

2022. 5. 14

リスクコントロール・オープン

愛称「みつぼしクルーズ」

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「リスクコントロール・オープン」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2022年5月13日に関東財務局長に提出しており、2022年5月14日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日 : 2022年5月13日
発行者名 : リ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
有価証券届出書(訂正届出書を含みます。)の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

リそなアセットマネジメント株式会社

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	67
第3【ファンドの経理状況】	72
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	318
第三部【委託会社等の情報】	319
約款	351

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「みつぼしくルーズ」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】

- 2022年5月14日から2022年11月15日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

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】

- ① ファンドの目的
安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
- ② ファンドの基本的性格
 - 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

<商品分類の定義>

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

4. 独立した区分

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

<補足として使用する商品分類>

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

<属性区分の定義>

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

- ①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

- ①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- ①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ②資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2. 決算頻度による属性区分

- ①年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- ②年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- ③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- ④年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑥日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- ⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

- ①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- ②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- ⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

あるものをいう。

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

①日経225

②TOPIX

③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

③ ファンドの特色

◆「保証契約」の表記について

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

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

◆「保証会社」の表記について

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

投資対象

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

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

ファンドの特色

- 1** 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、信託財産の収益確保を目指します。
- 2** 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。

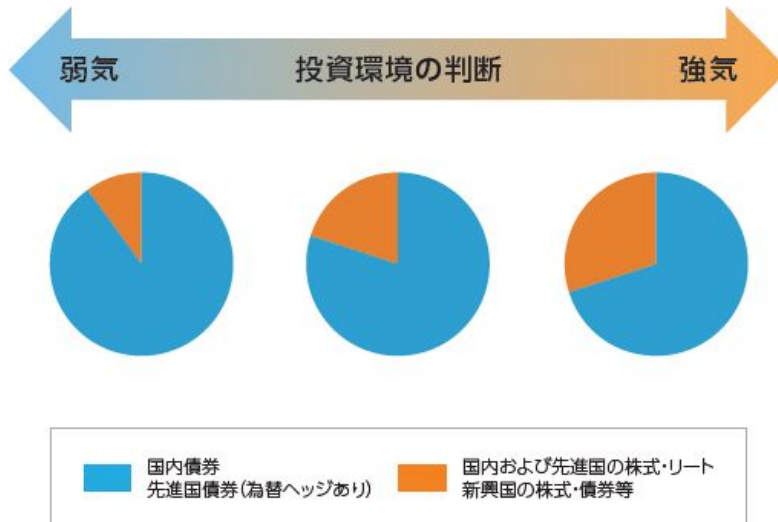
1 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、信託財産の収益確保を目指します。



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



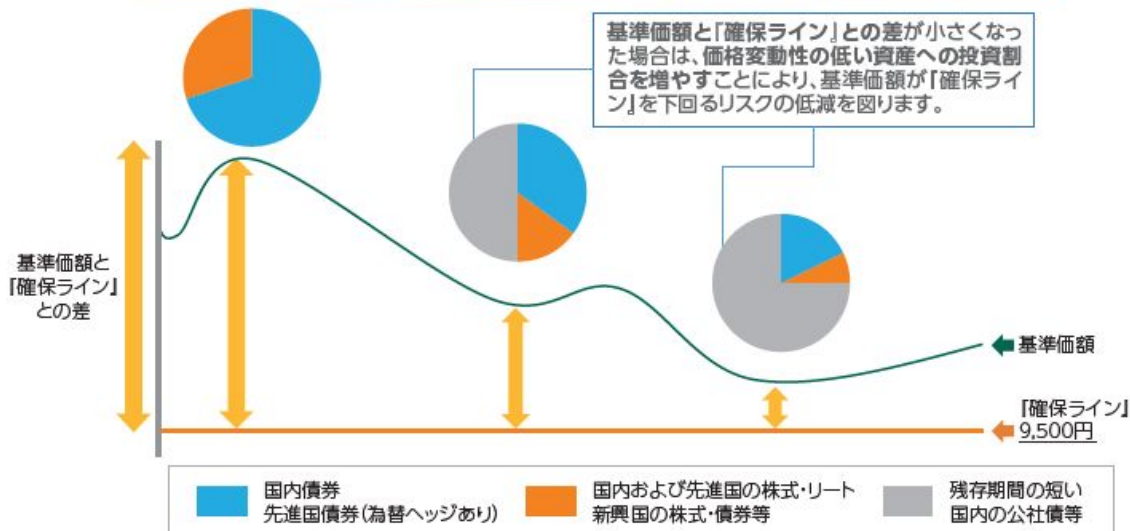
2

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。

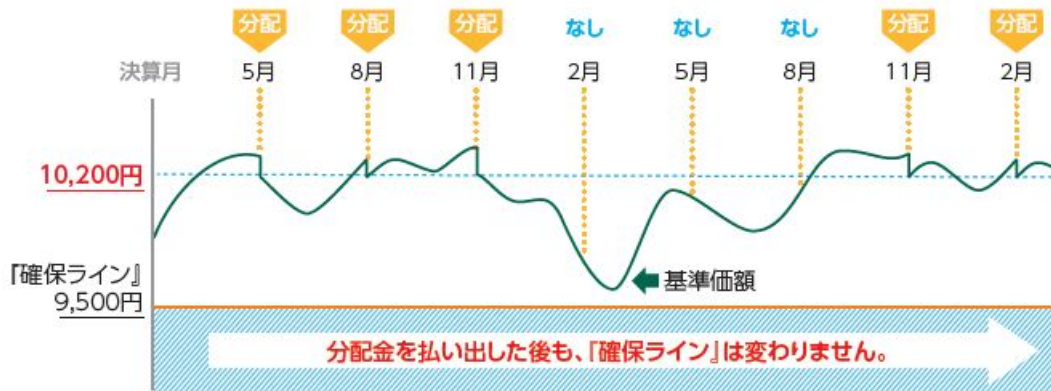
3

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円を超える額を目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



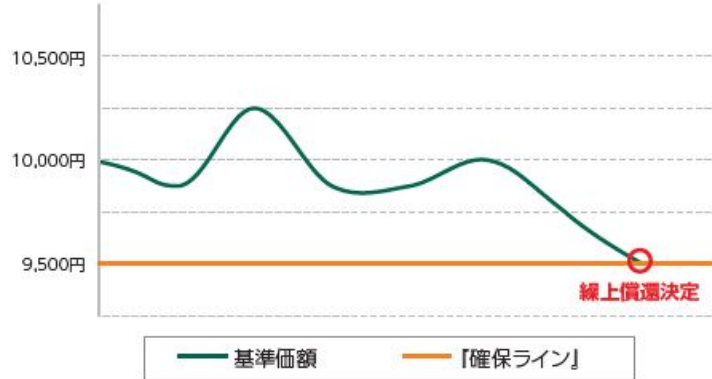
- *1分配金額は各決算日の収益分配前の基準価額で決定されますので、それより前の基準価額水準は考慮されません。
- *2決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額水準および市況動向により、委託会社の判断で、収益分配前の基準価額が10,200円を超過している額を必ずしも全額分配しない場合や、分配が行われない場合があります。
- ※投資者ごとに購入価額が異なるため、分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払い戻しに相当する場合があります。詳しくは後述の「収益分配金に関する留意事項」をご確認ください。

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。

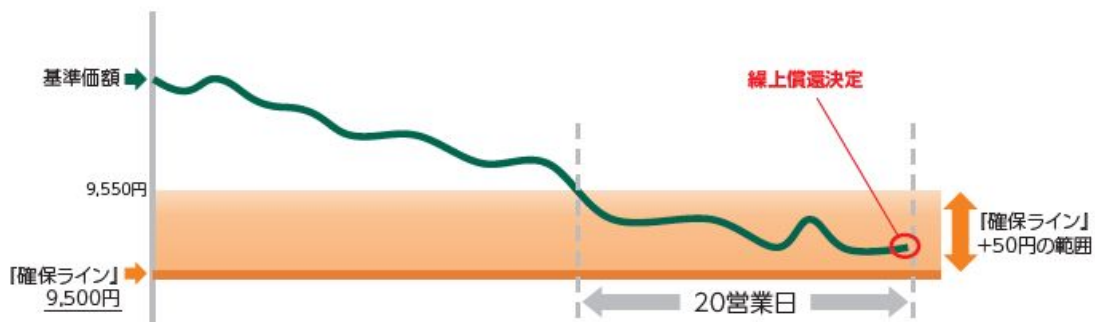
条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

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。

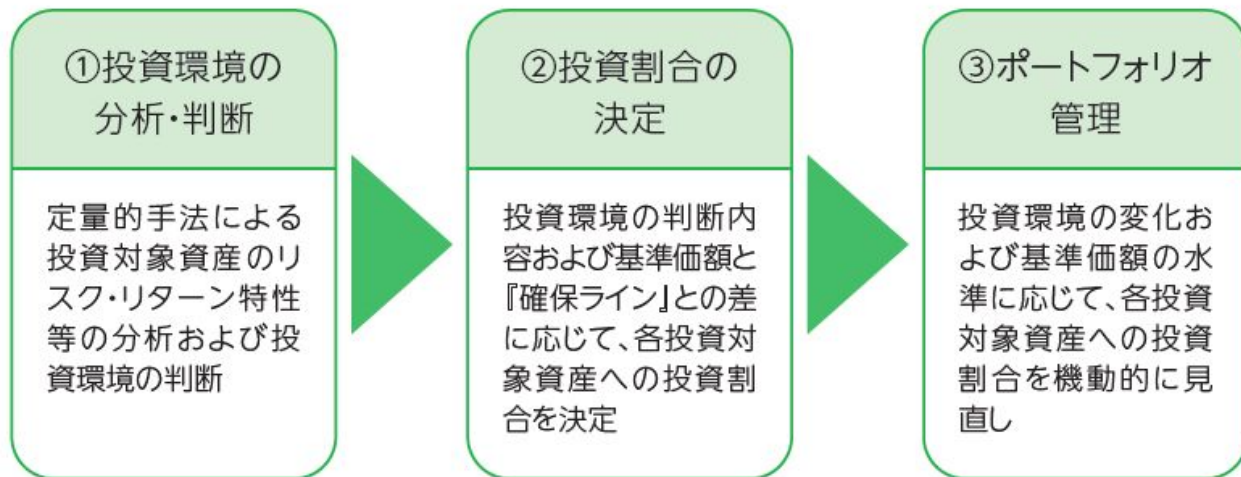


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

※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、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

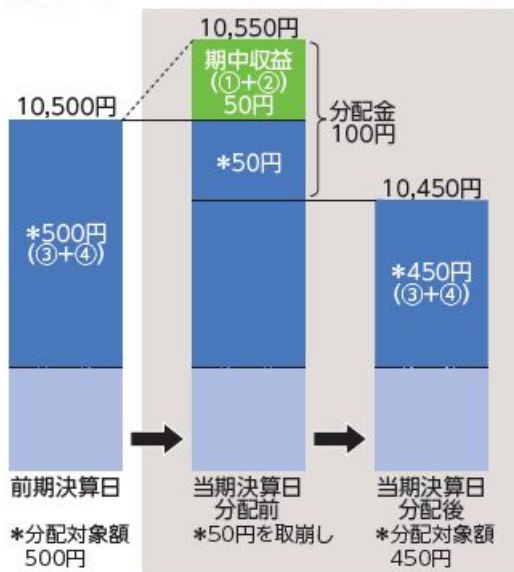
投資信託で分配金が支払われるイメージ



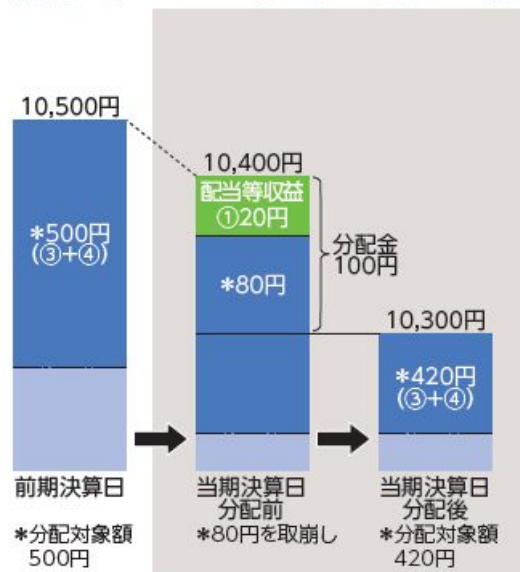
●分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

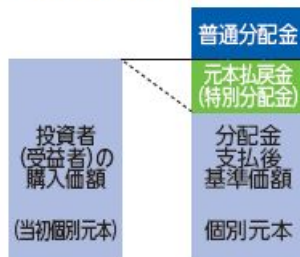


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益、②経費控除後の評価益を含む売買益、③分配準備積立金、④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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。

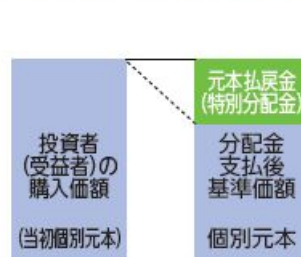
●投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがいさかった場合も同様です。

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

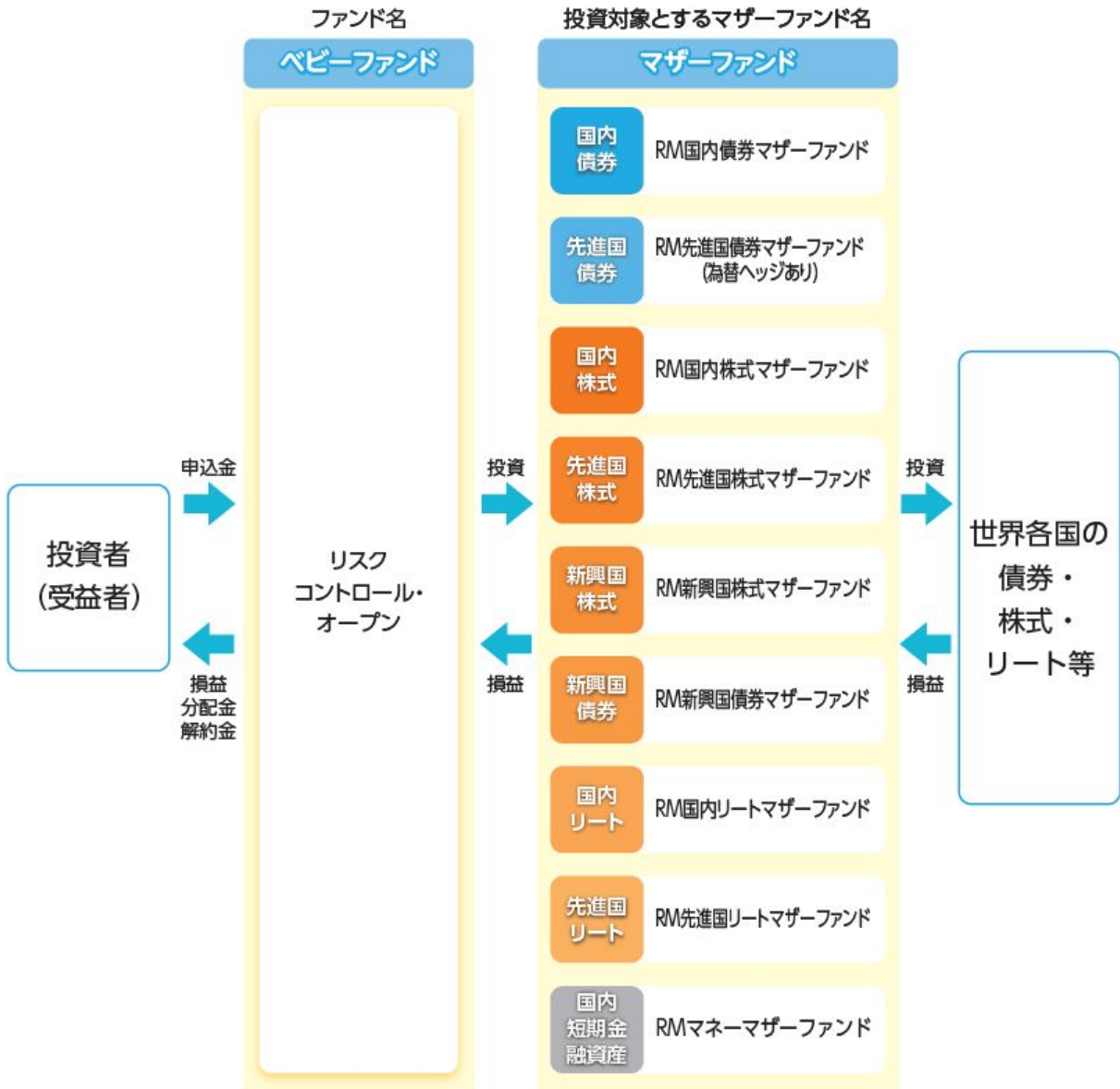


普通分配金：個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

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に実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用を行います。



■ 主な投資制限

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

インデックスの著作権等について

●RM国内債券マザーファンド

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

●RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RM国内株式マザーファンド

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

●RM先進国株式マザーファンド

「MSCI-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株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

●RM先進国リートマザーファンド

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

※RMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

④ 信託金限度額

- ・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。

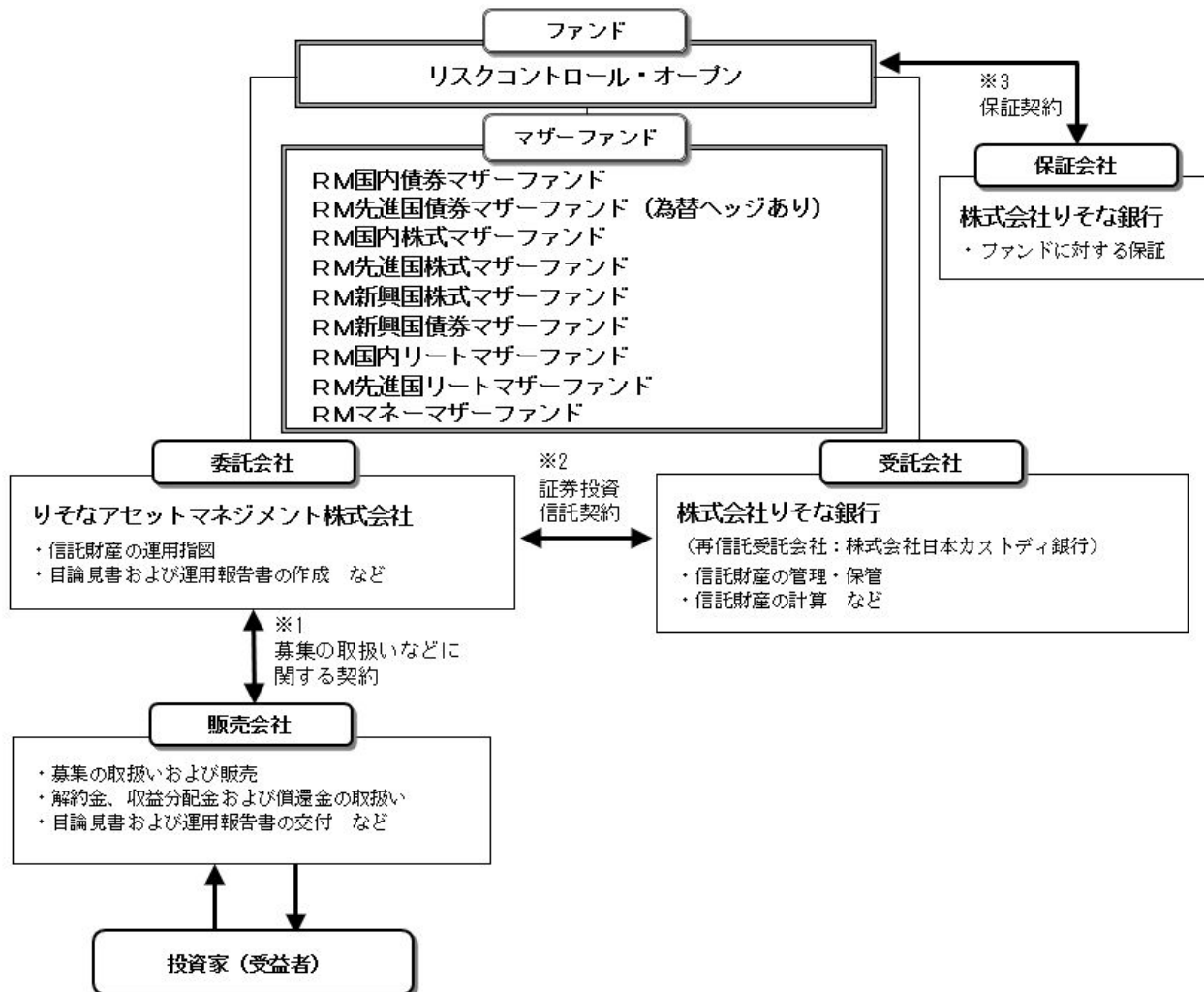
(2) 【ファンドの沿革】

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】

① ファンドの仕組み



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

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

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

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

② 委託会社の概況 (2022年2月末現在)

1) 資本金

1,000百万円

2) 沿革

2015年8月3日：りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

- ① 主として、次項に掲げる各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内債券および先進国債券(為替ヘッジあり)に投資を行い、安定した収益を確保しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準に従って、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券(リート)ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。
- ② 各投資対象資産への投資は、各資産を投資対象とするマザーファンドを通じて行います。また、各マザーファンドは下記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

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

- ③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。
- ④ 投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値(以下『確保ライン』といいます。)に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、RMマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。
※ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないよう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。
- ⑤ 『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。
- ⑥ 上記の方針に関わらず、以下の場合は、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。
イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
ロ 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
- ⑦ 一の会社(以下「保証会社」といいます。)との間で、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回ることがないよう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。
- ⑧ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

② 有価証券の指図範囲

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

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

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

③ 金融商品の指図範囲

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

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

6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの

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

④ その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

<RM国内債券マザーファンド>

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

<RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
投資方針	<p>① 主として、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>② 債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RM国内株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式
投資方針	<p>① 主として、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証株価指数（TOPIX、配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>② 株式（指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>① 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④ 外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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

<RM先進国株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・ 先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ② 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態での高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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

<RM新興国株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・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	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSC I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ② 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態での高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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

<RM新興国債券マザーファンド>

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

<RM国内リートマザーファンド>

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

<RM先進国リートマザーファンド>

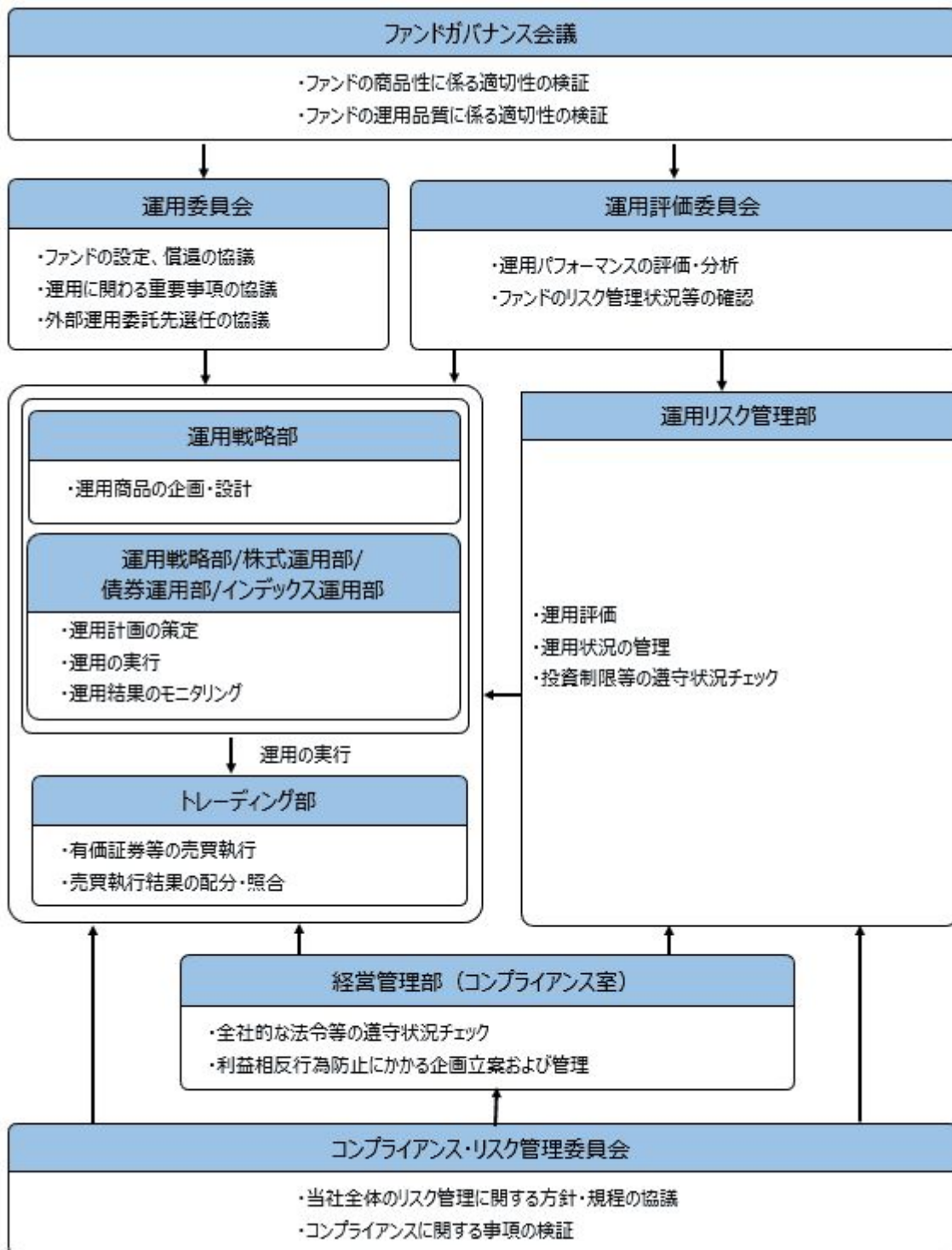
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<ol style="list-style-type: none"> ① 主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ② 不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> ① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

<RMマネーマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、金融市場の短期金利水準に応じた投資成果と流動性の確保を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ① 主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。 ② 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ① 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資は行いません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

(3) 【運用体制】

① ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

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

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

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、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) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。
※委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

② 収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

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

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し引いた額。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。

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。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

② 資産配分リスク

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

③ 信用リスク

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

④ 流動性リスク

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

⑤ カントリーリスク

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

(その他の留意点)

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

- ②当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証会社の破綻等により保証契約が履行されない場合には、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回る可能性があります。
- ③次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。
 - ・基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
 - ・基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
 - ・保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき。
- ④また次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意の上、繰上償還することができます。
 - ・信託財産の純資産総額が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。
- ⑤ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ⑥当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。
- ⑦当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
- ⑧分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。
- ⑨ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

(2) リスク管理体制

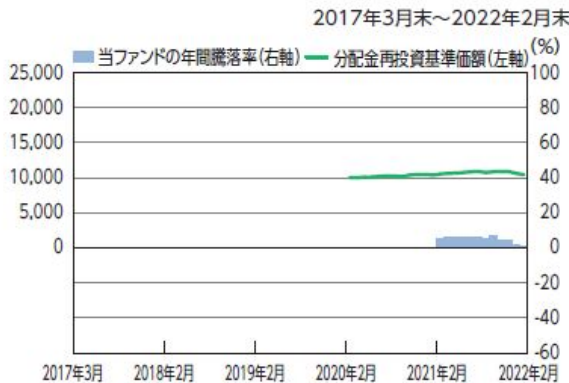
○委託会社における投資リスクに対する管理体制

- ①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、流動性リスクを含む運用リスクの状況、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。
 - ②運用評価委員会は、運用実績、流動性リスクを含む運用リスクの状況、主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。なお、流動性リスクについては、緊急時対応策の有効性検証結果や流動性リスク管理プロセスの見直し結果についても確認を行います。
- 運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

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

〔参考情報〕

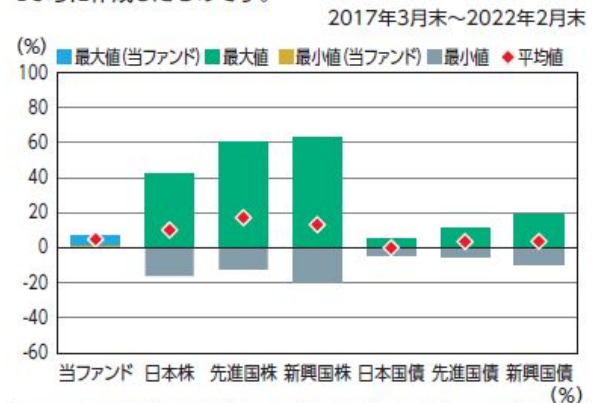
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 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2022年2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	6.8	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	0.5	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△5.4	△9.4
平均値	4.8	10.3	17.1	13.2	0.1	3.6	3.8

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年3月から2022年2月の5年間(当ファンドは2021年3月から2022年2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・・・東証株価指数(TOPIX、配当込み)
- 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
- 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが発行、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】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬

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

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

③ 支払時期

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

④ 保証料

保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率 0.25% 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①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】

- ① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
- ② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。
- ④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。
- ⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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。

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金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。

③ 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。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

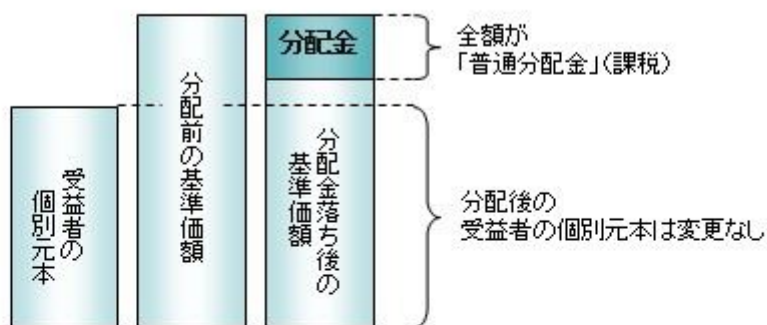
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

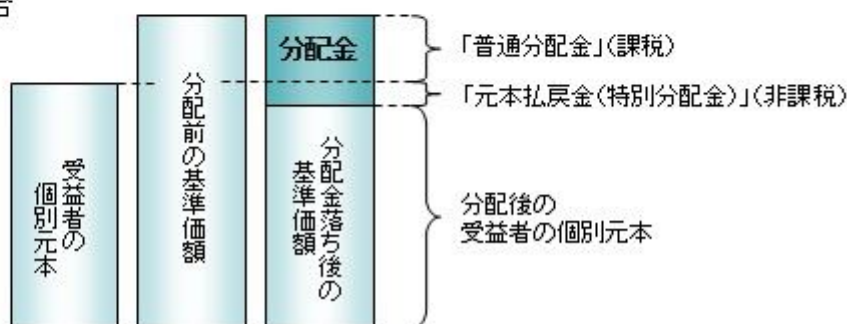
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

※上記は2022年2月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【リスクコントロール・オープン】

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	631,109,326	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	474,071	0.08
合計（純資産総額）		631,583,397	100.00

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	441,196,462	1.0000	441,207,929	1.0025	442,299,453	70.03
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	106,661,878	1.0358	110,481,169	1.0384	110,757,694	17.54
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	25,955,532	1.9750	51,262,176	1.9596	50,862,460	8.05
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	5,553,338	1.3992	7,770,231	1.4275	7,927,389	1.26
日本	親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	5,655,724	1.4010	7,923,670	1.3812	7,811,685	1.24
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	4,765,765	1.6426	7,828,246	1.5809	7,534,197	1.19
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	1,437,750	1.3636	1,960,516	1.3808	1,985,245	0.31
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	1,773,536	1.1031	1,956,388	1.0889	1,931,203	0.31

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

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

期別	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1 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
第4 特定期間末 (2022年 2月 15日)	632	632	0.9771	0.9771
2021年 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	—
9月末日	597	—	1.0073	—
10月末日	615	—	1.0197	—
11月末日	631	—	1.0162	—
12月末日	641	—	1.0169	—
2022年 1月末日	630	—	0.9932	—
2月末日	631	—	0.9753	—

(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。

② 【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
第4 特定期間	2021年 8月 17日～2022年 2月 15日	0.0035

③ 【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
第4 特定期間	2021年 8月 17日～2022年 2月 15日	△3.88

(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
第4 特定期間	2021年8月17日～2022年2月15日	111,502,416	39,211,081

(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)

RM国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	101,918,266,300	82.84
地方債証券	日本	6,875,214,340	5.59
特殊債券	日本	7,628,789,422	6.20
社債券	日本	5,504,257,000	4.47
	フランス	100,035,000	0.08
	オーストラリア	100,045,000	0.08
	小計	5,704,337,000	4.64
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	903,154,147	0.73
合計(純資産総額)		123,029,761,209	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	1,980,000,000	100.37	1,987,444,800	100.28	1,985,682,600	0.100	2024/3/20	1.61
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	1,710,000,000	100.40	1,716,976,800	100.29	1,715,112,900	0.100	2024/6/20	1.39
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	1,490,000,000	100.33	1,494,946,800	100.26	1,493,903,800	0.100	2023/12/20	1.21
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,360,000,000	100.57	1,367,860,800	100.38	1,365,168,000	0.100	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,310,000,000	100.69	1,319,104,500	100.45	1,315,947,400	0.100	2027/3/20	1.07
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	1,310,000,000	100.62	1,318,122,000	100.41	1,315,475,800	0.100	2025/12/20	1.07
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	1,280,000,000	100.24	1,283,097,600	100.04	1,280,550,400	0.005	2026/6/20	1.04
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,220,000,000	100.60	1,227,356,600	100.39	1,224,770,200	0.100	2025/9/20	1.00
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,180,000,000	100.66	1,187,843,400	100.42	1,184,979,600	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	1,180,000,000	100.25	1,182,961,800	100.20	1,182,454,400	0.100	2023/6/20	0.96
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	1,180,000,000	99.95	1,179,445,400	99.54	1,174,583,800	0.100	2031/6/20	0.95
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	1,170,000,000	100.45	1,175,270,700	100.31	1,173,732,300	0.100	2024/9/20	0.95

日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,150,000,000	100.61	1,157,017,300	100.22	1,152,587,500	0.100	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	1,070,000,000	100.66	1,077,083,400	100.45	1,074,879,200	0.100	2026/12/20	0.87
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	1,070,000,000	100.29	1,073,177,900	100.24	1,072,578,700	0.100	2023/9/20	0.87
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	1,030,000,000	100.49	1,035,053,900	100.33	1,033,460,800	0.100	2024/12/20	0.84
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	1,020,000,000	100.53	1,025,420,000	100.35	1,023,580,200	0.100	2025/3/20	0.83
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,010,000,000	100.55	1,015,565,100	100.15	1,011,565,500	0.100	2029/12/20	0.82
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	100.21	1,002,120,000	100.17	1,001,730,000	0.100	2023/3/20	0.81
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	980,000,000	100.73	987,203,000	100.44	984,341,400	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	980,000,000	100.24	982,440,200	100.06	980,588,000	0.005	2026/3/20	0.80
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	980,000,000	100.22	982,156,000	99.82	978,285,000	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	960,000,000	100.65	966,259,200	100.45	964,368,000	0.100	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	960,000,000	98.98	950,260,200	99.22	952,598,400	0.100	2031/12/20	0.77
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	934,000,000	101.70	949,878,000	101.45	947,617,720	0.400	2025/9/20	0.77
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	950,000,000	100.09	950,855,000	99.68	947,026,500	0.100	2031/3/20	0.77
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	950,000,000	99.80	948,185,500	99.38	944,186,000	0.100	2031/9/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	890,000,000	100.73	896,568,200	100.43	893,862,600	0.100	2027/12/20	0.73
日本	国債証券	第427回利付国債(2年)	840,000,000	100.12	841,075,200	100.09	840,772,800	0.005	2023/8/1	0.68
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	840,000,000	100.37	843,158,400	100.00	840,000,000	0.100	2030/6/20	0.68

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	82.84
地方債証券	5.59
特殊債券	6.20
社債券	4.64
合計	99.27

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	133,998,627,519	47.87
	カナダ	5,660,333,054	2.02
	メキシコ	2,004,397,738	0.72
	ドイツ	20,146,937,160	7.20
	イタリア	23,969,673,830	8.56
	フランス	27,297,752,730	9.75
	オランダ	5,068,217,251	1.81
	スペイン	15,894,575,404	5.68
	ベルギー	6,113,283,974	2.18
	オーストリア	3,874,816,247	1.38
	フィンランド	1,604,577,247	0.57
	アイルランド	2,139,020,715	0.76
	イギリス	15,953,717,035	5.70
	スウェーデン	762,721,676	0.27
	ノルウェー	673,602,370	0.24
	デンマーク	1,178,728,729	0.42
	ポーランド	1,240,625,123	0.44
	オーストラリア	4,434,956,776	1.58
	シンガポール	1,222,052,626	0.44
	マレーシア	1,444,250,416	0.52
中国	2,495,794,767	0.89	
イスラエル	1,187,281,103	0.42	
	小計	278,365,943,490	99.43
コール・ローン等・その他資産（負債控除後）	—	1,583,599,082	0.57
合計（純資産総額）		279,949,542,572	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	7,569,779,477	2.70
	売建	—	285,449,270,352	△101.96

