG	13,866	5.43	75,292.38
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	12.29	270,455.70
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	35.09	137,587.89
FINECOBANK SPA	11,008	16.18	178,109.44
ING GROEP NV-CVA	62,971	11.70	736,886.64
INTESA SANPAOLO	271,197	2.44	663,890.25
KBC GROEP NV	4,507	71.44	321,980.08
MEDIOBANCA SPA	6,857	9.98	68,487.71

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	21.16	25,730.56
SOCIETE GENERALE SA	14,646	27.45	402,105.93
UNICREDIT SPA	35,836	10.64	381,581.72
AMUNDI SA	618	81.85	50,583.30
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	10.98	387,421.29
DEUTSCHE BOERSE AG	3,191	147.35	470,193.85
EURAZEO	403	88.35	35,605.05
EXOR NV	2,224	75.64	168,223.36
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	99.98	197,860.42
SOFINA	168	386.80	64,982.40
WENDEL	294	124.00	36,456.00
AEGON NV	35,058	4.23	148,610.86
AGEAS	2,765	44.61	123,346.65
ALLIANZ SE-REG	6,681	201.95	1,349,227.95
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	17.37	354,780.12
AXA SA	31,953	24.44	781,091.08
CNP ASSURANCES	1,015	14.74	14,961.10
HANNOVER RUECK SE	1,152	155.10	178,675.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,344	250.90	588,109.60
NN GROUP NV	4,060	45.49	184,689.40
POSTE ITALIANE SPA	5,374	11.68	62,795.19
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	43.67	367,745.07
SCOR SE	1,565	25.05	39,203.25
AROUNDTOWN SA	10,475	6.94	72,738.40
DEUTSCHE WOHNEN SE	6,085	52.88	321,774.80
LEG IMMOBILIEN SE	1,031	136.85	141,092.35
VONOVIA SE	9,452	59.10	558,613.20
ADYEN NV	322	2,356.50	758,793.00
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	53.28	407,485.44
ATOS SE	1,599	43.47	69,508.53
BECHTLE AG	414	175.30	72,574.20
CAPGEMINI SA	2,687	190.55	512,007.85
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	47.89	556,577.58
EDENRED	3,764	48.65	183,118.60
NEMETSCHEK SE	536	79.18	42,440.48

NEXI SPA	7,091	17.40	123,418.85
SAP SE	17,307	125.60	2,173,759.20
TEAMVIEWER AG	2,285	28.29	64,642.65
WORLDLINE SA	4,054	76.06	308,347.24
NOKIA OYJ	89,059	5.20	463,552.09
CELLNEX TELECOM SA	8,821	58.36	514,793.56
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	54,555	18.55	1,012,213.47
ELISA OYJ	2,152	55.48	119,392.96
ILIAD SA	98	182.10	17,845.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.95	24,601.34
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.74	161,747.82
ORANGE	34,597	9.62	333,030.72
PROXIMUS	918	17.53	16,097.13
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.39	28,175.78
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.40	28,998.06
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.38	30,026.08
TELEFONICA SA	91,673	4.28	392,727.13
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	35.02	26,825.32
E.ON SE	38,444	10.77	414,041.88
EDF	10,409	11.01	114,603.09
EDP RENOVAVEIS SA	3,232	20.40	65,932.80
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.50	223,267.64
ELIA GROUP SA/NV	345	104.80	36,156.00
ENAGAS SA	2,667	19.82	52,859.94
ENDESA SA	4,803	20.82	99,998.46
ENEL SPA	133,241	7.88	1,051,138.24
ENGIE	31,335	11.92	373,575.87
FORTUM OYJ	6,395	24.38	155,910.10
IBERDROLA SA	94,841	10.15	962,636.15
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	21.80	101,326.40
RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	17.29	149,281.86
RWE AG	11,090	31.36	347,782.40
SNAM SPA	32,585	5.25	171,331.93
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	19.63	113,775.48
TERNA SPA	25,545	7.01	179,070.45

	UNIPER SE	2,857	32.50	92,852.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	28.25	242,046.00	
	VERBUND AG	1,516	82.35	124,842.60	
	ASM INTERNATIONAL NV	888	312.10	277,144.80	
	ASML HOLDING NV	6,910	665.60	4,599,296.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	21,326	34.66	739,265.79	
	STMICROELECTRONICS NV	11,414	36.49	416,496.86	
	ユーロ 小計	2,975,012		80,920,749.27 (10,450,914,768)	
英債券	BP PLC	330,682	3.05	1,009,737.48	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	66,729	14.59	973,976.48	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	60,484	14.38	870,243.79	
	ANGLO AMERICAN PLC	21,366	33.89	724,093.74	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	15.43	66,679.20	
	BHP GROUP PLC	34,634	23.22	804,374.65	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	90.18	197,764.74	
	EVRAZ PLC	3,072	5.88	18,075.64	
	GLENCORE PLC	166,199	3.36	559,841.33	
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	30.56	95,927.84	
	MONDI PLC	7,876	20.61	162,324.36	
	RIO TINTO PLC	18,226	56.50	1,029,769.00	
	ASHTED GROUP PLC	7,512	56.36	423,376.32	
	BAE SYSTEMS PLC	55,064	5.80	319,481.32	
	BUNZL PLC	4,790	26.58	127,318.20	
	DCC PLC	1,401	61.26	85,825.26	
	FERGUSON PLC	3,775	102.95	388,636.25	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.74	133,498.15	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.11	182,889.98	
	SMITHS GROUP PLC	6,986	14.71	102,798.99	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	157.80	189,991.20	
	EXPERIAN PLC	15,285	31.37	479,490.45	
	INTERTEK GROUP PLC	2,573	52.16	134,207.68	
	RELX PLC	31,739	21.71	689,053.69	
	RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	5.59	165,504.87	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	7.19	147,431.64	



BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	49.43	74,046.14
BURBERRY GROUP PLC	5,808	21.30	123,710.40
PERSIMMON PLC	5,194	29.05	150,885.70
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.76	76,509.97
COMPASS GROUP PLC	30,179	14.97	451,930.52
ENTAIN PLC	10,699	19.60	209,700.40
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	46.09	115,778.08
WHITBREAD PLC	2,921	31.20	91,135.20
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	6.37	72,207.50
INFORMA PLC	30,041	5.52	165,826.32
PEARSON PLC	13,772	7.84	108,027.56
WPP PLC	19,572	9.96	195,054.55
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	9.76	48,449.28
KINGFISHER PLC	29,802	3.69	110,148.19
NEXT PLC	2,522	81.08	204,483.76
OCADO GROUP PLC	9,232	17.80	164,329.60
SAINSBURY (J) PLC	27,842	3.02	84,166.36
TESCO PLC	131,492	2.42	319,459.81
WM MORRISON SUPERMARKETS	42,443	2.79	118,797.95
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	20.75	103,210.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	35,567	26.86	955,329.62
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	26.66	101,787.88
DIAGEO PLC	37,936	36.35	1,379,163.28
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	16.01	228,005.55
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	11,553	56.30	650,433.90
UNILEVER PLC	43,475	41.59	1,808,125.25
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	13.84	233,108.26
ASTRAZENECA PLC	25,687	84.26	2,164,386.62
GLAXOSMITHKLINE PLC	81,445	14.91	1,214,996.51
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	25.30	34,205.60
BARCLAYS PLC	284,737	1.85	527,048.18
HSBC HOLDINGS PLC	327,374	4.11	1,347,144.01
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,158,693	0.46	535,663.77
NATWEST GROUP PLC	73,118	2.19	160,494.01

	STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.64	184,979.06
	3I GROUP PLC	18,949	13.36	253,253.38
	ABRDN PLC	32,937	2.85	94,068.07
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	14.86	83,169.67
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,447	79.30	431,947.10
	M&G PLC	41,949	2.26	94,888.63
	SCHRODERS PLC	1,161	37.50	43,537.50
	ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	16.45	127,526.25
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	36.08	99,039.60
	AVIVA PLC	74,601	4.26	317,949.46
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	3.05	59,868.83
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.74	285,669.66
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.63	58,065.00
	PRUDENTIAL PLC	43,245	15.18	656,675.32
	AVEVA GROUP PLC	2,041	40.54	82,742.14
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	7.22	109,650.14
	HALMA PLC	6,704	29.60	198,438.40
	BT GROUP PLC	161,710	1.78	287,924.65
	VODAFONE GROUP PLC	448,104	1.20	539,069.11
	NATIONAL GRID PLC	59,116	9.55	564,853.38
	SEVERN TRENT PLC	2,734	28.70	78,465.80
	SSE PLC	18,204	16.25	295,815.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	10.87	142,832.25
	英ポンド 小計	4,820,557		29,500,490.88 (4,476,404,486)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.72	56,196.52
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	1,024.00	79,872.00
	GIVAUDAN-REG	153	4,596.00	703,188.00
	HOLCIM LTD	8,800	54.00	475,200.00
	SIKA AG-REG	2,337	331.60	774,949.20
	ABB LTD-REG	28,259	34.62	978,326.58
	GEBERIT AG-REG	620	771.20	478,144.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	293.60	63,124.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	305.80	216,200.60
	ADECCO SA-REG	2,354	53.20	125,232.80

	SGS SA-REG	90	2,859.00	257,310.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	315.00	265,860.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	8,543	114.90	981,590.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	291.80	119,638.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	56.55	14,194.05	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,344.00	98,448.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	10,300.00	247,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	104,300.00	104,300.00	
	NESTLE SA-REG	47,407	114.54	5,429,997.78	
	ALCON INC	8,263	64.84	535,772.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	360.00	370,440.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	162	1,670.00	270,540.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,218	722.20	879,639.60	
	NOVARTIS AG-REG	36,744	85.96	3,158,514.24	
	ROCHE HOLDING AG-BR	604	406.20	245,344.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11,592	367.95	4,265,276.40	
	VIFOR PHARMA AG	638	131.15	83,673.70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	83.20	22,713.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,644	9.53	397,117.18	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	63.12	225,275.28	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,610.00	645,610.00	
	UBS GROUP AG-REG	60,103	15.68	942,715.55	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	150.90	99,292.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	516	494.40	255,110.40	
	SWISS RE AG	5,123	86.92	445,291.16	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,466	408.10	1,006,374.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	98.80	110,359.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	140.95	164,770.55	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	98.72	291,125.28	
	SWISSCOM AG-REG	414	547.60	226,706.40	
	スイスフラン 小計	284,636		26,110,635.69 (3,123,354,241)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	266.90	862,087.00	
	BOLIDEN AB	4,039	335.50	1,355,084.50	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	9,468	166.50	1,576,422.00	

ALFA LAVAL AB	4,566	367.50	1,678,005.00
ASSA ABLOY AB-B	17,091	287.90	4,920,498.90
ATLAS COPCO AB-A SHS	11,247	603.00	6,781,941.00
ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	509.00	3,500,902.00
EPIROC AB-A	9,564	198.25	1,896,063.00
EPIROC AB-B	4,649	172.30	801,022.70
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	321.00	469,944.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	105.65	2,846,527.95
SANDVIK AB	19,332	227.50	4,398,030.00
SKANSKA AB-B SHS	4,937	253.50	1,251,529.50
SKF AB-B SHARES	7,216	229.40	1,655,350.40
VOLVO AB-A SHS	3,298	207.20	683,345.60
VOLVO AB-B SHS	25,143	202.90	5,101,514.70
SECURITAS AB-B SHS	3,833	146.30	560,767.90
ELECTROLUX AB-SER B	3,653	224.70	820,829.10
HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	120.90	979,169.10
EVOLUTION AB	3,009	1,408.20	4,237,273.80
EMBRACER GROUP AB	4,198	189.65	796,150.70
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	180.16	2,353,610.24
ICA GRUPPEN AB	1,462	432.10	631,730.20
SWEDISH MATCH AB	26,306	77.62	2,041,871.72
ESSITY AKTIEBOLAG-B	10,496	280.50	2,944,128.00
NORDEA BANK ABP	54,039	104.22	5,631,944.58
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	119.60	2,856,406.80
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	101.50	2,335,007.50
SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	170.78	2,280,937.68
EQT AB	4,360	443.50	1,933,660.00
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	336.20	576,246.80
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	322.60	759,077.80
INVESTOR AB-B SHS	30,610	218.00	6,672,980.00
KINNEVIK AB - B	3,881	369.60	1,434,417.60
LUNDBERGS AB-B SHS	920	621.40	571,688.00
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	642.80	1,017,552.40
SINCH AB	7,260	170.70	1,239,282.00
ERICSSON LM-B SHS	49,181	100.40	4,937,772.40