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,510,000	11,335.59	1,531,438,788	10,826.49	1,462,659,214	1.250	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,870,000	11,268.38	1,450,241,313	10,931.21	1,406,846,760	1.375	2031/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,950,000	11,729.48	1,401,672,919	11,210.15	1,339,613,509	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,660,000	11,008.44	1,283,585,095	10,544.61	1,229,501,930	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,420,000	11,410.92	1,189,018,443	11,385.96	1,186,417,230	0.750	2023/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,740,000	11,240.91	1,207,274,520	10,751.79	1,154,742,369	1.125	2031/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,070,000	10,730.10	1,187,822,765	10,344.65	1,145,153,729	0.625	2030/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,940,000	11,098.96	1,103,237,163	10,878.85	1,081,357,798	1.000	2028/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,809.79	1,093,951,013	10,380.99	1,050,556,542	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,647.75	1,061,147,048	12,188.71	1,022,633,520	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,415.07	1,027,356,830	11,239.49	1,011,554,477	0.250	2024/3/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,560,000	15,363.53	1,007,848,143	14,788.47	970,124,086	2.750	2027/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,140,000	12,889.64	1,049,216,889	11,726.29	954,520,301	2.375	2051/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,040,000	12,016.74	966,146,555	11,767.59	946,114,518	2.500	2024/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	11,269.78	935,391,974	11,211.50	930,555,259	1.250	2026/12/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	11,315.32	950,487,206	11,017.87	925,501,312	0.750	2026/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,133.96	983,128,792	10,475.32	924,971,611	1.875	2051/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,408.74	924,108,370	11,348.27	919,210,109	1.125	2025/1/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,484.51	918,761,160	11,386.86	910,949,240	0.125	2023/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	11,224.59	983,274,769	10,374.22	908,781,973	1.750	2041/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,517.87	921,429,975	11,347.37	907,789,641	0.500	2023/11/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,960,000	11,467.88	912,843,701	11,347.37	903,250,693	0.125	2023/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,910,000	11,496.36	909,362,657	11,337.44	896,791,514	0.375	2023/10/31	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	22,917.15	980,854,100	20,916.11	895,209,707	4.500	2041/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	11,893.34	987,147,994	10,778.64	894,627,820	2.000	2051/8/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,930,000	15,903.03	943,049,798	15,072.76	893,815,037	2.500	2030/5/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,277.46	902,197,243	11,113.56	889,084,962	1.375	2028/12/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,920,000	11,395.66	902,536,822	11,187.81	886,074,722	0.375	2024/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,460,000	11,542.32	976,480,309	10,460.65	884,971,790	1.875	2051/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	11,294.56	900,176,486	10,986.72	875,642,266	0.750	2026/8/31	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.43
合計	99.43

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	31,976,900.00	3,667,715,255	3,694,815,678	1.32

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

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	65,582,363,320	98.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	725,683,684	1.09
合計 (純資産総額)		66,308,047,004	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	680,760,000	1.03

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	175,200	3,675.70	643,983,678	3,743.00	655,773,600	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	65,900	10,536.17	694,333,942	9,883.00	651,289,700	0.98
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	28,700	18,489.32	530,643,526	21,130.00	606,431,000	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	74,700	8,550.45	638,719,220	7,787.00	581,688,900	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	199,800	2,603.88	520,255,884	2,793.50	558,141,300	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	194,500	2,801.24	544,842,735	2,865.50	557,339,750	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	378,000	1,449.83	548,038,295	1,450.50	548,289,000	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	98,000	5,290.75	518,493,970	5,591.00	547,918,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	82,600	6,691.56	552,723,046	6,574.00	543,012,400	0.82
日本	株式	SMC	機械	7,400	63,669.20	471,152,080	68,050.00	503,570,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	320,800	1,546.13	495,999,255	1,525.00	489,220,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	22,300	22,910.74	510,909,522	21,155.00	471,756,500	0.71

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.28
		建設業	2.30
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.55
		医薬品	4.99
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.60
		機械	5.17
		電気機器	17.45
		輸送用機器	8.41
		精密機器	2.62
		その他製品	2.37
		電気・ガス業	1.16
陸運業	3.04		
海運業	0.63		
空運業	0.43		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.98		

	卸売業	5.66
	小売業	4.32
	銀行業	5.37
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.16
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.96
	サービス業	5.66
合 計		98.91

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

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

RM先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	75,065,163,734	62.51
	カナダ	4,122,193,177	3.43
	パナマ	34,830,768	0.03
	ドイツ	2,765,393,623	2.30
	イタリア	605,659,606	0.50
	フランス	3,432,680,057	2.86
	オランダ	2,046,938,399	1.70
	スペイン	766,111,573	0.64
	ベルギー	269,681,782	0.22
	オーストリア	71,146,431	0.06
	ルクセンブルク	92,856,025	0.08
	フィンランド	390,382,042	0.33
	アイルランド	1,931,745,232	1.61
	ポルトガル	49,386,539	0.04
	イギリス	4,738,390,082	3.95
	スイス	3,654,823,672	3.04
	スウェーデン	1,065,406,267	0.89
	ノルウェー	231,383,156	0.19
	デンマーク	829,736,654	0.69
	ケイマン	206,200,630	0.17
	リベリア	37,881,524	0.03
	オーストラリア	2,179,979,716	1.82
	バミューダ	230,352,715	0.19
	ニュージーランド	88,406,950	0.07
	香港	712,348,390	0.59
	シンガポール	334,519,790	0.28
	イスラエル	232,000,806	0.19
	キュラソー	110,897,911	0.09
	ジャージー	433,212,499	0.36
	マン島	27,412,587	0.02
	小計	106,757,122,337	88.90
投資証券	アメリカ	2,178,306,923	1.81
	カナダ	8,079,788	0.01

	フランス	53,039,470	0.04
	イギリス	74,031,935	0.06
	オーストラリア	148,509,491	0.12
	香港	36,345,685	0.03
	シンガポール	43,309,290	0.04
	小計	2,541,622,582	2.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	10,790,116,903	8.99
合計(純資産総額)		120,088,861,822	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,578,547,550	7.14
	買建	ドイツ	2,011,081,792	1.67

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建	—	97,485,998	0.08
	売建	—	187,351,142	△0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	290,497	18,675.19	5,425,086,959	19,048.41	5,533,508,138	4.61
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	125,468	34,245.55	4,296,721,106	34,354.17	4,310,349,064	3.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,010	334,041.18	2,675,669,884	355,405.22	2,846,795,840	2.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	5,291	302,288.04	1,599,406,041	310,735.90	1,644,103,671	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	5,064	301,289.69	1,525,731,001	310,874.56	1,574,268,795	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	14,795	107,461.49	1,589,892,892	93,580.47	1,384,523,179	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	43,959	27,006.34	1,187,171,964	27,913.41	1,227,045,744	1.02
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	メディア・娯楽	41,897	35,671.44	1,494,526,343	24,320.96	1,018,975,429	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	16,600	53,415.29	886,693,955	54,972.91	912,550,347	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	52,598	16,748.97	880,962,455	17,097.93	899,317,106	0.75
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテ	46,343	18,831.18	872,693,537	19,181.30	888,918,986	0.74

			クノロジ ー・ライ フサイエ ンス						
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	23,341	35,096.00	819,175,771	36,888.18	861,007,056	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	42,835	18,638.21	798,367,940	18,284.63	783,222,212	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウ ェア・サ ービス	29,752	23,323.76	693,928,730	25,336.64	753,815,966	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバ コ	49,856	14,733.48	734,552,379	14,795.91	737,664,889	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	133,213	5,147.75	685,747,554	5,202.06	692,982,152	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	18,570	42,038.24	780,650,219	36,588.90	679,456,012	0.57
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギ ー	74,640	8,410.88	627,788,419	8,994.41	671,342,912	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウ ェア・サ ービス	15,539	40,375.48	627,394,599	42,648.34	662,712,703	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギ ー	34,119	14,695.64	501,400,848	16,220.90	553,441,194	0.46
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディ ア・娯楽	31,972	15,883.50	507,827,358	17,278.19	552,418,339	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	7,232	75,663.90	547,201,325	76,194.19	551,036,411	0.46
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	98,807	5,955.44	588,439,852	5,514.04	544,826,343	0.45
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	12,386	43,045.48	533,161,377	43,626.08	540,352,676	0.45
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	31,180	15,271.08	476,152,523	17,279.34	538,770,039	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	72,416	6,928.37	501,725,421	7,262.31	525,907,984	0.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	7,233	62,579.56	452,638,023	67,944.55	491,442,970	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロ ジー・ハ ードウェ アおよび 機器	74,415	6,574.79	489,263,370	6,475.42	481,868,528	0.40
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	24,388	20,028.28	488,449,729	19,456.30	474,500,464	0.40
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生 活必需品 小売り	7,811	56,492.39	441,262,098	59,795.96	467,066,318	0.39

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	3.87
		素材	3.94
		資本財	5.55
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	2.03
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.67
		メディア・娯楽	5.83
		小売	4.73
		食品・生活必需品小売り	1.34
		食品・飲料・タバコ	3.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.59
		ヘルスケア機器・サービス	4.41
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.31
		銀行	5.88
		各種金融	4.41
		保険	2.84
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	10.30
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.02		
電気通信サービス	1.44		
公益事業	2.66		
半導体・半導体製造装置	4.57		
投資証券	—	—	2.12
合計			91.01

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2203	買建	339	米ドル	74,724,075	8,634,366,879	74,241,000	8,578,547,550	7.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002203	買建	688	ユーロ	15,705,450	2,031,342,908	15,548,800	2,011,081,792	1.67

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

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

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

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	56,764,080	0.32
	メキシコ	312,715,588	1.77
	ブラジル	765,570,057	4.33
	チリ	67,506,202	0.38
	コロンビア	29,280,166	0.17
	ペルー	5,512,488	0.03
	オランダ	14,919,525	0.08
	ルクセンブルク	10,835,582	0.06
	ギリシャ	36,600,611	0.21
	トルコ	37,727,915	0.21
	チェコ	22,006,674	0.12
	キプロス	10,334,792	0.06
	ハンガリー	33,103,222	0.19
	ポーランド	99,544,081	0.56
	ロシア	283,611,396	1.60
	ケイマン	2,776,092,718	15.71
	バミューダ	79,810,001	0.45
	香港	186,110,512	1.05
	シンガポール	3,659,785	0.02
	マレーシア	223,805,501	1.27
	タイ	283,319,691	1.60
	フィリピン	116,380,217	0.66
	インドネシア	258,727,942	1.46
	韓国	1,866,870,353	10.56
	台湾	2,411,659,707	13.65
	中国	1,868,919,888	10.57
	インド	1,897,851,065	10.74
	カタール	135,883,537	0.77
	エジプト	11,308,293	0.06
	南アフリカ	537,983,557	3.04
ジャージー	7,340,823	0.04	
英ヴァージン諸島	932,506	0.01	
アラブ首長国連邦	194,708,160	1.10	

	マン島	5,755,514	0.03
	クウェート	105,877,946	0.60
	サウジアラビア	596,966,051	3.38
	小計	15,355,996,146	86.89
投資証券	メキシコ	7,442,210	0.04
	南アフリカ	6,413,716	0.04
	小計	13,855,926	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	2,303,722,448	13.03
合計(純資産総額)		17,673,574,520	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,269,205,511	12.84

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建	—	104,405	0.00
	売建	—	28,528,209	△0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	437,000	2,694.86	1,177,656,311	2,492.64	1,089,287,001	6.16
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	102,400	6,945.38	711,207,322	6,270.96	642,146,304	3.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	84,863	7,209.60	611,828,285	6,902.39	585,758,371	3.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	269,640	1,761.48	474,967,894	1,557.38	419,933,831	2.38
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	72,600	3,443.11	249,969,931	2,517.25	182,752,931	1.03
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	50,611	3,685.74	186,539,240	3,540.12	179,169,140	1.01
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	60,457	2,692.03	162,752,662	2,626.63	158,798,170	0.90
ブラジル	株式	VALE SA	素材	72,804	1,880.47	136,906,061	2,069.03	150,634,211	0.85
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	35,810	4,277.26	153,168,967	4,079.08	146,071,926	0.83
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,709,000	87.85	150,140,093	85.04	145,337,632	0.82
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	26,800	4,498.32	120,555,003	4,477.68	120,001,998	0.68
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	9,673	11,424.00	110,504,352	11,808.00	114,218,784	0.65

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	30,413	3,936.69	119,726,553	3,722.09	113,199,999	0.64
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	21,662	4,547.29	98,503,396	4,787.91	103,715,923	0.59
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	90,857	1,237.59	112,444,396	1,131.57	102,811,737	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	112,500	968.00	108,900,619	896.27	100,830,825	0.57
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	221,800	425.07	94,280,681	425.07	94,280,681	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	14,570	6,547.20	95,392,704	6,345.60	92,455,392	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	16,384	5,845.59	95,774,187	5,457.16	89,410,150	0.51
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,935	17,222.72	84,994,161	17,691.86	87,309,332	0.49
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	38,769	2,208.86	85,635,294	2,094.71	81,210,006	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	35,700	2,221.45	79,306,051	2,163.77	77,246,839	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,002,000	69.80	69,948,417	67.73	67,873,676	0.38
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	104,736	848.13	88,830,477	644.76	67,530,526	0.38
中国	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	69,500	1,002.02	69,640,564	958.39	66,608,244	0.38
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	2,175	31,536.00	68,590,800	30,192.00	65,667,600	0.37
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	84,200	716.36	60,317,557	762.32	64,187,698	0.36
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	982,100	63.17	62,049,077	65.20	64,037,830	0.36
アラブ首長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM GROUP CO	電気通信サービス	60,264	1,010.84	60,917,310	1,048.65	63,196,012	0.36
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,410,000	44.81	63,187,317	44.66	62,978,778	0.36

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.70
		素材	8.07
		資本財	2.79
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.68
		自動車・自動車部品	2.92
		耐久消費財・アパレル	1.41
		消費者サービス	0.86
		メディア・娯楽	6.19
		小売	5.82
		食品・生活必需品小売り	1.08
		食品・飲料・タバコ	3.33

		家庭用品・パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・サービス	0.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.47
		銀行	13.61
		各種金融	2.19
		保険	2.42
		不動産	1.77
		ソフトウェア・サービス	2.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.52
		電気通信サービス	2.81
		公益事業	2.11
		半導体・半導体製造装置	9.00
投資証券	—	—	0.08
合 計			86.97

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2203	買建	330	米ドル	19,995,360	2,310,463,857	19,638,300	2,269,205,511	12.84

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	903.64	105,374	104,405	0.00
	米ドル	売建	246,000.00	28,420,380	28,423,553	△0.16
	ブラジルリアル	売建	4,667.72	105,374	104,656	△0.00

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,978,254,658	29.22
	アイルランド	4,776,396,318	70.56
	小計	6,754,650,976	99.78
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	14,834,459	0.22
合計 (純資産総額)		6,769,485,435	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	—	22,068,693	△0.33

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	822,447	5,828.34	4,793,502,393	5,807.54	4,776,396,318	70.56
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	599,032	3,310.50	1,983,099,928	3,302.41	1,978,254,658	29.22

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.78
合計	99.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	191,000.00	22,066,230	22,068,693	△0.33

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	27,916,688,300	98.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	419,712,323	1.48
合計 (純資産総額)		28,336,400,623	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	388,642,500	1.37

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	3,137	643,028.92	2,017,181,722	658,000	2,064,146,000	7.28
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,690	610,043.51	1,641,017,041	613,000	1,648,970,000	5.82
日本	投資証券	G L P 投資法人	8,713	185,098.44	1,612,762,707	171,600	1,495,150,800	5.28
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,402	352,905.22	1,553,488,778	337,500	1,485,675,000	5.24
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,700	148,301.1	1,290,219,570	151,800	1,320,660,000	4.66
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,574	90,734.12	1,231,624,944	93,100	1,263,739,400	4.46
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,040	329,884.57	1,332,733,662	311,500	1,258,460,000	4.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,690	339,859.56	914,222,216	322,000	866,180,000	3.06
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,361	158,968.02	852,227,555	160,900	862,584,900	3.04
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,056	129,623.45	784,999,613	131,500	796,364,000	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,838	358,660.81	659,218,568	374,000	687,412,000	2.43
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,819	189,808.3	724,877,897	172,300	658,013,700	2.32
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,166	76,302.47	623,085,970	76,400	623,882,400	2.20
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	832	654,283.94	544,364,238	679,000	564,928,000	1.99
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	929	597,140.01	554,743,069	605,000	562,045,000	1.98
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,434	371,652.48	532,949,656	388,500	557,109,000	1.97
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,060	570,871.36	605,123,641	525,000	556,500,000	1.96
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,814	310,189.33	562,683,444	300,500	545,107,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,294	177,089.52	583,332,878	164,900	543,180,600	1.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,242	54,440	448,694,480	58,700	483,805,400	1.71

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	11,841	34,837.68	412,512,968	39,300	465,351,300	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,164	142,037.54	449,406,776	143,100	452,768,400	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	943	462,109.46	435,769,220	473,000	446,039,000	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,164	139,405.24	441,078,179	138,000	436,632,000	1.54
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	569	672,177.53	382,469,014	708,000	402,852,000	1.42
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,510	162,190.04	407,097,000	156,400	392,564,000	1.39
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,251	305,514.39	382,198,501	310,500	388,435,500	1.37
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	2,579	144,969.37	373,876,005	150,400	387,881,600	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,635	106,612.25	387,535,528	104,600	380,221,000	1.34
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,925	197,557.69	380,298,554	188,700	363,247,500	1.28

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.52
合 計	98.52

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	207	日本円	389,820,440	388,642,500	1.37

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

RM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2022年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	61,771,598	0.23
	オーストラリア	22,062,350	0.08
	小計	83,833,948	0.31
投資証券	アメリカ	20,568,891,054	75.82
	カナダ	530,691,634	1.96
	ドイツ	17,586,383	0.06
	イタリア	7,713,500	0.03
	フランス	517,605,616	1.91
	オランダ	51,435,046	0.19
	スペイン	112,398,298	0.41
	ベルギー	338,891,308	1.25
	アイルランド	27,017,558	0.10
	イギリス	1,461,864,330	5.39
	オーストラリア	1,777,309,810	6.55
	ニュージーランド	102,413,032	0.38
	香港	343,401,910	1.27
	シンガポール	916,617,295	3.38
	韓国	45,950,920	0.17
	イスラエル	20,511,455	0.08
	ガンジー	68,794,781	0.25
小計	26,909,093,930	99.19	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	135,510,907	0.50
合計 (純資産総額)		27,128,438,785	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	—	26,921,580	△0.10

(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産	0.31
投資証券	—	—	99.19
合計			99.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	180,000.00	20,795,400	20,797,722	△0.08

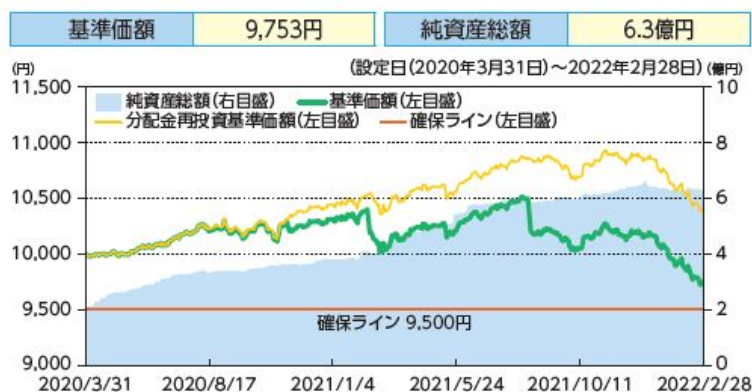
	カナダドル	売建	22,000.00	1,991,220	1,991,330	△0.01
	ユーロ	売建	20,000.00	2,586,240	2,586,814	△0.01
	英ポンド	売建	10,000.00	1,545,560	1,545,714	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

運用実績

2022年2月28日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2021年2月15日	215円
2021年5月17日	5円
2021年8月16日	290円
2021年11月15日	35円
2022年2月15日	0円
設定来累計	675円

※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。

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	17.5
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	70.0
RM国内株式マザーファンド	1.2
RM先進国株式マザーファンド	8.1
RM新興国株式マザーファンド	1.2
RM新興国債券マザーファンド	0.3
RM国内リートマザーファンド	0.3
RM先進国リートマザーファンド	1.3
短期公社債等	0.0
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	89.2
米ドル	7.1
ユーロ	0.9
英ポンド	0.4
香港ドル	0.3
その他	2.0
合計	100.0

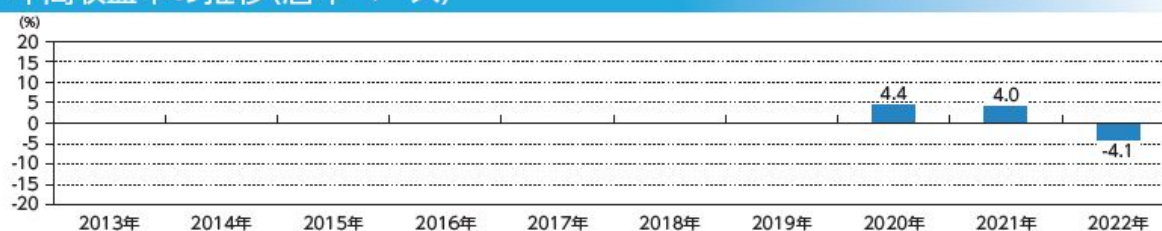
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
 ※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	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	1.6
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.4
	日本	第138回利付国債(5年)	2023/12/20	1.2
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/8/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/11/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.5
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	4.2
	日本	ソニーグループ	—	2.8
	日本	キーエンス	—	1.9
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	4.6
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	3.6
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.4
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	6.2
	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.6
新興国債券	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.3
	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	70.6
	アメリカ	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	—	29.2
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	7.3
	日本	ジャパソリアルエステイト投資法人	—	5.8
	日本	GLP投資法人	—	5.3
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	7.0
	アメリカ	EQUINIX INC	—	4.1
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	—	3.5

※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。2022年は2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時までには、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号ロ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時までには、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - ・ニューヨークの銀行の休業日
 - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・ロンドンの銀行の休業日
 - ・ロンドン証券取引所の休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

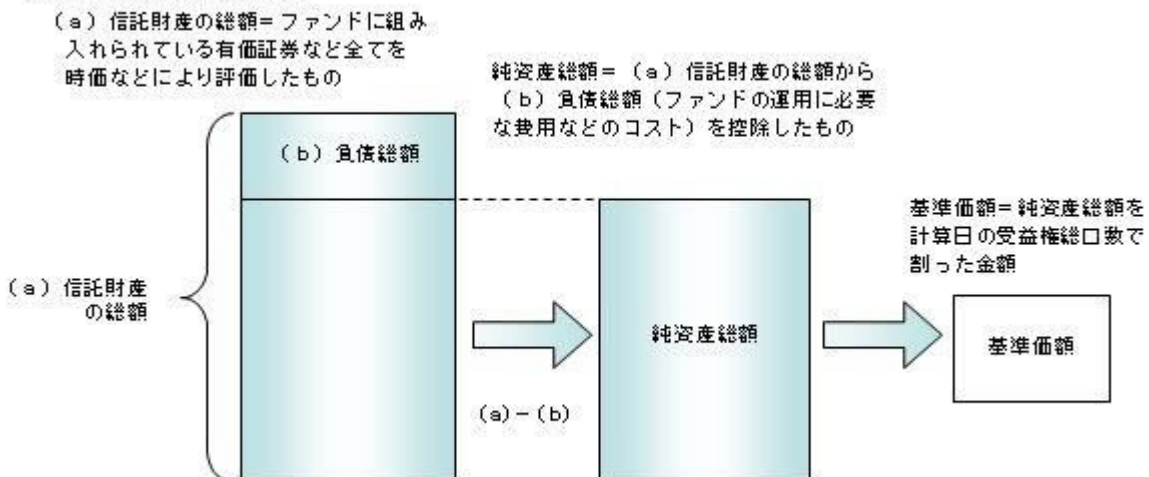
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年2月16日から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】

① 信託の終了（繰上償還）

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

イ) 信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

② 償還金について

- ・償還金は、信託終了日後 1 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。

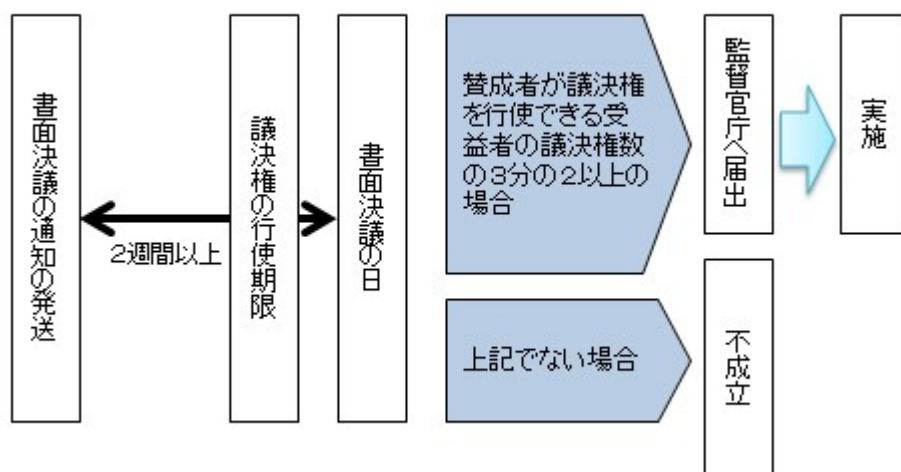
③ 信託約款の変更など

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

④ 書面決議

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

<書面決議の主な流れ>



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥ 運用報告書の作成

- ・委託会社は、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、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦ 関係法人との契約について

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

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行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4特定期間(2021年8月17日から2022年2月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2022年4月5日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 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（2021年8月17日から2022年2月15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2022年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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。継続企業的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) 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。

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3 特定期間 2021年 8月 16日現在	第4 特定期間 2022年 2月 15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,464,223	2,848,592
親投資信託受益証券	581,416,215	631,791,075
未収入金	21,293,000	-
流動資産合計	605,173,438	634,639,667
資産合計	605,173,438	634,639,667
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	16,667,807	-
未払受託者報酬	47,446	52,980
未払委託者報酬	1,739,628	1,942,520
未払利息	6	7
その他未払費用	371,674	415,028
流動負債合計	18,826,561	2,410,535
負債合計	18,826,561	2,410,535
純資産の部		
元本等		
元本	574,751,988	647,043,323
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	11,594,889	△14,814,191
(分配準備積立金)	4,647,657	4,922,121
元本等合計	586,346,877	632,229,132
純資産合計	586,346,877	632,229,132
負債純資産合計	605,173,438	634,639,667

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3 特定期間		第4 特定期間	
	自	至	自	至
	2021年 2月 16日	2021年 8月 16日	2021年 8月 17日	2022年 2月 15日
営業収益				
有価証券売買等損益		21,468,206		△20,381,140
営業収益合計		21,468,206		△20,381,140
営業費用				
支払利息		773		875
受託者報酬		85,564		102,555
委託者報酬		3,137,323		3,760,229
その他費用		670,277		803,384
営業費用合計		3,893,937		4,667,043
営業利益又は営業損失(△)		17,574,269		△25,048,183
経常利益又は経常損失(△)		17,574,269		△25,048,183
当期純利益又は当期純損失(△)		17,574,269		△25,048,183
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(△)		79,542		△199,432
期首剰余金又は期首欠損金(△)		7,522,531		11,594,889
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,888,438		1,366,968
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,888,438		1,366,968
剰余金減少額又は欠損金増加額		393,862		800,874
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		393,862		800,874
分配金		16,916,945		2,126,423
期末剰余金又は期末欠損金(△)		11,594,889		△14,814,191

(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、前特定期間末日が休業日のため、当特定期間は2021年8月17日から2022年2月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第3特定期間 2021年8月16日現在		第4特定期間 2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	395,001,284円	期首元本額	574,751,988円
期中追加設定元本額	200,700,872円	期中追加設定元本額	111,502,416円
期中一部解約元本額	20,950,168円	期中一部解約元本額	39,211,081円
2. 特定期間の末日における受益権の総数	574,751,988口	2. 特定期間の末日における受益権の総数	647,043,323口
		3. 元本の欠損	
		純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	14,814,191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	4. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9771円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(10,202円)	(10,000口当たり純資産額)	(9,771円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3特定期間 自2021年2月16日 至2021年8月16日		第4特定期間 自2021年8月17日 至2022年2月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
第5期		第7期	
2021年2月16日		2021年8月17日	
2021年5月17日		2021年11月15日	
A 費用控除後の配当等収益額	918,792円	A 費用控除後の配当等収益額	1,201,144円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	514,774円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,508,948円
C 収益調整金額	4,625,496円	C 収益調整金額	7,460,767円
D 分配準備積立金額	4,136,970円	D 分配準備積立金額	4,578,927円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	10,196,032円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	14,749,786円
F 当ファンドの期末残存口数	498,276,039口	F 当ファンドの期末残存口数	607,549,706口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	204円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	242円
H 10,000口当たり分配金額	5円	H 10,000口当たり分配金額	35円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000)	249,138円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000)	2,126,423円
第6期		第8期	
2021年5月18日		2021年11月16日	
2021年8月16日		2022年2月15日	
A 費用控除後の配当等収益額	1,864,975円	A 費用控除後の配当等収益額	0円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	14,196,186円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	6,947,232円	C 収益調整金額	7,024,345円
D 分配準備積立金額	5,254,303円	D 分配準備積立金額	4,922,121円

E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	28,262,696 円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	11,946,466 円
F 当ファンドの期末残存口数	574,751,988 口	F 当ファンドの期末残存口数	647,043,323 口
G 10,000 口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	491 円	G 10,000 口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	184 円
H 10,000 口当たり分配金額	290 円	H 10,000 口当たり分配金額	0 円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	16,667,807 円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0 円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

第3特定期間 自 2021年 2月 16日 至 2021年 8月 16日	第4特定期間 自 2021年 8月 17日 至 2022年 2月 15日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

II 金融商品の時価等に関する事項

第3特定期間 2021年 8月 16日現在	第4特定期間 2022年 2月 15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第3特定期間 自 2021年 2月 16日 至 2021年 8月 16日	第4特定期間 自 2021年 8月 17日 至 2022年 2月 15日

該当事項はありません。	同左
-------------	----

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第3 特定期間 自 2021年 2月 16日 至 2021年 8月 16日	第4 特定期間 自 2021年 8月 17日 至 2022年 2月 15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	17,438,420	△24,473,381
合計	17,438,420	△24,473,381

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	95,476,474	98,856,341	
	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	393,559,188	393,441,120	
	RM国内株式マザーファンド	10,031,382	14,053,966	
	RM先進国株式マザーファンド	45,783,915	90,423,232	
	RM新興国株式マザーファンド	8,605,918	14,136,080	
	RM新興国債券マザーファンド	3,232,249	3,565,493	
	RM国内リートマザーファンド	2,529,731	3,449,541	
	RM先進国リートマザーファンド	9,909,450	13,865,302	
合計		569,128,307	631,791,075	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月 15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月 17日
期首元本額	103,370,339,844円
期中追加設定元本額	27,627,608,003円
期中一部解約元本額	14,005,035,963円
期末元本額	116,992,911,884円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	7,427,663,724円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,602,656,234円
りそなラップ型ファンド(成長型)	248,943,469円
DCりそな グローバルバランス	619,065,501円
つみたてバランスファンド	3,880,125,976円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,227,935,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	806,997,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	248,805,524円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	279,721,006円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	83,061,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,843,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	15,715,956円
リスクコントロール・オープン	95,476,474円
FWりそな円建債券アクティブファンド	276,373,660円
FWりそな国内債券インデックスファンド	72,325,869,080円
Smart-i 国内債券インデックス	1,459,655,278円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,095,858,553円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	812,486,650円
Smart-i 8資産バランス 成長型	328,305,231円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,052,681,489円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,578,109,364円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	963,359,060円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	600,469,106円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,940,842,329円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	329,904,495円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	16,026,647円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,937,557,160円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,804,685,425円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	2,593,927円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	5,420,553円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	493,773円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	908,207,709円

2. 計算日における受益権の総数	116,992,911,884 口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0354 円
(10,000口当たり純資産額)	(10,354 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

合計	△1,462,166,155
----	----------------

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第4 2 3 回利付国債 (2年)	860,000,000	860,765,400	
	第4 2 4 回利付国債 (2年)	600,000,000	600,576,000	
	第4 2 5 回利付国債 (2年)	350,000,000	350,360,500	
	第4 2 6 回利付国債 (2年)	650,000,000	650,663,000	
	第4 2 7 回利付国債 (2年)	840,000,000	840,848,400	
	第4 2 8 回利付国債 (2年)	420,000,000	420,420,000	
	第4 2 9 回利付国債 (2年)	350,000,000	350,367,500	
	第4 3 0 回利付国債 (2年)	630,000,000	630,642,600	
	第4 3 2 回利付国債 (2年)	40,000,000	40,030,000	
	第1 3 5 回利付国債 (5年)	1,000,000,000	1,001,900,000	
	第1 3 6 回利付国債 (5年)	1,180,000,000	1,182,678,600	
	第1 3 7 回利付国債 (5年)	1,070,000,000	1,072,717,800	
	第1 3 8 回利付国債 (5年)	1,490,000,000	1,493,978,300	
	第1 3 9 回利付国債 (5年)	1,980,000,000	1,985,583,600	
	第1 4 0 回利付国債 (5年)	1,710,000,000	1,714,993,200	
	第1 4 1 回利付国債 (5年)	1,170,000,000	1,173,486,600	
	第1 4 2 回利付国債 (5年)	1,030,000,000	1,033,213,600	
	第1 4 3 回利付国債 (5年)	1,020,000,000	1,023,304,800	
	第1 4 4 回利付国債 (5年)	1,360,000,000	1,364,528,800	
	第1 4 5 回利付国債 (5年)	1,220,000,000	1,224,160,200	
	第1 4 6 回利付国債 (5年)	1,460,000,000	1,465,037,000	
	第1 4 7 回利付国債 (5年)	980,000,000	979,598,200	
	第1 4 8 回利付国債 (5年)	1,280,000,000	1,279,155,200	
	第1 4 9 回利付国債 (5年)	560,000,000	559,356,000	
	第1 回利付国債 (40年)	100,000,000	136,896,000	
	第2 回利付国債 (40年)	180,000,000	238,224,600	
第3 回利付国債 (40年)	110,000,000	146,325,300		
第4 回利付国債 (40年)	170,000,000	227,771,100		

第5回利付国債（40年）	240,000,000	310,970,400
第6回利付国債（40年）	240,000,000	306,105,600
第7回利付国債（40年）	220,000,000	269,865,200
第8回利付国債（40年）	290,000,000	332,476,300
第9回利付国債（40年）	480,000,000	411,489,600
第10回利付国債（40年）	420,000,000	421,121,400
第11回利付国債（40年）	340,000,000	330,286,200
第12回利付国債（40年）	360,000,000	315,136,800
第13回利付国債（40年）	430,000,000	374,831,000
第14回利付国債（40年）	360,000,000	334,821,600
第328回利付国債（10年）	411,000,000	414,016,740
第329回利付国債（10年）	297,000,000	300,442,230
第330回利付国債（10年）	257,000,000	260,500,340
第331回利付国債（10年）	90,000,000	90,938,700
第332回利付国債（10年）	652,000,000	659,687,080
第333回利付国債（10年）	225,000,000	227,961,000
第334回利付国債（10年）	261,000,000	264,818,430
第335回利付国債（10年）	345,000,000	349,605,750
第336回利付国債（10年）	210,000,000	213,042,900
第337回利付国債（10年）	170,000,000	171,496,000
第338回利付国債（10年）	631,000,000	638,887,500
第339回利付国債（10年）	385,000,000	390,139,750
第340回利付国債（10年）	934,000,000	947,244,120
第341回利付国債（10年）	440,000,000	444,897,200
第342回利付国債（10年）	380,000,000	381,318,600
第343回利付国債（10年）	780,000,000	782,698,800
第344回利付国債（10年）	960,000,000	963,072,000
第345回利付国債（10年）	1,070,000,000	1,073,359,800
第346回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,313,654,900
第347回利付国債（10年）	590,000,000	591,569,400
第348回利付国債（10年）	980,000,000	982,450,000
第349回利付国債（10年）	890,000,000	892,064,800
第350回利付国債（10年）	980,000,000	982,077,600
第351回利付国債（10年）	710,000,000	711,341,900
第352回利付国債（10年）	800,000,000	801,304,000
第353回利付国債（10年）	840,000,000	841,142,400

第354回利付国債（10年）	720,000,000	720,756,000	
第355回利付国債（10年）	800,000,000	800,288,000	
第356回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,149,126,000	
第357回利付国債（10年）	1,010,000,000	1,008,424,400	
第358回利付国債（10年）	820,000,000	818,023,800	
第359回利付国債（10年）	840,000,000	837,228,000	
第360回利付国債（10年）	440,000,000	438,130,000	
第361回利付国債（10年）	980,000,000	974,443,400	
第362回利付国債（10年）	950,000,000	943,198,000	
第363回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,170,253,200	
第364回利付国債（10年）	950,000,000	941,051,000	
第365回利付国債（10年）	520,000,000	514,482,800	
第1回利付国債（30年）	60,000,000	72,151,200	
第7回利付国債（30年）	40,000,000	48,343,600	
第10回利付国債（30年）	30,000,000	32,645,400	
第11回利付国債（30年）	80,000,000	92,434,400	
第12回利付国債（30年）	80,000,000	96,238,400	
第13回利付国債（30年）	200,000,000	238,742,000	
第14回利付国債（30年）	60,000,000	74,610,000	
第15回利付国債（30年）	200,000,000	251,756,000	
第16回利付国債（30年）	140,000,000	176,727,600	
第17回利付国債（30年）	160,000,000	200,428,800	
第18回利付国債（30年）	60,000,000	74,595,000	
第19回利付国債（30年）	100,000,000	124,613,000	
第20回利付国債（30年）	100,000,000	127,481,000	
第21回利付国債（30年）	180,000,000	225,147,600	
第22回利付国債（30年）	50,000,000	64,045,500	
第23回利付国債（30年）	220,000,000	282,462,400	
第24回利付国債（30年）	170,000,000	218,766,200	
第25回利付国債（30年）	200,000,000	252,174,000	
第26回利付国債（30年）	205,000,000	261,846,500	
第27回利付国債（30年）	295,000,000	382,550,100	
第28回利付国債（30年）	290,000,000	377,484,300	
第29回利付国債（30年）	150,000,000	193,663,500	
第30回利付国債（30年）	190,000,000	243,072,700	
第31回利付国債（30年）	170,000,000	215,163,900	