	HEXAGON AB-B SHS	33,733	146.80	4,952,004.40	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	129.80	963,635.20	
	TELIA CO AB	49,229	38.23	1,882,024.67	
	スウェーデンコロナ 小計	539,716		95,188,436.84 (1,206,037,494)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	17,989	186.60	3,356,747.40	
	NORSK HYDRO ASA	20,202	62.50	1,262,625.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	451.20	1,250,726.40	
	ADEVINTA ASA	3,943	171.65	676,815.95	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	418.00	230,736.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	470.30	547,899.50	
	MOWI ASA	8,760	226.50	1,984,140.00	
	ORKLA ASA	11,182	79.68	890,981.76	
	DNB BANK ASA	13,700	188.90	2,587,930.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	211.40	565,283.60	
	TELENOR ASA	13,825	157.55	2,178,128.75	
	ノルウェークローネ 小計	96,764		15,532,014.36 (192,907,618)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	573.00	1,171,212.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	493.00	1,643,662.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	3,378.00	435,762.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,911	241.60	4,085,697.60	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	17,820.00	694,980.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	18,615.00	1,842,885.00	
	DSV PANALPINA A S	3,473	1,531.00	5,317,163.00	
	PANDORA A/S	1,659	812.00	1,347,108.00	
	CARLSBERG AS-B	1,603	1,097.00	1,758,491.00	
	AMBU A/S-B	1,526	218.60	333,583.60	
	COLOPLAST-B	2,245	1,133.50	2,544,707.50	
	DEMANT A/S	1,941	352.20	683,620.20	
	GN STORE NORD A/S	1,892	524.00	991,408.00	
	GENMAB A/S	1,125	2,950.00	3,318,750.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	28,663	647.20	18,550,693.60	
DANSKE BANK A/S	9,894	114.05	1,128,410.70		
TRYG A/S	4,694	161.80	759,489.20		

	ORSTED A/S	3,278	967.20	3,170,481.60
	デンマーククローネ 小計	84,549		49,778,105.00 (864,645,683)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	28.50	85,842.00
	OIL SEARCH LTD	32,812	3.98	130,591.76
	SANTOS LTD	26,550	6.42	170,451.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	32.95	11,763.15
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	22.19	414,442.63
	BHP GROUP LTD	47,944	52.81	2,531,922.64
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	25.49	269,913.61
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	3.91	63,107.40
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	22.30	652,096.60
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	51.12	340,254.72
	NEWCREST MINING LTD	15,067	25.19	379,537.73
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.29	138,207.33
	ORICA LTD	6,263	12.85	80,479.55
	RIO TINTO LTD	6,335	120.36	762,480.60
	SOUTH32 LTD	74,829	3.01	225,235.29
	REECE LTD	5,105	24.04	122,724.20
	BRAMBLES LTD	27,700	11.84	327,968.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.00	92,144.00
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.54	39,498.00
	SYDNEY AIRPORT	22,505	7.75	174,413.75
	TRANSURBAN GROUP	47,822	13.48	644,640.56
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	42.44	386,585.96
	CROWN RESORTS LTD	773	9.31	7,196.63
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	127.62	132,086.70
	TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	4.97	188,377.91
	REA GROUP LTD	563	149.74	84,303.62
SEEK LTD	6,794	29.99	203,752.06	
WESFARMERS LTD	18,825	65.12	1,225,884.00	
COLES GROUP LTD	24,160	18.40	444,544.00	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	7.05	119,575.05	
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	40.78	873,140.58	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	12.25	86,362.50	

	COCHLEAR LTD	1,060	250.45	265,477.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	67.71	186,202.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	41.45	301,341.50	
	CSL LTD	7,413	297.53	2,205,589.89	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	46,634	29.53	1,377,102.02	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	29,575	104.03	3,076,687.25	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	53,909	27.70	1,493,279.30	
	WESTPAC BANKING CORP	59,855	26.16	1,565,806.80	
	ASX LTD	3,256	80.93	263,508.08	
	MACQUARIE GROUP LTD	5,810	164.48	955,628.80	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	51.40	80,029.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	5.43	191,630.13	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	3.52	118,335.36	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	12.58	305,316.60	
	SUNCORP GROUP LTD	27,697	12.37	342,611.89	
	LENDLEASE GROUP	8,292	12.59	104,396.28	
	AFTERPAY LTD	3,885	132.01	512,858.85	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	16.48	92,353.92	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	35.03	56,048.00	
	XERO LTD	2,603	142.85	371,838.55	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.96	286,549.56	
	AGL ENERGY LTD	7,599	7.47	56,764.53	
	APA GROUP	24,697	9.76	241,042.72	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.92	2,766.22	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.45	117,515.60	
	オーストラリアドル 小計	1,083,253		25,980,204.68 (2,092,185,882)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.28	162,382.65	
	A2 MILK CO LTD	7,857	6.33	49,734.81	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,000	31.63	347,930.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	13.90	76,533.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.71	204,277.37	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.88	49,572.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.14	118,009.26	
		120,137		1,008,439.49	

	ニュージーランドドル 小計			(77,659,925)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	57.70	2,798,450.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	21,500	165.80	3,564,700.00
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	30.05	901,500.00
	MTR CORP	32,000	45.50	1,456,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	49.00	2,009,000.00
	SANDS CHINA LTD	50,200	25.15	1,262,530.00
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	6.35	12,700.00
	WYNN MACAU LTD	5,200	8.53	44,356.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	15.18	513,084.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	21.00	462,000.00
	WH GROUP LTD	152,000	6.57	998,640.00
	BANK OF EAST ASIA	3,600	13.02	46,872.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	25.20	1,738,800.00
	HANG SENG BANK LTD	11,900	147.50	1,755,250.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	19,800	501.00	9,919,800.00
	AIA GROUP LTD	196,000	92.85	18,198,600.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	51.95	2,078,000.00
	ESR CAYMAN LTD	29,200	22.65	661,380.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	20.70	558,900.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	35.80	1,070,992.80
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	37.15	965,900.00
	SINO LAND CO	58,000	12.02	697,160.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	109.80	2,712,060.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	53.45	224,490.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	22.00	110,000.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	39.70	913,100.00
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.86	358,380.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	47.00	206,800.00
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	77.75	1,866,000.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.99	247,690.00
HONG KONG & CHINA GAS	208,717	12.76	2,663,228.92	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	49.55	891,900.00	
	香港ドル 小計	1,324,633		61,908,263.72 (871,049,270)



シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.39	102,410.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	4.09	150,103.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	5.12	134,656.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.80	64,640.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.44	111,888.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	30,000	30.98	929,400.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	11.97	678,699.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	26.90	546,070.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	10.81	124,315.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	4.10	204,180.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	6.83	20,490.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.25	15,225.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	19.50	79,950.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.39	294,209.00	
シンガポールドル 小計		488,600		3,456,235.00	(279,332,912)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	12,922	23.70	306,251.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	460.30	175,374.30	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	27.36	498,800.16	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	26.45	474,089.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	16.41	388,441.11	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	104.80	148,187.20	
	AZRIELI GROUP	234	256.50	60,021.00	
	NICE SYSTEMS LTD	960	856.20	821,952.00	
イスラエルシュケル 小計		75,737		2,873,116.97	(97,928,468)
合 計		17,599,814		97,787,432,221	(97,787,432,221)

(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	137,860.58	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,239	460,114.50	
AMERICAN TOWER CORP	7,181	2,031,648.52	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,521	220,246.23	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	531,958.95	
BOSTON PROPERTIES INC	2,200	259,402.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	247,762.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,018	1,366,966.04	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,665	742,201.50	
DUKE REALTY CORP	5,513	281,107.87	
EQUINIX INC	1,459	1,187,757.31	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	202,837.20	
EQUITY RESIDENTIAL	6,281	519,187.46	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,187	376,219.65	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,391	420,050.88	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,835	352,388.05	
HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	166,943.63	
INVITATION HOMES INC	9,853	390,375.86	
IRON MOUNTAIN INC	4,068	187,534.80	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	180,244.02	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,088	393,191.28	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	81,293.70	
PROLOGIS INC	12,019	1,586,267.62	
PUBLIC STORAGE	2,608	820,659.36	
REALTY INCOME CORP	5,689	409,323.55	
REGENCY CENTERS CORP	2,658	176,012.76	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,836	649,595.16	
SIMON PROPERTY GROUP INC	5,481	732,645.27	
SUN COMMUNITIES INC	1,872	370,075.68	
UDR INC	5,162	276,115.38	
VENTAS INC	6,823	389,525.07	
VEREIT INC	3,546	177,796.44	
VICI PROPERTIES INC	7,940	238,438.20	
VORNADO REALTY TRUST	2,829	120,770.01	
WELLTOWER INC	7,019	597,387.09	
WEYERHAEUSER CO	12,823	446,496.86	

	WP CAREY INC	2,436	191,518.32
	米ドル 小計	208,965	17,919,918.80 (1,962,410,307)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	57,608.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	33,858.90
	カナダドル 小計	2,480	91,466.90 (7,990,548)
ユーロ	COVIVIO	522	42,240.24
	GECINA SA	569	77,014.15
	KLEPIERRE	3,496	73,940.40
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	173,606.91
	ユーロ 小計	6,868	366,801.70 (47,372,439)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	73,694.80
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	48,650.06
	SEGRO PLC	18,596	234,681.52
	英ポンド 小計	39,086	357,026.38 (54,175,182)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	23,352	247,064.16
	GOODMAN GROUP	29,600	673,400.00
	GPT GROUP	32,860	153,127.60
	MIRVAC GROUP	63,099	189,297.00
	SCENTRE GROUP	83,252	213,125.12
	STOCKLAND	29,890	134,803.90
	VICINITY CENTRES	42,168	67,047.12
	オーストラリアドル 小計	304,221	1,677,864.90 (135,118,460)
香港ドル	LINK REIT	38,700	2,823,165.00
	香港ドル 小計	38,700	2,823,165.00 (39,721,931)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	227,733.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	158,702.40
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	48,300.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	80,465.00
	シンガポールドル 小計	209,360	515,200.40 (41,638,496)

合計		2,288,427,363	
		(2,288,427,363)	

(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 597銘柄	97.3%		70.5%
	投資証券 37銘柄		2.7%	2.0%
カナダドル	株式 89銘柄	99.8%		3.5%
	投資証券 2銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	99.5%		10.4%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 84銘柄	98.8%		4.5%
	投資証券 3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%		3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.9%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	93.9%		2.1%
	投資証券 7銘柄		6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 32銘柄	95.6%		0.9%
	投資証券 1銘柄		4.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.0%		0.3%
	投資証券 4銘柄		13.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月16日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,767,574,685
コール・ローン	31,990,887
株式	13,655,180,135
投資証券	10,905,512
派生商品評価勘定	1,156,977
未収入金	194,439
未収配当金	32,253,511
差入委託証拠金	1,068,041,941
流動資産合計	16,567,298,087
資産合計	16,567,298,087
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	110,667,379
未払金	3,298,005
未払解約金	17,144,000
未払利息	86
流動負債合計	131,109,470
負債合計	131,109,470
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	10,079,807,482
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,356,381,135
元本等合計	16,436,188,617
純資産合計	16,436,188,617
負債純資産合計	16,567,298,087

## 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
-------------------	---

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	8,411,464,997円
期中追加設定元本額	4,169,028,815円
期中一部解約元本額	2,500,686,330円
期末元本額	10,079,807,482円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	611,630,947円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,146,561,866円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,341,706,237円
DCりそな グローバルバランス	10,545,124円
つみたてバランスファンド	487,595,332円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	296,048,291円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	159,433,057円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	100,148,985円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	27,177,647円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	17,657,792円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,275,524円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,382,893円

リスクコントロール・オープン	8,772,334円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	139,924,574円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	102,694,219円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,402,251,890円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,416,969,061円
Smart-i 8資産バランス 安定型	52,196,293円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	136,077,502円
Smart-i 8資産バランス 成長型	153,487,619円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	246,547,782円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	460,808,651円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	274,226,886円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	198,295,274円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	225,856,987円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	39,117,982円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,299,320円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	11,963円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	41,271円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	64,179円
2. 計算日における受益権の総数	10,079,807,482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	1.6306円
(10,000口当たり純資産額)	(16,306円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### （金融商品に関する注記）

##### 金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月16日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		938,635,660
投資証券		1,078,667
合計		937,556,993



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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 8月16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	2,899,497,912	-	2,790,092,494	109,405,418
合計		2,899,497,912	-	2,790,092,494	109,405,418

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(通貨関連)

(2021年 8月16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	37,302,918	-	37,197,457	105,461
	米ドル	37,302,918	-	37,197,457	105,461
	売建	75,238	-	74,761	477
	韓国ウォン	75,238	-	74,761	477
合計		37,378,156	-	37,272,218	104,984

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	92,693	7.98	740,060.91	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	6,475	88.02	569,929.50	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,433	236.30	338,617.90	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	18,641	7.57	141,112.37	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	11,989	4.55	54,645.86	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,726	40.65	151,461.90	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	4.87	9,253.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	7.34	23,436.62	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	9,876	33.34	329,265.84	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,400	34.14	81,936.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	19.09	44,785.14	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,078	92.30	99,499.40	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	24.00	76,800.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,285	67.21	86,364.85	
	51JOB INC-ADR	500	69.83	34,915.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	8.32	39,104.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	6,900	27.21	187,749.00	
	LI AUTO INC - ADR	8,400	28.66	240,744.00	
	NIO INC - ADR	20,100	41.03	824,703.00	
	XPENG INC - ADR	6,000	40.15	240,900.00	
GAOTU TECHEDU INC	1,900	2.91	5,529.00		
HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,800	43.93	123,004.00		

NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	24,300	1.97	47,871.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	6,500	5.48	35,620.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	6,550	61.54	403,087.00
AUTOHOME INC-ADR	1,020	38.91	39,688.20
BAIDU INC - SPON ADR	4,150	152.45	632,667.50
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,500	74.10	185,250.00
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	3.45	5,520.00
HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	12.12	32,118.00
HUYA INC-ADR	1,300	10.10	13,130.00
IQIYI INC-ADR	4,500	9.47	42,615.00
JOYY INC	920	45.20	41,584.00
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	20.60	34,834.60
NETEASE INC-ADR	6,310	89.66	565,754.60
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	10,500	9.80	102,900.00
WEIBO CORP-SPON ADR	930	52.65	48,964.50
YANDEX NV-A	4,700	67.94	319,318.00
BAOZUN INC-SPN ADR	900	22.07	19,863.00
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	21.35	21,350.00
JD.COM INC-ADR	13,420	69.86	937,521.20
OZON HOLDINGS PLC - ADR	600	51.99	31,194.00
PINDUODUO INC-ADR	6,800	84.38	573,784.00
TRIP.COM GROUP LTD	7,950	24.91	198,034.50
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,000	16.26	113,820.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,497	15.09	67,859.73
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	33.94	63,773.26
ADECOAGRO SA	1,800	9.05	16,290.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,600	5.02	8,032.00
BEIGENE LTD-ADR	700	276.19	193,333.00
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	800	21.39	17,112.00
HUTCHMED CHINA-ADR	1,300	41.15	53,495.00
I-MAB-SPONSORED ADR	500	70.18	35,090.00
ZAI LAB LTD-ADR	1,200	150.24	180,288.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	20,476	3.71	75,965.96
CREDICORP LTD	1,044	100.33	104,744.52
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	41,932	17.96	753,098.72

	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	1,893	96.46	182,598.78
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.38	30,589.16
	360 DIGITECH INC	1,400	18.70	26,180.00
	LUFAX HOLDING LTD	2,900	7.76	22,504.00
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	41.46	20,730.00
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,400	16.07	22,498.00
	KE HOLDINGS INC	5,600	17.80	99,680.00
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.95	9,646.56
	21VIANET GROUP INC-ADR	1,400	18.88	26,432.00
	AGORA INC-ADR	800	28.51	22,808.00
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	11.27	16,905.00
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,400	57.90	81,060.00
	GLOBANT SA	621	271.42	168,551.82
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	27.56	24,804.00
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,900	4.78	9,082.00
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,200	8.65	62,280.00
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	800	51.50	41,200.00
	米ドル 小計	469,450		11,326,937.90 (1,240,412,969)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	240,900	16.10	3,878,490.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	49,400	93.24	4,606,056.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	271.17	501,664.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	55.45	787,390.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	64.29	475,746.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,700	225.54	1,511,118.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	348.43	1,055,742.90
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	150.06	412,665.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	39,400	51.04	2,010,976.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	68.34	150,348.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	83,200	70.23	5,843,136.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	122.96	946,792.00
	BECLE SAB DE CV	5,300	45.87	243,111.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	116.75	904,228.75
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	30,800	174.43	5,372,444.00
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	218.00	622,390.00

	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	48.89	1,305,363.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	24,500	32.15	787,675.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	41,000	131.29	5,382,890.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	30,800	19.30	594,440.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	537,500	17.24	9,266,500.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	15.87	312,639.00	
	メキシコペソ 小計	1,185,630		46,971,805.15	(258,664,336)
ブラジルリアル	COSAN SA	16,900	23.59	398,671.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	58,500	29.92	1,750,320.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	74,700	29.35	2,192,445.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	15.59	162,136.00	
	BRADESPAR SA -PREF	3,300	70.10	231,330.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	56.49	163,821.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	42.61	421,839.00	
	GERDAU SA-PREF	18,400	31.32	576,288.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	25.21	257,142.00	
	SUZANO SA	11,907	56.81	676,436.67	
	VALE SA	61,700	108.30	6,682,110.00	
	WEG SA	26,600	35.77	951,482.00	
	CCR SA	18,800	11.87	223,156.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	9,710	57.45	557,839.50	
	RUMO SA	21,000	19.12	401,520.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,700	59.51	160,677.00	
	AMERICANAS SA	5,500	43.14	237,270.00	
	LOJAS RENNER S.A.	13,000	40.84	530,920.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	46,300	20.27	938,501.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	18,700	27.25	509,575.00	
	VIA VAREJO SA	21,100	11.30	238,430.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	18.84	150,720.00	
	RAIA DROGASIL SA	17,600	25.88	455,488.00	
	AMBEV SA	74,400	16.65	1,238,760.00	
	BRF SA	9,900	23.77	235,323.00	
	JBS SA	16,900	31.33	529,477.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	14,300	54.51	779,493.00	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	15.35	264,020.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	8,300	84.23	699,109.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	3,700	73.00	270,100.00	
	HYPERA SA	6,400	36.57	234,048.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	23,432	19.97	467,937.04	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	76,379	23.23	1,774,284.17	
	BANCO DO BRASIL S.A.	13,800	29.50	407,100.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	5,500	65.65	361,075.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,200	40.77	252,774.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	75,800	30.78	2,333,124.00	
	ITAUSA SA	70,000	11.51	805,700.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	97,500	14.64	1,427,400.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,800	29.69	498,792.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	20.62	202,076.00	
	TOTVS SA	7,200	35.95	258,840.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	7,600	42.10	319,960.00	
	TIM SA	9,000	11.71	105,390.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	38.91	132,294.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	39.02	191,198.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	15,742	11.57	182,134.94	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	6.38	70,180.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	33.59	167,950.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	26.42	60,766.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	43.35	86,700.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	37.96	86,359.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,100	24.19	365,269.00	
	ブラジルリアル 小計	1,119,645		33,675,750.32	(702,503,092)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	6,600.00	37,587,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,620.10	24,014,742.30	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,233	42,001.00	93,788,233.00	
	FALABELLA SA	10,992	3,170.00	34,844,640.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,487.00	38,514,787.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	7,725.00	13,402,875.00	
	BANCO DE CHILE	766,095	69.23	53,036,756.85	

	BANCO DE CREDITO E INVERSION	945	30,420.00	28,746,900.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	38.90	37,411,063.60	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,065.00	5,543,325.00	
	COLBUN SA	161,671	124.15	20,071,454.65	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	104.96	40,260,241.92	
	ENEL CHILE SA	369,172	37.15	13,714,739.80	
	チリペソ 小計	2,709,768		440,936,759.12 (62,227,200)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,586.00	183,668,064.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	29,610.00	137,301,570.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,902	30,050.00	237,455,100.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	18,000.00	46,584,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	21,900.00	145,481,700.00	
	コロンビアペソ 小計	92,794		750,490,434.00 (21,374,718)	
ユーロ	OPAP SA	3,467	12.13	42,054.71	
	JUMBO SA	1,515	13.25	20,073.75	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	36,613	1.14	41,976.80	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	42,000	0.79	33,482.40	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	15.69	51,651.48	
	ユーロ 小計	86,887		189,239.14 (24,440,234)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,150	15.10	77,790.75	
	英ポンド 小計	5,150		77,790.75 (11,803,968)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	100.60	176,553.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	19.74	448,907.34	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	15.45	122,209.50	
	KOC HOLDING AS	14,295	23.04	329,356.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	8.69	147,730.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	181.30	197,979.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	69.45	574,768.20	
	AKBANK T.A.S.	43,035	5.48	235,831.80	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	9.27	294,053.67	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	5.41	135,460.99	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.43	294,574.13	
トルコリラ 小計		191,955		2,957,425.03	(38,061,468)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,233	832.00	1,025,856.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	88.00	619,960.00	
	CEZ AS	2,634	634.00	1,669,956.00	
チェココルナ 小計		10,912		3,315,772.00	(16,849,095)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,430.00	13,192,470.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	8,780.00	17,788,280.00	
	OTP BANK PLC	3,561	16,680.00	59,397,480.00	
ハンガリーフォリント 小計		11,016		90,378,230.00	(33,113,950)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,822	75.00	361,650.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	26,615	6.30	167,834.19	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,231	191.90	428,128.90	
	LPP SA	19	14,010.00	266,190.00	
	CD PROJEKT SA	1,166	168.90	196,937.40	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	34.32	167,344.32	
	ALLEGRO.EU SA	5,718	63.81	364,865.58	
	DINO POLSKA SA	707	321.40	227,229.80	
	BANK PEKAO SA	2,676	104.70	280,177.20	
	PKO BANK POLSKI SA	12,623	39.64	500,375.72	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	274.60	147,734.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,703	39.94	387,537.82	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	7.77	90,959.72	
	PGE SA	9,929	8.95	88,864.55	
ポーランドズロチ 小計		93,322		3,675,830.00	(103,973,792)
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	114,400	37.85	4,330,040.00	
	ALROSA PJSC	32,550	135.05	4,395,877.50	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	24,440	174.78	4,271,623.20	
	INTER RAO UES PJSC	423,000	4.30	1,822,495.50	
ロシアルーブル 小計		594,390		14,820,036.20	(22,230,054)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	5.90	165,200.00	



CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	380,000	3.63	1,379,400.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	53,500	15.44	826,040.00
PETROCHINA CO LTD-H	304,000	3.38	1,027,520.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	26,000	10.84	281,840.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	5.06	333,960.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	19,500	42.70	832,650.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	34,500	11.64	401,580.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	6.50	312,000.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	62,000	10.06	623,720.00
CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	7.41	266,760.00
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,000	161.00	644,000.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	16.06	289,080.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	7.03	154,660.00
MMG LTD	40,000	3.90	156,000.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	26,000	10.98	285,480.00
PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	15,000	1.91	28,650.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	13.66	129,770.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	6.93	90,090.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	90,000	12.08	1,087,200.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.56	244,640.00
BOC AVIATION LTD	3,500	63.00	220,500.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.54	99,120.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	25,500	30.90	787,950.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	17,000	16.16	274,720.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	3.66	237,900.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	5.41	162,300.00
CITIC LTD	92,000	8.35	768,200.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	40,000	10.00	400,000.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	29.15	291,500.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	9.91	188,290.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	16.02	184,230.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	31,000	19.20	595,200.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	13.72	175,616.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	8,700	49.55	431,085.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	8.14	159,544.00

A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	31.25	281,250.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	59,000	5.55	327,450.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	16.64	199,680.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	23,000	61.55	1,415,650.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.74	174,800.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	4.90	147,000.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.28	128,400.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	11.28	270,720.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.18	108,680.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	50,700	14.94	757,458.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.06	193,920.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.15	163,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	10.58	206,310.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.73	121,140.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	12,000	273.40	3,280,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.31	321,640.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,600	49.00	470,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	92,000	28.45	2,617,400.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	48,500	34.60	1,678,100.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	46,000	7.18	330,280.00	
MINTH GROUP LTD	12,000	34.00	408,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	14.94	298,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	17,000	166.40	2,828,800.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	5.84	315,360.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	31,000	29.30	908,300.00	
LI NING CO LTD	35,000	87.40	3,059,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,900	177.20	2,285,880.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	8.22	49,320.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	14.10	183,300.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	4.54	108,960.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	17,000	31.45	534,650.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	12,000	25.65	307,800.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.93	186,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	6,200	74.00	458,800.00	

KUAI SHOU TECHNOLOGY	4,300	80.05	344,215.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	89,500	470.20	42,082,900.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	235,440	184.00	43,320,960.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	43.90	351,200.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	0.83	115,370.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	4.78	210,320.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,550	76.15	346,482.50	
MEITUAN	56,100	233.40	13,093,740.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	15.64	225,216.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	10.72	257,280.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	9,000	70.70	636,300.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	4.89	154,035.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	101.32	111,452.00	
CHINA FEIHE LTD	56,000	14.04	786,240.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	49,000	43.35	2,124,150.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	22,000	60.65	1,334,300.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.15	126,575.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	6,400	40.35	258,240.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	19,000	45.15	857,850.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	32,000	14.00	448,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	66.55	532,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.43	156,030.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.31	382,320.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	7,000	48.55	339,850.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	10,500	46.20	485,100.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	21.20	127,200.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	64,000	12.26	784,640.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	13.58	271,600.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	10,000	53.45	534,500.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	71.10	511,920.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40,000	13.64	545,600.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	15.50	175,150.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	21,600	21.15	456,840.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	40.85	142,975.00	
3SBIO INC	20,500	7.44	152,520.00	

AKESO INC	5,000	44.30	221,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,200	297.60	357,120.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	22,000	17.00	374,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	25,500	4.12	105,060.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	46,000	4.22	194,120.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	140,000	10.90	1,526,000.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	35.30	635,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	141.10	268,090.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	25.60	460,800.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	18,000	73.30	1,319,400.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	173.80	364,980.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	8,000	59.00	472,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	162,250	6.62	1,074,095.00
SSY GROUP LTD	22,000	5.37	118,140.00
WUXI APPTec CO LTD-H	5,368	160.20	859,953.60
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	52,500	122.40	6,426,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.60	998,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,236,000	2.72	3,361,920.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	137,000	4.59	628,830.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	3.28	129,560.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	140,000	3.58	501,200.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,495,000	5.60	8,372,000.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.80	131,600.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	60,500	65.45	3,959,725.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	3.31	248,581.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.00	54,000.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	878,000	4.37	3,836,860.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.77	721,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	149,000	1.44	214,560.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	9.11	127,540.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.16	232,960.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	23,200	18.84	437,088.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	36,500	18.64	680,360.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.60	249,400.00

GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	12.90	201,240.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	6.86	299,096.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	10.82	279,156.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	116,000	12.96	1,503,360.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	41,400	22.65	937,710.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	11.64	284,016.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	14,100	22.40	315,840.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.42	304,920.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	104,000	6.87	714,480.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	98,500	67.10	6,609,350.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,900	36.15	285,585.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	9.06	163,080.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	20,000	5.56	111,200.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	5.72	137,280.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.43	233,280.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	60,500	18.68	1,130,140.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	7.77	155,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	50,000	29.15	1,457,500.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	5,800	43.10	249,980.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	27,100	23.40	634,140.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	54,000	5.58	301,320.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	122,000	8.53	1,040,660.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	10.24	153,600.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	7.27	191,928.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	10,700	27.10	289,970.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	2.43	89,910.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	9.06	194,790.00	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	9.24	212,520.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	28,500	37.35	1,064,475.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	2,400	45.65	109,560.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	6.12	153,000.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	7.53	271,080.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.27	118,040.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	16.08	321,600.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	19.22	192,200.00	

SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	20.85	834,000.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	11,000	21.65	238,150.00
WHARF HOLDINGS LTD	22,000	25.75	566,500.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	20,800	7.38	153,504.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	22,000	4.71	103,620.00
CHINA YOUZAN LTD	220,000	1.00	220,000.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	41,000	24.95	1,022,950.00
KINGSOFT CORP LTD	15,200	37.10	563,920.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	6,000	30.90	185,400.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	13.34	173,420.00
WEIMOB INC	27,000	10.20	275,400.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	11,500	46.55	535,325.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10,500	40.10	421,050.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	10,500	38.05	399,525.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	14.74	243,210.00
LENOVO GROUP LTD	114,000	7.92	902,880.00
SUNNY OPTICAL TECH	11,100	222.00	2,464,200.00
XIAOMI CORP-CLASS B	223,400	25.45	5,685,530.00
ZTE CORP-H	12,200	27.30	333,060.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	656,000	1.04	682,240.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	25.75	218,875.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.09	234,840.00
CGN POWER CO LTD-H	171,000	1.69	288,990.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	48,600	24.60	1,195,560.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	53,000	13.82	732,460.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	2.21	130,390.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	14,000	48.60	680,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	32,000	15.14	484,480.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,400	173.80	2,155,120.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	48,000	10.88	522,240.00
HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	3.04	158,080.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	64,000	7.32	468,480.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	33.35	233,450.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	8,000	43.50	348,000.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	76,000	15.98	1,214,480.00

	香港ドル 小計	13,319,408		238,243,801.10 (3,352,090,281)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.59	180,782.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	18.70	110,330.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	40,000	7.96	318,400.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	49,400	5.00	247,000.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	7.86	59,736.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.11	69,841.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.93	76,497.00	
	MISC BHD	17,600	6.71	118,096.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	4.19	82,124.00	
	GENTING BHD	32,900	4.71	154,959.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.77	154,289.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	26.28	55,188.00	
	IOI CORP BHD	32,500	3.74	121,550.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	20.18	129,152.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	133.30	133,300.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	18.22	202,606.40	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.63	96,554.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	3.51	106,704.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	7.13	168,981.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.80	184,440.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	3.15	52,290.00	
	SUPERMAX CORP BHD	19,217	3.13	60,149.21	
	TOP GLOVE CORP BHD	79,500	3.75	298,125.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	2.86	66,924.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	95,200	4.60	437,920.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.22	184,022.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	17.18	30,924.00	
	MALAYAN BANKING BHD	64,500	8.05	519,225.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	231,100	3.94	910,534.00	
	RHB BANK BHD	28,700	5.26	150,962.00	
AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.80	181,640.00		
DIGI.COM BHD	52,900	4.25	224,825.00		
MAXIS BHD	30,200	4.36	131,672.00		

	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.80	106,720.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	15.90	222,600.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	38,200	9.66	369,012.00	
	マレーシアリングット 小計	1,272,287		6,718,074.11 (173,398,195)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	103.00	2,441,100.00	
	PTT PCL-NVDR	161,800	35.00	5,663,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	45.50	600,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	26,800	39.75	1,065,300.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	60.00	1,968,000.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	20,500	68.25	1,399,125.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	12,700	410.00	5,207,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	70,100	56.00	3,925,600.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	7.75	693,625.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	8.45	891,475.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	3.90	242,580.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	29.75	1,445,850.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	31.00	1,029,975.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	12.70	1,118,870.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	28.00	1,526,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	32.75	540,375.00	
	CP ALL PCL-NVDR	94,900	57.50	5,456,750.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	137.50	673,750.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	26.00	1,474,200.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	36.00	702,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	21.70	1,054,620.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	159,100	23.00	3,659,300.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	128.00	768,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	37.75	505,850.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	102.50	799,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.30	257,500.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	96.50	1,486,100.00		
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	17.10	312,930.00		
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	59.25	870,975.00		
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	55.50	421,800.00		



	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	63.75	573,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	47.50	1,396,500.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	7.95	1,241,790.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,200	564.00	2,932,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	19,700	184.50	3,634,650.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	17,100	72.75	1,244,025.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.08	262,108.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	42.50	403,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	174.00	696,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	23,900	58.50	1,398,150.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	78.50	1,044,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	46,700	37.75	1,762,925.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	43.75	490,000.00	
	タイパーツ 小計	1,781,925		65,282,248.00 (214,125,773)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	37.00	864,320.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	710.00	3,372,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	523.00	815,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	55.00	2,832,005.00	
	SM INVESTMENTS CORP	4,030	912.00	3,675,360.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	17,520	170.00	2,978,400.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	182.00	1,264,900.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,570	129.00	1,750,530.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	84.80	2,239,568.00	
	BDO UNIBANK INC	28,100	106.60	2,995,460.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	45.00	1,242,540.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.72	539,400.00	
	AYALA LAND INC	134,900	31.70	4,276,330.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	148,800	32.25	4,798,800.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	1,960.00	882,000.00	
PLDT INC	980	1,275.00	1,249,500.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	290.00	910,600.00		
	フィリピンペソ 小計	638,623		36,688,093.00 (79,598,486)	
インドネシアル	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,385.00	208,996,500.00	

ピア

UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	20,650.00	456,365,000.00	
ANEKA TAMBANG TBK	111,500	2,380.00	265,370,000.00	
BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	1,075.00	405,812,500.00	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	6,700.00	361,130,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	10,650.00	247,080,000.00	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,820.00	452,610,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	8,875.00	490,787,500.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	293,800	5,025.00	1,476,345,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,300.00	682,290,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	6,600	32,600.00	215,160,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,200.00	268,140,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,225.00	505,470,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	4,250.00	427,975,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,300.00	450,450,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	174,900	32,050.00	5,605,545,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	303,200	6,000.00	1,819,200,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	5,100.00	538,050,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	882,300	3,870.00	3,414,501,000.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,315.00	456,699,500.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	792,800	3,300.00	2,616,240,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	3,030.00	426,927,000.00	
インドネシアルピア 小計	4,671,600		21,791,144,000.00 (165,612,694)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	848	41,850.00	35,488,800.00	
S-OIL CORP	662	93,800.00	62,095,600.00	
SK INNOVATION CO LTD	811	248,500.00	201,533,500.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	1,981	38,700.00	76,664,700.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,255	50,500.00	63,377,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	121	525,000.00	63,525,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	192,500.00	59,097,500.00	
LG CHEM LTD	719	896,000.00	644,224,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	398,000.00	52,934,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	239	248,000.00	59,272,000.00	
POSCO	1,166	341,000.00	397,606,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	448	155,000.00	69,440,000.00	

SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	296,000.00	32,560,000.00
SKC CO LTD	311	163,500.00	50,848,500.00
CJ CORP	193	98,900.00	19,087,700.00
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	30,500.00	15,677,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	883	43,250.00	38,189,750.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	4,146	20,800.00	86,236,800.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	41,750.00	35,028,250.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,161	51,900.00	60,255,900.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	67,800.00	55,121,400.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	32,450.00	32,450,000.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	119,000.00	66,283,000.00
LG CORP	1,396	94,000.00	131,224,000.00
SAMSUNG C&T CORP	1,346	134,000.00	180,364,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	23,050.00	55,435,250.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,170.00	42,616,190.00
SK	511	266,500.00	136,181,500.00
S-1 CORPORATION	228	81,700.00	18,627,600.00
CJ LOGISTICS	135	165,500.00	22,342,500.00
HMM CO LTD	4,121	39,150.00	161,337,150.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	314	187,500.00	58,875,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,155	29,800.00	64,219,000.00
PAN OCEAN CO LTD	3,277	7,410.00	24,282,570.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	47,500.00	45,885,000.00
HANON SYSTEMS	2,393	16,150.00	38,646,950.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,051	268,500.00	282,193,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	2,179	217,000.00	472,843,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	100,000.00	61,000,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	103,000.00	34,608,000.00
KIA CORP	4,149	85,200.00	353,494,800.00
COWAY CO LTD	831	75,200.00	62,491,200.00
FILA HOLDINGS CORP	654	55,000.00	35,970,000.00
HLB INC	1,142	37,350.00	42,653,700.00
LG ELECTRONICS INC	1,690	150,500.00	254,345,000.00
KANGWON LAND INC	1,387	26,750.00	37,102,250.00
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	23,200.00	24,360,000.00

HYBE CO LTD	230	299,000.00	68,770,000.00	
KAKAO CORP	4,858	146,000.00	709,268,000.00	
NAVER CORP	1,928	436,500.00	841,572,000.00	
NCSOFT CORP	263	786,000.00	206,718,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	127,000.00	34,417,000.00	
PEARL ABYSS CORP	350	63,600.00	22,260,000.00	
CJ ENM CO LTD	195	155,000.00	30,225,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	90,000.00	36,630,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	107,500.00	23,865,000.00	
SHINSEGAE INC	109	271,500.00	29,593,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	177,000.00	24,426,000.00	
E-MART INC	257	175,500.00	45,103,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	123	445,500.00	54,796,500.00	
KT&G CORP	1,875	81,800.00	153,375,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	116,500.00	47,998,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	526	220,500.00	115,983,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	56,400.00	24,195,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	149	1,444,000.00	215,156,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	669,000.00	20,739,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,232	119,200.00	146,854,400.00	
ALTEOGEN INC	360	81,200.00	29,232,000.00	
CELLTRION INC	1,516	275,500.00	417,658,000.00	
CELLTRION PHARM INC	238	163,500.00	38,913,000.00	
GREEN CROSS CORP	90	307,000.00	27,630,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	315,500.00	27,448,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	263	983,000.00	258,529,000.00	
SEEGENE INC	480	71,300.00	34,224,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	66,800.00	26,720,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	387	121,500.00	47,020,500.00	
YUHAN CORP	839	60,700.00	50,927,300.00	
HANA FINANCIAL GROUP	4,768	44,650.00	212,891,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	10,250.00	45,663,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	6,224	53,200.00	331,116,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	6,937	38,900.00	269,849,300.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	11,100.00	82,284,300.00	

	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	715	94,800.00	67,782,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	5,090.00	30,947,200.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,302	8,750.00	37,642,500.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	12,800.00	19,712,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	47,000.00	38,728,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	726	59,400.00	43,124,400.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	503	219,000.00	110,157,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	76,200.00	73,609,200.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	357	81,300.00	29,024,100.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	567	175,500.00	99,508,500.00	
	KMW CO LTD	357	51,000.00	18,207,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,338	20,800.00	69,430,400.00	
	LG INNOTEK CO LTD	243	213,000.00	51,759,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	899	179,500.00	161,370,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	74,262	74,400.00	5,525,092,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	12,856	69,600.00	894,777,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	862	817,000.00	704,254,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,613	14,400.00	52,027,200.00	
	SK TELECOM	628	306,000.00	192,168,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,249	24,750.00	105,162,750.00	
	SK HYNIX INC	8,517	101,500.00	864,475,500.00	
	韓国ウォン 小計	235,316		18,859,107,860.00 (1,776,527,960)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	96.50	1,833,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	45.60	1,413,600.00	
	CHINA STEEL CORP	186,000	37.75	7,021,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	56,000	81.70	4,575,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	60,000	99.80	5,988,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	81,000	86.40	6,998,400.00	
	TAIWAN CEMENT	78,477	48.40	3,798,286.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,100	920.00	1,932,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	29.65	1,156,350.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	4,174	339.50	1,417,073.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	37,550	130.50	4,900,275.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	30.00	660,000.00	

WAN HAI LINES LTD	8,000	215.00	1,720,000.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	28,000	133.00	3,724,000.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	40.30	1,209,000.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	552.00	1,667,040.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	222.50	1,352,800.00	
GIANT MANUFACTURING	4,000	337.50	1,350,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	440.50	881,000.00	
POU CHEN	34,000	33.80	1,149,200.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	578.00	2,890,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	9,000	281.50	2,533,500.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	77,000	69.80	5,374,600.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	195.00	585,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	16.80	1,203,148.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	292,000	22.80	6,657,600.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	179,906	26.95	4,848,466.70	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	163,627	23.10	3,779,783.70	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	135,416	19.70	2,667,695.20	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	172,000	31.05	5,340,600.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	13.35	1,935,683.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	140,769	16.95	2,386,034.55	
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.69	772,021.68	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	149,374	21.15	3,159,260.10	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	58,000	41.40	2,401,200.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	20,996	233.00	4,892,068.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	156,920	23.70	3,719,004.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	125,000	55.00	6,875,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	218,000	14.30	3,117,400.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	28.30	789,541.70	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	105,000	78.10	8,200,500.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	9.13	1,413,643.55	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	67.80	642,744.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	297.00	2,376,000.00	
ACER INC	38,000	25.05	951,900.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	356.00	1,886,444.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	11,000	316.50	3,481,500.00	