第32回利付国債（30年）	335,000,000	430,732,950
第33回利付国債（30年）	290,000,000	358,805,400
第34回利付国債（30年）	335,000,000	427,161,850
第35回利付国債（30年）	406,000,000	504,759,500
第36回利付国債（30年）	375,000,000	467,437,500
第37回利付国債（30年）	450,000,000	553,662,000
第38回利付国債（30年）	290,000,000	351,848,300
第39回利付国債（30年）	300,000,000	370,275,000
第40回利付国債（30年）	215,000,000	261,319,600
第41回利付国債（30年）	255,000,000	305,041,200
第42回利付国債（30年）	190,000,000	227,433,800
第43回利付国債（30年）	180,000,000	215,605,800
第44回利付国債（30年）	260,000,000	311,628,200
第45回利付国債（30年）	290,000,000	335,686,600
第46回利付国債（30年）	320,000,000	370,512,000
第47回利付国債（30年）	320,000,000	377,398,400
第48回利付国債（30年）	353,000,000	401,406,890
第49回利付国債（30年）	290,000,000	329,790,900
第50回利付国債（30年）	320,000,000	321,622,400
第51回利付国債（30年）	350,000,000	312,753,000
第52回利付国債（30年）	310,000,000	289,992,600
第53回利付国債（30年）	310,000,000	296,536,700
第54回利付国債（30年）	360,000,000	360,000,000
第55回利付国債（30年）	100,000,000	99,894,000
第56回利付国債（30年）	300,000,000	299,046,000
第57回利付国債（30年）	330,000,000	328,590,900
第58回利付国債（30年）	490,000,000	486,844,400
第59回利付国債（30年）	280,000,000	271,252,800
第60回利付国債（30年）	280,000,000	283,959,200
第61回利付国債（30年）	260,000,000	250,653,000
第62回利付国債（30年）	230,000,000	210,192,400
第63回利付国債（30年）	300,000,000	266,211,000
第64回利付国債（30年）	260,000,000	230,248,200
第65回利付国債（30年）	300,000,000	265,128,000
第66回利付国債（30年）	340,000,000	300,203,000
第67回利付国債（30年）	250,000,000	232,800,000

第68回利付国債（30年）	360,000,000	335,059,200	
第69回利付国債（30年）	340,000,000	324,798,600	
第70回利付国債（30年）	390,000,000	372,446,100	
第71回利付国債（30年）	360,000,000	343,684,800	
第72回利付国債（30年）	180,000,000	171,786,600	
第73回利付国債（30年）	10,000,000	9,540,700	
第61回利付国債（20年）	50,000,000	50,585,000	
第62回利付国債（20年）	80,000,000	80,927,200	
第63回利付国債（20年）	60,000,000	61,500,000	
第64回利付国債（20年）	120,000,000	123,736,800	
第65回利付国債（20年）	380,000,000	393,581,200	
第67回利付国債（20年）	20,000,000	20,806,200	
第68回利付国債（20年）	90,000,000	94,192,200	
第69回利付国債（20年）	60,000,000	62,669,400	
第70回利付国債（20年）	110,000,000	116,230,400	
第71回利付国債（20年）	100,000,000	105,196,000	
第72回利付国債（20年）	210,000,000	221,514,300	
第73回利付国債（20年）	180,000,000	190,254,600	
第75回利付国債（20年）	100,000,000	106,484,000	
第76回利付国債（20年）	100,000,000	105,866,000	
第77回利付国債（20年）	20,000,000	21,235,000	
第78回利付国債（20年）	50,000,000	53,154,500	
第79回利付国債（20年）	20,000,000	21,328,600	
第80回利付国債（20年）	90,000,000	96,279,300	
第81回利付国債（20年）	30,000,000	32,143,500	
第82回利付国債（20年）	170,000,000	182,756,800	
第83回利付国債（20年）	10,000,000	10,800,400	
第84回利付国債（20年）	120,000,000	129,144,000	
第85回利付国債（20年）	150,000,000	162,775,500	
第86回利付国債（20年）	100,000,000	109,334,000	
第87回利付国債（20年）	90,000,000	98,033,400	
第88回利付国債（20年）	185,000,000	203,287,250	
第89回利付国債（20年）	120,000,000	131,342,400	
第90回利付国債（20年）	170,000,000	186,915,000	
第91回利付国債（20年）	80,000,000	88,327,200	
第92回利付国債（20年）	255,000,000	280,380,150	

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

第129回利付国債（20年）	240,000,000	275,836,800	
第130回利付国債（20年）	220,000,000	253,484,000	
第131回利付国債（20年）	30,000,000	34,283,400	
第132回利付国債（20年）	80,000,000	91,624,800	
第133回利付国債（20年）	355,000,000	410,014,350	
第134回利付国債（20年）	45,000,000	52,042,050	
第135回利付国債（20年）	40,000,000	45,864,800	
第136回利付国債（20年）	50,000,000	56,837,000	
第137回利付国債（20年）	170,000,000	195,238,200	
第138回利付国債（20年）	90,000,000	101,543,400	
第139回利付国債（20年）	370,000,000	421,193,200	
第140回利付国債（20年）	420,000,000	483,088,200	
第141回利付国債（20年）	185,000,000	213,088,550	
第142回利付国債（20年）	390,000,000	453,324,300	
第143回利付国債（20年）	335,000,000	382,757,600	
第144回利付国債（20年）	270,000,000	305,586,000	
第145回利付国債（20年）	545,000,000	629,709,350	
第146回利付国債（20年）	560,000,000	648,183,200	
第147回利付国債（20年）	385,000,000	441,725,900	
第148回利付国債（20年）	545,000,000	619,479,700	
第149回利付国債（20年）	540,000,000	614,547,000	
第150回利付国債（20年）	590,000,000	664,711,700	
第151回利付国債（20年）	515,000,000	567,746,300	
第152回利付国債（20年）	660,000,000	727,927,200	
第153回利付国債（20年）	440,000,000	491,079,600	
第154回利付国債（20年）	358,000,000	394,916,960	
第155回利付国債（20年）	490,000,000	527,519,300	
第156回利付国債（20年）	630,000,000	626,654,700	
第157回利付国債（20年）	480,000,000	463,209,600	
第158回利付国債（20年）	270,000,000	271,290,600	
第159回利付国債（20年）	370,000,000	376,408,400	
第160回利付国債（20年）	510,000,000	525,412,200	
第161回利付国債（20年）	480,000,000	486,835,200	
第162回利付国債（20年）	290,000,000	293,767,100	
第163回利付国債（20年）	420,000,000	424,914,000	
第164回利付国債（20年）	460,000,000	457,272,200	

	第165回利付国債（20年）	430,000,000	426,775,000	
	第166回利付国債（20年）	610,000,000	623,432,200	
	第167回利付国債（20年）	440,000,000	434,931,200	
	第168回利付国債（20年）	530,000,000	514,365,000	
	第169回利付国債（20年）	410,000,000	390,065,800	
	第170回利付国債（20年）	540,000,000	512,184,600	
	第171回利付国債（20年）	400,000,000	378,524,000	
	第172回利付国債（20年）	360,000,000	345,992,400	
	第173回利付国債（20年）	510,000,000	489,105,300	
	第174回利付国債（20年）	550,000,000	526,317,000	
	第175回利付国債（20年）	450,000,000	437,566,500	
	第176回利付国債（20年）	530,000,000	514,312,000	
	第177回利付国債（20年）	490,000,000	466,146,800	
	第178回利付国債（20年）	240,000,000	232,329,600	
	国債証券合計	96,414,000,000	100,324,584,100	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	112,983,000	
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,196,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	101,518,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,977,000	
	第789回東京都公募公債	100,000,000	99,391,000	
	第808回東京都公募公債	100,000,000	98,863,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,892,000	
	第15回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,503,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,129,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,061,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,930,000	
	第170回大阪府公募公債	100,000,000	99,844,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	111,437,700	
	第444回大阪府公募公債	100,000,000	99,224,000	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	98,710,000	
	第471回大阪府公募公債	140,000,000	137,424,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,183,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,371,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,350,000	
	令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	99,390,000	
	平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,317,000	

平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,340,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	99,830,000	
平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	113,920,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,932,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,451,000	
令和3年度第12回愛知県公募公債	100,000,000	96,139,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,027,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,279,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	114,886,000	
第16回埼玉県公募公債	100,000,000	109,605,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,340,000	
令和3年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	97,262,000	
平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	113,414,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	101,773,000	
第11回千葉県公募公債	100,000,000	115,361,000	
第19回千葉県公募公債	100,000,000	108,936,000	
平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,571,000	
第15回千葉県公募公債	100,000,000	98,498,000	
第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,160,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,454,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,122,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,411,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,972,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,153,000	
第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,516,000	
第187回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,654,000	
第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,722,000	
第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,303,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,039,000	
第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,501,000	
第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,407,000	
令和3年度第2回堺市公募公債	100,000,000	98,733,000	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,567,000	
第11回大阪市公募公債	100,000,000	116,168,000	
第17回名古屋市公募公債	100,000,000	109,436,000	
令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	113,837,045	

	平成22年度第9回神戸市公募公債	100,000,000	116,140,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	115,160,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	114,367,000	
	第37回川崎市公募公債	100,000,000	98,511,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,344,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,554,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,456,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,214,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	100,515,000	
	地方債証券合計	6,684,500,000	6,860,673,745	
特殊債券	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,740,000	
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,335,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,483,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,596,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	93,366,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,724,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	129,758,000	
	第27回道路債券	100,000,000	105,018,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	171,123,000	
	第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,744,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	115,751,040	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	128,776,730	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,289,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,565,000	
	第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	104,910,650	
	第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	134,497,580	
	第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,285,000	
	第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,258,000	
	第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,442,000	
	第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,969,000	
	第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済	100,000,000	99,547,000	

機構債券			
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,755,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	120,418,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	107,062,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,511,300	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,316,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,698,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,191,400	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,798,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	213,000,000	214,013,880	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,586,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,912,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,230,000	
F14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,025,000	
F151回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,416,000	
第10回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	115,242,000	
第97回都市再生債券	100,000,000	105,834,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	110,687,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,088,000	67,589,595	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	72,883,000	72,541,178	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,389,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,195,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,597,000	79,708,435	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,704,000	79,590,820	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,358,000	81,094,400	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,334,000	80,201,448	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,633,000	83,321,048	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,866,000	84,972,931	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,383,000	88,728,087	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,053,000	90,964,013	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,916,000	94,111,112	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,969,000	96,447,306	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,890,000	97,007,032	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,400,000	97,072,584	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,555,000	97,208,738	

	第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,783,000	97,565,005	
	第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,128,000	98,352,819	
	第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,477,000	98,509,088	
	第223回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,134,000	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	46,566,000	46,325,719	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	47,730,000	47,514,260	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	50,984,000	50,792,810	
	第334回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,975,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	100,071,000	
	第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,830,000	
	第372回信金中金債	100,000,000	99,886,000	
	第376回信金中金債	100,000,000	99,836,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	101,684,000	
	第79回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,762,000	
	第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,857,000	
	第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,789,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,855,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,870,000	
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,048,000	
	特殊債券合計	7,454,297,000	7,617,673,008	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,973,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,029,000	
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,470,000	
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,759,000	
	第27回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	98,887,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,930,000	
	第18回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	98,443,000	
	第54回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	98,627,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,005,000	
	第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,336,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,422,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,479,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,909,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	

第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,697,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,989,000	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,889,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,028,000	
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,556,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,307,000	
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,293,000	
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,545,000	
第81アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,204,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,900,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,157,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,405,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,748,000	
第134回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,047,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,204,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,763,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,181,000	
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,253,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,184,000	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,199,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,677,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,576,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,037,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,068,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,769,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,620,000	

	第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,754,000	
	第540回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,697,000	
	第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,875,000	
	第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
	第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,345,000	
	第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,992,000	
	第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,368,000	
	第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,389,000	
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,475,000	
	社債券合計	5,700,000,000	5,696,959,000	
	合計		120,499,889,853	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2022年2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	22,532,199
コール・ローン	1,030,902,711
国債証券	274,843,497,132
派生商品評価勘定	29,872,123
未収入金	423,617,629
未収利息	1,590,224,802
前払費用	131,710,116
流動資産合計	278,072,356,712
資産合計	278,072,356,712
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,837,766,698
未払金	25,197,015
未払解約金	1,298,108,000
未払利息	2,796
流動負債合計	3,161,074,509
負債合計	3,161,074,509
純資産の部	
元本等	
元本	274,982,026,704
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△70,744,501
元本等合計	274,911,282,203
純資産合計	274,911,282,203
負債純資産合計	278,072,356,712

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	257,224,505,680円
期中追加設定元本額	66,243,176,571円
期中一部解約元本額	48,485,655,547円
期末元本額	274,982,026,704円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	28,760,828,458円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	18,098,428,870円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,795,867,899円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,338,217,664円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	823,700,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	256,177,062円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	289,287,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	85,899,790円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	18,241,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,252,273円
リスクコントロール・オープン	393,559,188円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,650,868,763円
FWりそな円建債券アクティブファンド	373,850,366円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	170,812,959,352円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,054,884,984円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,123,769,818円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	840,251,156円
Smart-i 8資産バランス 成長型	338,003,455円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	4,333,307,042円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	6,493,922,987円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	3,964,201,136円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	2,471,331,049円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	7,949,310,734円

りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,352,421,763円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,670,920,283円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	16,384,005円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	2,875,085,180円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	2,011,231,309円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	10,162,450円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	42,145,535円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	1,230,898円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	3,719,323,075円
2. 計算日における受益権の総数	274,982,026,704口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	70,744,501円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額	0.9997円
(10,000口当たり純資産額)	(9,997円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額

自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

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

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	2,360,000.00	2,372,998.40	
		US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,873,270.95	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,667,487.72	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,504,713.75	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,306,019.33	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,521,581.70	
		US TREASURY N/B	3,680,000.00	3,638,212.12	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,472,109.20	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,144,931.84	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,381,761.66	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,875,359.28	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,457,070.05	
		US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,655,542.84	
		US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,802,674.17	
		US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,547,968.64	
		US TREASURY N/B	6,410,000.00	6,442,926.24	
		US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,841,804.59	
		US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,067,081.25	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,831,921.74	
		US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,872,656.00	
		US TREASURY N/B	6,250,000.00	6,157,714.37	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,158,518.59	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,257,028.71	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,982,711.25	
		US TREASURY N/B	8,650,000.00	8,492,880.53	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,094,462.72	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,963,697.21			
US TREASURY N/B	7,960,000.00	7,806,085.44			

	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,554,345.55
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,880,234.00
	US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,315,876.43
	US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,170,603.12
	US TREASURY N/B	6,850,000.00	6,708,450.91
	US TREASURY N/B	6,940,000.00	6,792,795.66
	US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,323,105.56
	US TREASURY N/B	7,130,000.00	6,986,006.79
	US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,956,818.00
	US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,804,601.42
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,840,148.28
	US TREASURY N/B	7,910,000.00	7,752,108.49
	US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,593,238.72
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,888,867.00
	US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,444,105.37
	US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,253,661.52
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,848,436.80
	US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,428,554.44
	US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,943,624.83
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,751,574.05
	US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,268,773.39
	US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,319,361.12
	US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,453,290.97
	US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,049,494.38
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,873,986.15
	US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,989,800.00
	US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,777,774.87
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,818,421.74
	US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,411,450.00
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,746,875.00
	US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,404,126.48
	US TREASURY N/B	6,080,000.00	5,915,649.69
	US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,337,309.28
	US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,977,324.18
	US TREASURY N/B	8,040,000.00	8,186,666.48
	US TREASURY N/B	6,060,000.00	5,870,861.34

	US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,162,936.44
	US TREASURY N/B	5,980,000.00	5,783,313.61
	US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,397,292.12
	US TREASURY N/B	6,540,000.00	6,549,963.03
	US TREASURY N/B	4,990,000.00	4,834,646.82
	US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,495,204.63
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,004,374.80
	US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,207,855.31
	US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,661,362.10
	US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,649,693.55
	US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,450,550.00
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,532,788.38
	US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,545,101.46
	US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,736,059.32
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,795,194.70
	US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,451,856.88
	US TREASURY N/B	3,990,000.00	3,962,724.36
	US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,530,595.61
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,836,875.00
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,312,644.45
	US TREASURY N/B	4,880,000.00	4,844,543.38
	US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,842,437.81
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,431,500.00
	US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,796,437.50
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,924,062.40
	US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,672,706.80
	US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,250,417.02
	US TREASURY N/B	9,550,000.00	9,604,091.20
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,364,058.45
	US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,056,391.04
	US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,591,866.34
	US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,166,060.61
	US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,622,152.99
	US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,813,333.12
	US TREASURY N/B	5,950,000.00	6,005,315.96
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,550,564.23

	US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,047,972.97
	US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,181,695.18
	US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,968,879.03
	US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,325,585.82
	US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,099,460.88
	US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,327,316.17
	US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,945,666.35
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,607,617.10
	US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,524,542.06
	US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,675,731.25
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,287,312.50
	US TREASURY N/B	7,180,000.00	6,757,613.52
	US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,641,147.83
	US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,781,275.00
	US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,475,788.70
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,745,953.04
	US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,073,144.25
	US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,896,558.48
	US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,827,062.34
	US TREASURY N/B	6,860,000.00	6,785,236.29
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,738,050.76
	US TREASURY N/B	7,720,000.00	7,295,098.14
	US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,704,939.35
	US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,641,346.24
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,545,117.00
	US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,335,151.67
	US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,355,002.27
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,721,409.92
	US TREASURY N/B	8,400,000.00	7,993,125.00
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,694,937.50
	US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,919,823.86
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,595,328.06
	US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,422,812.16
	US TREASURY N/B	5,830,000.00	5,725,925.17
	US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,202,868.50
	US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,563,404.87

	US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,329,117.04
	US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,769,128.64
	US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,486,925.00
	US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,430,211.03
	US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,761,973.29
	US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,516,730.40
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,815,546.80
	US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,699,493.64
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,293,750.00
	US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,225,309.37
	US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,617,486.25
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	961,953.10
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,623,906.04
	US TREASURY N/B	4,180,000.00	3,886,093.75
	US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,721,784.14
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,341,109.24
	US TREASURY N/B	4,280,000.00	3,966,021.76
	US TREASURY N/B	5,970,000.00	5,487,969.06
	US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,638,236.12
	US TREASURY N/B	4,290,000.00	3,963,389.85
	US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,294,100.26
	US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,615,070.71
	US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,320,441.86
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,649,410.08
	US TREASURY N/B	6,680,000.00	6,181,348.02
	US TREASURY N/B	6,990,000.00	6,506,706.50
	US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,106,851.27
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,659,569.70
	US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,830,223.13
	US TREASURY N/B	7,730,000.00	7,393,322.16
	US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,404,966.88
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,212,577.80
	US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,877,406.16
	US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,445,882.74
	US TREASURY N/B	8,390,000.00	8,837,029.26
	US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,188,827.84

	US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,195,867.07
	US TREASURY N/B	6,080,000.00	5,836,324.54
	US TREASURY N/B	6,480,000.00	6,937,396.63
	US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,483,819.81
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,679,374.40
	US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,882,920.29
	US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,167,292.51
	US TREASURY N/B	4,900,000.00	4,779,413.93
	US TREASURY N/B	3,990,000.00	3,927,032.61
	US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,077,038.59
	US TREASURY N/B	780,000.00	1,033,987.50
	US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,075,979.30
	US TREASURY N/B	9,650,000.00	8,620,917.24
	US TREASURY N/B	13,620,000.00	12,401,116.23
	US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,117,200.89
	US TREASURY N/B	10,740,000.00	9,974,775.00
	US TREASURY N/B	11,950,000.00	11,577,495.79
	US TREASURY N/B	13,510,000.00	12,635,015.38
	US TREASURY N/B	9,370,000.00	8,848,061.01
	US TREASURY N/B	540,000.00	701,894.48
	US TREASURY N/B	130,000.00	178,678.90
	US TREASURY N/B	690,000.00	895,841.00
	US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,451,645.11
	US TREASURY N/B	960,000.00	1,131,900.00
	US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,663,797.62
	US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,780,001.46
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,096,000.00
	US TREASURY N/B	780,000.00	1,052,603.83
	US TREASURY N/B	950,000.00	1,248,693.30
	US TREASURY N/B	4,640,000.00	3,795,737.15
	US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,743,277.61
	US TREASURY N/B	7,060,000.00	5,753,347.90
	US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,579,947.58
	US TREASURY N/B	7,710,000.00	6,551,090.62
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,479,289.04
	US TREASURY N/B	7,360,000.00	6,807,712.21

	US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,490,275.75
	US TREASURY N/B	7,140,000.00	7,011,702.76
	US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,319,118.69
	US TREASURY N/B	8,760,000.00	7,914,112.50
	US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,167,603.11
	US TREASURY N/B	4,190,000.00	3,950,384.36
	US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,507,604.65
	US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,181,973.78
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,741,603.08
	US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,973,416.29
	US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,514,487.36
	US TREASURY N/B	3,710,000.00	4,007,524.56
	US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,936,408.11
	US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,783,154.51
	US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,803,447.46
	US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,169,535.51
	US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,427,697.55
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,093,452.88
	US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,434,264.54
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,767,285.00
	US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,813,994.33
	US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,021,408.48
	US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,127,802.26
	US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,147,816.68
	US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,133,788.85
	US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,423,442.13
	US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,283,956.77
	US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,570,307.65
	US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,679,746.87
	US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,346,314.20
	US TREASURY N/B	4,650,000.00	5,236,517.52
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,189,413.95
	US TREASURY N/B	5,090,000.00	5,744,541.93
	US TREASURY N/B	5,530,000.00	6,678,770.67
	US TREASURY N/B	5,280,000.00	5,985,787.10
	US TREASURY N/B	5,190,000.00	5,759,885.87

	US TREASURY N/B	5,670,000.00	5,576,533.45
	US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,384,925.51
	US TREASURY N/B	6,190,000.00	5,771,932.97
	US TREASURY N/B	6,760,000.00	5,242,960.67
	US TREASURY N/B	7,700,000.00	6,163,608.99
	US TREASURY N/B	7,270,000.00	6,191,994.94
	US TREASURY N/B	8,460,000.00	7,652,333.95
	US TREASURY N/B	8,140,000.00	8,244,929.48
	US TREASURY N/B	8,300,000.00	7,731,968.75
	US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,100,428.12
	米ドル 小計	1,155,290,000.00	1,140,318,902.91 (131,615,607,773)
カナダドル	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,229,651.00
	GOV OF CANADA	2,160,000.00	2,171,255.76
	GOV OF CANADA	1,700,000.00	1,678,984.60
	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,332,896.74
	GOV OF CANADA	1,550,000.00	1,524,972.15
	GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,604,153.96
	GOV OF CANADA	1,350,000.00	1,328,699.70
	GOV OF CANADA	1,140,000.00	1,123,406.16
	GOV OF CANADA	840,000.00	852,389.16
	GOV OF CANADA	2,310,000.00	2,248,886.64
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,205,155.24
	GOV OF CANADA	810,000.00	808,395.39
	GOV OF CANADA	1,460,000.00	1,428,767.68
	GOV OF CANADA	840,000.00	830,298.84
	GOV OF CANADA	560,000.00	557,154.08
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,274,070.00
	GOV OF CANADA	3,290,000.00	3,155,764.71
	GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,129,875.98
	GOV OF CANADA	850,000.00	842,111.15
	GOV OF CANADA	2,190,000.00	2,116,232.04
	GOV OF CANADA	910,000.00	885,364.48
	GOV OF CANADA	920,000.00	884,479.72
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,012,714.00
	GOV OF CANADA	670,000.00	850,301.69

	GOV OF CANADA	920,000.00	948,780.36
	GOV OF CANADA	3,850,000.00	3,678,051.30
	GOV OF CANADA	3,120,000.00	2,774,625.36
	GOV OF CANADA	4,140,000.00	3,996,085.32
	GOV OF CANADA	2,080,000.00	1,996,404.80
	GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,399,034.04
	GOV OF CANADA	690,000.00	942,747.69
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,229,497.92
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,424,761.45
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,388,996.25
	GOV OF CANADA	4,620,000.00	4,425,502.62
	GOV OF CANADA	1,580,000.00	1,409,036.10
	GOV OF CANADA	620,000.00	701,555.42
	カナダドル 小計	61,400,000.00	61,391,059.50 (5,566,941,275)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	16,030,000.00	15,918,110.60
	UNITED MEXICAN STATE	25,090,000.00	25,168,283.30
	UNITED MEXICAN STATE	36,900,000.00	37,067,157.00
	UNITED MEXICAN STATE	28,720,000.00	30,302,721.86
	UNITED MEXICAN STATE	50,780,000.00	47,231,351.41
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	796,426.40
	UNITED MEXICAN STATE	42,840,000.00	42,362,715.27
	UNITED MEXICAN STATE	32,190,000.00	33,525,820.62
	UNITED MEXICAN STATE	33,576,000.00	33,452,440.32
	UNITED MEXICAN STATE	10,100,000.00	10,017,079.00
	UNITED MEXICAN STATE	8,200,000.00	9,698,632.00
	UNITED MEXICAN STATE	24,800,000.00	25,860,182.64
	UNITED MEXICAN STATE	23,470,000.00	22,600,436.50
	UNITED MEXICAN STATE	24,210,000.00	23,914,625.89
	メキシコペソ 小計	357,786,000.00	357,915,982.81 (2,024,480,173)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	610,000.00	613,581.92
	GOV OF AUSTRIA	1,160,000.00	1,167,458.80
	GOV OF AUSTRIA	1,390,000.00	1,439,607.71
	GOV OF AUSTRIA	1,230,000.00	1,235,795.76
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,269,774.00

	GOV OF AUSTRIA	600,000.00	600,448.80
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,398,926.50
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,234,575.51
	GOV OF AUSTRIA	1,840,000.00	1,890,956.96
	GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,370,622.60
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,622,719.56
	GOV OF AUSTRIA	1,120,000.00	1,149,308.16
	GOV OF AUSTRIA	1,380,000.00	1,388,914.80
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,276,173.57
	GOV OF AUSTRIA	1,370,000.00	1,298,205.53
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,238,512.17
	GOV OF AUSTRIA	730,000.00	669,607.10
	GOV OF AUSTRIA	1,620,000.00	2,413,829.16
	GOV OF AUSTRIA	420,000.00	355,616.10
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	1,282,797.60
	GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,112,349.00
	GOV OF AUSTRIA	710,000.00	669,420.66
	GOV OF AUSTRIA	410,000.00	773,794.23
	GOV OF AUSTRIA	350,000.00	282,233.35
	GOV OF AUSTRIA	440,000.00	317,856.20
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	917,858.70
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	342,504.12
	GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,596,153.02
	GOV OF BELGIUM	1,160,000.00	1,171,232.28
	GOV OF BELGIUM	1,710,000.00	1,824,352.83
	GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,446,275.68
	GOV OF BELGIUM	2,490,000.00	2,558,056.68
	GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,420,831.20
	GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,094,756.16
	GOV OF BELGIUM	1,660,000.00	1,707,484.30
	GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,130,684.60
	GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,338,223.10
	GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,295,298.86
	GOV OF BELGIUM	2,030,000.00	2,098,356.19
	GOV OF BELGIUM	1,510,000.00	1,456,919.87
	GOV OF BELGIUM	2,100,000.00	2,174,760.00

	GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	1,357,658.20
	GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,505,057.17
	GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,222,920.45
	GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,173,916.68
	GOV OF BELGIUM	2,270,000.00	3,463,323.11
	GOV OF BELGIUM	450,000.00	484,249.50
	GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,124,501.00
	GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,100,412.73
	GOV OF BELGIUM	1,970,000.00	3,069,061.03
	GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,944,893.16
	GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,385,462.05
	GOV OF BELGIUM	1,280,000.00	1,421,644.80
	GOV OF BELGIUM	700,000.00	885,503.50
	GOV OF BELGIUM	800,000.00	1,011,768.00
	GOV OF BELGIUM	590,000.00	428,105.70
	GOV OF FINLAND	530,000.00	542,330.45
	GOV OF FINLAND	660,000.00	664,583.04
	GOV OF FINLAND	610,000.00	640,823.91
	GOV OF FINLAND	460,000.00	462,325.76
	GOV OF FINLAND	520,000.00	591,972.16
	GOV OF FINLAND	670,000.00	691,421.24
	GOV OF FINLAND	840,000.00	854,709.24
	GOV OF FINLAND	500,000.00	496,464.50
	GOV OF FINLAND	910,000.00	924,762.02
	GOV OF FINLAND	470,000.00	544,087.51
	GOV OF FINLAND	510,000.00	515,004.63
	GOV OF FINLAND	920,000.00	926,409.36
	GOV OF FINLAND	360,000.00	344,214.97
	GOV OF FINLAND	490,000.00	499,388.40
	GOV OF FINLAND	690,000.00	660,085.74
	GOV OF FINLAND	390,000.00	410,072.91
	GOV OF FINLAND	580,000.00	528,685.08
	GOV OF FINLAND	470,000.00	422,149.77
	GOV OF FINLAND	600,000.00	808,989.00
	GOV OF FINLAND	470,000.00	531,200.11
	GOV OF FINLAND	410,000.00	328,532.50

	GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,132,175.16
	GOV OF FRANCE	5,110,000.00	5,140,711.10
	GOV OF FRANCE	6,280,000.00	6,460,330.20
	GOV OF FRANCE	4,330,000.00	4,671,896.80
	GOV OF FRANCE	3,880,000.00	3,903,640.84
	GOV OF FRANCE	4,450,000.00	4,474,906.65
	GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,164,162.36
	GOV OF FRANCE	4,620,000.00	4,864,236.30
	GOV OF FRANCE	4,650,000.00	4,656,384.45
	GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,340,877.50
	GOV OF FRANCE	3,250,000.00	3,973,329.75
	GOV OF FRANCE	5,060,000.00	5,237,287.22
	GOV OF FRANCE	4,610,000.00	4,586,470.56
	GOV OF FRANCE	5,800,000.00	6,624,539.60
	GOV OF FRANCE	5,000,000.00	5,073,480.00
	GOV OF FRANCE	4,410,000.00	4,417,130.97
	GOV OF FRANCE	1,830,000.00	1,806,502.80
	GOV OF FRANCE	4,430,000.00	4,602,061.20
	GOV OF FRANCE	6,560,000.00	7,483,516.80
	GOV OF FRANCE	5,660,000.00	5,800,549.12
	GOV OF FRANCE	5,920,000.00	6,056,811.20
	GOV OF FRANCE	4,750,000.00	6,467,144.00
	GOV OF FRANCE	4,350,000.00	4,364,885.70
	GOV OF FRANCE	5,340,000.00	5,134,084.26
	GOV OF FRANCE	5,930,000.00	6,889,592.60
	GOV OF FRANCE	5,970,000.00	5,660,551.02
	GOV OF FRANCE	6,120,000.00	6,602,684.40
	GOV OF FRANCE	4,640,000.00	4,335,903.68
	GOV OF FRANCE	120,000.00	111,197.40
	GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,310,817.28
	GOV OF FRANCE	4,110,000.00	4,312,906.59
	GOV OF FRANCE	3,510,000.00	5,247,148.14
	GOV OF FRANCE	4,660,000.00	4,885,078.00
	GOV OF FRANCE	3,480,000.00	5,161,772.64
	GOV OF FRANCE	3,730,000.00	4,249,715.82
	GOV OF FRANCE	1,930,000.00	1,769,707.71

	GOV OF FRANCE	4,280,000.00	6,926,221.28
	GOV OF FRANCE	1,200,000.00	1,063,927.20
	GOV OF FRANCE	3,150,000.00	4,556,821.50
	GOV OF FRANCE	2,980,000.00	3,573,878.24
	GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,244,963.88
	GOV OF FRANCE	3,580,000.00	3,151,073.04
	GOV OF FRANCE	900,000.00	781,892.10
	GOV OF FRANCE	2,370,000.00	4,163,253.39
	GOV OF FRANCE	2,040,000.00	3,731,576.16
	GOV OF FRANCE	1,590,000.00	1,814,003.97
	GOV OF FRANCE	1,110,000.00	758,083.38
	GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,390,204.70
	GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,143,688.65
	GOV OF GERMANY	1,710,000.00	1,722,071.91
	GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,575,736.90
	GOV OF GERMANY	1,940,000.00	1,954,129.02
	GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,752,433.10
	GOV OF GERMANY	1,660,000.00	1,672,592.42
	GOV OF GERMANY	2,500,000.00	2,521,902.50
	GOV OF GERMANY	1,690,000.00	1,703,182.00
	GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,641,097.36
	GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,154,695.70
	GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,063,315.36
	GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,901,479.55
	GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,779,165.44
	GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,006,620.40
	GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,465,356.60
	GOV OF GERMANY	3,190,000.00	3,318,289.04
	GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,336,455.57
	GOV OF GERMANY	350,000.00	352,518.67
	GOV OF GERMANY	3,660,000.00	3,746,551.68
	GOV OF GERMANY	1,640,000.00	1,645,592.40
	GOV OF GERMANY	3,670,000.00	3,679,266.75
	GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,944,398.24
	GOV OF GERMANY	3,450,000.00	3,493,539.00
	GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,271,862.32

	GOV OF GERMANY	3,050,000.00	3,126,869.15
	GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,801,749.84
	GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,304,962.04
	GOV OF GERMANY	3,640,000.00	3,733,537.08
	GOV OF GERMANY	1,630,000.00	2,122,494.72
	GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,971,684.38
	GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,503,403.76
	GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,445,242.35
	GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,190,385.66
	GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,710,752.65
	GOV OF GERMANY	3,040,000.00	3,003,906.08
	GOV OF GERMANY	2,870,000.00	2,827,658.89
	GOV OF GERMANY	700,000.00	692,727.00
	GOV OF GERMANY	2,370,000.00	3,504,722.82
	GOV OF GERMANY	3,090,000.00	3,034,392.36
	GOV OF GERMANY	3,170,000.00	3,099,321.68
	GOV OF GERMANY	750,000.00	735,266.25
	GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,437,535.50
	GOV OF GERMANY	2,260,000.00	2,158,424.30
	GOV OF GERMANY	2,440,000.00	2,312,063.20
	GOV OF GERMANY	3,160,000.00	4,887,884.84
	GOV OF GERMANY	2,230,000.00	3,725,440.23
	GOV OF GERMANY	2,430,000.00	4,365,232.56
	GOV OF GERMANY	2,450,000.00	3,866,908.50
	GOV OF GERMANY	3,050,000.00	4,476,054.95
	GOV OF GERMANY	3,560,000.00	5,342,388.76
	GOV OF GERMANY	3,470,000.00	4,190,989.66
	GOV OF GERMANY	4,030,000.00	3,543,635.42
	GOV OF GERMANY	780,000.00	674,212.50
	GOV OF IRELAND	830,000.00	869,333.70
	GOV OF IRELAND	920,000.00	989,682.44
	GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,575,765.90
	GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,366,679.16
	GOV OF IRELAND	770,000.00	766,735.20
	GOV OF IRELAND	890,000.00	920,170.11
	GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,312,676.82

	GOV OF IRELAND	1,160,000.00	1,336,470.80
	GOV OF IRELAND	740,000.00	714,344.20
	GOV OF IRELAND	760,000.00	810,166.84
	GOV OF IRELAND	1,150,000.00	1,070,905.30
	GOV OF IRELAND	180,000.00	171,014.76
	GOV OF IRELAND	500,000.00	524,513.00
	GOV OF IRELAND	720,000.00	672,449.76
	GOV OF IRELAND	730,000.00	803,620.50
	GOV OF IRELAND	460,000.00	418,291.80
	GOV OF IRELAND	1,130,000.00	1,341,401.53
	GOV OF IRELAND	820,000.00	868,645.68
	GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,852,992.12
	GOV OF ITALY	2,290,000.00	2,319,055.52
	GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,049,687.60
	GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,342,889.12
	GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,684,903.07
	GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,270,357.58
	GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,274,771.17
	GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,341,659.52
	GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,730,916.50
	GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,511,374.00
	GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,147,508.00
	GOV OF ITALY	2,070,000.00	2,051,285.13
	GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,961,233.20
	GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,079,115.30
	GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,332,363.73
	GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,368,485.00
	GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,096,711.91
	GOV OF ITALY	2,420,000.00	2,547,370.15
	GOV OF ITALY	600,000.00	588,723.00
	GOV OF ITALY	2,410,000.00	2,388,447.37
	GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,655,746.04
	GOV OF ITALY	2,160,000.00	2,209,410.00
	GOV OF ITALY	2,260,000.00	2,315,709.00
	GOV OF ITALY	2,460,000.00	2,547,175.02
	GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,163,199.68

	GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,407,597.50
	GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,358,864.00
	GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,037,485.92
	GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,216,380.78
	GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,285,192.50
	GOV OF ITALY	2,170,000.00	2,269,689.80
	GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,715,059.80
	GOV OF ITALY	3,120,000.00	3,142,214.40
	GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,246,479.44
	GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,710,839.54
	GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,083,628.00
	GOV OF ITALY	2,660,000.00	2,613,315.40
	GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,322,740.72
	GOV OF ITALY	3,190,000.00	3,311,258.28
	GOV OF ITALY	2,110,000.00	1,969,066.34
	GOV OF ITALY	1,450,000.00	1,365,834.75
	GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,210,276.86
	GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,769,810.00
	GOV OF ITALY	730,000.00	676,688.10
	GOV OF ITALY	2,640,000.00	2,907,498.00
	GOV OF ITALY	3,280,000.00	4,165,695.12
	GOV OF ITALY	2,930,000.00	3,344,331.30
	GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,700,978.24
	GOV OF ITALY	2,010,000.00	1,884,244.35
	GOV OF ITALY	2,620,000.00	2,588,303.24
	GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,137,065.68
	GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,239,957.80
	GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,049,537.13
	GOV OF ITALY	2,180,000.00	1,997,311.64
	GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,136,683.40
	GOV OF ITALY	400,000.00	362,762.40
	GOV OF ITALY	2,530,000.00	3,496,138.69
	GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,678,382.30
	GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,645,452.18
	GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,143,603.44
	GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,531,286.92

	GOV OF ITALY	1, 810, 000. 00	1, 842, 335. 65
	GOV OF ITALY	3, 360, 000. 00	4, 159, 441. 44
	GOV OF ITALY	1, 770, 000. 00	1, 501, 614. 90
	GOV OF ITALY	1, 870, 000. 00	2, 065, 714. 20
	GOV OF ITALY	2, 270, 000. 00	3, 183, 173. 33
	GOV OF ITALY	1, 470, 000. 00	1, 652, 838. 60
	GOV OF ITALY	2, 430, 000. 00	3, 441, 730. 50
	GOV OF ITALY	1, 650, 000. 00	1, 517, 736. 00
	GOV OF ITALY	2, 070, 000. 00	2, 935, 705. 05
	GOV OF ITALY	1, 440, 000. 00	1, 218, 692. 16
	GOV OF ITALY	2, 030, 000. 00	2, 344, 014. 61
	GOV OF ITALY	2, 030, 000. 00	2, 138, 818. 15
	GOV OF ITALY	1, 870, 000. 00	2, 229, 443. 92
	GOV OF ITALY	1, 590, 000. 00	2, 025, 068. 52
	GOV OF ITALY	1, 870, 000. 00	1, 848, 186. 45
	GOV OF ITALY	1, 500, 000. 00	1, 254, 820. 50
	GOV OF ITALY	620, 000. 00	569, 154. 42
	GOV OF ITALY	1, 130, 000. 00	1, 135, 801. 42
	GOV OF ITALY	560, 000. 00	472, 245. 20
	GOV OF NETHERLANDS	2, 140, 000. 00	2, 209, 603. 50
	GOV OF NETHERLANDS	1, 830, 000. 00	1, 843, 219. 92
	GOV OF NETHERLANDS	1, 930, 000. 00	2, 035, 910. 68
	GOV OF NETHERLANDS	2, 290, 000. 00	2, 314, 434. 30
	GOV OF NETHERLANDS	300, 000. 00	299, 329. 80
	GOV OF NETHERLANDS	2, 090, 000. 00	2, 130, 378. 80
	GOV OF NETHERLANDS	1, 910, 000. 00	1, 896, 475. 29
	GOV OF NETHERLANDS	1, 840, 000. 00	1, 899, 577. 36
	GOV OF NETHERLANDS	1, 490, 000. 00	1, 956, 781. 24
	GOV OF NETHERLANDS	1, 640, 000. 00	1, 694, 718. 60
	GOV OF NETHERLANDS	840, 000. 00	821, 239. 44
	GOV OF NETHERLANDS	1, 400, 000. 00	1, 393, 918. 40
	GOV OF NETHERLANDS	1, 610, 000. 00	1, 560, 840. 26
	GOV OF NETHERLANDS	1, 460, 000. 00	1, 400, 890. 44
	GOV OF NETHERLANDS	1, 940, 000. 00	2, 352, 348. 94
	GOV OF NETHERLANDS	1, 940, 000. 00	2, 896, 885. 60
	GOV OF NETHERLANDS	870, 000. 00	790, 127. 04

	GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,189,008.00
	GOV OF NETHERLANDS	2,080,000.00	3,332,114.24
	GOV OF NETHERLANDS	2,360,000.00	3,565,783.00
	GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	992,278.80
	GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,397,096.39
	GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,450,217.48
	GOV OF SPAIN	2,560,000.00	2,581,713.92
	GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,791,177.47
	GOV OF SPAIN	1,790,000.00	1,959,763.60
	GOV OF SPAIN	2,750,000.00	2,982,100.00
	GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,217,058.50
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,080,281.69
	GOV OF SPAIN	2,310,000.00	2,476,852.68
	GOV OF SPAIN	2,540,000.00	2,526,608.09
	GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,548,397.00
	GOV OF SPAIN	2,610,000.00	2,997,650.25
	GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,060,499.12
	GOV OF SPAIN	2,170,000.00	2,132,391.73
	GOV OF SPAIN	2,540,000.00	2,698,444.68
	GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,087,196.62
	GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,171,991.41
	GOV OF SPAIN	620,000.00	600,404.28
	GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,790,630.60
	GOV OF SPAIN	2,490,000.00	2,504,915.10
	GOV OF SPAIN	2,760,000.00	2,876,781.12
	GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,121,183.79
	GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,308,908.78
	GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,104,959.52
	GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,615,698.20
	GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,568,171.20
	GOV OF SPAIN	2,730,000.00	2,838,503.85
	GOV OF SPAIN	2,820,000.00	2,753,039.10
	GOV OF SPAIN	2,120,000.00	2,040,500.00
	GOV OF SPAIN	2,890,000.00	3,109,680.46
	GOV OF SPAIN	2,870,000.00	2,915,498.11
	GOV OF SPAIN	2,280,000.00	2,075,985.60

	GOV OF SPAIN	2,640,000.00	2,469,583.77
	GOV OF SPAIN	1,120,000.00	1,057,882.56
	GOV OF SPAIN	2,650,000.00	3,836,020.75
	GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,555,750.80
	GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,381,384.36
	GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,575,008.35
	GOV OF SPAIN	820,000.00	737,276.76
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,182,475.96
	GOV OF SPAIN	2,340,000.00	2,162,178.72
	GOV OF SPAIN	2,470,000.00	3,744,986.83
	GOV OF SPAIN	410,000.00	362,186.62
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,876,672.40
	GOV OF SPAIN	2,110,000.00	2,590,674.88
	GOV OF SPAIN	1,750,000.00	2,076,093.25
	GOV OF SPAIN	2,290,000.00	1,847,022.40
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,320,759.80
	GOV OF SPAIN	530,000.00	399,016.86
	ユーロ 小計	733,850,000.00	806,136,683.36 (105,249,205,379)
英ポンド	UK TREASURY	3,920,000.00	3,875,573.85
	UK TREASURY	2,250,000.00	2,230,503.07
	UK TREASURY	1,760,000.00	1,782,066.88
	UK TREASURY	3,730,000.00	3,632,629.09
	UK TREASURY	1,260,000.00	1,247,990.43
	UK TREASURY	1,330,000.00	1,372,206.75
	UK TREASURY	1,420,000.00	1,369,235.00
	UK TREASURY	1,040,000.00	1,149,307.74
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,266,265.00
	UK TREASURY	1,810,000.00	1,843,988.18
	UK TREASURY	1,560,000.00	1,482,680.16
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,475,356.68
	UK TREASURY	1,770,000.00	1,681,473.09
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,595,542.20
	UK TREASURY	1,480,000.00	1,710,504.08
	UK TREASURY	1,270,000.00	1,175,092.90
	UK TREASURY	1,360,000.00	1,376,360.80

	UK TREASURY	1,210,000.00	1,565,295.20
	UK TREASURY	1,080,000.00	1,008,355.17
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,521,884.40
	UK TREASURY	2,110,000.00	1,915,940.34
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,812,610.80
	UK TREASURY	2,780,000.00	2,459,327.00
	UK TREASURY	2,060,000.00	2,577,369.00
	UK TREASURY	1,010,000.00	931,386.85
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,782,472.50
	UK TREASURY	2,010,000.00	1,749,185.61
	UK TREASURY	1,900,000.00	2,512,035.60
	UK TREASURY	2,180,000.00	2,190,267.80
	UK TREASURY	1,710,000.00	2,479,500.00
	UK TREASURY	530,000.00	483,354.70
	UK TREASURY	1,680,000.00	2,333,501.18
	UK TREASURY	1,520,000.00	2,142,485.60
	UK TREASURY	2,440,000.00	2,246,142.00
	UK TREASURY	2,170,000.00	3,230,565.80
	UK TREASURY	2,180,000.00	2,791,880.65
	UK TREASURY	1,970,000.00	2,638,275.61
	UK TREASURY	1,020,000.00	852,899.52
	UK TREASURY	1,990,000.00	3,012,263.00
	UK TREASURY	2,110,000.00	2,030,368.60
	UK TREASURY	1,190,000.00	1,212,514.80
	UK TREASURY	1,410,000.00	2,219,763.00
	UK TREASURY	870,000.00	670,169.70
	UK TREASURY	1,040,000.00	940,368.00
	UK TREASURY	1,450,000.00	2,179,437.00
	UK TREASURY	570,000.00	554,895.00
	UK TREASURY	1,290,000.00	1,291,728.60
	UK TREASURY	1,860,000.00	3,135,402.00
	UK TREASURY	2,020,000.00	2,114,111.80
	UK TREASURY	1,410,000.00	2,406,554.72
	UK TREASURY	1,580,000.00	1,110,740.00
	UK TREASURY	1,620,000.00	2,146,014.00
	UK TREASURY	1,630,000.00	2,734,585.80

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

	GOV OF POLAND	1,980,000.00	1,828,907.38
	GOV OF POLAND	4,480,000.00	4,315,181.24
	GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,139,444.80
	GOV OF POLAND	4,450,000.00	4,358,366.48
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	5,485,195.18
	GOV OF POLAND	2,380,000.00	2,006,127.22
	GOV OF POLAND	3,590,000.00	3,320,453.82
	GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,113,473.00
	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,244,399.73
	GOV OF POLAND	4,550,000.00	4,165,980.00
	GOV OF POLAND	4,000,000.00	3,211,533.19
	ポーランドズロチ 小計	48,290,000.00	45,165,551.64 (1,296,273,914)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	2,500,000.00	2,640,564.50
	GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,665,926.57
	GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	2,661,310.29
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,175,766.85
	GOV OF AUSTRALIA	1,640,000.00	1,552,165.03
	GOV OF AUSTRALIA	2,200,000.00	2,419,170.16
	GOV OF AUSTRALIA	1,890,000.00	1,780,010.87
	GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,604,598.58
	GOV OF AUSTRALIA	1,870,000.00	1,954,581.97
	GOV OF AUSTRALIA	1,560,000.00	1,585,740.62
	GOV OF AUSTRALIA	1,460,000.00	1,529,405.62
	GOV OF AUSTRALIA	2,270,000.00	2,456,120.93
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	1,837,565.80
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,798,010.50
	GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,078,567.01
	GOV OF AUSTRALIA	2,860,000.00	2,713,554.84
	GOV OF AUSTRALIA	2,880,000.00	2,596,404.67
	GOV OF AUSTRALIA	2,670,000.00	2,453,200.53
	GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	1,893,758.04
	GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	2,428,639.64
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,052,414.10
	GOV OF AUSTRALIA	1,390,000.00	1,630,305.84
	GOV OF AUSTRALIA	1,230,000.00	1,355,262.95

	GOV OF AUSTRALIA	1,370,000.00	1,400,656.89
	GOV OF AUSTRALIA	1,610,000.00	1,699,587.64
	GOV OF AUSTRALIA	1,770,000.00	1,431,862.20
	オーストラリアドル 小計	51,560,000.00	52,395,152.64 (4,312,645,013)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,108,419.29
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	930,821.89
	GOV OF SINGAPORE	710,000.00	721,253.50
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	947,037.00
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	391,362.00
	GOV OF SINGAPORE	700,000.00	674,100.00
	GOV OF SINGAPORE	820,000.00	836,236.00
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	362,085.70
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	942,732.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	648,396.00
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	843,720.00
	GOV OF SINGAPORE	970,000.00	1,042,071.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	321,403.56
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	693,265.00
	GOV OF SINGAPORE	930,000.00	947,614.20
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	394,440.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	686,398.90
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	876,900.00
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	712,880.00
	GOV OF SINGAPORE	280,000.00	265,858.60
	シンガポールドル 小計	13,850,000.00	14,346,994.64 (1,229,393,970)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,640,400.88
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	835,932.76
	GOV OF MALAYSIA	1,530,000.00	1,563,023.21
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,582,924.98
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,513,870.53
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,295,829.86
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	748,963.28
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,119,034.73
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,578,920.77

	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,219,846.15
	GOV OF MALAYSIA	2,960,000.00	3,034,667.48
	GOV OF MALAYSIA	700,000.00	715,706.88
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,791,820.07
	GOV OF MALAYSIA	1,890,000.00	1,926,548.63
	GOV OF MALAYSIA	3,130,000.00	3,153,267.16
	GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,491,567.21
	GOV OF MALAYSIA	1,690,000.00	1,778,076.53
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,690,862.81
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,791,153.77
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,395,303.99
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,168,681.69
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,052,875.37
	GOV OF MALAYSIA	2,360,000.00	2,401,673.34
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,733,123.14
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	961,142.59
	GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,555,136.40
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	921,615.47
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,220,646.51
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,356,791.04
	GOV OF MALAYSIA	2,270,000.00	2,123,001.61
	マレーシアリングット 小計	51,690,000.00	52,362,408.84 (1,443,160,350)
中国元	GOV OF CHINA	7,000,000.00	7,036,781.50
	GOV OF CHINA	3,820,000.00	3,830,099.31
	GOV OF CHINA	8,080,000.00	8,125,935.60
	GOV OF CHINA	8,600,000.00	8,694,987.00
	GOV OF CHINA	10,250,000.00	10,371,513.75
	GOV OF CHINA	4,300,000.00	4,315,723.38
	GOV OF CHINA	7,800,000.00	7,697,937.00
	GOV OF CHINA	3,600,000.00	3,668,292.00
	GOV OF CHINA	11,540,000.00	11,767,857.30
	GOV OF CHINA	11,000,000.00	11,076,395.00
	GOV OF CHINA	8,200,000.00	8,305,012.48
	GOV OF CHINA	5,470,000.00	5,666,011.98
	GOV OF CHINA	4,000,000.00	4,064,752.00

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 254 銘柄	100.0%	48.0%
カナダドル	国債証券 37 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.7%

ユーロ	国債証券	346 銘柄	100.0%	38.4%
英ポンド	国債証券	54 銘柄	100.0%	5.7%
スウェーデンクローナ	国債証券	8 銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	9 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8 銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	13 銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	26 銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	20 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	30 銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	20 銘柄	100.0%	0.9%
イスラエルシェケル	国債証券	15 銘柄	100.0%	0.4%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	614,831,758
株式	66,768,676,480
未収配当金	96,280,092
前払金	14,895,000
差入委託証拠金	26,235,000
流動資産合計	67,520,918,330
資産合計	67,520,918,330
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,381,450
未払解約金	60,048,000
未払利息	1,667
流動負債合計	81,431,117
負債合計	81,431,117
純資産の部	
元本等	
元本	48,136,209,431
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	19,303,277,782
元本等合計	67,439,487,213
純資産合計	67,439,487,213
負債純資産合計	67,520,918,330

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	42,508,666,188円
期中追加設定元本額	18,848,508,702円
期中一部解約元本額	13,220,965,459円
期末元本額	48,136,209,431円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	4,265,982,166円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,957,298,501円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,506,204,074円
DCりそな グローバルバランス	77,325,043円
つみたてバランスファンド	4,260,942,297円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	407,560,356円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	243,611,838円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	162,000,937円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	57,148,801円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	35,839,672円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	19,061,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	33,584,286円
リスクコントロール・オープン	10,031,382円
FWりそな国内株式アクティブファンド	480,744,964円
FWりそな国内株式インデックスファンド	25,406,659,097円
S m a r t e r i T O P I Xインデックス	1,854,963,960円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定型	81,328,277円
S m a r t e r i 8資産バランス 安定成長型	218,162,822円
S m a r t e r i 8資産バランス 成長型	256,467,235円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	110,102,376円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	161,858,380円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	98,804,963円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	62,822,415円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	203,787,508円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,609,164円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,845,899円

TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	519,963,732円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	943,025,990円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	676,460,355円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	875,630,730円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定型）（適格機関投資家専用）	1,635,577円
りそなVIグローバル・バランスファンド（安定成長型）（適格機関投資家専用）	13,037,222円
りそなVIグローバル・バランスファンド（成長型）（適格機関投資家専用）	12,030,539円
りそなDAAマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	81,677,055円
2. 計算日における受益権の総数	48,136,209,431口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4010円
(10,000口当たり純資産額)	(14,010円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		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	767,256,450	—	745,875,000	△21,381,450
合計		767,256,450	—	745,875,000	△21,381,450

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,200	3,215.00	3,858,000	
日本水産	34,600	558.00	19,306,800	
マルハニチロ	5,400	2,630.00	14,202,000	
雪国まいたけ	2,500	1,236.00	3,090,000	
カネコ種苗	1,000	1,563.00	1,563,000	
サカタのタネ	4,100	3,450.00	14,145,000	
ホクト	2,900	1,968.00	5,707,200	
ホクリョウ	500	687.00	343,500	
住石ホールディングス	6,100	136.00	829,600	
日鉄鉱業	800	6,460.00	5,168,000	
三井松島ホールディングス	1,400	1,710.00	2,394,000	
I N P E X	139,000	1,178.00	163,742,000	
石油資源開発	4,100	2,833.00	11,615,300	
K&Oエナジーグループ	1,600	1,566.00	2,505,600	
ヒノキヤグループ	800	2,362.00	1,889,600	
ショーボンドホールディングス	4,900	5,140.00	25,186,000	
ミライト・ホールディングス	11,200	1,951.00	21,851,200	
タマホーム	2,100	2,397.00	5,033,700	
サンヨーホームズ	400	745.00	298,000	
日本アクア	1,400	580.00	812,000	
ファーストコーポレーション	800	705.00	564,000	
ベステラ	700	1,288.00	901,600	
R o b o t H o m e	5,700	218.00	1,242,600	
キャンディル	600	490.00	294,000	
スペースバリューホールディングス	800	1,145.00	916,000	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,105.00	773,500	
第一カッター興業	900	1,378.00	1,240,200	
安藤・間	17,200	910.00	15,652,000	
東急建設	10,100	711.00	7,181,100	

コムシスホールディングス	11,200	2,758.00	30,889,600
ビーアールホールディングス	4,700	346.00	1,626,200
高松コンストラクショングループ	2,200	2,002.00	4,404,400
東建コーポレーション	1,000	9,260.00	9,260,000
ソネック	400	1,015.00	406,000
ヤマウラ	1,700	999.00	1,698,300
オリエンタル白石	11,600	243.00	2,818,800
大成建設	23,100	3,795.00	87,664,500
大林組	80,000	975.00	78,000,000
清水建設	74,900	788.00	59,021,200
飛島建設	2,100	1,091.00	2,291,100
長谷工コーポレーション	23,800	1,513.00	36,009,400
松井建設	3,100	751.00	2,328,100
銭高組	300	4,040.00	1,212,000
鹿島建設	58,600	1,534.00	89,892,400
不動テトラ	1,700	1,540.00	2,618,000
大末建設	800	1,333.00	1,066,400
鉄建建設	1,700	1,883.00	3,201,100
西松建設	4,800	3,790.00	18,192,000
三井住友建設	18,000	438.00	7,884,000
大豊建設	1,200	3,640.00	4,368,000
佐田建設	1,700	469.00	797,300
ナカノフドー建設	1,900	346.00	657,400
奥村組	4,700	3,255.00	15,298,500
東鉄工業	3,700	2,466.00	9,124,200
イチケン	600	1,927.00	1,156,200
富士ピー・エス	1,000	496.00	496,000
浅沼組	900	5,330.00	4,797,000
戸田建設	33,200	770.00	25,564,000
熊谷組	4,100	2,967.00	12,164,700
北野建設	500	2,173.00	1,086,500
植木組	700	1,528.00	1,069,600
矢作建設工業	3,500	787.00	2,754,500
ピーエス三菱	2,600	606.00	1,575,600
日本ハウスホールディングス	5,500	461.00	2,535,500
大東建託	8,200	12,910.00	105,862,000

新日本建設	3,400	755.00	2,567,000
N I P P O	1,900	3,990.00	7,581,000
東亜道路工業	400	4,975.00	1,990,000
日本道路	800	9,800.00	7,840,000
東亜建設工業	2,000	2,667.00	5,334,000
日本国土開発	7,800	531.00	4,141,800
若築建設	1,300	1,901.00	2,471,300
東洋建設	9,000	578.00	5,202,000
五洋建設	31,700	636.00	20,161,200
世紀東急工業	3,800	804.00	3,055,200
福田組	900	4,515.00	4,063,500
住友林業	20,500	2,281.00	46,760,500
日本基礎技術	2,200	674.00	1,482,800
巴コーポレーション	3,600	515.00	1,854,000
大和ハウス工業	73,900	3,391.00	250,594,900
ライト工業	5,000	1,908.00	9,540,000
積水ハウス	86,800	2,393.50	207,755,800
日特建設	1,700	724.00	1,230,800
北陸電気工事	1,700	792.00	1,346,400
ユアテック	4,600	711.00	3,270,600
日本リーテック	1,700	1,497.00	2,544,900
四電工	900	1,590.00	1,431,000
中電工	3,700	2,173.00	8,040,100
関電工	13,000	871.00	11,323,000
きんでん	17,900	1,650.00	29,535,000
東京エネシス	2,700	964.00	2,602,800
トーエネック	800	3,255.00	2,604,000
住友電設	2,000	2,205.00	4,410,000
日本電設工業	4,400	1,550.00	6,820,000
エクシオグループ	12,000	2,409.00	28,908,000
新日本空調	2,100	2,040.00	4,284,000
九電工	6,200	3,145.00	19,499,000
三機工業	5,200	1,462.00	7,602,400
日揮ホールディングス	24,600	1,123.00	27,625,800
中外炉工業	800	1,560.00	1,248,000
ヤマト	2,300	710.00	1,633,000

太平電業	1,800	2,721.00	4,897,800
高砂熱学工業	7,200	1,979.00	14,248,800
三晃金属工業	300	2,490.00	747,000
朝日工業社	500	3,070.00	1,535,000
明星工業	5,200	725.00	3,770,000
大氣社	3,900	3,035.00	11,836,500
ダイダン	1,800	2,312.00	4,161,600
日比谷総合設備	2,600	1,902.00	4,945,200
フィル・カンパニー	500	1,119.00	559,500
テスホールディングス	1,700	1,284.00	2,182,800
インフロニア・ホールディングス	34,100	1,057.00	36,043,700
東洋エンジニアリング	3,400	602.00	2,046,800
レイズネクスト	3,900	1,138.00	4,438,200
ニッポン	7,500	1,706.00	12,795,000
日清製粉グループ本社	28,900	1,702.00	49,187,800
日東富士製粉	400	4,220.00	1,688,000
昭和産業	2,400	2,729.00	6,549,600
鳥越製粉	2,300	664.00	1,527,200
中部飼料	2,900	1,068.00	3,097,200
フィード・ワン	3,400	692.00	2,352,800
東洋精糖	400	1,107.00	442,800
日本甜菜製糖	1,300	1,716.00	2,230,800
DM三井製糖ホールディングス	2,300	2,003.00	4,606,900
塩水港精糖	3,000	215.00	645,000
日新製糖	1,200	1,762.00	2,114,400
森永製菓	6,000	3,700.00	22,200,000
中村屋	600	3,385.00	2,031,000
江崎グリコ	7,000	3,910.00	27,370,000
名糖産業	1,100	1,675.00	1,842,500
井村屋グループ	1,500	2,333.00	3,499,500
不二家	1,400	2,428.00	3,399,200
山崎製パン	19,200	1,684.00	32,332,800
第一屋製パン	500	561.00	280,500
モロゾフ	800	2,682.00	2,145,600
亀田製菓	1,500	4,155.00	6,232,500
寿スピリッツ	2,500	6,020.00	15,050,000

カルビー	11,700	2,555.00	29,893,500
森永乳業	4,700	5,700.00	26,790,000
六甲バター	1,900	1,579.00	3,000,100
ヤクルト本社	19,000	6,170.00	117,230,000
明治ホールディングス	16,900	6,860.00	115,934,000
雪印メグミルク	6,200	2,038.00	12,635,600
プリマハム	3,200	2,405.00	7,696,000
日本ハム	9,800	4,375.00	42,875,000
林兼産業	800	514.00	411,200
丸大食品	2,500	1,568.00	3,920,000
S Foods	2,300	3,270.00	7,521,000
柿安本店	900	2,572.00	2,314,800
伊藤ハム米久ホールディングス	16,500	683.00	11,269,500
サッポロホールディングス	8,700	2,337.00	20,331,900
アサヒグループホールディングス	60,200	4,873.00	293,354,600
キリンホールディングス	94,100	1,978.00	186,129,800
宝ホールディングス	17,400	1,155.00	20,097,000
オエノンホールディングス	7,300	339.00	2,474,700
養命酒製造	800	1,762.00	1,409,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	18,000	1,505.00	27,090,000
サントリー食品インターナショナル	17,100	4,440.00	75,924,000
ダイドーグループホールディングス	1,300	5,030.00	6,539,000
伊藤園	7,800	6,710.00	52,338,000
キーコーヒー	2,500	2,072.00	5,180,000
ユニカフェ	800	983.00	786,400
ジャパンフーズ	400	1,227.00	490,800
日清オイリオグループ	3,200	2,995.00	9,584,000
不二製油グループ本社	5,500	2,265.00	12,457,500
かどや製油	300	3,790.00	1,137,000
J-オイルミルズ	2,400	1,701.00	4,082,400
キッコーマン	18,400	8,800.00	161,920,000
味の素	56,500	3,263.00	184,359,500
ブルドックソース	1,100	1,992.00	2,191,200
キューピー	13,400	2,473.00	33,138,200
ハウス食品グループ本社	9,600	3,030.00	29,088,000

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

トーア紡コーポレーション	900	425.00	382,500	
ダイドーリミテッド	3,200	147.00	470,400	
帝国繊維	2,800	1,995.00	5,586,000	
帝人	23,500	1,410.00	33,135,000	
東レ	180,900	673.80	121,890,420	
住江織物	500	1,920.00	960,000	
日本フェルト	1,400	448.00	627,200	
イチカワ	300	1,393.00	417,900	
日東製網	300	1,465.00	439,500	
アツギ	1,900	596.00	1,132,400	
ダイニック	900	738.00	664,200	
セーレン	5,100	2,164.00	11,036,400	
ソトー	900	853.00	767,700	
東海染工	300	1,157.00	347,100	
小松マテーレ	4,100	1,257.00	5,153,700	
ワコールホールディングス	6,200	2,064.00	12,796,800	
ホギメディカル	3,400	3,255.00	11,067,000	
クラウディアホールディングス	600	234.00	140,400	
T S I ホールディングス	8,300	327.00	2,714,100	
マツオカコーポレーション	800	1,171.00	936,800	
ワールド	3,300	1,246.00	4,111,800	
三陽商会	1,200	887.00	1,064,400	
ナイガイ	800	282.00	225,600	
オンワードホールディングス	15,000	297.00	4,455,000	
ルックホールディングス	800	1,532.00	1,225,600	
キムラタン	14,000	18.00	252,000	
ゴールドウイン	4,500	6,350.00	28,575,000	
デサント	4,900	3,295.00	16,145,500	
キング	1,200	533.00	639,600	
ヤマトインターナショナル	2,200	289.00	635,800	
特種東海製紙	1,500	4,220.00	6,330,000	
王子ホールディングス	104,400	612.00	63,892,800	
日本製紙	12,000	1,167.00	14,004,000	
三菱製紙	3,500	320.00	1,120,000	
北越コーポレーション	16,400	724.00	11,873,600	
中越パルプ工業	1,000	994.00	994,000	

巴川製紙所	700	862.00	603,400
大王製紙	12,000	1,834.00	22,008,000
阿波製紙	600	333.00	199,800
レンゴー	23,600	872.00	20,579,200
トーモク	1,500	1,757.00	2,635,500
ザ・パック	1,900	2,744.00	5,213,600
北の達人コーポレーション	8,900	229.00	2,038,100
クラレ	36,500	1,100.00	40,150,000
旭化成	165,600	1,122.00	185,803,200
共和レザー	1,600	661.00	1,057,600
昭和電工	21,700	2,270.00	49,259,000
住友化学	183,600	562.00	103,183,200
住友精化	1,100	3,300.00	3,630,000
日産化学	13,600	6,470.00	87,992,000
ラサ工業	900	1,631.00	1,467,900
クレハ	2,000	9,180.00	18,360,000
多木化学	1,000	4,755.00	4,755,000
テイカ	1,800	1,347.00	2,424,600
石原産業	4,200	1,085.00	4,557,000
片倉コープアグリ	600	1,166.00	699,600
日本曹達	3,200	3,465.00	11,088,000
東ソー	36,000	1,845.00	66,420,000
トクヤマ	8,000	1,914.00	15,312,000
セントラル硝子	4,100	2,111.00	8,655,100
東亜合成	13,900	1,098.00	15,262,200
大阪ソーダ	2,300	3,155.00	7,256,500
関東電化工業	5,500	1,129.00	6,209,500
デンカ	9,100	3,685.00	33,533,500
信越化学工業	42,900	18,000.00	772,200,000
日本カーバイド工業	900	1,395.00	1,255,500
堺化学工業	1,800	2,021.00	3,637,800
第一稀元素化学工業	2,300	1,008.00	2,318,400
エア・ウォーター	23,700	1,701.00	40,313,700
日本酸素ホールディングス	24,000	2,249.00	53,976,000
日本化学工業	800	2,512.00	2,009,600
東邦アセチレン	400	1,209.00	483,600

日本パーカライジング	12,600	992.00	12,499,200
高圧ガス工業	4,000	738.00	2,952,000
チタン工業	300	1,633.00	489,900
四国化成工業	3,300	1,432.00	4,725,600
戸田工業	500	2,780.00	1,390,000
ステラ ケミファ	1,300	2,410.00	3,133,000
保土谷化学工業	800	4,455.00	3,564,000
日本触媒	4,200	5,750.00	24,150,000
大日精化工業	2,100	2,218.00	4,657,800
カネカ	6,500	3,825.00	24,862,500
三菱瓦斯化学	23,200	2,074.00	48,116,800
三井化学	22,700	2,952.00	67,010,400
J S R	23,300	3,585.00	83,530,500
東京応化工業	4,000	6,740.00	26,960,000
大阪有機化学工業	2,100	3,135.00	6,583,500
三菱ケミカルホールディングス	167,000	815.30	136,155,100
KHネオケム	4,100	2,884.00	11,824,400
ダイセル	36,000	884.00	31,824,000
住友ベークライト	3,900	5,050.00	19,695,000
積水化学工業	52,300	1,999.00	104,547,700
日本ゼオン	22,500	1,371.00	30,847,500
アイカ工業	7,000	3,245.00	22,715,000
宇部興産	11,800	2,155.00	25,429,000
積水樹脂	3,800	1,976.00	7,508,800
タキロンシーアイ	5,400	562.00	3,034,800
旭有機材	1,400	2,098.00	2,937,200
ニチバン	1,500	1,753.00	2,629,500
リケンテクノス	6,100	465.00	2,836,500
大倉工業	1,300	1,923.00	2,499,900
積水化成品工業	3,300	460.00	1,518,000
群栄化学工業	600	3,415.00	2,049,000
タイガースポリマー	1,300	448.00	582,400
ミライアル	800	1,518.00	1,214,400
ダイキアクシス	1,000	722.00	722,000
ダイキョーニシカワ	5,300	584.00	3,095,200
竹本容器	900	785.00	706,500

森六ホールディングス	1,300	1,967.00	2,557,100
恵和	700	4,510.00	3,157,000
日本化薬	19,700	1,163.00	22,911,100
カーリットホールディングス	2,500	712.00	1,780,000
日本精化	2,000	1,979.00	3,958,000
扶桑化学工業	2,200	4,645.00	10,219,000
トリケミカル研究所	2,600	2,893.00	7,521,800
ADEKA	11,500	2,640.00	30,360,000
日油	8,500	5,170.00	43,945,000
新日本理化	4,100	243.00	996,300
ハリマ化成グループ	1,900	817.00	1,552,300
花王	56,400	5,157.00	290,854,800
第一工業製薬	900	2,750.00	2,475,000
石原ケミカル	1,300	1,334.00	1,734,200
日華化学	800	776.00	620,800
ニイタカ	500	2,283.00	1,141,500
三洋化成工業	1,500	5,110.00	7,665,000
有機合成薬品工業	1,700	269.00	457,300
大日本塗料	3,100	813.00	2,520,300
日本ペイントホールディングス	93,900	961.00	90,237,900
関西ペイント	25,900	2,352.00	60,916,800
神東塗料	1,900	153.00	290,700
中国塗料	5,900	899.00	5,304,100
日本特殊塗料	1,900	868.00	1,649,200
藤倉化成	3,100	455.00	1,410,500
太陽ホールディングス	3,700	3,215.00	11,895,500
D I C	10,600	2,719.00	28,821,400
サカタインクス	5,000	972.00	4,860,000
東洋インキS Cホールディングス	5,300	1,915.00	10,149,500
T&K TOKA	2,000	887.00	1,774,000
富士フイルムホールディングス	44,800	7,542.00	337,881,600
資生堂	47,500	6,431.00	305,472,500
ライオン	30,800	1,498.00	46,138,400
高砂香料工業	1,800	2,750.00	4,950,000
マンダム	5,400	1,334.00	7,203,600
ミルボン	3,100	5,780.00	17,918,000

ファンケル	10,300	3,185.00	32,805,500
コーセー	4,800	12,560.00	60,288,000
コタ	1,600	1,550.00	2,480,000
シーボン	300	1,814.00	544,200
ポーラ・オルビスホールディングス	10,900	1,748.00	19,053,200
ノエビアホールディングス	2,200	5,210.00	11,462,000
アジュバンホールディングス	600	1,147.00	688,200
新日本製薬	700	1,365.00	955,500
エステー	1,600	1,561.00	2,497,600
アグロ カネショウ	800	1,248.00	998,400
コニシ	4,200	1,628.00	6,837,600
長谷川香料	4,400	2,376.00	10,454,400
星光PMC	1,400	610.00	854,000
小林製薬	7,100	9,620.00	68,302,000
荒川化学工業	2,100	1,123.00	2,358,300
メック	1,900	2,897.00	5,504,300
日本高純度化学	700	2,517.00	1,761,900
タカラバイオ	6,700	2,326.00	15,584,200
JCU	2,900	4,550.00	13,195,000
新田ゼラチン	1,600	664.00	1,062,400
OATアグリオ	500	1,848.00	924,000
デクセリアルズ	6,600	3,080.00	20,328,000
アース製薬	2,100	5,660.00	11,886,000
北興化学工業	2,400	836.00	2,006,400
大成ラミック	800	2,763.00	2,210,400
クミアイ化学工業	9,500	805.00	7,647,500
日本農薬	4,500	536.00	2,412,000
アキレス	1,600	1,275.00	2,040,000
有沢製作所	3,700	1,006.00	3,722,200
日東電工	15,400	8,520.00	131,208,000
レック	3,300	960.00	3,168,000
三光合成	2,900	361.00	1,046,900
きもと	3,900	207.00	807,300
藤森工業	2,300	4,100.00	9,430,000
前澤化成工業	1,600	1,272.00	2,035,200
未来工業	900	1,510.00	1,359,000

ウェーブロックホールディングス	1,000	711.00	711,000	
J S P	1,500	1,593.00	2,389,500	
エフピコ	4,700	3,365.00	15,815,500	
天馬	2,000	2,550.00	5,100,000	
信越ポリマー	4,600	1,082.00	4,977,200	
東リ	6,300	228.00	1,436,400	
ニフコ	8,500	3,525.00	29,962,500	
バルカー	2,100	2,500.00	5,250,000	
ユニ・チャーム	49,200	4,281.00	210,625,200	
ショーエイコーポレーション	700	634.00	443,800	
協和キリン	29,900	2,937.00	87,816,300	
武田薬品工業	200,500	3,485.00	698,742,500	
アステラス製薬	221,200	1,971.50	436,095,800	
大日本住友製薬	15,800	1,244.00	19,655,200	
塩野義製薬	32,100	7,603.00	244,056,300	
わかもと製薬	3,000	298.00	894,000	
日本新薬	6,700	7,770.00	52,059,000	
中外製薬	79,800	3,961.00	316,087,800	
科研製薬	4,000	4,240.00	16,960,000	
エーザイ	30,500	5,855.00	178,577,500	
ロート製薬	13,100	3,555.00	46,570,500	
小野薬品工業	58,600	2,860.00	167,596,000	
久光製薬	6,700	3,755.00	25,158,500	
持田製薬	3,200	3,835.00	12,272,000	
参天製薬	47,600	1,304.00	62,070,400	
扶桑薬品工業	900	2,264.00	2,037,600	
日本ケミファ	300	2,203.00	660,900	
ツムラ	7,900	3,270.00	25,833,000	
日医工	7,900	811.00	6,406,900	
キッセイ薬品工業	4,500	2,419.00	10,885,500	
生化学工業	4,500	902.00	4,059,000	
栄研化学	4,500	1,756.00	7,902,000	
日水製薬	900	985.00	886,500	
鳥居薬品	1,400	2,857.00	3,999,800	
J C R ファーマ	7,200	2,109.00	15,184,800	
東和薬品	3,700	3,060.00	11,322,000	

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

日本電気硝子	10,200	2,865.00	29,223,000
オハラ	1,000	1,103.00	1,103,000
住友大阪セメント	4,700	3,540.00	16,638,000
太平洋セメント	14,500	2,333.00	33,828,500
日本ヒューム	2,600	697.00	1,812,200
日本コンクリート工業	5,000	294.00	1,470,000
三谷セキサン	1,200	6,620.00	7,944,000
アジアパイルホールディングス	3,900	445.00	1,735,500
東海カーボン	21,400	1,176.00	25,166,400
日本カーボン	1,300	4,145.00	5,388,500
東洋炭素	1,700	3,030.00	5,151,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	4,495.00	6,293,000
TOTO	18,200	4,950.00	90,090,000
日本碍子	27,600	1,847.00	50,977,200
日本特殊陶業	19,400	2,144.00	41,593,600
ダントーホールディングス	1,700	370.00	629,000
MARUWA	900	14,030.00	12,627,000
品川リフラクトリーズ	600	3,825.00	2,295,000
黒崎播磨	400	4,335.00	1,734,000
ヨータイ	1,600	1,248.00	1,996,800
イソライト工業	1,000	1,194.00	1,194,000
東京窯業	3,200	303.00	969,600
ニッカトー	1,200	583.00	699,600
フジミインコーポレーテッド	2,000	6,410.00	12,820,000
クニミネ工業	800	991.00	792,800
エーアンドエーマテリアル	400	911.00	364,400
ニチアス	5,900	2,624.00	15,481,600
ニチハ	3,500	2,622.00	9,177,000
日本製鉄	112,900	1,981.00	223,654,900
神戸製鋼所	47,100	593.00	27,930,300
中山製鋼所	4,000	459.00	1,836,000
合同製鐵	1,400	1,331.00	1,863,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	68,100	1,652.00	112,501,200
東京製鐵	8,600	1,096.00	9,425,600
共英製鋼	2,800	1,658.00	4,642,400
大和工業	4,800	3,700.00	17,760,000