AU OPTRONICS CORP	122,000	20.40	2,488,800.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	11,000	179.50	1,974,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	63,000	21.65	1,363,950.00	
DELTA ELECTRONICS INC	31,000	274.00	8,494,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	64.00	896,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	194,800	109.00	21,233,200.00	
INNOLUX CORP	126,000	19.85	2,501,100.00	
INVENTEC CORP	41,000	23.75	973,750.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,600	2,695.00	4,312,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	35,000	61.30	2,145,500.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	137.50	1,375,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	3,000	380.00	1,140,000.00	
PEGATRON CORP	33,000	65.70	2,168,100.00	
QUANTA COMPUTER INC	43,000	73.70	3,169,100.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	53.90	916,300.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	135.00	2,295,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	188.00	940,000.00	
WISTRON CORP	40,951	27.15	1,111,819.65	
WIWYNN CORP	1,000	859.00	859,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	26,960	47.90	1,291,384.00	
YAGEO CORPORATION	6,198	500.00	3,099,000.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10,000	98.00	980,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	60,000	117.50	7,050,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	61.40	1,473,600.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	27,000	106.00	2,862,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	52,000	120.00	6,240,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,900.00	950,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	768.00	2,304,000.00	
MEDIATEK INC	23,500	910.00	21,385,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	64.30	1,093,100.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	9,000	509.00	4,581,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	434.00	868,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	109.00	1,090,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	7,000	542.00	3,794,000.00	
SILERGY CORP	1,250	3,755.00	4,693,750.00	

	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	382,700	581.00	222,348,700.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	185,000	57.60	10,656,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	141.50	1,698,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	331.50	1,989,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	28.50	1,197,000.00	
	新台湾ドル 小計	5,009,664		501,628,217.68 (1,972,652,966)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	13,868	454.90	6,308,553.20	
	COAL INDIA LTD	25,983	143.75	3,735,056.25	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	255.05	2,068,965.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	104.65	2,561,204.10	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	37,490	116.10	4,352,589.00	
	PETRONET LNG LTD	12,992	215.80	2,803,673.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	44,465	2,145.65	95,406,327.25	
	ACC LTD	1,105	2,308.60	2,551,003.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,501	402.45	4,628,577.45	
	ASIAN PAINTS LTD	6,046	2,988.70	18,069,680.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	811.15	3,306,247.40	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	4,259	1,496.90	6,375,297.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,088	442.05	11,090,150.40	
	JSW STEEL LTD	12,106	749.05	9,067,999.30	
	PI INDUSTRIES LTD	1,184	3,141.90	3,720,009.60	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	2,206.70	4,698,064.30	
	SHREE CEMENT LTD	150	26,600.40	3,990,060.00	
	TATA STEEL LTD	9,239	1,461.65	13,504,184.35	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,607	7,460.70	11,989,344.90	
	UPL LTD	7,039	779.10	5,484,084.90	
	VEDANTA LTD	18,209	328.65	5,984,387.85	
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,200	1,437.00	6,035,400.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	19,000	174.50	3,315,500.00	
	HAVELLS INDIA LTD	2,780	1,242.15	3,453,177.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	10,871	1,668.40	18,137,176.40	
	SIEMENS LTD	766	2,244.75	1,719,478.50	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,215	704.15	5,784,592.25	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	666.10	2,736,338.80	



INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,676.60	2,177,903.40
BAJAJ AUTO LTD	1,141	3,825.75	4,365,180.75
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	2,292.10	2,784,901.50
BHARAT FORGE LTD	3,030	819.70	2,483,691.00
EICHER MOTORS LTD	2,214	2,546.80	5,638,615.20
HERO MOTOCORP LTD	1,947	2,772.20	5,397,473.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	13,839	778.65	10,775,737.35
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,145	7,002.20	15,019,719.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	18,232	221.45	4,037,476.40
MRF LTD	27	78,872.85	2,129,566.95
TATA MOTORS LTD	26,597	307.25	8,171,928.25
PAGE INDUSTRIES LTD	97	31,183.45	3,024,794.65
TITAN CO LTD	5,705	1,837.90	10,485,219.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	3,781.50	4,239,061.50
INFO EDGE INDIA LTD	1,257	5,428.55	6,823,687.35
TRENT LTD	2,541	882.85	2,243,321.85
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,611	3,594.55	9,385,370.05
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,600	3,579.55	5,727,280.00
ITC LTD	47,218	211.45	9,984,246.10
NESTLE INDIA LTD	540	18,269.55	9,865,557.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	9,657	807.45	7,797,544.65
UNITED SPIRITS LTD	4,926	660.50	3,253,623.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,642.00	2,766,770.00
DABUR INDIA LTD	9,014	588.30	5,302,936.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	983.25	5,289,885.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	12,917	2,404.50	31,058,926.50
MARICO LTD	7,098	515.30	3,657,599.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,657	4,064.10	6,734,213.70
AUROBINDO PHARMA LTD	4,816	761.30	3,666,420.80
BIOCON LTD	5,970	371.40	2,217,258.00
CIPLA LTD	7,779	894.40	6,957,537.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,117	4,948.70	10,476,397.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,854	4,652.20	8,625,178.80
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,385.45	2,387,835.45
LUPIN LTD	3,463	976.85	3,382,831.55

SUN PHARMACEUTICAL INDUS	13,422	778.30	10,446,342.60	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	2,963.75	2,584,390.00	
AXIS BANK LTD	35,514	759.90	26,987,088.60	
BANDHAN BANK LTD	9,895	293.55	2,904,677.25	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	26,702	2,704.15	72,206,213.30	
ICICI BANK LTD	79,821	704.80	56,257,840.80	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	8,749	1,788.00	15,643,212.00	
STATE BANK OF INDIA	28,263	431.20	12,187,005.60	
YES BANK LTD	141,484	11.90	1,683,659.60	
BAJAJ FINANCE LTD	4,258	6,156.55	26,214,589.90	
BAJAJ FINSERV LTD	619	14,317.50	8,862,532.50	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,200	503.35	3,120,770.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,939.55	2,087,080.50	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,451.20	2,632,476.80	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,715	2,724.90	4,673,203.50	
REC LTD	14,000	146.85	2,055,900.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	3,000	1,029.90	3,089,700.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,295.05	3,544,551.85	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,966	670.50	8,693,703.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,638	1,450.05	5,275,281.90	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	671.40	4,049,213.40	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,379	1,138.60	7,263,129.40	
DLF LTD	9,206	332.60	3,061,915.60	
HCL TECHNOLOGIES LTD	17,122	1,119.45	19,167,222.90	
INFOSYS LTD	53,107	1,712.20	90,929,805.40	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	4,862.50	3,637,150.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,446	3,463.40	50,032,276.40	
TECH MAHINDRA LTD	10,014	1,383.15	13,850,864.10	
WIPRO LTD	21,755	615.50	13,390,202.50	
BHARTI AIRTEL LTD	38,516	637.05	24,536,617.80	
INDUS TOWERS LTD	8,128	213.50	1,735,328.00	
ADANI GREEN ENERGY LTD	5,571	919.10	5,120,306.10	
ADANI TOTAL GAS LTD	4,100	917.20	3,760,520.00	
ADANI TRANSMISSION LTD	4,100	971.15	3,981,715.00	
GAIL INDIA LTD	24,471	148.40	3,631,496.40	

	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	535.15	2,523,767.40	
	NTPC LTD	78,280	118.25	9,256,610.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	50,784	184.75	9,382,344.00	
	インドルピー 小計	1,288,625		1,031,673,516.55 (1,526,876,804)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	17.90	114,560.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.01	111,523.51	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	1.97	149,389.04	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	13.31	318,282.03	
	COMMERCIAL BANK PQSC	33,159	5.69	188,906.82	
	MASRAF AL RAYAN	59,948	4.40	264,070.94	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	9.40	88,162.57	
	QATAR ISLAMIC BANK	18,726	17.27	323,398.02	
	QATAR NATIONAL BANK	71,025	19.00	1,349,475.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.09	76,613.54	
	OOREDOO QPSC	12,412	7.01	87,045.35	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	16.90	136,856.20	
	カタールリアル 小計	380,672		3,208,283.02 (95,799,330)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	175.89	739,969.23	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	291.77	477,627.49	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	852	1,639.55	1,396,896.60	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,642	234.43	1,557,084.06	
	GOLD FIELDS LTD	14,144	131.80	1,864,179.20	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	53.00	365,435.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	12,499	242.15	3,026,632.85	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	747.82	797,923.94	
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	216.92	1,080,261.60	
	SASOL LTD	8,982	217.51	1,953,674.82	
	SIBANYE STILLWATER LTD	44,383	61.75	2,740,650.25	
	BIDVEST GROUP LTD	4,193	194.82	816,880.26	
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	120.20	734,181.60	
	MR PRICE GROUP LTD	3,738	231.71	866,131.98	
NASPERS LTD-N SHS	6,784	2,807.18	19,043,909.12		
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	16,364	57.65	943,384.60	

	BID CORP LTD	5,393	320.00	1,725,760.00	
	CLICKS GROUP LTD	3,433	283.44	973,049.52	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,180	165.60	1,354,608.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	194.47	494,148.27	
	TIGER BRANDS LTD	2,099	184.20	386,635.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	6,295	179.81	1,131,903.95	
	ABSA GROUP LTD	11,483	146.60	1,683,407.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,171	1,711.14	2,003,744.94	
	NEDBANK GROUP LTD	5,252	174.30	915,423.60	
	STANDARD BANK GROUP LTD	20,435	131.26	2,682,298.10	
	FIRSTRAND LTD	79,568	57.55	4,579,138.40	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,213	287.43	636,082.59	
	REMGRO LTD	8,773	112.00	982,576.00	
	DISCOVERY LTD	7,125	123.03	876,588.75	
	OLD MUTUAL LTD	76,960	13.47	1,036,651.20	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	31.75	317,944.50	
	SANLAM LTD	30,241	59.90	1,811,435.90	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	98.75	589,438.75	
	MTN GROUP LTD	26,706	119.80	3,199,378.80	
	VODACOM GROUP LTD	9,434	133.89	1,263,118.26	
	南アフリカランド 小計	466,760		67,048,155.73 (498,167,797)	
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	36,436	4.37	159,225.32	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,749	7.36	329,352.64	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.46	111,236.58	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	5.01	102,404.40	
	EMIRATES NBD PJSC	40,014	13.40	536,187.60	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	68,484	16.76	1,147,791.84	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	63,815	4.16	265,470.40	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	4.05	199,150.65	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	27,455	24.08	661,116.40	
	アラブディルハム 小計	370,939		3,511,935.83 (104,866,403)	
クウェートディナール	AGILITY	18,700	1.00	18,793.50	
	BOUBYAN BANK K.S.C	14,451	0.78	11,387.38	

	KUWAIT FINANCE HOUSE	73,529	0.78	57,940.85	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	107,400	0.89	95,586.00	
	MABANEE CO KPSC	7,811	0.73	5,725.46	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,345	0.59	20,853.55	
	クウェートディナール 小計	257,236		210,286.74 (76,710,499)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,400	4.02	9,648.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.00	130,000.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	17.96	98,780.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.28	17,952.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	4.77	5,247.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.22	2,110.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.55	98,735.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	11.19	106,305.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	8.71	4,529.20	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	14.85	4,455.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	13.30	49,210.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	38.63	34,767.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	18.40	18,234.40	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	6.30	80,010.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	41.15	160,485.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	56.32	28,160.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	8.25	155,925.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	2.61	2,349.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.42	37,008.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	17.47	57,895.58	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	7.26	124,872.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	45.17	158,095.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	12.29	43,015.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	31.65	15,825.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	119.61	142,335.90	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	30.95	177,034.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	12.28	23,946.00		
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.80	4,200.00		
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	13.44	61,824.00		

HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	18.56	20,416.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	7.78	27,230.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.78	123,154.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.12	17,920.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	26.39	84,448.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	7.20	13,680.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	129.30	38,790.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	92.20	46,100.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	25.27	50,540.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	176.28	193,908.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	21.04	67,328.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	36.42	61,914.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	20.35	38,665.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	17.67	107,787.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.18	22,896.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	19.99	200,899.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	18.20	63,117.60
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	37.27	67,831.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	5.93	59,300.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	48.25	38,600.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	12.23	26,906.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	144.00	103,680.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	9.57	45,936.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	25.39	43,163.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	115.60	69,360.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	28.33	62,326.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.26	1,956.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	157.15	88,004.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	12.92	14,212.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	28.10	42,150.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	3.76	5,640.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.93	10,309.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,000	113.50	340,500.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	82.60	33,040.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	28.65	34,380.00

YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.08	21,610.40
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	15.27	47,337.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	900	259.00	233,100.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	125.50	145,580.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	12.95	29,785.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	13.17	42,144.00
ZHEJIANG SATELLITE PETROCH-A	1,680	45.96	77,212.80
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4,700	8.27	38,869.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	11.29	199,833.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	23.41	23,410.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	62.50	156,250.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.46	34,380.00
AVICOPTER PLC-A	500	57.05	28,525.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	36.60	51,240.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	97.43	38,972.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	17.43	76,692.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	11.09	5,545.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.26	112,564.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	4.63	137,974.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,200	502.05	1,104,510.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	13.17	7,902.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,820	111.00	202,020.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	10.09	4,207.53
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	56.86	56,860.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	228.73	91,492.00
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	36.75	73,500.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	46.22	27,732.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	70.80	21,240.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	105.83	109,639.88
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	9.28	24,128.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.72	81,096.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	20.02	80,080.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	4,246	31.40	133,324.40
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	5.33	122,590.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	33.70	67,400.00

SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8,200	30.83	252,806.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.69	15,064.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.90	50,960.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	74.02	199,854.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	6.62	59,580.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	143.98	215,970.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	42.50	55,250.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	6.97	2,788.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	698.81	111,809.60
TBEA CO LTD-A	2,100	17.21	36,141.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	18.45	16,605.00
WEICHAH POWER CO LTD-A	5,900	19.88	117,292.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	264.31	132,155.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	6.61	50,897.00
XIAMEN C & D INC-A	300	7.39	2,217.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	13.89	47,226.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	42.98	42,120.40
YUTONG BUS CO LTD-A	200	12.25	2,450.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.30	33,390.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	53.83	107,660.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	71.08	29,853.60
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	122.57	98,056.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	25.32	75,706.80
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	20.33	26,429.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	20.50	82,000.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	8.80	56,320.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.27	18,902.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	75.65	60,520.00
AIR CHINA LTD-A	6,400	6.57	42,048.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	40,800	4.52	184,416.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.42	47,736.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.40	49,140.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	21.66	278,764.20
S F HOLDING CO LTD-A	4,300	60.11	258,473.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	38.20	38,200.00



SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.07	45,123.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.62	9,240.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	900	48.90	44,010.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	9.23	36,920.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	13.85	16,204.50
BYD CO LTD -A	1,600	300.02	480,032.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	199.17	39,834.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	20.96	126,179.20
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	11.48	36,736.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	50.89	96,691.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	1,600	58.45	93,520.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	21.84	65,520.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	25.20	55,440.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	26.90	32,280.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	40.07	32,056.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	19.27	133,155.70
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	9.40	29,140.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	39.28	51,064.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	22.19	2,219.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	186.16	111,696.00
GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A	800	21.33	17,064.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	27.63	157,491.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	33.00	36,300.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	42.86	42,860.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	100.12	50,060.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	72.00	57,600.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	25.32	15,192.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,200	71.61	229,152.00
NAVINFO CO LTD-A	900	12.73	11,457.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	146.52	79,120.80
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	6.02	27,090.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	20.64	8,256.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	7.54	106,314.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	36.39	18,558.90
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.64	3,856.00

ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	53.28	15,984.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	11.82	11,820.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	44.67	26,802.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	6.99	58,017.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	12.81	13,834.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	8.78	11,414.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	8.18	1,636.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.59	91,839.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	425.54	42,554.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	10.80	2,160.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	15.76	12,608.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	2.35	9,635.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	56.00	73,360.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	9.62	10,582.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	14.62	19,737.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	18.09	16,281.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	5.24	15,720.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,900	257.65	489,535.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	20.24	4,048.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.99	49,950.00
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	5.51	50,141.00
WANGFUJING GROUP CO LTD-A	800	27.50	22,000.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.89	35,340.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	47.65	34,308.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	48.28	13,518.40
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	1,700	14.77	25,109.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	51.94	28,359.24
YIXINTANG PHARMACEUTICAL G-A	600	31.88	19,128.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	4.18	12,958.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	48.18	33,726.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	204.29	61,287.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	56.75	28,375.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	8.75	4,375.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	32.22	19,332.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.32	15,168.00

CHACHA FOOD CO LTD-A	400	42.38	16,952.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	174.00	69,600.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	28.57	19,999.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	3,390	115.68	392,155.20
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	177.61	71,044.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.39	18,351.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	68.88	89,544.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	15.14	37,850.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	27.00	64,800.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5,900	35.29	208,211.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	44.47	44,470.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	172.64	241,696.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	9.62	19,240.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	225.51	90,204.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	36.94	11,082.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	71.60	21,480.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,200	1,700.04	2,040,048.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,400	188.90	264,460.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,016	46.85	234,999.60
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	12.18	31,668.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	800	25.95	20,760.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	82.54	80,889.20
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,120	322.70	361,424.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	122.81	49,124.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	30.34	21,238.00
TONGWEI CO LTD-A	4,400	46.10	202,840.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	86.98	78,282.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	13.46	76,183.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,600	240.80	866,880.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	900	72.80	65,520.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	23.71	26,081.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	29.85	38,805.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	22.72	22,720.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	175.59	17,559.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	50.18	30,108.00

AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	52.94	294,611.10
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	67.09	42,266.70
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	30.50	12,200.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	134.53	94,171.00
GUANGZHOU WONFO BIOTECH C-A	390	54.09	21,095.10
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	35.60	61,944.00
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	109.97	32,991.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	56.40	66,552.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	37.10	18,550.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.74	2,948.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	26.28	18,396.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.96	3,820.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	86.45	79,534.00
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	33.07	19,842.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	18.96	37,920.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,100	364.90	401,390.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	305.99	91,797.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	14.00	14,560.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	30.90	27,810.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	417.00	83,400.00
BEIJING Tiantan Biological-A	1,080	36.11	38,998.80
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	92.47	27,741.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	105.81	31,743.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	308.18	123,272.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	24.43	2,443.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,500	157.70	236,550.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	21.39	20,534.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	31.43	3,143.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	30.43	42,602.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	158.50	47,550.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	37.08	66,002.40
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	23.52	32,928.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,116	56.53	345,737.48
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.62	15,620.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.11	19,376.00

JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	151.32	84,739.20
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	40.40	20,200.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	33.92	33,920.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	31.24	26,397.80
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	207.00	144,900.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.22	4,997.20
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	71.75	136,325.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.31	21,199.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	16.48	14,832.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	131.75	79,050.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	26.19	2,619.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,400	18.59	26,026.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	18.19	3,638.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	10.45	2,090.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	76.72	115,080.00
WUXI APPTec CO LTD-A	2,328	138.74	322,986.72
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	15.15	15,150.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	94.54	103,994.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	387.06	232,236.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	18.78	22,723.80
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	47.37	61,581.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	27.36	58,440.96
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	60.97	24,388.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.93	207,737.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.31	80,597.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	11.17	16,755.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.03	101,808.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.36	163,500.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	13.55	78,590.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.89	102,661.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.24	82,236.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	35.94	179,700.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.23	98,400.30
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.91	54,372.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.35	116,915.00

CHINA MERCHANTS BANK-A	19,300	51.18	987,774.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	4.01	119,498.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.60	60,840.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.84	32,640.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.56	68,388.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	58,300	4.61	268,763.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	18.63	335,340.00
PING AN BANK CO LTD-A	17,400	19.89	346,086.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	21,100	5.33	112,463.00
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.89	20,617.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	27,500	9.18	252,450.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.83	3,447.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	15.46	46,380.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.01	15,015.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.03	47,804.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	9.93	27,804.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	9.63	28,890.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	53.20	63,840.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	17.60	117,920.00
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	24.10	267,510.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	27.28	136,400.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.57	2,114.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	10,104	32.16	324,944.64
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	15.28	48,896.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.41	3,205.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.36	60,192.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	18.24	107,616.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	11.28	27,072.00
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	14.19	31,218.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.05	50,830.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	16.85	116,265.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.28	3,640.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.47	102,083.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	97.71	48,855.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.11	2,044.00

HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	14.71	80,905.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.37	2,811.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	9.89	66,263.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	11.19	17,904.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	7.98	23,940.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	13.61	70,772.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.12	9,984.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	8.11	44,377.92
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	3.95	9,875.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.34	2,536.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.40	119,680.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	10.68	45,924.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.25	2,475.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.62	17,556.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.30	18,490.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	7.61	3,805.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	11.44	14,872.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	28.41	71,025.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.09	181,503.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	3.38	2,028.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	40.05	76,095.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	5.11	17,885.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	10,200	54.31	553,962.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	13.91	9,737.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	9.98	79,840.00
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	22.79	202,831.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	5.93	2,372.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	36.55	87,720.00
GEMDALE CORP-A	3,300	10.40	34,320.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.46	66,498.60
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	5.04	15,624.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.67	3,269.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	12.02	153,856.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.99	2,994.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	15.85	26,628.00

SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.12	15,408.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	4.49	15,266.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.49	20,119.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.63	60,190.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.31	11,781.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	12.04	48,160.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	34.61	16,612.80
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	18.84	2,637.60
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	15.71	10,997.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	55.51	11,102.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	16.49	11,543.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.13	2,852.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	964	51.44	49,588.16
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	54.13	135,325.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	24.81	19,848.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	255.25	102,100.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	520	65.30	33,956.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	131.89	39,567.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	37.91	87,496.28
ADDSINO CO LTD -A	1,700	22.43	38,131.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	36.26	83,398.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	45.97	22,985.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	161.42	32,284.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	5.78	198,254.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	44.12	79,416.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	16.19	42,094.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.10	56,100.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	19.40	21,340.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.84	84,064.00
GOERTEK INC -A	3,300	41.50	136,950.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.25	22,550.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	7.21	49,749.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.16	3,048.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	114.18	57,090.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	30.49	30,490.00



INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	31.69	19,014.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	24.75	113,850.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	9.31	21,413.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,733	39.34	264,876.22
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	413.09	148,712.40
NINESTAR CORP-A	100	36.50	3,650.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	7.90	3,160.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	117.50	82,250.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	26.72	26,720.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	102.35	28,658.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	17.10	17,100.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	37.90	30,320.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	26.26	23,634.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	20.07	14,049.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	44.51	31,157.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	14.49	34,776.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	25.56	47,950.56
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	13.94	18,122.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	106.30	127,560.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	29.17	55,539.68
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	8.62	21,550.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	12.63	22,228.80
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	79.42	50,828.80
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	85.98	77,382.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	20.46	49,104.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	40.44	20,220.00
ZTE CORP-A	3,800	35.50	134,900.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	5.09	21,887.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,900	19.60	448,840.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.77	33,763.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.32	4,316.00
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.02	3,216.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	9.12	60,192.00
SHEENERGY COMPANY LIMITED-A	700	6.09	4,263.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	8.34	5,004.00

	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.42	59,384.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	47.44	52,184.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.63	19,909.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	172.41	130,341.96	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	131.78	158,136.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	60.80	121,600.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	153.85	61,540.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	61.70	74,040.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	35.14	66,766.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	4,940	84.16	415,750.40	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	59.99	42,832.86	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	348.98	174,490.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	39.65	174,460.00	
	SG MICRO CORP-A	150	334.50	50,175.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	109.37	27,342.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	148.49	44,547.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	46.81	107,663.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	12.95	24,605.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	20.76	16,608.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	191.84	95,920.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	269.59	215,672.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	62.00	55,800.00	
	オフショア人民元 小計	1,894,735		38,113,415.27 (644,147,208)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	24.88	97,803.28	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	34,823	35.35	1,230,993.05	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	74.50	139,985.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	21.56	81,539.92	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	46.55	93,100.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,497	127.60	446,217.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	5,474	33.35	182,557.90	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	6,999	74.40	520,725.60	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	14,155	123.60	1,749,558.00	
	SAUDI CEMENT	1,265	63.50	80,327.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	36.20	107,984.60	

SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	10,947	19.14	209,525.58	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	69.70	253,638.30	
JARIR MARKETING CO	911	210.00	191,310.00	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	115.60	46,933.60	
ALMARAI CO	4,232	56.10	237,415.20	
SAVOLA	4,558	40.50	184,599.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	186.20	146,353.20	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	749	202.80	151,897.20	
AL RAJHI BANK	19,204	121.80	2,339,047.20	
ALINMA BANK	16,108	22.94	369,517.52	
ARAB NATIONAL BANK	8,707	22.70	197,648.90	
BANK AL-JAZIRA	5,356	19.00	101,764.00	
BANK ALBILAD	5,393	41.80	225,427.40	
BANQUE SAUDI FRANSI	9,664	40.35	389,942.40	
RIYAD BANK	21,695	27.55	597,697.25	
SAUDI BRITISH BANK	11,978	33.60	402,460.80	
THE SAUDI NATIONAL BANK	34,421	59.10	2,034,281.10	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	157.20	125,760.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	93.50	61,803.50	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	8,367	10.36	86,682.12	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	12.86	55,233.70	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	31.90	178,129.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	14.06	73,112.00	
SAUDI TELECOM CO	9,462	135.40	1,281,154.80	
SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	27.50	339,872.50	
サウジアラビアリアル 小計	286,270		15,011,999.42 (438,950,863)	
合 計	38,444,979		13,655,180,135 (13,655,180,135)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	----	-----	------	-----	----

投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	45,800	983,784.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	983,784.00	(5,417,501)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	738,628.80	
	南アフリカランド 小計		48,594	738,628.80	(5,488,011)
合計				10,905,512	(10,905,512)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 74銘柄	100.0%		9.1%
メキシコペソ	株式 22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 53銘柄	100.0%		5.1%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 11銘柄	100.0%		0.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%		0.8%
ロシアルーブル	株式 4銘柄	100.0%		0.2%
香港ドル	株式 211銘柄	100.0%		24.4%
マレーシアリングット	株式 36銘柄	100.0%		1.3%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%		1.6%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.2%
韓国ウォン	株式 103銘柄	100.0%		13.0%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		14.4%