東京鐵鋼	1,100	1,357.00	1,492,700	
大阪製鐵	1,300	1,206.00	1,567,800	
淀川製鋼所	3,300	2,731.00	9,012,300	
丸一鋼管	8,900	2,896.00	25,774,400	
モリ工業	700	2,503.00	1,752,100	
大同特殊鋼	4,100	4,260.00	17,466,000	
日本高周波鋼業	900	350.00	315,000	
日本冶金工業	1,800	2,801.00	5,041,800	
山陽特殊製鋼	2,600	2,113.00	5,493,800	
愛知製鋼	1,400	2,564.00	3,589,600	
日立金属	26,600	2,083.00	55,407,800	
日本金属	600	1,088.00	652,800	
大平洋金属	1,600	3,160.00	5,056,000	
新日本電工	16,300	355.00	5,786,500	
栗本鐵工所	1,100	1,575.00	1,732,500	
虹技	300	956.00	286,800	
日本鑄鉄管	300	1,002.00	300,600	
三菱製鋼	1,600	1,165.00	1,864,000	
日亜鋼業	3,300	280.00	924,000	
日本精線	400	4,415.00	1,766,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	1,311.00	1,048,800	
シンニッタン	3,000	229.00	687,000	
新家工業	600	1,697.00	1,018,200	
大紀アルミニウム工業所	3,800	1,624.00	6,171,200	
日本軽金属ホールディングス	6,400	1,816.00	11,622,400	
三井金属鉱業	6,800	3,330.00	22,644,000	
東邦亜鉛	1,400	2,645.00	3,703,000	
三菱マテリアル	16,700	2,089.00	34,886,300	
住友金属鉱山	32,200	5,569.00	179,321,800	
DOWAホールディングス	6,900	4,870.00	33,603,000	
古河機械金属	4,200	1,299.00	5,455,800	
エス・サイエンス	12,200	24.00	292,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	849.00	2,462,100	
東邦チタニウム	4,500	897.00	4,036,500	
UACJ	3,800	2,289.00	8,698,200	
CKサンエツ	500	3,995.00	1,997,500	

古河電気工業	7,800	2,330.00	18,174,000
住友電気工業	94,300	1,580.00	148,994,000
フジクラ	28,100	650.00	18,265,000
昭和電線ホールディングス	2,200	1,857.00	4,085,400
東京特殊電線	400	2,827.00	1,130,800
タツタ電線	4,400	460.00	2,024,000
カナレ電気	400	1,510.00	604,000
平河ヒューテック	1,400	1,183.00	1,656,200
リョービ	3,100	1,112.00	3,447,200
アーレスティ	2,700	379.00	1,023,300
アサヒホールディングス	10,100	2,223.00	22,452,300
稲葉製作所	1,400	1,312.00	1,836,800
宮地エンジニアリンググループ	800	3,575.00	2,860,000
トーカロ	6,500	1,302.00	8,463,000
アルファC o	1,000	1,090.00	1,090,000
SUMCO	38,800	2,085.00	80,898,000
川田テクノロジーズ	500	3,925.00	1,962,500
RS Technologies	800	5,430.00	4,344,000
ジェイテックコーポレーション	300	1,537.00	461,100
信和	1,600	824.00	1,318,400
東洋製罐グループホールディングス	16,100	1,590.00	25,599,000
ホッカンホールディングス	1,400	1,403.00	1,964,200
コロナ	1,400	892.00	1,248,800
横河ブリッジホールディングス	4,300	2,129.00	9,154,700
駒井ハルテック	500	2,177.00	1,088,500
高田機工	200	2,862.00	572,400
三和ホールディングス	23,800	1,257.00	29,916,600
文化シャッター	8,000	1,060.00	8,480,000
三協立山	3,200	614.00	1,964,800
アルインコ	1,800	909.00	1,636,200
東洋シャッター	600	544.00	326,400
LIXIL	39,700	2,518.00	99,964,600
日本ファイルコン	1,800	526.00	946,800
ノーリツ	4,800	1,613.00	7,742,400
長府製作所	2,600	1,959.00	5,093,400
リンナイ	4,800	9,990.00	47,952,000

ダイニチ工業	1,200	704.00	844,800	
日東精工	3,200	516.00	1,651,200	
三洋工業	300	1,845.00	553,500	
岡部	4,800	746.00	3,580,800	
ジーテクト	3,100	1,435.00	4,448,500	
東プレ	4,700	1,218.00	5,724,600	
高周波熱錬	4,500	598.00	2,691,000	
東京製綱	1,500	851.00	1,276,500	
サンコール	2,200	500.00	1,100,000	
モリテック スチール	2,000	318.00	636,000	
パイオラックス	3,600	1,721.00	6,195,600	
エイチワン	2,500	664.00	1,660,000	
日本発條	23,200	882.00	20,462,400	
中央発條	1,200	786.00	943,200	
アドバネクス	300	1,529.00	458,700	
立川ブラインド工業	1,100	1,075.00	1,182,500	
三益半導体工業	2,000	2,374.00	4,748,000	
日本ドライケミカル	600	1,777.00	1,066,200	
日本製鋼所	7,700	3,490.00	26,873,000	
三浦工業	10,900	3,390.00	36,951,000	
タクマ	8,500	1,460.00	12,410,000	
ツガミ	5,500	1,301.00	7,155,500	
オークマ	2,900	4,765.00	13,818,500	
芝浦機械	2,800	2,979.00	8,341,200	
アマダ	39,800	1,037.00	41,272,600	
アイダエンジニアリング	6,600	979.00	6,461,400	
滝澤鉄工所	700	1,207.00	844,900	
F U J I	11,600	2,456.00	28,489,600	
牧野フライス製作所	2,800	3,650.00	10,220,000	
オーエスジー	11,700	1,939.00	22,686,300	
ダイジェット工業	300	1,016.00	304,800	
旭ダイヤモンド工業	6,600	582.00	3,841,200	
DMG 森精機	15,000	1,730.00	25,950,000	
ソディック	5,500	775.00	4,262,500	
ディスコ	3,700	32,850.00	121,545,000	
日東工器	1,400	1,621.00	2,269,400	

日進工具	2,000	1,389.00	2,778,000
パンチ工業	2,100	492.00	1,033,200
富士ダイス	1,300	617.00	802,100
豊和工業	1,300	855.00	1,111,500
OKK	900	734.00	660,600
石川製作所	700	1,529.00	1,070,300
東洋機械金属	1,600	563.00	900,800
津田駒工業	500	613.00	306,500
エンシュウ	600	659.00	395,400
島精機製作所	3,700	1,847.00	6,833,900
オプトラン	3,200	1,882.00	6,022,400
NCホールディングス	700	1,682.00	1,177,400
イワキポンプ	1,600	1,024.00	1,638,400
フリー	2,200	1,059.00	2,329,800
ヤマシンフィルタ	5,100	377.00	1,922,700
日阪製作所	3,100	826.00	2,560,600
やまびこ	4,900	1,280.00	6,272,000
野村マイクロ・サイエンス	700	3,720.00	2,604,000
平田機工	1,200	5,460.00	6,552,000
ペガサスミシン製造	2,600	520.00	1,352,000
マルマエ	1,000	2,361.00	2,361,000
タツモ	1,200	1,463.00	1,755,600
ナブテスコ	14,400	3,295.00	47,448,000
三井海洋開発	2,700	1,173.00	3,167,100
レオン自動機	2,700	1,035.00	2,794,500
SMC	7,500	65,420.00	490,650,000
ホソカワミクロン	1,800	2,734.00	4,921,200
ユニオンツール	900	3,595.00	3,235,500
オイレス工業	3,500	1,591.00	5,568,500
日精エー・エス・ビー機械	900	2,987.00	2,688,300
サトーホールディングス	3,300	2,084.00	6,877,200
技研製作所	2,200	3,720.00	8,184,000
日本エアーテック	1,200	1,016.00	1,219,200
カワタ	800	1,021.00	816,800
日精樹脂工業	1,800	1,015.00	1,827,000
オカダアイヨン	800	1,434.00	1,147,200

ワイエイシイホールディングス	1,000	1,054.00	1,054,000
小松製作所	115,600	2,717.00	314,085,200
住友重機械工業	14,600	2,896.00	42,281,600
日立建機	10,200	2,919.00	29,773,800
日工	3,500	618.00	2,163,000
巴工業	1,000	2,273.00	2,273,000
井関農機	2,400	1,330.00	3,192,000
TOWA	2,200	2,243.00	4,934,600
丸山製作所	500	1,540.00	770,000
北川鉄工所	1,100	1,363.00	1,499,300
ローツェ	1,300	10,310.00	13,403,000
タカキタ	900	612.00	550,800
クボタ	123,600	2,060.50	254,677,800
荏原実業	1,200	2,155.00	2,586,000
三菱化工機	800	1,992.00	1,593,600
月島機械	4,700	1,045.00	4,911,500
帝国電機製作所	1,800	1,379.00	2,482,200
東京機械製作所	1,000	779.00	779,000
新東工業	5,600	701.00	3,925,600
澁谷工業	2,200	2,545.00	5,599,000
アイチ コーポレーション	3,600	840.00	3,024,000
小森コーポレーション	6,500	703.00	4,569,500
鶴見製作所	2,000	1,821.00	3,642,000
住友精密工業	400	1,922.00	768,800
日本ギア工業	900	278.00	250,200
酒井重工業	400	2,901.00	1,160,400
荏原製作所	10,600	5,650.00	59,890,000
石井鐵工所	400	3,000.00	1,200,000
西島製作所	2,300	940.00	2,162,000
北越工業	2,400	885.00	2,124,000
ダイキン工業	32,500	21,505.00	698,912,500
オルガノ	700	7,700.00	5,390,000
トーヨーカネツ	1,000	2,366.00	2,366,000
栗田工業	13,800	4,820.00	66,516,000
椿本チエイン	3,300	3,370.00	11,121,000
大同工業	1,100	920.00	1,012,000

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

ジェイテクト	24,500	1,047.00	25,651,500
不二越	2,200	4,225.00	9,295,000
日本トムソン	7,000	565.00	3,955,000
THK	14,400	2,755.00	39,672,000
ユーシン精機	2,000	689.00	1,378,000
前澤給装工業	1,900	975.00	1,852,500
イーグル工業	3,200	1,050.00	3,360,000
前澤工業	1,700	647.00	1,099,900
日本ピラー工業	2,600	2,855.00	7,423,000
キッツ	8,600	681.00	5,856,600
マキタ	31,000	4,131.00	128,061,000
三井E&Sホールディングス	9,200	359.00	3,302,800
日立造船	21,600	774.00	16,718,400
三菱重工業	40,100	3,271.00	131,167,100
I H I	15,900	2,650.00	42,135,000
サノヤスホールディングス	3,100	128.00	396,800
スター精密	3,800	1,459.00	5,544,200
日清紡ホールディングス	15,600	1,023.00	15,958,800
イビデン	13,400	5,650.00	75,710,000
コニカミノルタ	55,700	500.00	27,850,000
ブラザー工業	31,200	2,148.00	67,017,600
ミネベアミツミ	44,000	2,559.00	112,596,000
日立製作所	122,700	5,751.00	705,647,700
東芝	44,600	4,392.00	195,883,200
三菱電機	255,100	1,435.00	366,068,500
富士電機	15,400	6,010.00	92,554,000
東洋電機製造	900	964.00	867,600
安川電機	27,500	4,760.00	130,900,000
シンフォニアテクノロジー	3,100	1,300.00	4,030,000
明電舎	4,300	2,472.00	10,629,600
オリジン	600	1,231.00	738,600
山洋電気	1,100	4,840.00	5,324,000
デンヨー	2,200	1,700.00	3,740,000
PHCホールディングス	2,900	1,592.00	4,616,800
東芝テック	2,700	5,050.00	13,635,000
芝浦メカトロニクス	500	7,910.00	3,955,000

マブチモーター	5,900	3,840.00	22,656,000
日本電産	66,100	10,115.00	668,601,500
ユニー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	394.00	433,400
トレックス・セミコンダクター	1,300	2,432.00	3,161,600
東光高岳	1,400	1,441.00	2,017,400
ダブル・スコープ	7,300	939.00	6,854,700
ダイヘン	2,800	4,065.00	11,382,000
ヤーマン	4,200	928.00	3,897,600
JVCケンウッド	20,700	191.00	3,953,700
ミマキエンジニアリング	2,300	731.00	1,681,300
I-PEX	1,200	1,561.00	1,873,200
日新電機	6,000	1,466.00	8,796,000
大崎電気工業	4,700	488.00	2,293,600
オムロン	21,200	8,010.00	169,812,000
日東工業	3,400	1,608.00	5,467,200
IDEC	3,200	2,256.00	7,219,200
正興電機製作所	800	1,070.00	856,000
不二電機工業	500	1,076.00	538,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	8,300	2,363.00	19,612,900
サクサホールディングス	600	1,377.00	826,200
メルコホールディングス	600	3,810.00	2,286,000
テクノメディカ	600	1,524.00	914,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	700	979.00	685,300
日本電気	32,400	5,260.00	170,424,000
富士通	23,000	16,035.00	368,805,000
沖電気工業	10,400	898.00	9,339,200
岩崎通信機	1,000	823.00	823,000
電気興業	1,300	2,350.00	3,055,000
サンケン電気	2,400	4,885.00	11,724,000
ナカヨ	500	1,123.00	561,500
アイホン	1,400	2,129.00	2,980,600
ルネサスエレクトロニクス	138,400	1,391.00	192,514,400
セイコーエプソン	31,700	1,817.00	57,598,900
ワコム	19,800	873.00	17,285,400
アルバック	5,100	5,930.00	30,243,000
アクセル	1,100	1,090.00	1,199,000

E I Z O	2,000	3,745.00	7,490,000
ジャパンディスプレイ	86,700	44.00	3,814,800
日本信号	6,500	885.00	5,752,500
京三製作所	5,500	426.00	2,343,000
能美防災	3,400	2,026.00	6,888,400
ホーチキ	1,800	1,218.00	2,192,400
星和電機	1,200	493.00	591,600
エレコム	5,800	1,553.00	9,007,400
パナソニック	272,100	1,211.50	329,649,150
シャープ	29,100	1,318.00	38,353,800
アンリツ	16,400	1,623.00	26,617,200
富士通ゼネラル	6,900	2,517.00	17,367,300
ソニーグループ	159,800	12,210.00	1,951,158,000
TDK	36,900	4,510.00	166,419,000
帝国通信工業	1,100	1,356.00	1,491,600
タムラ製作所	9,800	606.00	5,938,800
アルプスアルパイン	22,600	1,243.00	28,091,800
池上通信機	800	662.00	529,600
日本電波工業	2,300	1,184.00	2,723,200
鈴木	1,300	801.00	1,041,300
メイコー	2,100	3,925.00	8,242,500
日本トリム	500	2,748.00	1,374,000
ローランド ディー. ジー.	1,500	2,789.00	4,183,500
フォスター電機	2,600	812.00	2,111,200
SMK	600	2,138.00	1,282,800
ヨコオ	1,900	2,669.00	5,071,100
ティアック	4,000	124.00	496,000
ホシデン	6,100	1,199.00	7,313,900
ヒロセ電機	3,900	17,150.00	66,885,000
日本航空電子工業	5,800	1,827.00	10,596,600
TOA	2,700	777.00	2,097,900
マクセル	5,100	1,231.00	6,278,100
古野電気	3,000	1,057.00	3,171,000
ユニデンホールディングス	600	3,420.00	2,052,000
スミダコーポレーション	2,400	864.00	2,073,600
アイコム	900	2,371.00	2,133,900

リオン	1,000	2,109.00	2,109,000
本多通信工業	2,000	480.00	960,000
横河電機	25,500	1,877.00	47,863,500
新電元工業	1,000	3,005.00	3,005,000
アズビル	14,900	4,225.00	62,952,500
東亜ディーケーケー	1,300	901.00	1,171,300
日本光電工業	10,500	3,170.00	33,285,000
チノー	800	1,548.00	1,238,400
共和電業	2,400	378.00	907,200
日本電子材料	1,300	2,068.00	2,688,400
堀場製作所	4,700	6,590.00	30,973,000
アドバンテスト	19,000	9,210.00	174,990,000
小野測器	1,100	497.00	546,700
エスペック	2,100	2,029.00	4,260,900
キーエンス	23,100	57,590.00	1,330,329,000
日置電機	1,200	6,400.00	7,680,000
シスメックス	21,600	8,868.00	191,548,800
日本マイクロニクス	4,400	1,592.00	7,004,800
メガチップス	2,400	3,890.00	9,336,000
OBARA GROUP	1,200	3,020.00	3,624,000
澤藤電機	300	1,463.00	438,900
原田工業	1,200	977.00	1,172,400
コーセル	2,800	809.00	2,265,200
イリソ電子工業	2,100	4,580.00	9,618,000
オプテックスグループ	4,200	1,489.00	6,253,800
千代田インテグレ	1,100	1,923.00	2,115,300
アイ・オー・データ機器	800	1,299.00	1,039,200
レーザーテック	11,200	21,995.00	246,344,000
スタンレー電気	17,800	2,759.00	49,110,200
岩崎電気	900	2,289.00	2,060,100
ウシオ電機	13,100	1,828.00	23,946,800
岡谷電機産業	1,800	310.00	558,000
ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	292.00	642,400
エノモト	700	1,542.00	1,079,400
日本セラミック	2,400	2,480.00	5,952,000
遠藤照明	1,200	1,003.00	1,203,600

古河電池	1,800	1,217.00	2,190,600	
双信電機	1,200	562.00	674,400	
山一電機	1,800	2,007.00	3,612,600	
図研	1,700	2,965.00	5,040,500	
日本電子	5,300	6,720.00	35,616,000	
カシオ計算機	18,500	1,407.00	26,029,500	
ファナック	22,400	22,865.00	512,176,000	
日本シイエムケイ	5,000	625.00	3,125,000	
エンプラス	600	2,594.00	1,556,400	
大真空	3,400	1,136.00	3,862,400	
ローム	11,400	9,310.00	106,134,000	
浜松ホトニクス	18,300	5,830.00	106,689,000	
三井ハイテック	2,500	8,100.00	20,250,000	
新光電気工業	7,500	4,895.00	36,712,500	
京セラ	35,900	6,655.00	238,914,500	
太陽誘電	12,400	5,050.00	62,620,000	
村田製作所	74,900	7,996.00	598,900,400	
双葉電子工業	4,400	667.00	2,934,800	
北陸電気工業	1,000	1,275.00	1,275,000	
ニチコン	8,000	1,264.00	10,112,000	
日本ケミコン	2,400	1,950.00	4,680,000	
KOA	3,800	1,465.00	5,567,000	
市光工業	3,100	497.00	1,540,700	
小糸製作所	14,000	5,780.00	80,920,000	
ミツバ	4,700	389.00	1,828,300	
SCREENホールディングス	4,400	11,210.00	49,324,000	
キヤノン電子	2,300	1,592.00	3,661,600	
キヤノン	126,800	2,819.50	357,512,600	
リコー	70,800	1,034.00	73,207,200	
象印マホービン	6,900	1,460.00	10,074,000	
MUTOHホールディングス	300	2,051.00	615,300	
東京エレクトロン	16,200	55,220.00	894,564,000	
トヨタ紡織	10,400	2,180.00	22,672,000	
芦森工業	500	904.00	452,000	
ユニプレス	3,800	823.00	3,127,400	
豊田自動織機	20,600	9,110.00	187,666,000	

モリタホールディングス	4,100	1,256.00	5,149,600
三櫻工業	3,500	716.00	2,506,000
デンソー	56,200	8,409.00	472,585,800
東海理化電機製作所	6,700	1,561.00	10,458,700
川崎重工業	18,600	2,133.00	39,673,800
名村造船所	7,600	217.00	1,649,200
日本車輛製造	900	2,090.00	1,881,000
三菱ロジスネクスト	3,400	956.00	3,250,400
近畿車輛	400	1,038.00	415,200
日産自動車	300,800	606.40	182,405,120
いすゞ自動車	80,000	1,576.00	126,080,000
トヨタ自動車	1,292,100	2,153.50	2,782,537,350
日野自動車	31,900	1,072.00	34,196,800
三菱自動車工業	94,400	324.00	30,585,600
エフテック	1,800	546.00	982,800
レンシップホールディングス	1,000	547.00	547,000
GMB	500	793.00	396,500
ファルテック	400	696.00	278,400
武蔵精密工業	5,700	1,861.00	10,607,700
日産車体	3,700	682.00	2,523,400
新明和工業	7,200	926.00	6,667,200
極東開発工業	4,700	1,460.00	6,862,000
トピー工業	2,100	1,107.00	2,324,700
ティラド	700	2,542.00	1,779,400
曙ブレーキ工業	13,900	168.00	2,335,200
タチエス	4,500	1,143.00	5,143,500
NOK	12,300	1,218.00	14,981,400
フタバ産業	6,400	406.00	2,598,400
KYB	2,700	3,015.00	8,140,500
大同メタル工業	4,900	644.00	3,155,600
プレス工業	12,600	384.00	4,838,400
ミクニ	3,200	418.00	1,337,600
太平洋工業	5,300	1,049.00	5,559,700
河西工業	3,100	306.00	948,600
アイシン	18,700	4,375.00	81,812,500
マツダ	80,100	910.00	72,891,000

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

タムロン	2,000	2,390.00	4,780,000
HOYA	49,800	15,300.00	761,940,000
シード	1,200	508.00	609,600
ノーリツ鋼機	2,300	1,867.00	4,294,100
エー・アンド・デイ	2,300	915.00	2,104,500
朝日インテック	28,000	2,238.00	62,664,000
シチズン時計	29,900	504.00	15,069,600
リズム	800	1,376.00	1,100,800
大研医器	2,000	522.00	1,044,000
メニコン	8,500	3,095.00	26,307,500
シンシア	300	526.00	157,800
松風	1,100	1,884.00	2,072,400
セイコーホールディングス	3,600	2,320.00	8,352,000
ニプロ	19,000	1,102.00	20,938,000
中本パックス	700	1,718.00	1,202,600
スノーピーク	3,300	2,791.00	9,210,300
パラマウントベッドホールディングス	4,900	1,944.00	9,525,600
トランザクション	1,400	1,022.00	1,430,800
粧美堂	700	433.00	303,100
ニホンフラッシュ	2,200	1,061.00	2,334,200
前田工織	2,800	3,215.00	9,002,000
永大産業	3,300	313.00	1,032,900
アートネイチャー	2,200	713.00	1,568,600
バンダイナムコホールディングス	22,900	8,000.00	183,200,000
アイフィスジャパン	600	690.00	414,000
共立印刷	4,200	145.00	609,000
SHOEI	2,400	4,470.00	10,728,000
フランスベッドホールディングス	3,300	914.00	3,016,200
パイロットコーポレーション	4,300	4,605.00	19,801,500
萩原工業	1,700	1,217.00	2,068,900
フジシールインターナショナル	6,200	1,872.00	11,606,400
タカラトミー	10,700	1,288.00	13,781,600
広済堂ホールディングス	1,600	831.00	1,329,600
エステールホールディングス	600	655.00	393,000
タカノ	900	715.00	643,500
プロネクサス	2,000	1,075.00	2,150,000

ホクシン	1,800	153.00	275,400	
ウッドワン	800	1,012.00	809,600	
大建工業	1,500	2,325.00	3,487,500	
凸版印刷	38,800	2,297.00	89,123,600	
大日本印刷	30,100	2,925.00	88,042,500	
共同印刷	700	2,752.00	1,926,400	
N I S S H A	5,200	1,414.00	7,352,800	
光村印刷	200	1,468.00	293,600	
TAKARA & COMPANY	1,600	1,811.00	2,897,600	
アシックス	22,600	2,322.00	52,477,200	
ツツミ	600	1,802.00	1,081,200	
ローランド	1,800	4,115.00	7,407,000	
小松ウオール工業	800	1,865.00	1,492,000	
ヤマハ	14,800	5,500.00	81,400,000	
河合楽器製作所	700	3,020.00	2,114,000	
クリナップ	2,400	542.00	1,300,800	
ピジョン	15,400	2,286.00	35,204,400	
兼松サステック	200	1,669.00	333,800	
キングジム	2,200	879.00	1,933,800	
リンテック	5,500	2,660.00	14,630,000	
イトーキ	4,700	355.00	1,668,500	
任天堂	14,400	57,420.00	826,848,000	
三菱鉛筆	4,200	1,272.00	5,342,400	
タカラスタンダード	5,300	1,395.00	7,393,500	
コクヨ	12,200	1,672.00	20,398,400	
ナカバヤシ	2,300	516.00	1,186,800	
グローブライド	2,300	2,883.00	6,630,900	
オカムラ	8,800	1,202.00	10,577,600	
美津濃	2,500	2,347.00	5,867,500	
東京電力ホールディングス	190,900	355.00	67,769,500	
中部電力	78,000	1,131.00	88,218,000	
関西電力	96,600	1,150.00	111,090,000	
中国電力	39,900	905.00	36,109,500	
北陸電力	23,300	558.00	13,001,400	
東北電力	59,700	737.00	43,998,900	
四国電力	23,000	801.00	18,423,000	

九州電力	52,600	844.00	44,394,400	
北海道電力	22,200	507.00	11,255,400	
沖縄電力	5,400	1,412.00	7,624,800	
電源開発	21,700	1,882.00	40,839,400	
エフオン	1,500	521.00	781,500	
イーレックス	3,800	1,624.00	6,171,200	
レノバ	5,000	1,423.00	7,115,000	
東京瓦斯	48,900	2,314.00	113,154,600	
大阪瓦斯	46,200	2,093.00	96,696,600	
東邦瓦斯	11,700	3,230.00	37,791,000	
北海道瓦斯	1,300	1,521.00	1,977,300	
広島ガス	4,900	357.00	1,749,300	
西部ガスホールディングス	2,900	2,259.00	6,551,100	
静岡ガス	6,600	889.00	5,867,400	
メタウォーター	2,600	1,985.00	5,161,000	
SBSホールディングス	1,900	3,235.00	6,146,500	
東武鉄道	24,900	2,935.00	73,081,500	
相鉄ホールディングス	8,200	2,242.00	18,384,400	
東急	64,300	1,599.00	102,815,700	
京浜急行電鉄	32,800	1,268.00	41,590,400	
小田急電鉄	37,900	2,163.00	81,977,700	
京王電鉄	13,200	5,420.00	71,544,000	
京成電鉄	17,800	3,415.00	60,787,000	
富士急行	3,000	4,185.00	12,555,000	
新京成電鉄	600	2,002.00	1,201,200	
東日本旅客鉄道	44,900	7,150.00	321,035,000	
西日本旅客鉄道	30,900	5,086.00	157,157,400	
東海旅客鉄道	21,200	15,825.00	335,490,000	
西武ホールディングス	33,300	1,234.00	41,092,200	
鴻池運輸	4,100	1,191.00	4,883,100	
西日本鉄道	7,100	2,693.00	19,120,300	
ハマキョウレックス	1,800	2,897.00	5,214,600	
サカイ引越センター	1,200	4,480.00	5,376,000	
近鉄グループホールディングス	24,200	3,595.00	86,999,000	
阪急阪神ホールディングス	30,200	3,545.00	107,059,000	
南海電気鉄道	10,800	2,392.00	25,833,600	

京阪ホールディングス	10,800	2,947.00	31,827,600
神戸電鉄	600	3,360.00	2,016,000
名古屋鉄道	19,900	2,033.00	40,456,700
山陽電気鉄道	1,900	1,999.00	3,798,100
アルプス物流	1,700	1,037.00	1,762,900
ヤマトホールディングス	33,900	2,185.00	74,071,500
山九	6,400	4,105.00	26,272,000
丸運	1,300	244.00	317,200
丸全昭和運輸	2,000	3,205.00	6,410,000
センコーグループホールディングス	12,100	924.00	11,180,400
トナミホールディングス	600	3,815.00	2,289,000
ニッコンホールディングス	8,100	2,178.00	17,641,800
日本石油輸送	300	2,637.00	791,100
福山通運	4,000	3,910.00	15,640,000
セイノーホールディングス	16,400	1,212.00	19,876,800
エスライン	700	910.00	637,000
神奈川中央交通	600	3,450.00	2,070,000
日立物流	4,700	5,830.00	27,401,000
丸和運輸機関	5,100	1,137.00	5,798,700
C&Fロジホールディングス	2,400	1,317.00	3,160,800
九州旅客鉄道	18,700	2,583.00	48,302,100
S Gホールディングス	45,600	2,476.00	112,905,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	8,400	7,280.00	61,152,000
日本郵船	20,200	9,660.00	195,132,000
商船三井	13,400	8,910.00	119,394,000
川崎汽船	7,400	7,180.00	53,132,000
NSユニテッド海運	1,300	3,885.00	5,050,500
明治海運	2,900	858.00	2,488,200
飯野海運	11,200	769.00	8,612,800
共栄タンカー	400	945.00	378,000
乾汽船	1,700	2,782.00	4,729,400
日本航空	55,400	2,336.00	129,414,400
ANAホールディングス	61,400	2,577.00	158,227,800
パスコ	500	1,303.00	651,500
トランコム	700	7,360.00	5,152,000

日新	1,900	1,698.00	3,226,200
三菱倉庫	7,700	2,786.00	21,452,200
三井倉庫ホールディングス	2,600	2,345.00	6,097,000
住友倉庫	8,500	2,108.00	17,918,000
澁澤倉庫	1,400	2,219.00	3,106,600
東陽倉庫	4,000	317.00	1,268,000
日本トランスシティ	5,300	635.00	3,365,500
ケイヒン	400	1,383.00	553,200
中央倉庫	1,500	982.00	1,473,000
川西倉庫	400	1,100.00	440,000
安田倉庫	2,000	972.00	1,944,000
ファイズホールディングス	500	598.00	299,000
東洋埠頭	700	1,452.00	1,016,400
上組	13,300	2,197.00	29,220,100
サンリツ	700	842.00	589,400
キムラユニティー	600	1,364.00	818,400
キューソー流通システム	1,200	938.00	1,125,600
近鉄エクスプレス	4,600	3,145.00	14,467,000
東海運	1,400	306.00	428,400
エーアイテイー	1,500	1,394.00	2,091,000
内外トランスライン	900	1,937.00	1,743,300
日本コンセプト	800	1,387.00	1,109,600
NEC ネットエスアイ	8,300	1,790.00	14,857,000
クロスキャット	700	1,606.00	1,124,200
システナ	35,700	382.00	13,637,400
デジタルアーツ	1,300	6,270.00	8,151,000
日鉄ソリューションズ	3,600	3,645.00	13,122,000
キューブシステム	1,300	937.00	1,218,100
WOW WORLD	400	1,140.00	456,000
コア	1,100	1,511.00	1,662,100
ラクーンホールディングス	2,100	1,205.00	2,530,500
ソリトンシステムズ	1,300	1,469.00	1,909,700
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	4,055.00	4,460,500
T I S	23,900	2,698.00	64,482,200
J N Sホールディングス	1,200	422.00	506,400
グリー	11,400	812.00	9,256,800

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

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

ランドコンピュータ	600	864.00	518,400
ダブルスタンダード	800	1,926.00	1,540,800
オープンドア	1,500	1,907.00	2,860,500
マイネット	900	485.00	436,500
アカツキ	1,100	2,880.00	3,168,000
ベネフィットジャパン	200	1,878.00	375,600
U b i c o mホールディングス	700	1,922.00	1,345,400
カナミックネットワーク	2,700	427.00	1,152,900
ノムラシステムコーポレーション	1,300	229.00	297,700
チェンジ	4,600	1,587.00	7,300,200
シンクロ・フード	1,300	275.00	357,500
オークネット	1,300	1,451.00	1,886,300
キャピタル・アセット・プランニング	500	769.00	384,500
セグエグループ	600	545.00	327,000
エイトレッド	400	2,047.00	818,800
マクロミル	5,400	1,102.00	5,950,800
ビーグリー	600	1,161.00	696,600
オロ	800	2,472.00	1,977,600
ユーザーローカル	800	1,550.00	1,240,000
テモナ	500	415.00	207,500
ニーズウェル	600	612.00	367,200
マネーフォワード	3,800	5,040.00	19,152,000
サインポスト	800	870.00	696,000
電算システムホールディングス	1,000	2,699.00	2,699,000
ソルクシーズ	2,100	404.00	848,400
フェイス	700	675.00	472,500
プロトコーポレーション	2,700	1,249.00	3,372,300
ハイマックス	700	1,167.00	816,900
野村総合研究所	48,400	3,935.00	190,454,000
サイバネットシステム	1,800	635.00	1,143,000
C Eホールディングス	1,300	472.00	613,600
日本システム技術	500	2,101.00	1,050,500
インテージホールディングス	2,900	1,751.00	5,077,900
東邦システムサイエンス	700	913.00	639,100
ソースネクスト	10,700	151.00	1,615,700
インフォコム	2,700	2,031.00	5,483,700

シンプレクス・ホールディングス	2,900	1,809.00	5,246,100
HEROZ	700	899.00	629,300
ラクスル	2,700	3,535.00	9,544,500
I P S	700	1,970.00	1,379,000
F I G	2,700	284.00	766,800
システムサポート	900	1,008.00	907,200
イーソル	1,500	500.00	750,000
アルテリア・ネットワークス	3,200	1,336.00	4,275,200
東海ソフト	400	898.00	359,200
ウイングアーク1st	1,400	1,339.00	1,874,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	1,768.00	1,060,800
サーバーワークス	400	2,323.00	929,200
東名	200	964.00	192,800
ヴィッツ	200	1,175.00	235,000
トビラシステムズ	500	814.00	407,000
S a n s a n	8,900	1,095.00	9,745,500
L i n k - U	400	757.00	302,800
ギフトィ	2,300	955.00	2,196,500
ベース	400	4,700.00	1,880,000
J M D C	2,300	5,630.00	12,949,000
フォーカスシステムズ	1,700	917.00	1,558,900
クレスコ	1,800	1,688.00	3,038,400
フジ・メディア・ホールディングス	24,100	1,286.00	30,992,600
オービック	7,900	18,720.00	147,888,000
ジャストシステム	3,600	5,500.00	19,800,000
T D C ソフト	2,200	1,106.00	2,433,200
Zホールディングス	363,800	563.80	205,110,440
トレンドマイクロ	13,400	6,000.00	80,400,000
I Dホールディングス	1,600	850.00	1,360,000
日本オラクル	4,100	8,220.00	33,702,000
アルファシステムズ	700	3,790.00	2,653,000
フューチャー	5,300	1,408.00	7,462,400
C A C H o l d i n g s	1,500	1,328.00	1,992,000
S Bテクノロジー	1,100	2,504.00	2,754,400
トーセ	700	728.00	509,600

オービックビジネスコンサルタント	2,400	4,290.00	10,296,000
伊藤忠テクノソリューションズ	11,400	2,963.00	33,778,200
アイティフォー	3,000	786.00	2,358,000
東計電算	300	4,970.00	1,491,000
エックスネット	400	998.00	399,200
大塚商会	13,500	4,400.00	59,400,000
サイボウズ	3,300	1,377.00	4,544,100
電通国際情報サービス	3,600	3,540.00	12,744,000
A C C E S S	2,800	569.00	1,593,200
デジタルガレージ	4,100	3,935.00	16,133,500
EMシステムズ	4,100	697.00	2,857,700
ウェザーニューズ	800	7,770.00	6,216,000
C I J	1,600	804.00	1,286,400
ビジネスエンジニアリング	300	3,570.00	1,071,000
日本エンタープライズ	2,500	168.00	420,000
WOWOW	1,200	1,770.00	2,124,000
スカラ	2,100	653.00	1,371,300
インテリジェント ウェイブ	1,300	561.00	729,300
I M A G I C A G R O U P	2,100	623.00	1,308,300
ネットワンシステムズ	9,500	2,877.00	27,331,500
システムソフト	5,300	96.00	508,800
アルゴグラフィックス	1,900	3,070.00	5,833,000
マーベラス	3,900	727.00	2,835,300
エイベックス	4,300	1,336.00	5,744,800
日本ユニシス	7,800	3,120.00	24,336,000
兼松エレクトロニクス	1,400	3,855.00	5,397,000
都築電気	1,300	1,387.00	1,803,100
T B S ホールディングス	15,200	1,950.00	29,640,000
日本テレビホールディングス	20,900	1,367.00	28,570,300
朝日放送グループホールディングス	2,500	756.00	1,890,000
テレビ朝日ホールディングス	6,000	1,667.00	10,002,000
スカパー J S A T ホールディングス	21,200	455.00	9,646,000
テレビ東京ホールディングス	1,800	2,137.00	3,846,600
日本B S 放送	800	1,075.00	860,000
ビジョン	4,300	1,037.00	4,459,100
スマートバリュー	600	448.00	268,800

USEN-NEXT HOLDINGS	2,400	2,423.00	5,815,200
ワイヤレスゲート	1,000	298.00	298,000
コネクシオ	1,800	1,396.00	2,512,800
日本通信	20,800	181.00	3,764,800
クロップス	500	869.00	434,500
日本電信電話	261,900	3,285.00	860,341,500
KDDI	182,500	3,720.00	678,900,000
ソフトバンク	379,100	1,434.00	543,629,400
光通信	2,900	14,720.00	42,688,000
エムティーアイ	2,400	515.00	1,236,000
GMOインターネット	8,900	2,573.00	22,899,700
ファイバーゲート	1,100	1,127.00	1,239,700
アイドママーケティングコミュニケーション	500	286.00	143,000
KADOKAWA	13,700	2,407.00	32,975,900
学研ホールディングス	3,500	1,004.00	3,514,000
ゼンリン	4,100	1,053.00	4,317,300
昭文社ホールディングス	1,000	448.00	448,000
インプレスホールディングス	2,000	207.00	414,000
アイネット	1,300	1,279.00	1,662,700
松竹	1,700	12,160.00	20,672,000
東宝	14,800	4,785.00	70,818,000
東映	800	17,300.00	13,840,000
エヌ・ティ・ティ・データ	66,600	2,107.00	140,326,200
ピー・シー・エー	1,500	1,411.00	2,116,500
ビジネスブレイン太田昭和	900	1,525.00	1,372,500
DTS	4,800	2,737.00	13,137,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,600	5,670.00	65,772,000
シーイーシー	2,700	1,061.00	2,864,700
カプコン	23,600	2,878.00	67,920,800
アイ・エス・ビー	1,200	935.00	1,122,000
ジャステック	1,400	1,044.00	1,461,600
SCSK	17,300	1,939.00	33,544,700
日本システムウエア	900	2,087.00	1,878,300
アイネス	2,300	1,499.00	3,447,700
TKC	4,200	3,135.00	13,167,000
富士ソフト	2,700	5,050.00	13,635,000

NSD	8,000	2,132.00	17,056,000
コナミホールディングス	9,100	6,760.00	61,516,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,110.00	3,421,000
J B C Cホールディングス	1,700	1,468.00	2,495,600
ミロク情報サービス	2,200	1,364.00	3,000,800
ソフトバンクグループ	150,100	5,158.00	774,215,800
ハウスイ	200	820.00	164,000
高千穂交易	1,000	1,513.00	1,513,000
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,493.00	597,200
伊藤忠食品	600	5,020.00	3,012,000
エレマテック	2,000	1,064.00	2,128,000
J A L U X	600	2,557.00	1,534,200
あらた	2,000	3,905.00	7,810,000
トーメンデバイス	400	6,280.00	2,512,000
東京エレクトロン デバイス	700	5,320.00	3,724,000
フィールズ	2,200	572.00	1,258,400
双日	27,800	1,919.00	53,348,200
アルフレッサ ホールディングス	27,900	1,737.00	48,462,300
横浜冷凍	7,000	884.00	6,188,000
神栄	300	845.00	253,500
ラサ商事	1,300	1,004.00	1,305,200
アルコニックス	3,100	1,323.00	4,101,300
神戸物産	19,500	3,745.00	73,027,500
ハイパー	600	480.00	288,000
あい ホールディングス	3,600	1,800.00	6,480,000
ディーブイエックス	900	1,063.00	956,700
ダイワボウホールディングス	12,200	1,746.00	21,301,200
マクニカ・富士エレホールディングス	6,000	2,616.00	15,696,000
ラクト・ジャパン	900	2,032.00	1,828,800
グリムス	1,100	2,090.00	2,299,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	814.00	3,581,600
八洲電機	1,800	960.00	1,728,000
メディアスホールディングス	1,400	886.00	1,240,400
レスターホールディングス	2,400	1,955.00	4,692,000
ジュテックホールディングス	600	1,217.00	730,200
大光	1,100	695.00	764,500

〇CHIホールディングス	700	1,335.00	934,500
TOKAIホールディングス	12,200	906.00	11,053,200
黒谷	700	640.00	448,000
Cominix	400	734.00	293,600
三洋貿易	2,500	1,016.00	2,540,000
ビューティガレージ	400	3,100.00	1,240,000
ウイン・パートナーズ	1,800	1,032.00	1,857,600
ミタチ産業	600	860.00	516,000
シップヘルスケアホールディングス	8,100	2,364.00	19,148,400
明治電機工業	800	1,255.00	1,004,000
デリカフーズホールディングス	1,000	555.00	555,000
スターティアホールディングス	600	674.00	404,400
コメダホールディングス	5,500	2,152.00	11,836,000
ピーバンドットコム	300	594.00	178,200
アセンテック	900	702.00	631,800
富士興産	600	942.00	565,200
協栄産業	300	1,518.00	455,400
フルサト・マルカホールディングス	2,400	2,169.00	5,205,600
ヤマエグループホールディングス	1,700	1,067.00	1,813,900
小野建	2,400	1,596.00	3,830,400
南陽	500	1,921.00	960,500
佐鳥電機	1,600	915.00	1,464,000
エコートレーディング	500	597.00	298,500
伯東	1,500	2,311.00	3,466,500
コンドーテック	1,900	1,030.00	1,957,000
中山福	1,300	396.00	514,800
ナガイレーベン	3,300	2,127.00	7,019,100
三菱食品	2,400	3,225.00	7,740,000
松田産業	1,800	2,231.00	4,015,800
第一興商	4,800	3,555.00	17,064,000
メディパルホールディングス	27,100	2,120.00	57,452,000
S P K	1,000	1,300.00	1,300,000
萩原電気ホールディングス	900	2,042.00	1,837,800
アズワン	3,600	6,390.00	23,004,000
スズデン	900	2,000.00	1,800,000
尾家産業	700	1,001.00	700,700

シモジマ	1,500	1,011.00	1,516,500
ドウシシャ	2,400	1,548.00	3,715,200
小津産業	600	2,000.00	1,200,000
高速	1,500	1,508.00	2,262,000
たけびし	900	1,426.00	1,283,400
リックス	600	1,575.00	945,000
丸文	2,200	717.00	1,577,400
ハピネット	2,100	1,588.00	3,334,800
橋本総業ホールディングス	500	2,032.00	1,016,000
日本ライフライン	7,400	1,037.00	7,673,800
タカショー	1,900	660.00	1,254,000
I DOM	7,600	660.00	5,016,000
進和	1,500	2,032.00	3,048,000
エスケイジャパン	600	421.00	252,600
ダイترون	1,100	1,870.00	2,057,000
シークス	3,600	1,269.00	4,568,400
田中商事	800	650.00	520,000
オーハシテクニカ	1,300	1,360.00	1,768,000
白銅	800	2,596.00	2,076,800
ダイコー通産	300	1,185.00	355,500
伊藤忠商事	175,700	3,794.00	666,605,800
丸紅	247,800	1,182.50	293,023,500
高島	400	2,424.00	969,600
長瀬産業	13,800	1,884.00	25,999,200
蝶理	1,400	1,789.00	2,504,600
豊田通商	25,200	4,895.00	123,354,000
三共生興	3,300	571.00	1,884,300
兼松	9,400	1,370.00	12,878,000
ツカモトコーポレーション	400	1,333.00	533,200
三井物産	195,100	2,964.00	578,276,400
日本紙パルプ商事	1,300	4,085.00	5,310,500
カメイ	3,000	1,054.00	3,162,000
東都水産	100	3,940.00	394,000
OUGホールディングス	400	2,741.00	1,096,400
スターゼン	1,900	2,129.00	4,045,100
山善	10,600	1,017.00	10,780,200

椿本興業	500	4,195.00	2,097,500	
住友商事	158,600	1,862.00	295,313,200	
内田洋行	1,100	4,665.00	5,131,500	
三菱商事	188,300	3,964.00	746,421,200	
第一実業	1,100	4,305.00	4,735,500	
キヤノンマーケティングジャパン	6,200	2,494.00	15,462,800	
西華産業	1,300	1,595.00	2,073,500	
佐藤商事	2,100	1,206.00	2,532,600	
菱洋エレクトロ	1,500	2,123.00	3,184,500	
東京産業	2,300	706.00	1,623,800	
ユアサ商事	2,400	2,964.00	7,113,600	
神鋼商事	600	3,690.00	2,214,000	
トルク	1,300	223.00	289,900	
阪和興業	5,000	3,345.00	16,725,000	
正栄食品工業	1,600	4,150.00	6,640,000	
カナデン	2,000	990.00	1,980,000	
菱電商事	2,000	1,716.00	3,432,000	
岩谷産業	6,000	5,250.00	31,500,000	
ナイス	900	1,898.00	1,708,200	
ニチモウ	400	2,678.00	1,071,200	
極東貿易	700	2,301.00	1,610,700	
アステナホールディングス	3,500	414.00	1,449,000	
三愛石油	6,200	936.00	5,803,200	
稲畑産業	5,500	2,434.00	13,387,000	
G S I クレオス	1,200	1,141.00	1,369,200	
明和産業	2,300	1,111.00	2,555,300	
クワザワホールディングス	1,000	607.00	607,000	
ワキタ	5,400	1,017.00	5,491,800	
東邦ホールディングス	8,100	1,895.00	15,349,500	
サンゲツ	6,600	1,589.00	10,487,400	
ミツウロコグループホールディングス	3,700	1,079.00	3,992,300	
シナネンホールディングス	900	3,295.00	2,965,500	
伊藤忠エネクス	5,600	1,036.00	5,801,600	
サンリオ	7,800	2,473.00	19,289,400	
サンワテクノス	1,500	1,343.00	2,014,500	
リョーサン	2,800	2,345.00	6,566,000	

新光商事	3,800	902.00	3,427,600
トーヨー	1,100	1,095.00	1,204,500
三信電気	1,200	1,643.00	1,971,600
東陽テクニカ	2,500	1,059.00	2,647,500
モスフードサービス	3,300	3,065.00	10,114,500
加賀電子	2,300	3,305.00	7,601,500
ソーダニッカ	2,500	886.00	2,215,000
立花エレテック	2,000	1,607.00	3,214,000
フォーバル	1,100	907.00	997,700
PAL TAC	3,500	4,455.00	15,592,500
三谷産業	2,900	312.00	904,800
太平洋興発	900	650.00	585,000
西本Wismettacホールディングス	600	2,818.00	1,690,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,971.00	394,200
コア商事ホールディングス	1,600	641.00	1,025,600
国際紙パルプ商事	5,200	344.00	1,788,800
ヤマタネ	1,200	1,629.00	1,954,800
丸紅建材リース	200	1,776.00	355,200
日鉄物産	1,800	5,330.00	9,594,000
泉州電業	700	6,280.00	4,396,000
トラスコ中山	5,200	2,493.00	12,963,600
オートバックスセブン	8,400	1,433.00	12,037,200
モリト	1,800	731.00	1,315,800
加藤産業	3,600	3,235.00	11,646,000
北恵	600	895.00	537,000
イノテック	1,500	1,399.00	2,098,500
イエローハット	4,300	1,643.00	7,064,900
JKホールディングス	2,000	1,052.00	2,104,000
日伝	2,100	2,259.00	4,743,900
北沢産業	1,700	230.00	391,000
杉本商事	1,200	2,080.00	2,496,000
因幡電機産業	6,700	2,617.00	17,533,900
東テク	800	2,442.00	1,953,600
ミスミグループ本社	31,500	3,535.00	111,352,500
アルテック	1,700	302.00	513,400
タキヒヨー	800	1,416.00	1,132,800

蔵王産業	500	1,899.00	949,500
スズケン	9,800	3,585.00	35,133,000
ジェコス	1,700	820.00	1,394,000
グローセル	2,900	437.00	1,267,300
ローソン	5,600	4,970.00	27,832,000
サンエー	1,900	4,020.00	7,638,000
カワチ薬品	1,900	2,371.00	4,504,900
エービーシー・マート	3,900	5,280.00	20,592,000
ハードオフコーポレーション	1,100	801.00	881,100
アスクル	5,700	1,664.00	9,484,800
ゲオホールディングス	3,400	1,501.00	5,103,400
アダストリア	2,700	1,710.00	4,617,000
ジーフット	1,500	329.00	493,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	380.00	152,000
くら寿司	2,600	3,740.00	9,724,000
キャンドウ	900	2,068.00	1,861,200
アイケイ	800	420.00	336,000
パルグループホールディングス	2,200	1,634.00	3,594,800
エディオン	11,500	1,190.00	13,685,000
サーラコーポレーション	5,100	637.00	3,248,700
ワッツ	1,200	705.00	846,000
ハローズ	1,100	2,802.00	3,082,200
フジオフードグループ本社	2,100	1,323.00	2,778,300
あみやき亭	600	2,952.00	1,771,200
ひらまつ	5,300	196.00	1,038,800
大黒天物産	800	4,735.00	3,788,000
ハニーズホールディングス	2,200	1,019.00	2,241,800
ファーマライズホールディングス	600	718.00	430,800
アルペン	1,900	2,216.00	4,210,400
ハブ	800	622.00	497,600
クオールホールディングス	3,100	1,308.00	4,054,800
ジーンズホールディングス	1,700	6,620.00	11,254,000
ビックカメラ	14,900	1,040.00	15,496,000
DCMホールディングス	15,500	1,111.00	17,220,500
ペッパーフードサービス	3,400	350.00	1,190,000
Monotaro	31,800	2,034.00	64,681,200

東京一番フーズ	600	598.00	358,800
DDホールディングス	1,300	542.00	704,600
きちりホールディングス	700	430.00	301,000
アークランドサービスホールディングス	1,800	2,244.00	4,039,200
J. フロント リテイリング	30,000	1,077.00	32,310,000
ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,644.00	7,069,200
マツキヨココカラ&カンパニー	15,500	4,235.00	65,642,500
ブロンコビリー	1,400	2,273.00	3,182,200
ZOZO	17,300	3,185.00	55,100,500
トレジャー・ファクトリー	700	970.00	679,000
物語コーポレーション	1,200	6,790.00	8,148,000
三越伊勢丹ホールディングス	44,000	954.00	41,976,000
H a m e e	900	1,070.00	963,000
マーケットエンタープライズ	200	663.00	132,600
ウエルシアホールディングス	13,300	3,170.00	42,161,000
クリエイトSDホールディングス	3,700	3,170.00	11,729,000
丸善CHIホールディングス	2,900	365.00	1,058,500
ミサワ	500	650.00	325,000
ティーライフ	300	1,310.00	393,000
エー・ピーホールディングス	500	450.00	225,000
チムニー	800	1,140.00	912,000
シュッピン	2,100	1,160.00	2,436,000
オイシックス・ラ・大地	3,600	2,560.00	9,216,000
ネクステージ	5,100	2,558.00	13,045,800
ジョイフル本田	7,600	1,558.00	11,840,800
鳥貴族ホールディングス	900	1,861.00	1,674,900
ホットランド	1,900	1,292.00	2,454,800
すかいらーくホールディングス	32,400	1,450.00	46,980,000
SFPホールディングス	1,200	1,428.00	1,713,600
綿半ホールディングス	1,900	1,313.00	2,494,700
ヨシックスホールディングス	500	2,189.00	1,094,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,300	1,079.00	7,876,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,300	1,050.00	1,365,000
B E E N O S	1,300	1,546.00	2,009,800
あさひ	2,100	1,405.00	2,950,500

日本調剤	1,500	1,399.00	2,098,500
コスモス薬品	2,500	15,250.00	38,125,000
トーエル	1,200	864.00	1,036,800
セブン&アイ・ホールディングス	98,300	5,832.00	573,285,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	13,400	759.00	10,170,600
ツルハホールディングス	5,500	9,400.00	51,700,000
サンマルクホールディングス	2,000	1,616.00	3,232,000
フェリシモ	600	1,191.00	714,600
トリドールホールディングス	6,200	2,649.00	16,423,800
TOKYO BASE	2,300	441.00	1,014,300
ウイルプラスホールディングス	500	892.00	446,000
JMホールディングス	1,700	1,763.00	2,997,100
サツドラホールディングス	1,100	640.00	704,000
アレンザホールディングス	1,900	1,088.00	2,067,200
串カツ田中ホールディングス	700	2,106.00	1,474,200
バロックジャパンリミテッド	1,700	884.00	1,502,800
クスリのアオキホールディングス	2,500	7,000.00	17,500,000
力の源ホールディングス	1,300	565.00	734,500
FOOD & LIFE COMPANIES	14,700	3,795.00	55,786,500
メディカルシステムネットワーク	2,400	522.00	1,252,800
一家ホールディングス	500	531.00	265,500
藤久ホールディングス	800	633.00	506,400
はるやまホールディングス	1,200	534.00	640,800
ノジマ	4,100	2,513.00	10,303,300
カッパ・クリエイト	3,500	1,379.00	4,826,500
ライトオン	1,900	710.00	1,349,000
良品計画	28,900	1,739.00	50,257,100
三城ホールディングス	3,100	248.00	768,800
アドヴァングループ	2,600	938.00	2,438,800
アルビス	800	2,228.00	1,782,400
コナカ	3,000	356.00	1,068,000
ハウス オブ ローゼ	300	1,699.00	509,700
G-7ホールディングス	2,800	1,552.00	4,345,600
イオン北海道	4,400	1,194.00	5,253,600
コジマ	4,300	549.00	2,360,700
ヒマラヤ	900	1,010.00	909,000

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

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

元気寿司	700	2,566.00	1,796,200
ヤマダホールディングス	91,900	405.00	37,219,500
アークランドサカモト	3,900	1,540.00	6,006,000
ニトリホールディングス	10,000	16,670.00	166,700,000
グルメ杵屋	2,000	1,031.00	2,062,000
愛眼	1,800	181.00	325,800
ケーユーホールディングス	1,300	1,085.00	1,410,500
吉野家ホールディングス	8,800	2,435.00	21,428,000
松屋フーズホールディングス	1,200	3,640.00	4,368,000
サガミホールディングス	3,800	1,223.00	4,647,400
関西フードマーケット	1,900	1,106.00	2,101,400
王将フードサービス	1,700	6,020.00	10,234,000
プレナス	2,800	2,055.00	5,754,000
ミニストップ	1,900	1,483.00	2,817,700
アークス	4,800	2,190.00	10,512,000
バローホールディングス	5,600	2,257.00	12,639,200
ベルク	1,100	5,340.00	5,874,000
大庄	1,300	1,034.00	1,344,200
ファーストリテイリング	3,400	62,970.00	214,098,000
サンドラッグ	9,500	3,130.00	29,735,000
サックスパー ホールディングス	2,400	525.00	1,260,000
ヤマザワ	600	1,620.00	972,000
やまや	500	2,532.00	1,266,000
ベルーナ	5,400	741.00	4,001,400
島根銀行	800	562.00	449,600
じもとホールディングス	1,800	686.00	1,234,800
めぶきフィナンシャルグループ	130,700	281.00	36,726,700
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,200	1,978.00	6,329,600
九州フィナンシャルグループ	51,400	430.00	22,102,000
ゆうちょ銀行	59,400	1,056.00	62,726,400
富山第一銀行	6,000	319.00	1,914,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	143,700	490.00	70,413,000
西日本フィナンシャルホールディングス	16,400	846.00	13,874,400
三十三フィナンシャルグループ	2,300	1,537.00	3,535,100
第四北越フィナンシャルグループ	4,100	2,756.00	11,299,600
ひろぎんホールディングス	37,100	708.00	26,266,800

おきなわフィナンシャルグループ	2,300	2,344.00	5,391,200	
十六フィナンシャルグループ	3,400	2,405.00	8,177,000	
北國フィナンシャルホールディングス	2,300	3,365.00	7,739,500	
新生銀行	16,400	2,200.00	36,080,000	
あおぞら銀行	14,100	2,679.00	37,773,900	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,577,900	734.10	1,158,336,390	
りそなホールディングス	287,500	535.20	153,870,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	47,600	4,193.00	199,586,800	
三井住友フィナンシャルグループ	174,200	4,310.00	750,802,000	
千葉銀行	84,000	775.00	65,100,000	
群馬銀行	48,300	402.00	19,416,600	
武蔵野銀行	3,700	1,928.00	7,133,600	
千葉興業銀行	5,900	284.00	1,675,600	
筑波銀行	9,800	214.00	2,097,200	
七十七銀行	7,900	1,566.00	12,371,400	
青森銀行	1,900	1,944.00	3,693,600	
秋田銀行	1,600	1,760.00	2,816,000	
山形銀行	2,800	995.00	2,786,000	
岩手銀行	1,600	1,929.00	3,086,400	
東邦銀行	21,000	223.00	4,683,000	
東北銀行	1,200	1,031.00	1,237,200	
みちのく銀行	1,600	895.00	1,432,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	21,200	2,377.00	50,392,400	
静岡銀行	61,300	907.00	55,599,100	
スルガ銀行	22,100	449.00	9,922,900	
八十二銀行	56,700	443.00	25,118,100	
山梨中央銀行	2,700	986.00	2,662,200	
大垣共立銀行	5,000	2,054.00	10,270,000	
福井銀行	2,200	1,491.00	3,280,200	
清水銀行	1,000	1,629.00	1,629,000	
富山銀行	500	2,200.00	1,100,000	
滋賀銀行	4,700	2,261.00	10,626,700	
南都銀行	3,900	2,143.00	8,357,700	
百五銀行	24,100	360.00	8,676,000	
京都銀行	9,000	5,670.00	51,030,000	
紀陽銀行	8,500	1,592.00	13,532,000	

ほくほくフィナンシャルグループ	15,700	970.00	15,229,000	
山陰合同銀行	14,900	689.00	10,266,100	
中国銀行	20,100	930.00	18,693,000	
鳥取銀行	800	1,275.00	1,020,000	
伊予銀行	33,300	628.00	20,912,400	
百十四銀行	2,700	1,785.00	4,819,500	
四国銀行	3,800	811.00	3,081,800	
阿波銀行	3,900	2,344.00	9,141,600	
大分銀行	1,400	2,008.00	2,811,200	
宮崎銀行	1,600	2,252.00	3,603,200	
佐賀銀行	1,400	1,551.00	2,171,400	
琉球銀行	5,500	854.00	4,697,000	
セブン銀行	74,700	248.00	18,525,600	
みずほフィナンシャルグループ	321,800	1,605.00	516,489,000	
高知銀行	900	771.00	693,900	
山口フィナンシャルグループ	29,300	738.00	21,623,400	
長野銀行	800	1,296.00	1,036,800	
名古屋銀行	1,900	3,240.00	6,156,000	
北洋銀行	37,900	265.00	10,043,500	
愛知銀行	900	4,795.00	4,315,500	
中京銀行	900	1,692.00	1,522,800	
大光銀行	900	1,532.00	1,378,800	
愛媛銀行	3,500	993.00	3,475,500	
トマト銀行	900	1,072.00	964,800	
京葉銀行	10,700	523.00	5,596,100	
栃木銀行	12,100	239.00	2,891,900	
北日本銀行	800	1,733.00	1,386,400	
東和銀行	4,400	578.00	2,543,200	
福島銀行	2,900	246.00	713,400	
大東銀行	1,200	748.00	897,600	
トモニホールディングス	19,400	351.00	6,809,400	
フィデアホールディングス	2,300	1,404.00	3,229,200	
池田泉州ホールディングス	28,900	192.00	5,548,800	
F P G	8,500	868.00	7,378,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,900	1,091.00	2,072,900	
マーキュリアホールディングス	1,000	545.00	545,000	

SBIホールディングス	31,000	3,085.00	95,635,000	
日本アジア投資	1,900	175.00	332,500	
ジャフコグループ	9,600	1,680.00	16,128,000	
大和証券グループ本社	188,400	691.00	130,184,400	
野村ホールディングス	384,100	540.30	207,529,230	
岡三証券グループ	19,800	391.00	7,741,800	
丸三証券	7,500	543.00	4,072,500	
東洋証券	8,300	153.00	1,269,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,900	409.00	11,820,100	
光世証券	500	473.00	236,500	
水戸証券	6,700	279.00	1,869,300	
いちよし証券	4,700	670.00	3,149,000	
松井証券	12,300	816.00	10,036,800	
マネックスグループ	20,500	530.00	10,865,000	
極東証券	3,400	762.00	2,590,800	
岩井コスモホールディングス	2,400	1,386.00	3,326,400	
アイザワ証券グループ	4,100	946.00	3,878,600	
マネーパートナーズグループ	2,600	226.00	587,600	
スパークス・グループ	11,600	258.00	2,992,800	
小林洋行	700	213.00	149,100	
かんぽ生命保険	25,300	2,094.00	52,978,200	
SOMPOホールディングス	41,300	5,339.00	220,500,700	
アニコムホールディングス	7,700	800.00	6,160,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	56,400	3,928.00	221,539,200	
第一生命ホールディングス	123,800	2,594.00	321,137,200	
東京海上ホールディングス	82,900	6,891.00	571,263,900	
T&Dホールディングス	65,300	1,734.00	113,230,200	
アドバンスクリエイト	1,200	1,004.00	1,204,800	
全国保証	6,000	4,855.00	29,130,000	
あんしん保証	700	283.00	198,100	
ジェイリース	800	1,864.00	1,491,200	
イントラスト	1,100	585.00	643,500	
日本モーゲージサービス	1,400	1,012.00	1,416,800	
C a s a	900	832.00	748,800	
アルヒ	3,700	1,040.00	3,848,000	

プレミアグループ	1,300	3,945.00	5,128,500
ネットプロテクションズホールディングス	5,700	729.00	4,155,300
クレディセゾン	16,200	1,365.00	22,113,000
芙蓉総合リース	2,600	7,890.00	20,514,000
みずほリース	3,900	3,265.00	12,733,500
東京センチュリー	4,900	5,870.00	28,763,000
日本証券金融	9,900	903.00	8,939,700
アイフル	42,200	360.00	15,192,000
リコーリース	2,200	3,800.00	8,360,000
イオンフィナンシャルサービス	13,700	1,274.00	17,453,800
アコム	49,600	332.00	16,467,200
ジャックス	2,800	3,245.00	9,086,000
オリエントコーポレーション	68,100	127.00	8,648,700
オリックス	152,700	2,363.50	360,906,450
三菱HCキャピタル	92,900	599.00	55,647,100
九州リースサービス	1,200	600.00	720,000
日本取引所グループ	63,700	2,288.00	145,745,600
イー・ギャランティ	3,700	2,061.00	7,625,700
アサックス	1,300	686.00	891,800
NECキャピタルソリューション	1,000	2,130.00	2,130,000
いちご	28,000	270.00	7,560,000
日本駐車場開発	27,500	138.00	3,795,000
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,233.00	1,726,200
SREホールディングス	600	4,010.00	2,406,000
ADワークスグループ	5,200	140.00	728,000
ヒューリック	60,100	1,082.00	65,028,200
三栄建築設計	1,000	1,652.00	1,652,000
野村不動産ホールディングス	13,000	2,762.00	35,906,000
三重交通グループホールディングス	5,100	466.00	2,376,600
サムティ	4,000	2,131.00	8,524,000
ディア・ライフ	3,200	514.00	1,644,800
コーセーアールイー	700	592.00	414,400
地主	1,600	1,757.00	2,811,200
プレサンスコーポレーション	3,300	1,840.00	6,072,000
THEグローバル社	1,300	180.00	234,000
ハウスコム	400	1,255.00	502,000

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

空港施設	2,500	565.00	1,412,500
明和地所	1,200	591.00	709,200
ゴールドクレスト	2,000	1,865.00	3,730,000
エスリード	1,000	1,736.00	1,736,000
日神グループホールディングス	4,100	484.00	1,984,400
日本エスコン	4,700	764.00	3,590,800
タカラレーベン	10,500	317.00	3,328,500
AVANTIA	1,300	849.00	1,103,700
イオンモール	12,600	1,680.00	21,168,000
毎日コムネット	900	699.00	629,100
ファースト住建	900	1,142.00	1,027,800
ランド	136,200	11.00	1,498,200
カチタス	6,200	3,460.00	21,452,000
トーセイ	3,500	1,055.00	3,692,500
穴吹興産	500	2,004.00	1,002,000
サンフロンティア不動産	3,500	1,058.00	3,703,000
FJネクストホールディングス	2,500	985.00	2,462,500
インテリックス	600	626.00	375,600
ランドビジネス	1,000	245.00	245,000
サンネクスタグループ	800	1,015.00	812,000
グランディハウス	1,700	580.00	986,000
日本空港ビルデング	9,600	5,440.00	52,224,000
明豊ファシリティワークス	1,100	720.00	792,000
日本工営	1,600	3,015.00	4,824,000
LIFULL	7,400	228.00	1,687,200
ミクシィ	5,600	2,250.00	12,600,000
ジェイエイシーリクルートメント	2,000	1,954.00	3,908,000
日本M&Aセンターホールディングス	40,000	1,760.00	70,400,000
メンバーズ	700	2,867.00	2,006,900
中広	400	394.00	157,600
UTグループ	3,500	3,505.00	12,267,500
アイティメディア	1,200	1,583.00	1,899,600
E・Jホールディングス	1,400	1,106.00	1,548,400
夢真ビーネックスグループ	7,900	1,526.00	12,055,400
コシダカホールディングス	6,500	653.00	4,244,500
アルトナー	600	856.00	513,600

パソナグループ	2,600	2,443.00	6,351,800
CDS	600	1,577.00	946,200
リンクアンドモチベーション	5,400	449.00	2,424,600
エス・エム・エス	8,300	3,230.00	26,809,000
サニーサイドアップグループ	800	730.00	584,000
パーソルホールディングス	24,400	2,677.00	65,318,800
リニカル	1,400	707.00	989,800
クックパッド	7,600	258.00	1,960,800
エスクリ	1,100	394.00	433,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,200	579.00	694,800
学情	1,000	992.00	992,000
スタジオアリス	1,100	2,172.00	2,389,200
シミックホールディングス	1,300	1,577.00	2,050,100
エプコ	500	689.00	344,500
NJS	500	1,977.00	988,500
総合警備保障	9,700	4,275.00	41,467,500
カカクコム	17,900	2,596.00	46,468,400
アイロムグループ	900	1,948.00	1,753,200
セントケア・ホールディング	1,600	818.00	1,308,800
サイネックス	400	605.00	242,000
ルネサンス	1,700	1,096.00	1,863,200
ディップ	4,300	3,390.00	14,577,000
デジタルホールディングス	1,700	1,480.00	2,516,000
新日本科学	3,000	1,588.00	4,764,000
キャリアデザインセンター	600	1,200.00	720,000
ベネフィット・ワン	8,900	2,623.00	23,344,700
エムスリー	43,000	4,123.00	177,289,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,500	291.00	436,500
プラス	300	649.00	194,700
アウトソーシング	14,000	1,372.00	19,208,000
ウエルネット	2,500	437.00	1,092,500
ワールドホールディングス	1,000	2,062.00	2,062,000
ディー・エヌ・エー	9,300	1,710.00	15,903,000
博報堂DYホールディングス	33,900	1,604.00	54,375,600
ぐるなび	4,000	411.00	1,644,000
タカミヤ	3,000	386.00	1,158,000

ジャパンベストレスキューシステム	1,600	968.00	1,548,800
ファンコミュニケーションズ	6,100	382.00	2,330,200
ライク	800	1,835.00	1,468,000
ビジネス・ブレイクスルー	900	429.00	386,100
エスプール	6,900	1,017.00	7,017,300
WDBホールディングス	1,100	2,772.00	3,049,200
手間いらず	400	4,730.00	1,892,000
ティア	1,400	435.00	609,000
CDG	300	1,357.00	407,100
アドウェイズ	3,600	677.00	2,437,200
バリューコマース	1,900	3,490.00	6,631,000
インフォマート	26,700	595.00	15,886,500
J Pホールディングス	6,200	233.00	1,444,600
エコナックホールディングス	4,300	88.00	378,400
CLホールディングス	500	1,111.00	555,500
プレステージ・インターナショナル	9,100	717.00	6,524,700
アミューズ	1,300	2,107.00	2,739,100
ドリームインキュベータ	700	2,533.00	1,773,100
クイック	1,700	1,624.00	2,760,800
TAC	1,300	220.00	286,000
電通グループ	25,100	4,620.00	115,962,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,100	1,236.00	1,359,600
ぴあ	900	3,395.00	3,055,500
イオンファンタジー	900	2,154.00	1,938,600
シーティーエス	2,700	808.00	2,181,600
ネクシィーズグループ	900	665.00	598,500
H. U. グループホールディングス	6,400	2,995.00	19,168,000
アルプス技研	2,200	1,972.00	4,338,400
サニックス	4,200	196.00	823,200
ダイオーズ	500	1,007.00	503,500
日本空調サービス	2,600	787.00	2,046,200
オリエンタルランド	28,800	21,830.00	628,704,000
ダスキン	5,700	2,757.00	15,714,900
明光ネットワークジャパン	2,900	569.00	1,650,100
ファルコホールディングス	1,200	2,007.00	2,408,400
秀英予備校	500	430.00	215,000

田谷	400	555.00	222,000
ラウンドワン	6,800	1,487.00	10,111,600
リゾートトラスト	11,200	1,949.00	21,828,800
ビー・エム・エル	3,100	3,555.00	11,020,500
りらいあコミュニケーションズ	3,600	1,074.00	3,866,400
リソー教育	11,100	404.00	4,484,400
早稲田アカデミー	1,400	1,008.00	1,411,200
ユー・エス・エス	27,300	1,932.00	52,743,600
東京個別指導学院	2,100	620.00	1,302,000
サイバーエージェント	60,100	1,522.00	91,472,200
楽天グループ	125,300	981.00	122,919,300
クリーク・アンド・リバー社	1,300	1,718.00	2,233,400
モーニングスター	4,300	544.00	2,339,200
デー・オー・ダブリュー	4,600	291.00	1,338,600
山田コンサルティンググループ	1,300	1,144.00	1,487,200
セントラルスポーツ	900	2,409.00	2,168,100
フルキャストホールディングス	2,100	2,163.00	4,542,300
エン・ジャパン	3,900	2,875.00	11,212,500
リソルホールディングス	300	4,325.00	1,297,500
テクノプロ・ホールディングス	14,600	3,295.00	48,107,000
アトラグループ	500	261.00	130,500
インターワークス	700	371.00	259,700
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	3,940.00	4,334,000
K e e P e r 技研	1,600	2,066.00	3,305,600
ファーストロジック	500	791.00	395,500
三機サービス	400	1,006.00	402,400
G u n o s y	1,300	753.00	978,900
デザインワン・ジャパン	500	188.00	94,000
イー・ガーディアン	1,000	2,602.00	2,602,000
リブセンス	1,300	161.00	209,300
ジャパンマテリアル	7,500	1,704.00	12,780,000
ベクトル	3,400	1,061.00	3,607,400
ウチヤマホールディングス	1,200	327.00	392,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,800	1,069.00	1,924,200
キャリアリンク	900	1,560.00	1,404,000
I B J	2,000	802.00	1,604,000

アサンテ	1,100	1,590.00	1,749,000
バリューHR	1,000	2,528.00	2,528,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,000	5,080.00	10,160,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	900	1,375.00	1,237,500
ERIホールディングス	700	1,127.00	788,900
アビスト	400	2,911.00	1,164,400
シグマクシス・ホールディングス	1,500	2,090.00	3,135,000
ウィルグループ	1,800	1,214.00	2,185,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,200	192.00	614,400
メドピア	1,900	2,631.00	4,998,900
レアジョブ	500	812.00	406,000
リクルートホールディングス	188,000	5,046.00	948,648,000
エラン	3,400	992.00	3,372,800
土木管理総合試験所	1,100	319.00	350,900
ネットマーケティング	1,200	408.00	489,600
日本郵政	318,300	981.00	312,252,300
ベルシステム24ホールディングス	3,500	1,403.00	4,910,500
鎌倉新書	2,800	515.00	1,442,000
SMN	500	591.00	295,500
一蔵	300	375.00	112,500
グローバルキッズCOMPANY	400	794.00	317,600
エアトリ	1,600	3,355.00	5,368,000
アトラエ	1,700	2,110.00	3,587,000
ストライク	900	4,365.00	3,928,500
ソラスト	6,000	1,025.00	6,150,000
セラク	800	1,188.00	950,400
インソース	2,400	1,880.00	4,512,000
ベイクレント・コンサルティング	1,700	40,600.00	69,020,000
Orchestra Holdings	500	2,877.00	1,438,500
アイモバイル	700	1,205.00	843,500
キャリアインデックス	800	735.00	588,000
MS-Japan	1,000	863.00	863,000
船場	500	756.00	378,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	1,581.00	12,173,700
フルテック	300	1,330.00	399,000

グリーンズ	900	500.00	450,000
ツナググループ・ホールディングス	500	279.00	139,500
GameWith	700	438.00	306,600
ソウルドアウト	600	1,804.00	1,082,400
MS&Consulting	400	695.00	278,000
ウェルビー	1,600	1,155.00	1,848,000
エル・ティー・エス	300	1,970.00	591,000
ミダックホールディングス	1,100	2,429.00	2,671,900
日総工産	1,900	806.00	1,531,400
キュービーネットホールディングス	1,100	1,705.00	1,875,500
RPAホールディングス	3,400	354.00	1,203,600
スプリックス	700	1,499.00	1,049,300
マネジメントソリューションズ	1,200	3,315.00	3,978,000
プロレド・パートナーズ	500	807.00	403,500
and factory	500	396.00	198,000
テノ.ホールディングス	300	556.00	166,800
フロンティア・マネジメント	600	818.00	490,800
ピアラ	400	541.00	216,400
コプロ・ホールディングス	500	1,071.00	535,500
ギークス	400	1,183.00	473,200
カーブスホールディングス	6,700	701.00	4,696,700
フォーラムエンジニアリング	1,700	862.00	1,465,400
Fast Fitness Japan	300	1,928.00	578,400
ダイレクトマーケティングミックス	2,800	1,511.00	4,230,800
ポピンズホールディングス	600	2,427.00	1,456,200
LITALICO	2,000	3,200.00	6,400,000
アドバンテッジリスクマネジメント	1,200	673.00	807,600
リログループ	13,300	1,846.00	24,551,800
東祥	1,800	1,699.00	3,058,200
TREホールディングス	3,300	1,437.00	4,742,100
人・夢・技術グループ	1,000	1,766.00	1,766,000
エイチ・アイ・エス	5,400	2,060.00	11,124,000
ラックランド	700	2,790.00	1,953,000
共立メンテナンス	4,300	4,335.00	18,640,500
イチネンホールディングス	2,500	1,297.00	3,242,500
建設技術研究所	1,500	2,320.00	3,480,000

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	57,290,704,264円
期中追加設定元本額	20,328,469,205円
期中一部解約元本額	15,622,001,704円
期末元本額	61,997,171,765円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,420,066,831円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,023,352,105円
りそなラップ型ファンド(成長型)	6,668,233,170円
DCりそな グローバルバランス	24,636,473円
つみたてバランスファンド	1,960,625,973円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,779,812,528円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	1,027,172,516円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	688,455,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	244,682,551円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	151,868,218円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	81,041,281円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	143,004,688円