インドルピー	株式	101銘柄	100.0%		11.2%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.9%		3.6%
	投資証券	1銘柄		1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%		0.8%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%		0.6%
オフショア人民元	株式	471銘柄	100.0%		4.7%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%		3.2%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	50,798,153
コール・ローン	52,122,953
投資信託受益証券	6,367,314,044
流動資産合計	6,470,235,150
資産合計	6,470,235,150
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	332,684
未払金	84,872,103
未払解約金	1,691,000
未払利息	141
流動負債合計	86,895,928
負債合計	86,895,928
純資産の部	
元本等	

2021年 8月16日現在

元本	5,828,275,304
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	555,063,918
元本等合計	6,383,339,222
純資産合計	6,383,339,222
負債純資産合計	6,470,235,150

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	4,842,031,112円
期中追加設定元本額	2,508,797,912円
期中一部解約元本額	1,522,553,720円
期末元本額	5,828,275,304円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	909,721,197円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	680,838,514円
りそなラップ型ファンド(成長型)	377,534,171円
DCりそな グローバルバランス	16,020,379円
つみたてバランスファンド	725,029,612円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	213,553,448円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	115,006,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	74,275,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	19,558,261円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	13,138,949円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,973,287円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	10,065,502円
リスクコントロール・オープン	3,333,132円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	107,748,078円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	44,814,809円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,162,360,023円
Smart-i 8資産バランス 安定型	38,523,914円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	100,521,974円
Smart-i 8資産バランス 成長型	116,117,192円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	186,588,976円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	349,008,756円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	206,149,447円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	150,077,410円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	170,873,103円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,391,678円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	996,891円
りそな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)	18,062円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	18,062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)	17,792円
2. 計算日における受益権の総数	5,828,275,304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	1.0952円
(10,000口当たり純資産額)	(10,952円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在

#### 1.金融商品に対する取組方針

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

#### 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2.時価の算定方法

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 8月16日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在
	損益に含まれた評価差額（円）



投資信託受益証券	304,026,740
合計	304,026,740

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 8月16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	40,544,388	-	40,211,704	332,684
	米ドル	40,544,388	-	40,211,704	332,684
	合計	40,544,388	-	40,211,704	332,684

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	743,247	40,744,800.54	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	564,532	17,398,876.24	
		米ドル 小計	1,307,779	58,143,676.78 (6,367,314,044)	
合計				6,367,314,044 (6,367,314,044)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

#### R M国内リートマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月16日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	419,689,858
投資証券	31,784,883,050
派生商品評価勘定	2,303,080
未収配当金	213,681,840
差入委託証拠金	19,436,000
流動資産合計	32,439,993,828
<b>資産合計</b>	<b>32,439,993,828</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,520
前受金	2,666,000
未払金	239,649,100
未払解約金	117,000
未払利息	1,138
流動負債合計	242,483,758
<b>負債合計</b>	<b>242,483,758</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	20,967,186,061
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,230,324,009
元本等合計	32,197,510,070
<b>純資産合計</b>	<b>32,197,510,070</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>32,439,993,828</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	

期首	2021年 2月16日
期首元本額	20,846,254,157円
期中追加設定元本額	9,010,600,510円
期中一部解約元本額	8,889,668,606円
期末元本額	20,967,186,061円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	830,830,430円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	705,279,344円
りそなラップ型ファンド(成長型)	606,228,325円
DCりそな グローバルバランス	17,524,632円
つみたてバランスファンド	1,047,032,151円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	150,240,860円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	81,762,519円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	53,047,471円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,965,466円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,384,148円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,973,663円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,179,355円
リスクコントロール・オープン	2,380,427円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	77,126,094円
FWりそな国内リートインデックスオープン	4,333,366,031円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,453,583,558円
Smart-i Jリートインデックス	2,554,805,903円
Smart-i 8資産バランス 安定型	27,431,276円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	71,696,974円
Smart-i 8資産バランス 成長型	82,927,783円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	132,524,683円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	246,089,867円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	145,316,059円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	106,318,086円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	121,083,215円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	20,689,666円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,799,364,166円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,553,772円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	911,214,444円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	17,079円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	25,960円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	43,176円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	2,352,179,478円
2. 計算日における受益権の総数	20,967,186,061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	1.5356円
(10,000口当たり純資産額)	(15,356円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月16日現在	
該当事項はありません。	

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,462,212,154
合計		3,462,212,154

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

## (投資証券関連)

(2021年 8月16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	431,553,440	-	433,806,000	2,252,560
合計		431,553,440	-	433,806,000	2,252,560

## (注) 時価の算定方法

## 先物取引

## 国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	546	76,658,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	663	89,239,800	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,137	200,339,400	
	東海道リート投資法人	208	22,963,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	936	635,544,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,187	507,689,100	
	産業ファンド投資法人	3,848	836,940,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,710	1,010,830,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,851	432,393,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,358	638,260,000	
	G L P 投資法人	8,779	1,778,625,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,220	424,560,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,294	1,646,749,000	
	星野リゾート・リート投資法人	418	280,060,000	
	O n e リート投資法人	423	142,128,000	
	イオンリート投資法人	2,933	446,989,200	
	ヒューリックリート投資法人	2,383	449,910,400	
	日本リート投資法人	836	362,824,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,225	390,490,750	
	積水ハウス・リート投資法人	7,972	754,948,400	
	トーセイ・リート投資法人	566	78,787,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,082	317,567,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	578	85,890,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	614	74,171,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8,765	1,484,791,000	
いちごホテルリート投資法人	449	39,736,500		
ラサールロジポート投資法人	3,318	652,982,400		
スターアジア不動産投資法人	2,621	153,328,500		

マリモ地方創生リート投資法人	254	32,613,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,008	635,040,000	
大江戸温泉リート投資法人	437	35,178,500	
投資法人みらい	3,090	166,860,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	636	84,079,200	
三菱地所物流リート投資法人	689	348,634,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	930	196,788,000	
ザイマックス・リート投資法人	393	48,339,000	
タカラレーベン不動産投資法人	860	105,780,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,057	168,802,900	
日本ビルファンド投資法人	3,072	2,236,416,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,711	1,838,058,000	
日本都市ファンド投資法人	13,676	1,482,478,400	
オリックス不動産投資法人	5,401	1,101,263,900	
日本プライムリアルティ投資法人	1,781	744,458,000	
N T T 都市開発リート投資法人	2,448	377,481,600	
東急リアル・エステート投資法人	1,817	351,226,100	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,882	233,368,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,102	979,371,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,937	295,198,800	
インヴィンシブル投資法人	11,930	483,165,000	
フロンティア不動産投資法人	950	460,275,000	
平和不動産リート投資法人	1,756	291,320,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,771	603,025,500	
福岡リート投資法人	1,402	251,799,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	838	656,154,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,221	213,216,000	
大和証券オフィス投資法人	573	433,188,000	
阪急阪神リート投資法人	1,224	193,147,200	
スタートアップロシード投資法人	422	105,500,000	
大和ハウスリート投資法人	3,867	1,293,511,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,304	531,456,000	
大和証券リビング投資法人	3,545	426,109,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,515	366,184,000	
合計	172,419	31,784,883,050	



(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

### R M先進国リートマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月16日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	253,126,431
コール・ローン	27,484,099
株式	93,517,361
投資証券	25,827,708,935
派生商品評価勘定	3,458
未収入金	22,522,134
未収配当金	50,971,128
流動資産合計	26,275,333,546
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	191,104
未払金	225,090,114
未払解約金	2,854,000
未払利息	74
流動負債合計	228,135,292
<b>負債合計</b>	
228,135,292	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,346,017,324
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,701,180,930
元本等合計	26,047,198,254
<b>純資産合計</b>	
26,047,198,254	
<b>負債純資産合計</b>	
26,275,333,546	

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 8月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月16日
期首元本額	22,246,292,394円
期中追加設定元本額	10,496,135,186円
期中一部解約元本額	13,396,410,256円
期末元本額	19,346,017,324円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,337,255,504円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,163,440,102円
りそなラップ型ファンド(成長型)	957,005,682円
DCりそな グローバルバランス	20,263,738円
つみたてバランスファンド	591,566,357円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	351,910,398円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	191,494,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	122,171,406円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	32,573,182円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	21,675,828円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	11,450,973円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,523,081円
リスクコントロール・オープン	10,898,189円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	180,209,995円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,271,655,576円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,087,333,334円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,792,172,655円
Smart-i 8資産バランス 安定型	64,298,713円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	165,774,019円
Smart-i 8資産バランス 成長型	190,617,607円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	304,069,555円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	569,741,997円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	336,780,709円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	245,154,377円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	278,803,641円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	47,987,406円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,815,186円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	980,227,055円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	11,350円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	49,453円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	86,016円
2. 計算日における受益権の総数	19,346,017,324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	1.3464円
(10,000口当たり純資産額)	(13,464円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月16日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月16日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

### 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 8月16日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

### 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 8月16日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

株式		14,423,173
投資証券		3,881,824,290
合計		3,896,247,463

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 8月16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	72,243,520	-	72,055,874	187,646
	米ドル	72,243,520	-	72,055,874	187,646
合計		72,243,520	-	72,055,874	187,646

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

米ドル	BROADSTONE NET LEASE INC-A	23,530	26.92	633,427.60	
米ドル 小計		23,530		633,427.60	(69,366,656)
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	92,276	3.25	299,897.00	
オーストラリアドル 小計		92,276		299,897.00	(24,150,705)
合 計		115,806		93,517,361	(93,517,361)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	12,803	274,240.26	
		AGREE REALTY CORP	10,280	764,729.20	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,826	222,366.04	
		ALEXANDER'S INC	282	76,419.18	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,923	4,299,676.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,448	284,811.52	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,174	1,032,020.76	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,753	152,143.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	41,388	1,695,252.48	
		AMERICOLD REALTY TRUST	38,285	1,417,693.55	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,650	1,192,196.50	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,021	163,583.01	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,985	458,578.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,442	140,967.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,264	4,774,831.20	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	41,142.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,532	2,538,838.12	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	25,098	346,352.40	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,365	1,068,799.40	
		BRT APARTMENTS CORP	877	15,514.13	

CAMDEN PROPERTY TRUST	14,933	2,180,218.00	
CARETRUST REIT INC	14,780	329,150.60	
CENTERSPACE	2,032	195,620.64	
CHATHAM LODGING TRUST	6,046	70,798.66	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	15,300.00	
CITY OFFICE REIT INC	5,694	75,274.68	
CLIPPER REALTY INC	1,350	10,651.50	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,563	303,876.31	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,585	173,800.80	
COREPOINT LODGING INC	4,988	70,181.16	
CORESITE REALTY CORP	6,558	936,416.82	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,384	491,967.20	
COUSINS PROPERTIES INC	22,368	880,404.48	
CTO REALTY GROWTH INC	900	49,338.00	
CUBESMART	30,799	1,559,969.35	
CYRUSONE INC	18,740	1,414,682.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,908	277,599.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,833	6,814,730.30	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	76,416	536,440.32	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	31,514	119,122.92	
DOUGLAS EMMETT INC	24,802	796,144.20	
DUKE REALTY CORP	56,623	2,887,206.77	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,183	267,904.17	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,134	1,073,265.98	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,548	230,994.56	
EPR PROPERTIES	11,436	570,656.40	
EQUINIX INC	13,619	11,087,091.71	
EQUITY COMMONWEALTH	18,850	502,352.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,627	2,126,015.92	
EQUITY RESIDENTIAL	52,449	4,335,434.34	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,166	563,872.64	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,855	3,123,542.25	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,205	3,549,614.40	

FARMLAND PARTNERS INC	3,259	38,195.48	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,734	1,288,080.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,581	1,079,108.91	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,955	327,327.90	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,675	61,600.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,062	1,597,225.22	
GEO GROUP INC/THE	19,712	165,186.56	
GETTY REALTY CORP	5,766	183,358.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,761	131,754.07	
GLADSTONE LAND CORP	4,296	102,502.56	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,379	126,774.27	
GLOBAL NET LEASE INC	15,494	274,088.86	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,146	642,626.94	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,093	972,934.20	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,376	2,915,702.08	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	52,843.22	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,706	720,905.40	
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,328	1,723,498.48	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23,071	614,611.44	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,188	306,038.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,736	263,748.24	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,676	857,610.80	
INVITATION HOMES INC	86,614	3,431,646.68	
IRON MOUNTAIN INC	43,654	2,012,449.40	
JBG SMITH PROPERTIES	17,210	525,077.10	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	87,700	66,213.50	
KILROY REALTY CORP	16,129	1,074,191.40	
KIMCO REALTY CORP	91,168	2,009,342.72	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,509	247,428.02	
LEXINGTON REALTY TRUST	42,016	560,493.44	
LIFE STORAGE INC	11,646	1,397,287.08	
LTC PROPERTIES INC	5,856	207,888.00	
MACERICH CO/THE	24,792	417,993.12	
MACK-CALI REALTY CORP	12,808	224,780.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	164,318.00	



MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	89,825	1,808,177.25	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,469	3,289,587.39	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,510	275,254.70	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,775	1,284,129.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,979	666,391.77	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,995	440,335.25	
NETSTREIT CORP	3,551	92,112.94	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	107,803.80	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,640	217,053.20	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	191,876.32	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,022	1,256,807.58	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	67,825.50	
PARAMOUNT GROUP INC	24,691	226,416.47	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,881	663,439.69	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,727	424,722.31	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	18,539.56	
PHYSICIANS REALTY TRUST	32,660	611,068.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,539	342,786.11	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	92,619.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,628	77,547.60	
PRIME US REIT	58,100	48,804.00	
PROLOGIS INC	112,441	14,839,963.18	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,989	455,822.50	
PUBLIC STORAGE	23,154	7,285,869.18	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,336	803,417.28	
REALTY INCOME CORP	56,964	4,098,559.80	
REGENCY CENTERS CORP	24,019	1,590,538.18	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,513	305,952.11	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	33,921	427,743.81	
RETAIL VALUE INC	2,135	53,866.05	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,519	1,261,713.31	
RLJ LODGING TRUST	24,148	351,111.92	
RPT REALTY	12,942	166,692.96	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,192	654,295.04	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,693	554,800.21	

	SAFEHOLD INC	2,242	201,712.74	
	SAUL CENTERS INC	2,130	100,003.50	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,880	90,199.20	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	25,427	288,087.91	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,028	6,687,242.76	
	SITE CENTERS CORP	26,450	415,265.00	
	SL GREEN REALTY CORP	10,513	769,131.08	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,780	905,002.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	24,006	1,006,811.64	
	STORE CAPITAL CORP	36,880	1,332,105.60	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,091	155,699.01	
	SUN COMMUNITIES INC	17,061	3,372,789.09	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,870	369,458.80	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,692	272,570.04	
	TERRENO REALTY CORP	10,428	703,785.72	
	UDR INC	44,836	2,398,277.64	
	UMH PROPERTIES INC	6,220	145,796.80	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,693	97,415.22	
	URBAN EDGE PROPERTIES	16,309	308,403.19	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,952	76,076.00	
	VENTAS INC	57,149	3,262,636.41	
	VEREIT INC	34,615	1,735,596.10	
	VICI PROPERTIES INC	81,141	2,436,664.23	
	VORNADO REALTY TRUST	23,888	1,019,778.72	
	WASHINGTON REIT	12,508	307,446.64	
	WELLTOWER INC	63,531	5,407,123.41	
	WHITESTONE REIT	5,243	49,389.06	
	WP CAREY INC	27,251	2,142,473.62	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,546	297,053.78	
	米ドル 小計	3,762,245	176,772,264.31 (19,358,330,664)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,835	430,773.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,346	98,148.96	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	44,485.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,575	171,421.25	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,806	776,555.84
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,700	386,271.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,992	158,809.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,406	116,845.44
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,346	146,388.84
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,853	213,873.92
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	86,102.76
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,077	288,421.38
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,026	448,268.94
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,239	335,360.23
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	180,433.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	166,335.36
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	54,461.41
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	43,289.22
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,384	200,761.20
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	45,700.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,837	527,512.81
	SLATE GROCERY REIT	2,561	34,829.60
	SLATE OFFICE REIT	4,169	22,512.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,562	321,401.66
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,930	276,443.40
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	40,076.55
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,574	179,470.20
	カナダドル 小計	264,847	5,794,952.77 (506,247,073)
ユーロ	AEDIFICA	5,390	665,126.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,825	499,737.00
	ALTAREA	598	118,882.40
	BEFIMMO	3,878	139,220.20
	CARE PROPERTY INVEST	4,207	117,585.65
	CARMILA	6,182	77,769.56
	COFINIMMO	4,480	633,024.00
	COVIVIO	7,455	603,258.60
	CROMWELL REIT EUR	43,440	109,468.80
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,323	121,151.48

	GECINA SA	8,358	1,131,255.30
	HAMBORNER REIT AG	11,656	116,105.41
	HIBERNIA REIT PLC	105,660	142,007.04
	ICADE	4,670	353,519.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	28,638.12
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	38,000	359,290.00
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,038	79,595.60
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,224	108,203.26
	KLEPIERRE	30,491	644,884.65
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	44,815.03
	MERCIALYS	5,259	55,166.91
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	51,236	505,596.84
	MONTEA NV	1,425	166,725.00
	NSI NV	2,837	102,983.10
	RETAIL ESTATES	1,743	121,487.10
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,928	1,592,830.08
	VASTNED RETAIL NV	2,828	71,689.80
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,741	794,380.30
	WERELDHAVE NV	6,360	92,220.00
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,620	147,768.00
	ユーロ 小計	509,820	9,744,384.23 (1,258,487,223)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	21,000.00
	ASSURA PLC	419,571	329,153.44
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,612	389,558.52
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	123,187	123,679.74
	BRITISH LAND CO PLC	143,240	762,609.76
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	131,258	233,376.72
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	108,732.78
	CUSTODIAN REIT PLC	53,561	55,060.70
	DERWENT LONDON PLC	16,878	636,806.94
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	78,829	79,617.29
	GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	143,909.84
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	40,109	321,674.18
	HAMMERSON PLC	609,917	219,448.13
	HOME REIT PLC	35,027	40,981.59

	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,357	65,099.83
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	114,915	840,947.97
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	139,144	360,382.96
	LXI REIT PLC	100,508	144,530.50
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	33,144.69
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	70,311	68,693.84
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	201,064	336,179.00
	REGIONAL REIT LTD	63,471	56,362.24
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,906	368,547.20
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	68,450	35,730.90
	SEGRE PLC	182,414	2,302,064.68
	SHAFTESBURY PLC	46,808	295,358.48
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	49,887.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	121,418	148,129.96
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	65,972.05
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	261,402	604,884.22
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	116,460	94,798.44
	UNITE GROUP PLC	59,789	735,703.64
	WORKSPACE GROUP PLC	20,047	188,842.74
	英bond 小計	3,797,217	10,260,869.97 (1,556,984,409)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	62,398	202,793.50
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	90,911.46
	ARENA REIT	57,189	227,040.33
	AVENTUS GROUP	61,838	194,789.70
	BWP TRUST	77,963	312,631.63
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	63,573	246,663.24
	CENTURIA OFFICE REIT	49,819	119,565.60
	CHARTER HALL GROUP	71,538	1,203,984.54
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	80,884	411,699.56
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	290,050.74
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	42,983	155,168.63
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,409	249,931.96
	DEXUS/AU	165,349	1,749,392.42

	GDI PROPERTY GROUP	66,335	74,958.55
	GOODMAN GROUP	255,541	5,813,557.75
	GPT GROUP	293,441	1,367,435.06
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,211	184,844.00
	HOME CONSORTIUM	29,930	173,594.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	68,755	99,350.97
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	99,966.60
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	48,374	293,630.18
	IRONGATE GROUP	69,568	101,221.44
	MIRVAC GROUP	601,102	1,803,306.00
	NATIONAL STORAGE REIT	158,895	355,924.80
	RURAL FUNDS GROUP	63,091	162,143.87
	SCENTRE GROUP	786,242	2,012,779.52
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,342	435,816.04
	STOCKLAND	363,570	1,639,700.70
	VICINITY CENTRES	568,591	904,059.69
	WAYPOINT REIT LTD	117,252	323,615.52
	オーストラリアドル 小計	4,853,155	21,300,528.00 (1,715,331,519)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	135,240	220,441.20
	GOODMAN PROPERTY TRUST	174,709	445,507.95
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	264,009.97
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	173,901	293,892.69
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	63,535	208,394.80
	ニュージーランドドル 小計	774,003	1,432,246.61 (110,297,311)
香港ドル	CHAMPION REIT	294,000	1,284,780.00
	FORTUNE REIT	223,000	1,960,170.00
	LINK REIT	318,100	23,205,395.00
	PROSPERITY REIT	163,000	490,630.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	178,000	868,640.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	247,000	995,410.00
	香港ドル 小計	1,423,100	28,805,025.00 (405,286,701)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	90,675.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	184,100	164,769.50

	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	492,900	1,523,061.00	
	ASCOTT TRUST	298,296	304,261.92	
	CAPITALAND CHINA TRUST	161,600	211,696.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	693,132	1,483,302.48	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,600	143,442.00	
	EC WORLD REIT	50,000	40,750.00	
	ESR REIT	392,600	178,633.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	93,717.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	43,498.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	213,700	504,332.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	69,524.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	444,279	675,304.08	
	IREIT GLOBAL	95,000	61,750.00	
	KEPPEL DC REIT	191,300	485,902.00	
	KEPPEL REIT	300,900	343,026.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	123,103.50	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	56,013.30	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	323,800	679,980.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	298,500	871,620.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	446,000	932,140.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	325,300	328,553.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	152,471.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	53,900	257,642.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	91,400	40,673.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	61,085.00	
	SPH REIT	164,700	147,406.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	178,700	108,113.50	
	SUNTEC REIT	329,100	477,195.00	
	シンガポールドル 小計	7,831,407	10,653,639.78 (861,027,167)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	15,000	102,900,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,400,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	95,220,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	25,403,950.00	
	LOTTE REIT CO LTD	15,761	92,044,240.00	

		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	47,016,150.00
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	41,014,520.00
		韓国ウォン 小計	72,085	425,998,860.00 (40,129,092)
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	25,765	457,328.75
		イスラエルシェケル 小計	25,765	457,328.75 (15,587,776)
	合計			25,827,708,935 (25,827,708,935)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 1銘柄	0.4%		0.3%
	投資証券 153銘柄		99.6%	74.6%
カナダドル	投資証券 27銘柄		100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄		100.0%	4.9%
英ポンド	投資証券 34銘柄		100.0%	6.0%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	1.4%		0.1%
	投資証券 30銘柄		98.6%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄		100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄		100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄		100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。



### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 8月31日現在です。

### 【リスクコントロール・オープン】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	591,051,819円
負債総額	362,187円
純資産総額（ - ）	590,689,632円
発行済口数	577,917,538口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0221円

（参考）

### R M国内債券マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	112,575,502,451円
負債総額	325,132,186円
純資産総額（ - ）	112,250,370,265円
発行済口数	106,341,857,314口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0556円

### R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 純資産額計算書

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

### R M国内株式マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	62,701,412,535円
負債総額	524,468,686円
純資産総額（ - ）	62,176,943,849円
発行済口数	43,761,086,222口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4208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	113,080,959,740円
負債総額	45,233,628円
純資産総額（ - ）	113,035,726,112円
発行済口数	57,920,372,585口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9516円

## R M新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書

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

## R M先進国リートマザーファンド

### 純資産額計算書

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

### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

#### （1）名義書換

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

#### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

#### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

##### 受益権の譲渡

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

2021年8月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

###### 過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
2017年7月7日	1,000,000,000円（490,000,000円）

###### (2) 委託会社の機構（2021年8月末現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

###### PLAN：計画

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

###### DO：実行

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

###### CHECK：検証 ACTION：改善

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

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	101	1,099,363
単位型株式投資信託	8	103,560
合計	109	1,202,924

## 3【委託会社等の経理状況】

- （1）委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- （2）財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- （3）当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	2,211,091	4,261,664
前払費用	186,739	245,658
未収入金	247	8,551
未収委託者報酬	810,183	768,778
未収運用受託報酬	1,261,327	2,597,734
未収投資助言報酬	418,494	437,046
流動資産計	4,888,083	8,319,433
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 4,325	5,302
器具備品	1 11,668	18,218
有形固定資産計	15,993	23,520
無形固定資産		
ソフトウェア	18,733	8,588
無形固定資産計	18,733	8,588
投資その他の資産		
投資有価証券	7,975	19,301
長期前払費用	416	-
繰延税金資産	72,304	128,654

投資その他の資産計	80,969	147,956
固定資産計	115,424	180,065
資産合計	5,003,507	8,499,498

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	311,378	256,287
その他未払金	2 760,759	1,255,082
未払費用	85,094	99,584
未払法人税等	192,367	269,609
未払消費税等	287,966	352,528
預り金	1,648	1,387
賞与引当金	96,675	224,862
流動負債計	1,735,890	2,459,343
負債合計	1,735,890	2,459,343
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	1,778,051	4,548,350
利益剰余金計	1,778,051	4,548,350
株主資本計	3,268,051	6,038,350
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	433	1,804
評価・換算差額等計	433	1,804
純資産合計	3,267,617	6,040,155
負債・純資産合計	5,003,507	8,499,498

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,170,025	3,539,887
運用受託報酬	1,201,400	4,624,333
投資助言報酬	1,166,500	839,669
その他営業収益	-	261
営業収益計	5,537,925	9,004,153
営業費用		
支払手数料	1,050,201	1,166,440
広告宣伝費	63,238	37,315



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 引当金の計上基準

### 賞与引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

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

### (3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## (未適用の会計基準等)

### 1. 収益認識に関する会計基準等

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

#### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

#### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

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

### （1）概要

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

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

### （2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### （3）当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

#### 2 関係会社に対する資産及び負債

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

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

### （損益計算書関係）

#### 1 関係会社に対する主な取引

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

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

#### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

## 負債

未払手数料、その他未払金

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

（税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(\*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

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

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

法定実効税率 30.61%

## （調整）

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

## （セグメント情報等）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## （1）製品及びサービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## （1）製品及びサービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

## (2) 兄弟会社等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社に関する注記

## 親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）



当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

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

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 5【その他】

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容

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

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末現在）

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

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
四国アライアンス証券株式会社	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。
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(3) 保証会社

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

(3) 保証会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 保証会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見

書）」という名称を用いることがあります。

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

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

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

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

### 監査意見

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

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

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年10月7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」に掲げられているリスクコントロール・オープンの2021年2月16日から2021年8月16日までの特定期間の財務諸表、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、リスクコントロール・オープンの2021年8月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。