リスクコントロール・オープン	45,783,915 円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	301,550,642 円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	160,219,140 円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	26,057,073,032 円
Sm a r t e r i 先進国株式インデックス	8,193,280,692 円
Sm a r t e r i 8資産バランス 安定型	338,807,504 円
Sm a r t e r i 8資産バランス 安定成長型	921,885,996 円
Sm a r t e r i 8資産バランス 成長型	1,078,777,566 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	466,004,851 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	676,679,497 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	413,063,613 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	265,898,936 円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	859,341,759 円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	146,506,289 円
グローバル9資産バランスファンド (適格機関投資家限定)	5,252,164 円
りそなFT 先進国株式インデックス (適格機関投資家専用)	304,799,012 円
りそなDAAファンド (適格機関投資家専用)	479,735,460 円
りそなFT RCバランスファンド (適格機関投資家専用)	646,476,859 円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定型) (適格機関投資家専用)	940,392 円
りそなVIグローバル・バランスファンド (安定成長型) (適格機関投資家専用)	23,388,962 円
りそなVIグローバル・バランスファンド (成長型) (適格機関投資家専用)	21,070,558 円
りそなDAAマルチアセットファンド (適格機関投資家専用)	377,683,324 円
2. 計算日における受益権の総数	61,997,171,765 口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9750 円
(10,000口当たり純資産額)	(19,750 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在
該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2022年2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	494,579,586	
投資証券	△95,099,125	
合計	399,480,461	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		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	13,112,682,391	-	12,534,416,604	△578,265,787
合計		13,112,682,391	-	12,534,416,604	△578,265,787

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		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	413,704,954	—	413,730,856	25,902
	米ドル	288,523,500	—	288,539,250	15,750
	カナダドル	9,066,770	—	9,067,570	800
	ユーロ	80,943,604	—	80,949,184	5,580
	英ポンド	20,308,210	—	20,310,082	1,872
	スイスフラン	6,246,640	—	6,247,270	630
	スウェーデンクローナ	4,918,480	—	4,920,000	1,520
	香港ドル	3,697,750	—	3,697,500	△250
	売建	109,848,713	—	109,749,229	99,484
	米ドル	80,794,000	—	80,793,020	980
	ユーロ	18,880,848	—	18,800,798	80,050
	英ポンド	10,173,865	—	10,155,411	18,454
	合計	523,553,667	—	523,480,085	125,386

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	15,178	28.54	433,180.12	
	CHENIERE ENERGY INC	4,215	116.89	492,691.35	
	CHEVRON CORP	34,119	136.67	4,663,043.73	
	CONOCOPHILLIPS	23,383	91.55	2,140,713.65	
	COTERRA ENERGY INC	14,095	23.23	327,426.85	
	DEVON ENERGY CORP	11,449	52.26	598,324.74	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,151	130.47	411,110.97	
	EOG RESOURCES INC	10,144	113.41	1,150,431.04	
	EXXON MOBIL CORP	74,640	78.98	5,895,067.20	
	HALLIBURTON CO	15,912	32.36	514,912.32	
	HESS CORP	5,183	94.73	490,985.59	
	KINDER MORGAN INC	35,520	17.19	610,588.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,357	79.16	899,020.12	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	41.23	681,366.98	
	ONEOK INC	7,921	62.92	498,389.32	
	PHILLIPS 66	7,637	90.52	691,301.24	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,195	224.05	939,889.75	
	SCHLUMBERGER LTD	24,328	39.30	956,090.40	
	VALERO ENERGY CORP	6,797	89.72	609,826.84	
	WILLIAMS COS INC	21,953	30.08	660,346.24	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,913	243.49	952,776.37	
	ALBEMARLE CORP	2,101	227.68	478,355.68	
	AMCOR PLC	30,404	11.57	351,774.28	
	AVERY DENNISON CORP	1,524	181.78	277,032.72	
	BALL CORP	5,635	92.28	519,997.80	
	CELANESE CORP	1,759	154.17	271,185.03	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,978	71.46	284,267.88		
CORTEVA INC	12,364	50.90	629,327.60		
CROWN HOLDINGS INC	2,078	118.36	245,952.08		
DOW INC	12,848	60.83	781,543.84		

DUPONT DE NEMOURS INC	9,146	79.32	725,460.72
EASTMAN CHEMICAL CO	2,692	120.69	324,897.48
ECOLAB INC	4,554	182.91	832,972.14
FMC CORP	2,253	115.75	260,784.75
FREEPORT-MCMORAN INC	26,009	42.45	1,104,082.05
INTERNATIONAL PAPER CO	6,946	46.23	321,113.58
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	131.61	567,370.71
LINDE PLC	8,974	293.51	2,633,958.74
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	100.15	448,772.15
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,158	369.05	427,359.90
MOSAIC CO/THE	5,552	44.62	247,730.24
NEWMONT CORP	13,779	64.35	886,678.65
NUCOR CORP	5,308	117.35	622,893.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,870	147.02	274,927.40
PPG INDUSTRIES INC	4,073	149.27	607,976.71
RPM INTERNATIONAL INC	2,344	84.54	198,161.76
SEALED AIR CORP	2,628	63.31	166,378.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,380	270.48	1,184,702.40
STEEL DYNAMICS INC	3,569	61.61	219,886.09
VULCAN MATERIALS CO	2,241	183.89	412,097.49
WESTROCK CO	5,361	45.79	245,480.19
3M CO	10,000	158.01	1,580,100.00
ALLEGION PLC	1,523	118.33	180,216.59
AMETEK INC	3,972	130.16	516,995.52
BOEING CO/THE	9,870	210.04	2,073,094.80
CARRIER GLOBAL CORP	14,219	44.79	636,869.01
CATERPILLAR INC	9,706	199.89	1,940,132.34
CUMMINS INC	2,516	219.44	552,111.04
DEERE & CO	5,137	387.26	1,989,354.62
DOVER CORP	2,606	161.16	419,982.96
EATON CORP PLC	7,026	152.17	1,069,146.42
EMERSON ELECTRIC CO	10,598	93.97	995,894.06
FASTENAL CO	9,880	51.92	512,969.60
FORTIVE CORP	5,995	65.05	389,974.75
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2,548	89.24	227,383.52
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	270.45	303,985.80

GENERAL DYNAMICS CORP	4,138	211.17	873,821.46
GENERAL ELECTRIC CO	19,463	96.60	1,880,125.80
HEICO CORP	647	139.08	89,984.76
HEICO CORP-CLASS A	1,342	114.44	153,578.48
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,986	186.69	2,237,666.34
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	34.07	199,445.78
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	181.26	109,481.04
IDEX CORP	1,396	191.68	267,585.28
ILLINOIS TOOL WORKS	5,557	219.17	1,217,927.69
INGERSOLL-RAND INC	6,884	53.80	370,359.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	60.23	246,943.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	12,349	66.50	821,208.50
KORNIT DIGITAL LTD	899	98.31	88,380.69
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,531	219.82	776,184.42
LENNOX INTERNATIONAL INC	728	262.75	191,282.00
LOCKHEED MARTIN CORP	4,314	386.97	1,669,388.58
MASCO CORP	4,315	57.25	247,033.75
NORDSON CORP	961	222.11	213,447.71
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,635	390.60	1,029,231.00
OTIS WORLDWIDE CORP	7,016	79.75	559,526.00
OWENS CORNING	1,611	90.47	145,747.17
PACCAR INC	5,970	92.98	555,090.60
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	301.14	676,661.58
PENTAIR PLC	2,913	58.96	171,750.48
PLUG POWER INC	8,433	21.47	181,056.51
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	26,144	93.57	2,446,294.08
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,998	268.37	536,203.26
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,875	442.19	829,106.25
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	56.72	181,220.40
SMITH (A. O.) CORP	2,718	71.23	193,603.14
SNAP-ON INC	1,158	210.71	244,002.18
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	164.33	466,532.87
SUNRUN INC	2,890	22.60	65,314.00
TEXTRON INC	4,227	68.56	289,803.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,119	151.45	623,822.55
TRANSDIGM GROUP INC	898	630.74	566,404.52

UNITED RENTALS INC	1,210	313.25	379,032.50
WABTEC CORP	3,299	87.48	288,596.52
WW GRAINGER INC	813	466.39	379,175.07
XYLEM INC	3,290	89.26	293,665.40
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	74.33	181,365.20
CINTAS CORP	1,623	370.50	601,321.50
CLARIVATE PLC	5,086	16.46	83,715.56
COPART INC	3,654	122.73	448,455.42
COSTAR GROUP INC	6,783	65.99	447,610.17
EQUIFAX INC	2,089	220.98	461,627.22
IHS MARKIT LTD	6,841	107.80	737,459.80
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,482	120.67	299,502.94
LEIDOS HOLDINGS INC	2,533	87.36	221,282.88
REPUBLIC SERVICES INC	3,830	118.57	454,123.10
ROBERT HALF INTL INC	2,316	119.58	276,947.28
ROLLINS INC	3,021	30.84	93,167.64
TRANSUNION	3,373	100.58	339,256.34
VERISK ANALYTICS INC	2,643	191.81	506,953.83
WASTE CONNECTIONS INC	4,493	119.41	536,509.13
WASTE MANAGEMENT INC	7,500	141.77	1,063,275.00
AMERCO	179	577.19	103,317.01
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	89.21	205,539.84
CSX CORP	39,064	33.92	1,325,050.88
DELTA AIR LINES INC	2,928	41.97	122,888.16
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	107.01	329,162.76
FEDEX CORP	4,433	228.46	1,012,763.18
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,685	192.49	324,345.65
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	54.97	135,226.20
LYFT INC-A	4,003	39.99	160,079.97
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,300	272.27	1,170,761.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,802	293.95	529,697.90
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	45.38	100,062.90
UBER TECHNOLOGIES INC	21,623	34.59	747,939.57
UNION PACIFIC CORP	11,446	242.55	2,776,227.30
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	12,875	213.99	2,755,121.25
APTIV PLC	4,894	136.60	668,520.40

BORGWARNER INC	3,548	42.76	151,712.48
FORD MOTOR CO	70,192	17.46	1,225,552.32
GENERAL MOTORS CO	23,162	48.40	1,121,040.80
LEAR CORP	1,094	167.24	182,960.56
LUCID GROUP INC	7,369	27.44	202,205.36
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	3,143	62.65	196,908.95
TESLA INC	14,795	875.76	12,956,869.20
DR HORTON INC	5,990	82.95	496,870.50
GARMIN LTD	2,605	120.76	314,579.80
HASBRO INC	2,664	94.56	251,907.84
LENNAR CORP-A	4,830	90.59	437,549.70
LULULEMON ATHLETICA INC	2,154	313.64	675,580.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	143.82	131,739.12
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	24.92	137,907.28
NIKE INC -CL B	22,578	141.59	3,196,819.02
NVR INC	54	4,977.94	268,808.76
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,483	32.83	147,176.89
PULTEGROUP INC	4,833	47.82	231,114.06
VF CORP	5,597	59.89	335,204.33
WHIRLPOOL CORP	966	196.62	189,934.92
AIRBNB INC-CLASS A	4,238	169.66	719,019.08
ARAMARK	4,618	35.98	166,155.64
BOOKING HOLDINGS INC	729	2,545.66	1,855,786.14
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,570	81.23	289,991.10
CARNIVAL CORP	14,286	21.36	305,148.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	484	1,563.95	756,951.80
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	143.42	341,769.86
DOMINO'S PIZZA INC	663	430.71	285,560.73
DRAFTKINGS INC - CL A	5,981	22.20	132,778.20
EXPEDIA GROUP INC	2,522	197.17	497,262.74
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,781	151.43	723,986.83
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	46.21	236,826.25
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,754	171.33	814,502.82
MCDONALD'S CORP	13,188	253.39	3,341,707.32
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	10.86	39,096.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	44.65	313,755.55

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,914	82.75	323,883.50
STARBUCKS CORP	20,869	93.65	1,954,381.85
VAIL RESORTS INC	810	271.44	219,866.40
WYNN RESORTS LTD	1,490	92.06	137,169.40
YUM! BRANDS INC	5,112	121.40	620,596.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,734	81.50	1,119,321.00
ALPHABET INC-CL A	5,291	2,710.52	14,341,361.32
ALPHABET INC-CL C	5,064	2,706.00	13,703,184.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	9,418	17.75	167,169.50
CABLE ONE INC	110	1,500.72	165,079.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,285	607.94	1,389,142.90
COMCAST CORP-CLASS A	80,609	47.40	3,820,866.60
DISCOVERY INC - A	1,722	29.42	50,661.24
DISCOVERY INC-C	5,617	29.33	164,746.61
DISH NETWORK CORP-A	3,674	30.97	113,783.78
ELECTRONIC ARTS INC	4,991	133.40	665,799.40
FOX CORP - CLASS A	6,194	42.67	264,297.98
FOX CORP- CLASS B	1,836	38.75	71,145.00
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	131.68	148,271.68
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	35.08	206,059.92
LIBERTY BROADBAND-A	223	149.21	33,273.83
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	152.03	407,288.37
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	62.29	243,927.64
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,025	50.59	153,034.75
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	50.66	47,924.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,942	115.27	339,124.34
MATCH GROUP INC	4,456	113.78	507,003.68
META PLATFORMS INC	41,897	217.70	9,120,976.90
NETFLIX INC	7,787	396.57	3,088,090.59
NEWS CORP - CLASS A	5,861	22.28	130,583.08
OMNICOM GROUP	3,237	84.74	274,303.38
PINTEREST INC- CLASS A	9,515	24.71	235,115.65
ROKU INC	2,074	159.02	329,807.48
SEA LTD-ADR	2,474	129.17	319,566.58
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.17	64,087.79
SNAP INC - A	18,792	39.62	744,539.04

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,134	167.07	356,527.38
TWITTER INC	13,838	35.69	493,878.22
VIACOMCBS INC - CLASS B	10,543	35.03	369,321.29
WALT DISNEY CO/THE	31,972	150.85	4,822,976.20
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	4,026	55.35	222,839.10
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	224.28	210,150.36
AMAZON.COM INC	8,010	3,103.34	24,857,753.40
AUTOZONE INC	373	1,924.60	717,875.80
BATH & BODY WORKS INC	4,700	55.03	258,641.00
BEST BUY CO INC	3,865	100.64	388,973.60
BURLINGTON STORES INC	1,107	224.59	248,621.13
CARMAX INC	2,885	110.96	320,119.60
CARVANA CO	1,380	140.63	194,069.40
CHEWY INC - CLASS A	1,090	52.63	57,366.70
DOLLAR GENERAL CORP	4,065	200.61	815,479.65
DOLLAR TREE INC	3,916	136.96	536,335.36
DOORDASH INC - A	1,947	97.11	189,073.17
EBAY INC	11,722	58.18	681,985.96
ETSY INC	2,268	142.65	323,530.20
FIVERR INTERNATIONAL LTD	506	82.20	41,593.20
GENUINE PARTS CO	2,564	127.06	325,781.84
HOME DEPOT INC	18,570	351.56	6,528,469.20
LKQ CORP	4,394	53.77	236,265.38
LOWE'S COS INC	12,194	225.95	2,755,234.30
MERCADOLIBRE INC	773	1,119.01	864,994.73
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,200	661.04	793,248.00
POOL CORP	783	450.94	353,086.02
ROSS STORES INC	6,131	94.27	577,969.37
TARGET CORP	8,531	208.57	1,779,310.67
TJX COMPANIES INC	20,783	67.99	1,413,036.17
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,120	217.93	462,011.60
ULTA BEAUTY INC	950	362.65	344,517.50
WAYFAIR INC- CLASS A	1,439	142.21	204,640.19
COSTCO WHOLESALE CORP	7,811	506.56	3,956,740.16
KROGER CO	13,182	45.69	602,285.58
SYSCO CORP	8,818	81.99	722,987.82

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,659	47.36	599,530.24
WALMART INC	27,244	133.95	3,649,333.80
ALTRIA GROUP INC	32,118	50.09	1,608,790.62
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,767	76.12	743,464.04
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	66.37	350,566.34
BUNGE LTD	2,145	100.83	216,280.35
CAMPBELL SOUP CO	3,976	44.03	175,063.28
COCA-COLA CO/THE	72,416	60.68	4,394,202.88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,239	56.98	241,538.22
CONAGRA BRANDS INC	8,705	35.30	307,286.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,972	233.85	695,002.20
GENERAL MILLS INC	10,536	67.63	712,549.68
HERSHEY CO/THE	2,482	203.35	504,714.70
HORMEL FOODS CORP	4,355	47.46	206,688.30
JM SMUCKER CO/THE	1,878	137.43	258,093.54
KELLOGG CO	4,596	64.75	297,591.00
KEURIG DR PEPPER INC	13,149	38.10	500,976.90
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	34.59	393,322.89
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	100.40	428,005.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	49.41	138,100.95
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	24,384	66.14	1,612,757.76
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	82.57	562,549.41
PEPSICO INC	24,388	166.70	4,065,479.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	27,578	109.24	3,012,620.72
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	94.88	479,049.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	97.57	408,428.02
CLOROX COMPANY	2,061	142.95	294,619.95
COLGATE-PALMOLIVE CO	13,947	79.26	1,105,439.22
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,027	303.85	1,223,603.95
KIMBERLY-CLARK CORP	5,879	132.37	778,203.23
PROCTER & GAMBLE CO/THE	42,835	156.74	6,713,957.90
ABBOTT LABORATORIES	31,273	122.78	3,839,698.94
ABIOMED INC	756	290.43	219,565.08
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,331	505.67	673,046.77
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,590	140.18	363,066.20
ANTHEM INC	4,202	443.97	1,865,561.94

BAXTER INTERNATIONAL INC	8,563	85.45	731,708.35
BECTON DICKINSON AND CO	5,101	268.90	1,371,658.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	25,011	42.73	1,068,720.03
CARDINAL HEALTH INC	4,308	52.29	225,265.32
CENTENE CORP	9,908	82.01	812,555.08
CERNER CORP	5,093	91.66	466,824.38
CIGNA CORP	5,878	225.24	1,323,960.72
COOPER COS INC/THE	912	391.35	356,911.20
CVS HEALTH CORP	23,358	103.00	2,405,874.00
DAVITA INC	1,175	113.65	133,538.75
DENTSPLY SIRONA INC	3,748	53.54	200,667.92
DEXCOM INC	1,652	407.00	672,364.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,093	107.73	1,195,048.89
HCA HEALTHCARE INC	4,736	235.42	1,114,949.12
HENRY SCHEIN INC	2,103	75.79	159,386.37
HOLOGIC INC	4,309	70.31	302,965.79
HUMANA INC	2,285	419.64	958,877.40
IDEXX LABORATORIES INC	1,506	505.53	761,328.18
INMODE LTD	975	45.60	44,460.00
INSULET CORP	1,229	245.56	301,793.24
INTUITIVE SURGICAL INC	6,319	281.14	1,776,523.66
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	272.68	440,378.20
MASIMO CORP	1,017	224.59	228,408.03
MCKESSON CORP	2,622	270.67	709,696.74
MEDTRONIC PLC	23,778	102.31	2,432,727.18
MOLINA HEALTHCARE INC	1,137	307.51	349,638.87
NOVOCURE LTD	1,677	78.88	132,281.76
OAK STREET HEALTH INC	1,457	17.03	24,812.71
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,197	130.29	286,247.13
RESMED INC	2,476	233.62	578,443.12
STERIS PLC	1,666	226.55	377,432.30
STRYKER CORP	6,026	250.45	1,509,211.70
TELADOC HEALTH INC	2,707	70.84	191,763.88
TELEFLEX INC	849	317.34	269,421.66
UNITEDHEALTH GROUP INC	16,600	474.40	7,875,040.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,562	132.22	206,527.64

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,458	227.93	560,251.94
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,535	116.99	413,559.65
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	89.42	116,871.94
ABBVIE INC	31,180	143.00	4,458,740.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,278	135.21	713,638.38
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,148	148.66	319,321.68
AMGEN INC	9,935	224.27	2,228,122.45
AVANTOR INC	8,797	35.36	311,061.92
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	620.98	232,867.50
BIO-TECHNE CORP	759	413.64	313,952.76
BIOGEN INC	2,609	214.12	558,639.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,350	90.01	301,533.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	38,624	66.81	2,580,469.44
CATALENT INC	2,865	98.97	283,549.05
CHARLES RIVER LABORATORIES	981	327.44	321,218.64
DANAHER CORP	11,338	271.50	3,078,267.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	25.13	190,686.44
ELI LILLY & CO	14,345	234.69	3,366,628.05
EXACT SCIENCES CORP	3,021	78.33	236,634.93
GILEAD SCIENCES INC	21,697	61.11	1,325,903.67
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,710	96.49	357,977.90
ILLUMINA INC	2,556	329.45	842,074.20
INCYTE CORP	3,430	66.02	226,448.60
IQVIA HOLDINGS INC	3,320	239.90	796,468.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	142.31	107,159.43
JOHNSON & JOHNSON	46,343	165.60	7,674,400.80
MERCK & CO. INC.	44,664	76.47	3,415,456.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	404	1,416.12	572,112.48
MODERNA INC	5,902	142.47	840,857.94
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,875	86.52	162,225.00
NOVAVAX INC	1,081	80.11	86,598.91
PERKINELMER INC	2,057	181.13	372,584.41
PFIZER INC	98,807	49.80	4,920,588.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,831	623.53	1,141,683.43
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,242	39.11	244,124.62
SEAGEN INC	2,365	124.51	294,466.15

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	8.52	178,425.84
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,937	561.19	3,892,975.03
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,485	231.23	1,037,066.55
VIATRIS INC	22,098	15.03	332,132.94
WATERS CORP	1,044	318.05	332,044.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,251	383.68	479,983.68
ZOETIS INC	8,212	196.43	1,613,083.16
BANK OF AMERICA CORP	133,213	47.42	6,316,960.46
CITIGROUP INC	35,708	66.46	2,373,153.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	53.66	402,503.66
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	48.23	599,740.05
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	210	770.00	161,700.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,042	171.77	522,524.34
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.70	408,733.80
JPMORGAN CHASE & CO	52,598	152.49	8,020,669.02
KEYCORP	17,095	25.91	442,931.45
M & T BANK CORP	2,483	180.41	447,958.03
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,340	204.57	1,501,543.80
REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	24.52	415,638.52
SIGNATURE BANK	1,113	331.37	368,814.81
SVB FINANCIAL GROUP	1,055	621.53	655,714.15
TRUIST FINANCIAL CORP	23,236	63.00	1,463,868.00
US BANCORP	24,451	57.87	1,414,979.37
WEBSTER FINANCIAL CORP	3,156	61.16	193,020.96
WELLS FARGO & CO	72,485	57.85	4,193,257.25
ALLY FINANCIAL INC	6,403	48.34	309,521.02
AMERICAN EXPRESS CO	11,793	192.35	2,268,383.55
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	300.95	624,772.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,244	65.63	344,163.72
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14,390	61.47	884,553.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	23,341	314.28	7,335,609.48
BLACKROCK INC	2,692	760.31	2,046,754.52
BLACKSTONE INC	12,166	121.20	1,474,519.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,945	155.14	1,232,587.30
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	46.77	126,279.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	120.58	235,854.48

CME GROUP INC	6,339	239.17	1,516,098.63
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	691	195.25	134,917.75
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,266	124.16	653,826.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	33.94	189,996.12
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	749	400.03	299,622.47
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	30.40	138,715.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	44.12	35,296.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,868	360.24	2,113,888.32
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,958	124.84	1,243,156.72
INVESCO LTD	5,927	22.82	135,254.14
KKR & CO INC	9,044	60.57	547,795.08
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	370.33	256,638.69
MOODY'S CORP	2,986	323.47	965,881.42
MORGAN STANLEY	24,101	102.57	2,472,039.57
MSCI INC	1,424	532.97	758,949.28
NASDAQ INC	2,170	171.93	373,088.10
NORTHERN TRUST CORP	3,716	121.51	451,531.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,393	109.48	371,465.64
ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,321	13.35	44,335.35
S&P GLOBAL INC	4,271	380.71	1,626,012.41
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,625	87.74	2,248,337.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	59.40	103,118.40
SOFI TECHNOLOGIES INC	9,460	12.00	113,520.00
STATE STREET CORP	6,599	98.68	651,189.32
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	44.03	429,644.74
T ROWE PRICE GROUP INC	3,918	144.14	564,740.52
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	82.44	126,133.20
UPSTART HOLDINGS INC	356	104.60	37,237.60
AFLAC INC	11,207	64.22	719,713.54
ALLEGHANY CORP	197	672.20	132,423.40
ALLSTATE CORP	5,193	124.80	648,086.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,465	135.82	198,976.30
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,874	58.99	877,417.26
AON PLC	3,988	279.88	1,116,161.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	46.42	283,208.42
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,581	153.35	549,146.35

ASSURANT INC	896	161.99	145,143.04
BROWN & BROWN INC	4,086	65.98	269,594.28
CHUBB LTD	7,783	202.07	1,572,710.81
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,800	119.48	334,544.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	183.58	70,127.56
EVEREST RE GROUP LTD	734	293.12	215,150.08
FNF GROUP	4,754	47.80	227,241.20
GLOBE LIFE INC	1,521	104.03	158,229.63
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	69.66	455,855.04
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	70.94	237,010.54
LOEWS CORP	3,999	61.13	244,458.87
MARKEL CORP	251	1,235.50	310,110.50
MARSH & MCLENNAN COS	8,802	151.71	1,335,351.42
METLIFE INC	12,898	70.13	904,536.74
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	74.19	370,504.86
PROGRESSIVE CORP	10,386	106.21	1,103,097.06
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,833	115.80	791,261.40
TRAVELERS COS INC/THE	4,363	170.77	745,069.51
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	218.86	472,299.88
WR BERKLEY CORP	2,140	89.49	191,508.60
CBRE GROUP INC - A	5,718	98.21	561,564.78
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	5.71	114,771.00
ZILLOW GROUP INC - A	904	57.35	51,844.40
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	58.07	156,440.58
ACCENTURE PLC-CL A	11,199	326.13	3,652,329.87
ADOBE INC	8,401	474.01	3,982,158.01
AFFIRM HOLDINGS INC	1,615	43.70	70,575.50
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	110.65	320,885.00
ANSYS INC	1,507	317.12	477,899.84
ASANA INC - CL A	1,233	68.66	84,657.78
AUTODESK INC	3,802	226.90	862,673.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,352	201.98	1,484,956.96
AVALARA INC	1,520	99.26	150,875.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	39.03	101,126.73
BILL.COM HOLDINGS INC	1,382	240.00	331,680.00
BLACK KNIGHT INC	3,383	65.53	221,687.99

BLOCK INC	8,884	111.64	991,809.76
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,131	144.84	308,654.04
CADENCE DESIGN SYS INC	4,809	142.08	683,262.72
CERIDIAN HCM HOLDING INC	2,496	69.95	174,595.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	129.68	215,787.52
CITRIX SYSTEMS INC	2,191	101.96	223,394.36
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,172	105.56	440,396.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9,115	86.24	786,077.60
COUPA SOFTWARE INC	1,218	130.64	159,119.52
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,333	180.60	601,939.80
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	798	153.18	122,237.64
DATADOG INC - CLASS A	3,490	164.35	573,581.50
DOCUSIGN INC	3,419	120.78	412,946.82
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	24.39	130,047.48
DYNATRACE INC	3,655	42.72	156,141.60
EPAM SYSTEMS INC	975	427.95	417,251.25
FAIR ISAAC CORP	571	512.40	292,580.40
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,714	111.50	1,194,611.00
FISERV INC	10,369	97.89	1,015,021.41
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	244.69	345,012.90
FORTINET INC	2,399	310.35	744,529.65
GARTNER INC	1,494	288.58	431,138.52
GLOBAL PAYMENTS INC	5,102	146.96	749,789.92
GODADDY INC - CLASS A	3,327	80.37	267,390.99
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,578	94.47	149,073.66
HUBSPOT INC	774	545.89	422,518.86
INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,931	130.15	2,073,419.65
INTUIT INC	4,832	529.05	2,556,369.60
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	170.18	218,511.12
MASTERCARD INC-CLASS A	15,539	374.16	5,814,072.24
MICROSOFT CORP	125,468	295.00	37,013,060.00
MONGODB INC	966	429.93	415,312.38
NORTONLIFELOCK INC	8,787	29.48	259,040.76
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,530	55.25	305,532.50
OKTA INC	2,109	189.41	399,465.69
ORACLE CORP	29,659	78.95	2,341,578.05

PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,325	13.26	362,329.50
PALO ALTO NETWORKS INC	1,683	521.02	876,876.66
PAYCHEX INC	5,606	118.48	664,198.88
PAYCOM SOFTWARE INC	910	345.72	314,605.20
PAYPAL HOLDINGS INC	19,724	114.12	2,250,902.88
PTC INC	1,603	111.91	179,391.73
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	168.16	213,563.20
SALESFORCE.COM INC	17,272	206.40	3,564,940.80
SERVICENOW INC	3,513	579.58	2,036,064.54
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,761	291.13	1,094,939.93
SPLUNK INC	2,723	124.97	340,293.31
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	75.14	310,027.64
SYNOPSYS INC	2,636	294.96	777,514.56
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,455	76.51	570,382.05
TWILIO INC - A	2,853	195.71	558,360.63
TYLER TECHNOLOGIES INC	748	467.28	349,525.44
UNITY SOFTWARE INC	839	107.59	90,268.01
VERISIGN INC	1,710	213.56	365,187.60
VISA INC-CLASS A SHARES	29,752	225.34	6,704,315.68
VMWARE INC-CLASS A	3,863	123.58	477,389.54
WESTERN UNION CO	5,513	19.80	109,157.40
WIX.COM LTD	998	112.62	112,394.76
WORKDAY INC-CLASS A	3,335	232.98	776,988.30
ZENDESK INC	2,234	116.39	260,015.26
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,674	142.09	522,038.66
ZSCALER INC	1,359	274.43	372,950.37
AMPHENOL CORP-CL A	10,315	75.31	776,822.65
APPLE INC	290,497	168.88	49,059,133.36
ARISTA NETWORKS INC	4,084	122.82	501,596.88
ARROW ELECTRONICS INC	1,337	124.57	166,550.09
CDW CORP/DE	2,596	176.10	457,155.60
CISCO SYSTEMS INC	74,415	53.18	3,957,389.70
COGNEX CORP	2,959	63.25	187,156.75
CORNING INC	14,801	41.29	611,133.29
DELL TECHNOLOGIES -C	5,156	58.60	302,141.60
F5 INC	916	193.80	177,520.80

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	24,541	16.87	414,006.67
HP INC	22,784	36.51	831,843.84
IPG PHOTONICS CORP	558	146.68	81,847.44
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	33.79	153,170.07
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	165.93	512,059.98
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,928	213.81	626,035.68
NETAPP INC	3,840	87.79	337,113.60
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,790	106.13	402,232.70
TE CONNECTIVITY LTD	5,700	143.53	818,121.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	803	416.94	334,802.82
TRIMBLE INC	4,462	65.85	293,822.70
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	52.86	271,964.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	426.42	398,276.28
AT&T INC	125,744	24.05	3,024,143.20
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	27.68	36,150.08
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	27.74	172,903.42
LUMEN TECHNOLOGIES INC	16,742	9.91	165,913.22
T-MOBILE US INC	10,801	125.51	1,355,633.51
VERIZON COMMUNICATIONS INC	72,878	53.27	3,882,211.06
AES CORP	13,306	21.46	285,546.76
ALLIANT ENERGY CORP	4,611	56.87	262,227.57
AMEREN CORPORATION	4,330	85.13	368,612.90
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,643	86.18	744,853.74
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,140	148.03	464,814.20
ATMOS ENERGY CORP	2,000	105.98	211,960.00
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	26.91	266,758.83
CMS ENERGY CORP	5,193	62.39	323,991.27
CONSOLIDATED EDISON INC	6,459	83.02	536,226.18
CONSTELLATION ENERGY	5,632	48.11	270,955.52
DOMINION ENERGY INC	14,281	78.75	1,124,628.75
DTE ENERGY COMPANY	3,309	116.05	384,009.45
DUKE ENERGY CORP	13,295	99.95	1,328,835.25
EDISON INTERNATIONAL	6,481	60.06	389,248.86
ENTERGY CORP	3,422	104.50	357,599.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	45.12	179,667.84
EVERGY INC	3,540	61.91	219,161.40

EVERSOURCE ENERGY	6,304	82.21	518,251.84
EXELON CORP	16,898	42.20	713,095.60
FIRSTENERGY CORP	10,241	40.74	417,218.34
NEXTERA ENERGY INC	34,688	74.92	2,598,824.96
NISOURCE INC	7,043	28.41	200,091.63
NRG ENERGY INC	5,306	38.68	205,236.08
P G & E CORP	27,434	11.28	309,455.52
PPL CORP	13,143	28.35	372,604.05
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,740	64.77	566,089.80
SEMPRA ENERGY	5,479	135.13	740,377.27
SOUTHERN CO/THE	18,300	65.85	1,205,055.00
UGI CORP	3,091	37.49	115,881.59
VISTRA CORP	9,405	21.60	203,148.00
WEC ENERGY GROUP INC	5,459	89.63	489,290.17
XCEL ENERGY INC	9,302	66.40	617,652.80
ADVANCED MICRO DEVICES	21,400	114.27	2,445,378.00
ANALOG DEVICES INC	9,295	153.98	1,431,244.10
APPLIED MATERIALS INC	15,855	131.86	2,090,640.30
BROADCOM INC	7,233	578.58	4,184,869.14
ENPHASE ENERGY INC	2,171	143.93	312,472.03
ENTEGRIS INC	2,468	126.04	311,066.72
INTEL CORP	71,561	47.58	3,404,872.38
KLA CORP	2,650	365.16	967,674.00
LAM RESEARCH CORP	2,465	558.25	1,376,086.25
MARVELL TECHNOLOGY INC	14,361	67.75	972,957.75
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,458	71.19	673,315.02
MICRON TECHNOLOGY INC	19,379	89.86	1,741,396.94
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	786	433.32	340,589.52
NVIDIA CORP	43,959	242.67	10,667,530.53
NXP SEMICONDUCTORS NV	4,766	185.88	885,904.08
ON SEMICONDUCTOR CORP	7,719	58.66	452,796.54
QORVO INC	2,035	129.31	263,145.85
QUALCOMM INC	19,896	165.13	3,285,426.48
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	134.73	364,175.19
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	952	249.22	237,257.44
TERADYNE INC	2,952	112.31	331,539.12

	TEXAS INSTRUMENTS INC	16,293	162.47	2,647,123.71
	XILINX INC	4,251	194.92	828,604.92
	米ドル 小計	5,552,650		679,259,050.15 (78,400,079,568)
カナダドル	CAMECO CORP	8,016	27.67	221,802.72
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	20,529	67.05	1,376,469.45
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	19.96	439,878.48
	ENBRIDGE INC	35,044	52.79	1,849,972.76
	IMPERIAL OIL LTD	4,737	56.27	266,550.99
	KEYERA CORP	5,630	31.04	174,755.20
	PARKLAND CORP	1,790	34.70	62,113.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,270	42.29	434,318.30
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	37.84	969,271.60
	TC ENERGY CORP	17,347	66.63	1,155,830.61
	TOURMALINE OIL CORP	6,019	46.26	278,438.94
	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,745	66.77	583,903.65
	BARRICK GOLD CORP	29,830	26.85	800,935.50
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	63.92	198,407.68
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,217	35.39	361,579.63
	FRANCO-NEVADA CORP	3,254	182.25	593,041.50
	IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	11.29	116,953.11
	KINROSS GOLD CORP	19,092	7.32	139,753.44
	LUNDIN MINING CORP	16,915	11.94	201,965.10
	NUTRIEN LTD	9,609	93.43	897,768.87
	PAN AMERICAN SILVER CORP	5,353	30.50	163,266.50
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	8,203	45.59	373,974.77
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,663	124.61	207,226.43
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	54.02	426,001.72
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	11.81	31,579.94
	CAE INC	5,971	31.78	189,758.38
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	113.59	160,843.44
	WSP GLOBAL INC	1,908	161.91	308,924.28
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	38.26	119,945.10
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	73.08	132,201.72
	THOMSON REUTERS CORP	2,939	129.58	380,835.62
	AIR CANADA	840	24.24	20,361.60

CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,196	156.43	1,907,820.28
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,106	91.61	1,475,470.66
TFI INTERNATIONAL INC	1,624	135.98	220,831.52
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	97.55	527,647.95
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	49.27	186,634.76
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	72.69	385,184.31
QUEBECOR INC -CL B	4,598	30.77	141,480.46
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	37.64	327,543.28
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	181.48	169,320.84
DOLLARAMA INC	5,287	63.71	336,834.77
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	14,242	52.65	749,841.30
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	39.04	102,597.12
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	100.75	326,732.25
METRO INC	4,307	67.42	290,377.94
WESTON (GEORGE) LTD	1,578	139.67	220,399.26
SAPUTO INC	3,667	29.74	109,056.58
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	31.53	193,531.14
CANOPY GROWTH CORP	3,659	10.72	39,224.48
BANK OF MONTREAL	11,149	148.73	1,658,190.77
BANK OF NOVA SCOTIA	20,901	92.52	1,933,760.52
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,713	161.48	1,245,495.24
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	102.43	578,319.78
ROYAL BANK OF CANADA	25,220	145.00	3,656,900.00
TORONTO-DOMINION BANK	32,272	106.27	3,429,545.44
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	25,108	72.15	1,811,542.20
IGM FINANCIAL INC	1,623	45.39	73,667.97
ONEX CORPORATION	908	91.82	83,372.56
TMX GROUP LTD	1,457	133.05	193,853.85
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	648.75	295,830.00
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	39.76	172,081.28
IA FINANCIAL CORP INC	2,752	81.28	223,682.56
INTACT FINANCIAL CORP	3,041	181.13	550,816.33
MANULIFE FINANCIAL CORP	33,538	27.05	907,202.90
POWER CORP OF CANADA	10,869	41.88	455,193.72
SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	68.33	682,616.70
FIRSTSERVICE CORP	671	193.23	129,657.33

	BLACKBERRY LTD	7,347	8.78	64,506.66
	CGI INC	3,796	106.97	406,058.12
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,126.35	725,085.35
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	36.62	58,335.66
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	78.92	65,424.68
	OPEN TEXT CORP	4,289	56.30	241,470.70
	SHOPIFY INC - CLASS A	2,003	1,078.95	2,161,136.85
	BCE INC	1,259	66.45	83,660.55
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6,149	65.91	405,280.59
	TELUS CORP	8,222	31.71	260,719.62
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,058	17.73	249,248.34
	ALTAGAS LTD	7,212	27.69	199,700.28
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	44.02	90,505.12
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.04	34,584.48
	EMERA INC	4,505	58.78	264,803.90
	FORTIS INC	8,232	57.19	470,788.08
	HYDRO ONE LTD	4,991	32.23	160,859.93
	NORTHLAND POWER INC	3,252	36.32	118,112.64
	カナダドル 小計	694,124		45,491,169.63 (4,125,139,262)
ユーロ	ENI SPA	42,914	13.32	571,786.13
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.98	73,996.26
	NESTE OYJ	7,057	37.59	265,272.63
	OMV AG	2,574	55.96	144,041.04
	REPSOL SA	24,986	11.66	291,536.64
	TENARIS SA	5,062	11.50	58,238.31
	TOTALENERGIES SE	44,618	51.13	2,281,318.34
	AIR LIQUIDE SA	8,488	142.12	1,206,314.56
	AKZO NOBEL	3,222	91.74	295,586.28
	ARCELORMITTAL	12,348	26.34	325,246.32
	ARKEMA	1,076	124.90	134,392.40
	BASF SE	16,548	66.34	1,097,794.32
	COVESTRO AG	3,382	52.70	178,231.40
	CRH PLC	13,641	43.69	595,975.29
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	28.65	112,365.30
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,085	36.36	39,450.60

HEIDELBERGCEMENT AG	2, 164	63. 50	137, 414. 00
KONINKLIJKE DSM NV	2, 952	159. 15	469, 810. 80
LANXESS AG	1, 915	51. 62	98, 852. 30
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3, 976	47. 03	186, 991. 28
SOLVAY SA	1, 489	106. 30	158, 280. 70
STORA ENSO OYJ-R SHS	11, 685	18. 17	212, 374. 87
SYMRISE AG	2, 370	101. 40	240, 318. 00
UMICORE	3, 883	32. 33	125, 537. 39
UPM-KYMMENE OYJ	9, 909	32. 82	325, 213. 38
VOESTALPINE AG	2, 425	30. 58	74, 156. 50
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4, 217	21. 96	92, 605. 32
AIRBUS SE	10, 578	116. 30	1, 230, 221. 40
ALSTOM	5, 811	25. 70	149, 342. 70
BOUYGUES SA	3, 499	32. 11	112, 352. 89
BRENTAG SE	2, 419	76. 02	183, 892. 38
CNH INDUSTRIAL NV	19, 340	13. 94	269, 696. 30
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8, 682	60. 63	526, 389. 66
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	7, 471	31. 41	234, 664. 11
DASSAULT AVIATION SA	110	115. 30	12, 683. 00
EIFFAGE	1, 503	96. 00	144, 288. 00
FERROVIAL SA	7, 014	23. 80	166, 933. 20
GEA GROUP AG	3, 473	40. 54	140, 795. 42
IMCD NV	1, 073	141. 40	151, 722. 20
KINGSPAN GROUP PLC	2, 977	87. 00	258, 999. 00
KION GROUP AG	1, 385	78. 08	108, 140. 80
KNORR-BREMSE AG	1, 136	87. 68	99, 604. 48
KONE OYJ-B	5, 617	54. 78	307, 699. 26
LEGRAND SA	4, 583	85. 32	391, 021. 56
MTU AERO ENGINES AG	938	193. 90	181, 878. 20
PRYSMIAN SPA	4, 594	27. 54	126, 518. 76
RATIONAL AG	80	683. 00	54, 640. 00
SAFRAN SA	5, 873	112. 22	659, 068. 06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	9, 655	142. 12	1, 372, 168. 60
SIEMENS AG-REG	13, 602	139. 36	1, 895, 574. 72
SIEMENS ENERGY AG	7, 711	18. 57	143, 193. 27
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4, 128	16. 37	67, 575. 36

THALES SA	1,768	83.06	146,850.08
VINCI SA	9,484	100.04	948,779.36
WARTSILA OYJ ABP	8,128	10.21	83,027.52
BUREAU VERITAS SA	4,564	24.51	111,863.64
RANDSTAD NV	1,871	62.92	117,723.32
TELEPERFORMANCE	1,061	320.40	339,944.40
WOLTERS KLUWER	4,948	87.44	432,653.12
ADP	314	129.35	40,615.90
AENA SME SA	1,497	150.00	224,550.00
ATLANTIA SPA	8,066	16.17	130,467.55
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10,938	7.22	78,972.36
DEUTSCHE POST AG-REG	17,844	50.63	903,441.72
GETLINK	9,276	13.83	128,333.46
INPOST SA	3,195	6.28	20,093.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,866	91.58	537,208.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	77.30	47,848.70
CONTINENTAL AG	2,088	87.17	182,010.96
FAURECIA	2,333	41.35	96,469.55
FERRARI NV	2,202	193.80	426,747.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	14,942	73.45	1,097,489.90
MICHELIN (CGDE)	3,012	144.75	435,987.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	84.92	203,723.08
RENAULT SA	3,099	34.38	106,559.11
STELLANTIS NV	35,353	16.34	577,668.02
VALEO SA	3,692	25.47	94,035.24
VOLKSWAGEN AG	462	240.00	110,880.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,269	181.24	592,473.56
ADIDAS AG	3,306	232.85	769,802.10
ESSILORLUXOTTICA	5,113	164.46	840,883.98
HERMES INTERNATIONAL	550	1,186.50	652,575.00
KERING	1,339	616.20	825,091.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,915	670.00	3,293,050.00
MONCLER SPA	3,302	54.44	179,760.88
PUMA SE	2,047	87.68	179,480.96
SEB SA	609	134.80	82,093.20
ACCOR SA	2,330	33.10	77,123.00

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	133.25	372,833.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,369	36.17	85,686.73
SODEXO	1,542	84.54	130,360.68
BOLLORE	14,850	4.87	72,438.30
PUBLICIS GROUPE	3,613	63.30	228,702.90
SCOUT24 SE	1,621	52.04	84,356.84
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,377	50.44	119,895.88
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,144	21.00	297,024.00
VIVENDI	14,144	11.71	165,696.96
DELIVERY HERO SE	2,979	42.59	126,875.61
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,585	25.33	470,758.05
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	38.39	135,035.21
PROSUS NV	16,565	67.83	1,123,603.95
ZALANDO SE	3,789	61.58	233,326.62
CARREFOUR SA	10,978	17.20	188,876.49
COLRUYT SA	290	36.04	10,451.60
HELLOFRESH SE	3,031	48.00	145,488.00
JERONIMO MARTINS	5,217	19.45	101,470.65
KESKO OYJ-B SHS	4,478	26.50	118,667.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,708	28.77	509,459.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,146	54.47	770,532.62
DANONE	11,362	54.76	622,183.12
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	10.39	93,655.46
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	75.45	137,319.00
HEINEKEN NV	4,447	93.16	414,282.52
JDE PEET' S BV	1,184	26.27	31,103.68
KERRY GROUP PLC-A	2,701	107.40	290,087.40
PERNOD RICARD SA	3,643	190.25	693,080.75
REMY COINTREAU	264	175.70	46,384.80
BEIERSDORF AG	1,716	87.02	149,326.32
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	70.15	109,574.30
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,219	73.22	235,695.18
L' OREAL	4,486	353.10	1,584,006.60
AMPLIFON SPA	2,059	34.74	71,529.66
BIOMERIEUX	820	101.05	82,861.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	128.45	80,923.50

DIASORIN SPA	629	119.75	75,322.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	57.56	223,217.68
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	36.18	257,926.68
KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,274	29.28	447,299.09
ORPEA	1,093	37.04	40,484.72
SARTORIUS AG-VORZUG	502	409.80	205,719.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	55.22	257,711.74
ARGENX SE	902	252.30	227,574.60
BAYER AG-REG	17,000	52.57	893,690.00
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	85.00	182,665.00
GRIFOLS SA	3,329	14.44	48,070.76
IPSEN	158	93.38	14,754.04
MERCK KGAA	2,192	175.25	384,148.00
ORION OYJ-CLASS B	2,696	34.77	93,739.92
QIAGEN N. V.	4,271	42.15	180,022.65
RECORDATI SPA	1,969	44.78	88,171.82
SANOFI	20,239	92.20	1,866,035.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	352.40	156,465.60
UCB SA	2,214	84.94	188,057.16
ABN AMRO BANK NV-CVA	7,957	12.89	102,581.64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	114,269	5.73	654,875.63
BANCO SANTANDER SA	302,871	3.34	1,013,557.80
BNP PARIBAS	19,707	61.75	1,216,907.25
CAIXABANK S. A	78,740	3.29	259,133.34
COMMERZBANK AG	13,866	8.47	117,458.88
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	13.56	298,306.44
ERSTE GROUP BANK AG	5,946	41.84	248,780.64
FINECOBANK SPA	11,008	15.49	170,513.92
ING GROEP NV-CVA	69,555	12.88	896,285.73
INTESA SANPAOLO	281,987	2.76	780,399.02
KBC GROEP NV	4,507	76.84	346,317.88
MEDIOBANCA SPA	10,633	10.16	108,084.44
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	2,444	26.02	63,592.88
SOCIETE GENERALE SA	14,646	33.79	494,961.57
UNICREDIT SPA	35,836	15.02	538,471.73
AMUNDI SA	618	67.95	41,993.10

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	13.78	486,092.76
DEUTSCHE BOERSE AG	3,278	157.50	516,285.00
EURAZEO	403	70.50	28,411.50
EURONEXT NV	1,722	82.65	142,323.30
EXOR NV	2,224	72.16	160,483.84
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	92.88	183,809.52
SOFINA	168	340.00	57,120.00
WENDEL	294	92.90	27,312.60
AEGON NV	35,058	4.80	168,453.69
AGEAS	3,211	44.24	142,054.64
ALLIANZ SE-REG	7,359	222.65	1,638,481.35
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	18.35	374,790.74
AXA SA	33,466	27.57	922,824.95
CNP ASSURANCES	3,403	21.83	74,287.49
HANNOVER RUECK SE	1,152	170.55	196,473.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,428	261.70	635,407.60
NN GROUP NV	4,060	50.44	204,786.40
POSTE ITALIANE SPA	11,160	10.79	120,472.20
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	44.30	373,050.30
AROUNDTOWN SA	20,993	5.30	111,346.87
LEG IMMOBILIEN SE	1,515	110.60	167,559.00
VONOVIA SE	12,977	47.32	614,071.64
ADYEN NV	351	1,877.80	659,107.80
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	60.34	461,480.32
BECHTLE AG	1,242	47.04	58,423.68
CAPGEMINI SA	2,763	193.10	533,535.30
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	40.27	468,076.05
EDENRED	4,235	38.36	162,454.60
NEMETSCHEK SE	1,322	77.00	101,794.00
NEXI SPA	7,091	12.64	89,665.69
SAP SE	18,577	104.98	1,950,213.46
WORLDLINE SA	4,054	45.48	184,375.92
NOKIA OYJ	92,708	4.87	451,997.85
CELLNEX TELECOM SA	8,821	39.00	344,019.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	57,744	17.20	993,196.80
ELISA OYJ	2,589	50.68	131,210.52

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.87	21,941.47
	KONINKLIJKE KPN NV	58,946	3.08	181,553.68
	ORANGE	34,597	10.88	376,484.55
	PROXIMUS	918	18.00	16,528.59
	TELECOM ITALIA SPA	242,872	0.41	100,306.13
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.64	33,394.55
	TELEFONICA SA	91,673	4.37	401,436.06
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	34.30	26,273.80
	E.ON SE	38,444	11.97	460,482.23
	EDF	10,409	8.13	84,687.62
	EDP RENOVAVEIS SA	4,503	17.00	76,551.00
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.00	198,064.00
	ELIA GROUP SA/NV	345	113.90	39,295.50
	ENAGAS SA	6,522	18.60	121,309.20
	ENDESA SA	4,803	18.33	88,038.99
	ENEL SPA	146,107	6.32	923,396.24
	ENGIE	31,335	14.29	448,027.83
	FORTUM OYJ	7,645	23.57	180,192.65
	IBERDROLA SA	101,726	9.14	930,182.54
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	24.57	114,201.36
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	17.02	146,950.68
	RWE AG	11,090	36.33	402,899.70
	SNAM SPA	32,585	4.74	154,680.99
	TERNA SPA	25,545	6.62	169,107.90
	UNIPER SE	1,582	38.90	61,539.80
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,301	31.51	356,094.51
	VERBUND AG	1,068	94.00	100,392.00
	ASM INTERNATIONAL NV	888	273.30	242,690.40
	ASML HOLDING NV	7,232	559.70	4,047,750.40
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,556	32.21	726,528.76
	STMICROELECTRONICS NV	12,491	39.10	488,398.10
	ユーロ 小計	3,276,919		82,870,126.14 (10,819,523,668)
英ポンド	BP PLC	349,095	4.00	1,398,649.11
	SHELL PLC-NEW	134,629	20.05	2,699,984.59
	ANGLO AMERICAN PLC	22,057	36.17	797,911.97

ANTOFAGASTA PLC	7,429	13.89	103,225.95
BHP GROUP LTD	37,095	25.17	933,681.15
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,620	73.24	191,888.80
GLENCORE PLC	170,301	4.22	718,840.52
JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	17.65	55,419.04
MONDI PLC	7,876	18.64	146,848.02
RIO TINTO PLC	20,084	57.22	1,149,206.48
ASHTED GROUP PLC	7,622	48.41	368,981.02
BAE SYSTEMS PLC	55,064	6.00	330,384.00
BUNZL PLC	7,087	26.64	188,797.68
DCC PLC	1,401	63.58	89,075.58
FERGUSON PLC	3,775	109.55	413,551.25
MELROSE INDUSTRIES PLC	68,951	1.52	104,805.52
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.17	193,615.32
SMITHS GROUP PLC	6,986	15.40	107,619.33
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	119.80	144,239.20
EXPERIAN PLC	16,860	28.65	483,039.00
INTERTEK GROUP PLC	2,573	51.64	132,869.72
RELX PLC	34,385	22.39	769,880.15
RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	4.98	147,351.96
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	6.18	126,779.74
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,383	40.83	56,467.89
BURBERRY GROUP PLC	7,146	19.63	140,275.98
PERSIMMON PLC	5,194	24.45	126,993.30
TAYLOR WIMPEY PLC	77,500	1.52	117,993.75
COMPASS GROUP PLC	30,179	17.81	537,638.88
ENTAIN PLC	10,699	16.84	180,224.65
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,117	50.52	157,470.84
WHITBREAD PLC	2,921	32.01	93,501.21
AUTO TRADER GROUP PLC	20,378	6.38	130,052.39
INFORMA PLC	30,041	6.08	182,769.44
PEARSON PLC	13,772	6.25	86,102.54
WPP PLC	19,572	11.93	233,591.82
JD SPORTS FASHION PLC	24,800	1.68	41,788.00
KINGFISHER PLC	46,444	3.18	147,738.36
NEXT PLC	2,522	71.58	180,524.76

OCADO GROUP PLC	9,232	13.00	120,062.16
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.77	77,205.86
TESCO PLC	131,492	2.95	388,427.36
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	18.78	93,411.72
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	37,631	34.09	1,282,840.79
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	24.05	91,822.90
DIAGEO PLC	41,407	36.32	1,503,902.24
IMPERIAL BRANDS PLC	16,315	17.81	290,570.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,307	59.05	726,728.35
UNILEVER PLC	45,230	38.10	1,723,263.00
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	12.06	203,054.22
ASTRAZENECA PLC	27,384	83.81	2,295,053.04
GLAXOSMITHKLINE PLC	89,341	15.71	1,403,725.79
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,811	19.46	74,162.06
BARCLAYS PLC	290,654	1.95	568,402.96
HSBC HOLDINGS PLC	362,413	5.58	2,022,989.36
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,213,798	0.51	627,654.94
NATWEST GROUP PLC	106,419	2.42	258,172.49
STANDARD CHARTERED PLC	49,470	5.50	272,183.94
3I GROUP PLC	18,949	13.22	250,505.78
ABRDN PLC	32,937	2.37	78,159.50
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	13.05	73,014.75
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,605	68.74	385,287.70
M&G PLC	41,949	2.12	89,015.77
SCHRODERS PLC	2,782	32.31	89,886.42
ST JAMES' S PLACE PLC	11,459	15.02	172,171.47
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	30.30	83,173.50
AVIVA PLC	74,601	4.31	321,530.31
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.72	283,584.48
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.57	57,505.00
PRUDENTIAL PLC	44,928	11.77	528,802.56
AVEVA GROUP PLC	2,041	26.78	54,657.98
SAGE GROUP PLC/THE	18,579	6.82	126,783.09
HALMA PLC	6,704	23.30	156,203.20
BT GROUP PLC	161,710	1.92	311,615.17

	VODAFONE GROUP PLC	498,320	1.36	680,406.12
	NATIONAL GRID PLC	65,257	10.75	701,512.75
	SEVERN TRENT PLC	5,286	28.30	149,593.80
	SSE PLC	18,204	15.25	277,611.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	10.44	137,184.63
	英ポンド 小計	5,105,060		33,241,617.22 (5,193,670,274)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	16.80	47,863.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	913.50	71,253.00
	GIVAUDAN-REG	160	3,585.00	573,600.00
	HOLCIM LTD	9,074	50.70	460,051.80
	SIKA AG-REG	2,454	296.10	726,629.40
	ABB LTD-REG	29,408	31.40	923,411.20
	GEBERIT AG-REG	643	596.00	383,228.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	221.40	47,601.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	222.60	157,378.20
	VAT GROUP AG	505	339.80	171,599.00
	ADECCO SA-REG	2,354	46.66	109,837.64
	SGS SA-REG	121	2,576.00	311,696.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	936	253.10	236,901.60
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	9,372	130.95	1,227,263.40
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	287.20	117,752.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	55.35	13,892.85
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	76	2,090.00	158,840.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	10,080.00	241,920.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	103,100.00	103,100.00
	NESTLE SA-REG	49,856	117.30	5,848,108.80
	ALCON INC	8,564	70.96	607,701.44
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	318.90	328,148.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	176	1,381.00	243,056.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	116	505.00	58,580.00
	LONZA GROUP AG-REG	1,318	603.00	794,754.00
	NOVARTIS AG-REG	38,435	79.19	3,043,667.65
	ROCHE HOLDING AG-BR	604	371.40	224,325.60
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12,386	342.20	4,238,489.20
	VIFOR PHARMA AG	638	163.00	103,994.00

	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	44,532	8.31	370,149.98	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	58.18	207,644.42	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,244.00	498,844.00	
	UBS GROUP AG-REG	65,676	19.06	1,252,112.94	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	160.50	105,609.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	568	591.80	336,142.40	
	SWISS RE AG	5,123	98.06	502,361.38	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,680	443.00	1,187,240.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	89.25	99,692.25	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	108.20	126,485.80	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	73.00	215,277.00	
	SWISSCOM AG-REG	414	548.00	226,872.00	
	スイスフラン 小計	301,616		26,703,074.25 (3,336,282,096)	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	338.10	1,092,063.00	
	BOLIDEN AB	4,039	400.80	1,618,831.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	10,612	161.95	1,718,613.40	
	ALFA LAVAL AB	6,477	284.00	1,839,468.00	
	ASSA ABLOY AB-B	17,222	261.50	4,503,553.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,365	497.60	6,152,824.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	434.80	2,990,554.40	
	EPIROC AB-A	11,278	189.90	2,141,692.20	
	EPIROC AB-B	4,649	162.00	753,138.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	121.30	982,408.70	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	266.80	390,595.20	
	LIFCO AB-B SHS	4,582	203.50	932,437.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	85.14	2,293,927.02	
	SANDVIK AB	19,332	232.90	4,502,422.80	
	SKANSKA AB-B SHS	7,676	238.50	1,830,726.00	
	SKF AB-B SHARES	7,216	187.90	1,355,886.40	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	212.80	701,814.40	
	VOLVO AB-B SHS	25,143	210.90	5,302,658.70	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	118.95	455,935.35	
	ELECTROLUX AB-B	3,653	180.30	658,635.90	
	EVOLUTION AB	3,009	1,060.00	3,189,540.00	
	EMBRACER GROUP AB	8,396	84.57	710,049.72	

	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	177.96	2,324,869.44
	SWEDISH MATCH AB	26,306	69.64	1,831,949.84
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,023	264.50	3,180,083.50
	GETINGE AB-B SHS	4,502	354.90	1,597,759.80
	NORDEA BANK ABP	55,961	109.64	6,135,564.04
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,381	120.60	3,784,548.60
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	28,629	96.86	2,773,004.94
	SWEDBANK AB - A SHARES	17,971	168.52	3,028,472.92
	EQT AB	5,102	339.00	1,729,578.00
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,067	287.60	594,469.20
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	282.40	664,487.20
	INVESTOR AB-A SHS	9,765	206.90	2,020,378.50
	INVESTOR AB-B SHS	31,447	194.96	6,130,907.12
	KINNEVIK AB - B	3,881	253.20	982,669.20
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	470.30	432,676.00
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	586.60	928,587.80
	SAGAX AB-B	3,246	255.00	827,730.00
	SINCH AB	7,260	95.80	695,508.00
	ERICSSON LM-B SHS	50,322	115.14	5,794,075.08
	HEXAGON AB-B SHS	33,961	122.75	4,168,712.75
	TELE2 AB-B SHS	7,424	130.65	969,945.60
	TELIA CO AB	49,229	37.20	1,831,564.94
	スウェーデンクローナ 小計	597,791		98,545,316.86 (1,212,107,397)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	2,452	271.40	665,472.80
	EQUINOR ASA	17,989	273.75	4,924,488.75
	NORSK HYDRO ASA	21,082	77.38	1,631,325.16
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	443.00	1,227,996.00
	ADEVINTA ASA	3,943	83.00	327,269.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,287	203.40	465,175.80
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	231.70	269,930.50
	MOWI ASA	8,760	235.20	2,060,352.00
	ORKLA ASA	11,182	84.42	943,984.44
	DNB BANK ASA	15,146	212.10	3,212,466.60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	212.40	567,957.60
	TELENOR ASA	13,825	137.30	1,898,172.50

	ノルウェークローネ 小計	103,277		18,194,591.15 (236,529,684)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	477.40	975,805.60
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	389.10	1,297,259.40
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,448.00	315,792.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,442	162.80	2,839,557.60
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	67	21,440.00	1,436,480.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	22,650.00	2,242,350.00
	DSV A/S	3,468	1,261.00	4,373,148.00
	PANDORA A/S	1,826	717.80	1,310,702.80
	CARLSBERG AS-B	2,072	1,029.50	2,133,124.00
	AMBU A/S-B	1,526	120.50	183,883.00
	COLOPLAST-B	2,245	916.40	2,057,318.00
	DEMANT A/S	1,941	267.30	518,829.30
	GN STORE NORD A/S	1,892	366.00	692,472.00
	GENMAB A/S	1,125	2,199.00	2,473,875.00
	NOVO NORDISK A/S-B	29,811	643.10	19,171,454.10
	DANSKE BANK A/S	13,184	131.00	1,727,104.00
TRYG A/S	4,694	152.00	713,488.00	
ORSTED A/S	3,278	655.40	2,148,401.20	
	デンマーククローネ 小計	90,177		46,611,044.00 (817,557,711)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	32.35	97,438.20
	SANTOS LTD	47,139	7.72	363,913.08
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,985	26.52	105,682.20
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	27.43	512,310.11
	BHP GROUP LTD	52,531	48.33	2,538,823.23
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	18.79	198,967.31
	EVOLUTION MINING LTD	46,650	3.96	184,734.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	22.75	665,255.50
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	7,431	46.69	346,953.39
	NEWCREST MINING LTD	15,067	23.70	357,087.90
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.00	133,893.00
	ORICA LTD	6,263	14.72	92,191.36
	RIO TINTO LTD	6,335	121.58	770,209.30
	SOUTH32 LTD	81,080	4.53	367,292.40

REECE LTD	5,105	19.96	101,895.80
BRAMBLES LTD	27,700	9.42	260,934.00
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.62	83,390.32
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.31	46,197.00
TRANSURBAN GROUP	55,676	12.83	714,323.08
ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,150	40.23	448,564.50
CROWN RESORTS LTD	773	12.64	9,770.72
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	101.14	104,679.90
IDP EDUCATION LTD	4,049	27.46	111,185.54
TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	5.20	197,095.60
REA GROUP LTD	563	135.44	76,252.72
SEEK LTD	6,794	27.78	188,737.32
WESFARMERS LTD	19,365	53.87	1,043,192.55
COLES GROUP LTD	24,160	16.32	394,291.20
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.27	106,345.47
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	33.91	726,047.01
TREASURY WINE ESTATES LTD	16,613	10.63	176,596.19
COCHLEAR LTD	1,060	190.07	201,474.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	63.60	174,900.00
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	37.51	272,697.70
CSL LTD	8,417	243.56	2,050,044.52
AUST AND NZ BANKING GROUP	48,894	28.20	1,378,810.80
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	31,437	100.04	3,144,957.48
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,718	30.43	1,725,928.74
WESTPAC BANKING CORP	63,088	23.88	1,506,541.44
ASX LTD	3,380	82.92	280,269.60
MACQUARIE GROUP LTD	6,279	194.22	1,219,507.38
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	18.23	28,384.11
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	43,709	4.72	206,306.48
MEDIBANK PRIVATE LTD	63,743	3.18	202,702.74
QBE INSURANCE GROUP LTD	26,086	12.70	331,292.20
SUNCORP GROUP LTD	27,697	11.73	324,885.81
LENDLEASE GROUP	17,548	10.04	176,181.92
COMPUTERSHARE LTD	12,120	23.06	279,487.20
WISETECH GLOBAL LTD	1,600	45.65	73,040.00
XERO LTD	2,603	109.00	283,727.00

	TELSTRA CORP LTD	72,361	4.06	293,785.66
	APA GROUP	24,697	10.00	246,970.00
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	6.21	163,993.68
	オーストラリアドル 小計	1,173,294		26,090,138.56 (2,147,479,304)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.23	161,156.70
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,319	28.01	317,045.19
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	9.35	51,481.10
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.40	190,630.00
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.79	41,688.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	4.89	112,269.51
	ニュージーランドドル 小計	112,599		874,270.50 (66,820,494)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	59.75	2,897,875.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25,000	133.40	3,335,000.00
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	21.60	648,000.00
	MTR CORP	32,000	42.75	1,368,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	31,000	31.40	973,400.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	45.75	1,875,750.00
	SANDS CHINA LTD	50,200	22.00	1,104,400.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	16.08	543,504.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	23.05	507,100.00
	WH GROUP LTD	152,000	5.73	870,960.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	31.80	2,194,200.00
	HANG SENG BANK LTD	11,900	167.90	1,998,010.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20,700	437.40	9,054,180.00
	AIA GROUP LTD	213,800	87.20	18,643,360.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	32,000	52.30	1,673,600.00
	ESR CAYMAN LTD	29,200	26.10	762,120.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	16.42	443,340.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	34.75	1,039,581.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	32.80	852,800.00
	SINO LAND CO	58,000	10.28	596,240.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	97.55	2,409,485.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	48.35	203,070.00
SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	21.00	105,000.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	35.95	1,150,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	101,000	10.88	1,098,880.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	50.95	224,180.00	
	CLP HOLDINGS LTD	27,500	79.85	2,195,875.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.88	244,280.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	208,717	12.10	2,525,475.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,000	49.90	1,147,700.00	
	香港ドル 小計	1,444,533		62,685,765.70 (927,122,474)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	25,600	6.04	154,624.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	3.82	140,194.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	5.21	137,023.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.77	62,216.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	41,900	4.54	190,226.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	31,100	37.20	1,156,920.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	13.34	756,378.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	32.70	663,810.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	14,400	9.74	140,256.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	49,800	3.62	180,276.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.14	21,420.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.30	15,330.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.12	74,292.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	169,000	2.55	430,950.00	
	シンガポールドル 小計	561,800		4,123,915.00 (353,378,276)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	12,922	32.43	419,060.46	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	563.50	214,693.50	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	33.09	603,263.79	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,954	34.24	1,025,624.96	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	21.29	503,955.59	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	122.00	172,508.00	
	AZRIELI GROUP	234	277.90	65,028.60	
	NICE SYSTEMS LTD	1,161	852.60	989,868.60	
	イスラエルシェケル 小計	87,968		3,994,003.50 (141,598,207)	
	合 計	19,101,808		107,777,288,415	

(107, 777, 288, 415)

(注 1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額 (単位:円) であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	8, 437	115, 671. 27	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2, 660	488, 429. 20	
		AMERICAN TOWER CORP	8, 088	1, 894, 937. 52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25, 521	183, 495. 99	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2, 369	564, 177. 35	
		BOSTON PROPERTIES INC	2, 764	323, 249. 80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1, 697	274, 964. 91	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7, 724	1, 294, 387. 92	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4, 809	654, 697. 26	
		DUKE REALTY CORP	6, 340	345, 847. 00	
		EQUINIX INC	1, 607	1, 075, 693. 66	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3, 451	264, 174. 05	
		EQUITY RESIDENTIAL	6, 281	539, 663. 52	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1, 187	375, 507. 45	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2, 391	464, 356. 11	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9, 835	315, 703. 50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	10, 493	188, 139. 49	
		INVITATION HOMES INC	9, 853	407, 914. 20	
		IRON MOUNTAIN INC	5, 780	252, 297. 00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8, 954	186, 064. 12	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2, 088	433, 427. 04	
		PROLOGIS INC	13, 145	1, 910, 494. 30	
		PUBLIC STORAGE	2, 693	957, 738. 52	
		REALTY INCOME CORP	9, 338	624, 618. 82	
		REGENCY CENTERS CORP	2, 658	173, 195. 28	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1, 865	576, 937. 75	
SIMON PROPERTY GROUP INC	5, 918	827, 928. 20			
SUN COMMUNITIES INC	2, 159	408, 525. 98			
UDR INC	5, 162	281, 896. 82			
VENTAS INC	6, 823	341, 559. 38			

	VICI PROPERTIES INC	10,702	301,368.32
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	115,253.46
	WELLTOWER INC	7,706	613,937.02
	WEYERHAEUSER CO	12,823	524,588.93
	WP CAREY INC	3,546	268,857.72
	米ドル 小計	219,696	18,569,698.86 (2,143,314,642)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	52,715.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	36,291.60
	カナダドル 小計	2,480	89,007.10 (8,071,163)
ユーロ	COVIVIO	522	37,792.80
	GECINA SA	1,073	119,424.90
	KLEPIERRE	3,496	82,715.36
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	156,157.26
	ユーロ 小計	7,372	396,090.32 (51,713,552)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	74,525.32
	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,632	115,417.21
	SEGRO PLC	22,581	278,875.35
	英ポンド 小計	51,055	468,817.88 (73,248,105)
オーストラリアドル	DEXUS/AU	23,352	237,256.32
	GOODMAN GROUP	29,600	675,472.00
	GPT GROUP	32,860	166,271.60
	MIRVAC GROUP	63,099	157,116.51
	SCENTRE GROUP	86,904	256,366.80
	STOCKLAND	54,131	212,193.52
	VICINITY CENTRES	42,168	71,685.60
	オーストラリアドル 小計	332,114	1,776,362.35 (146,212,385)
香港ドル	LINK REIT	38,700	2,573,550.00
	香港ドル 小計	38,700	2,573,550.00 (38,062,804)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	208,571.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	81,863	167,819.15

	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	41,630.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	49,500	85,635.00	
	シンガポールドル 小計	228,063	503,655.15 (43,158,209)	
	合計		2,503,780,860 (2,503,780,860)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 608 銘柄	97.3%	—	71.2%
	投資証券 35 銘柄	—	2.7%	1.9%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.8%	—	3.8%
	投資証券 2 銘柄	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式 227 銘柄	99.5%	—	9.9%
	投資証券 4 銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式 80 銘柄	98.6%	—	4.8%
	投資証券 3 銘柄	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 41 銘柄	100.0%	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 44 銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 18 銘柄	100.0%	—	0.7%
オーストラリアドル	株式 53 銘柄	93.6%	—	1.9%
	投資証券 7 銘柄	—	6.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式 30 銘柄	96.1%	—	0.8%
	投資証券 1 銘柄	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 14 銘柄	89.1%	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	10.9%	0.0%
イスラエルシケル	株式 8 銘柄	100.0%	—	0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	10,079,807,482円
期中追加設定元本額	3,519,567,242円
期中一部解約元本額	2,193,964,508円
期末元本額	11,405,410,216円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	682,299,038円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,424,230,273円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,709,449,490円
DCりそな グローバルバランス	11,940,904円
つみたてバランスファンド	593,645,552円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	349,016,183円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	207,909,222円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	139,722,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	48,949,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	30,957,209円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	16,583,292円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	29,101,062円

リスクコントロール・オープン	8,605,918円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	163,668,010円
九州SDGs・グローバルバランス	79,861,814円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	57,475,396円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,064,937,789円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,652,234,822円
Smart-i 8資産バランス 安定型	67,904,306円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	186,862,931円
Smart-i 8資産バランス 成長型	219,660,760円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	94,879,981円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	138,844,046円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	84,757,018円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	54,125,515円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	174,677,341円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,795,357円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,505,455円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	234,678円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	5,998,008円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	5,883,170円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	69,694,228円
2. 計算日における受益権の総数	11,405,410,216口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6426円
(10,000口当たり純資産額)	(16,426円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,805,988,316	—	2,767,367,630	△38,620,686
合計		2,805,988,316	—	2,767,367,630	△38,620,686

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(通貨関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		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	48,471,948	—	48,474,594	2,646
	米ドル	48,471,948	—	48,474,594	2,646
	売建	49,053,500	—	49,052,905	595
	米ドル	49,053,500	—	49,052,905	595
	合計	97,525,448	—	97,527,499	3,241

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

KANZHUN LTD	1,293	32.90	42,539.70
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,024	5.90	70,941.60
VK CO LTD	2,211	7.70	17,035.75
WEIBO CORP-SPON ADR	1,164	30.85	35,909.40
YANDEX NV-A	5,354	45.18	241,893.72
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	10.08	10,080.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	19.23	17,691.60
PINDUODUO INC-ADR	7,772	59.16	459,791.52
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	9.68	80,314.96
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,671	14.20	94,728.20
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	22.53	51,728.88
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,147	3.41	34,601.27
BEIGENE LTD-ADR	824	205.30	169,167.20
HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	25.32	42,233.76
I-MAB-SPONSORED ADR	761	24.89	18,941.29
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	736	39.72	29,233.92
ZAI LAB LTD-ADR	1,299	52.50	68,197.50
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	3.20	106,883.20
CREDICORP LTD	1,182	152.95	180,786.90
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	47,670	13.52	644,736.75
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,188	67.10	146,814.80
VTB BANK JSC -GDR-REG S	32,868	1.06	34,840.08
360 DIGITECH INC	1,366	20.64	28,194.24
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	780	29.69	23,158.20
KE HOLDINGS INC	6,358	19.89	126,460.62
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.93	9,444.96
AGORA INC-ADR	800	10.74	8,592.00
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	4.87	7,305.00
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,653	41.67	68,880.51
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	7.64	6,876.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	7,300	4.45	32,485.00
VNET GROUP INC	1,400	7.50	10,500.00
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	8,384	7.46	62,544.64
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,000	38.20	38,200.00
米ドル 小計	531,172		9,305,524.05 (1,074,043,585)

メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	260,700	11.13	2,901,591.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	54,700	102.18	5,589,246.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,650	228.01	604,226.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	51.27	1,015,146.00	
	ALFA S. A. B. -A	56,600	14.95	846,170.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	56.03	414,622.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,100	299.46	1,826,706.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	448.94	1,719,440.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4,405	153.50	676,167.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	44,300	43.46	1,925,278.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	6,500	60.07	390,455.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	92,400	72.76	6,723,024.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	118.01	908,677.00	
	BECLE SAB DE CV	11,400	49.38	562,932.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	9,510	106.91	1,016,714.10	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	34,200	154.64	5,288,688.00	
	GRUMA S. A. B. -B	4,125	271.96	1,121,835.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	62.90	1,679,430.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	23,400	30.24	707,616.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	45,700	135.56	6,195,092.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	45,800	31.60	1,447,280.00		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	607,600	18.90	11,483,640.00		
TELESITES SAB DE CV	19,700	23.52	463,344.00		
メキシコペソ 小計		1,395,220		55,507,320.30 (313,966,055)	
ブラジルリアル	COSAN SA	19,300	22.27	429,811.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	65,700	36.24	2,380,968.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	84,200	33.00	2,778,600.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	14,100	14.62	206,142.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	52.60	152,540.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	27.74	343,976.00	
	GERDAU SA-PREF	21,400	27.78	594,492.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,600	23.96	325,856.00	
	SUZANO SA	13,007	58.36	759,088.52	
	VALE SA	72,804	91.57	6,666,662.28	
	WEG SA	29,200	30.44	888,848.00	

CCR SA	23,400	12.49	292,266.00
LOCALIZA RENT A CAR	10,210	58.62	598,510.20
RUMO SA	24,400	16.19	395,036.00
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	27.30	73,710.00
AMERICANAS SA	12,000	33.72	404,640.00
LOJAS RENNER S. A.	17,820	25.91	461,716.20
MAGAZINE LUIZA SA	48,800	6.48	316,224.00
VIA S/A	21,100	4.02	84,822.00
VIBRA ENERGIA SA	21,700	23.07	500,619.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	16.30	130,400.00
RAIA DROGASIL SA	20,200	23.00	464,600.00
AMBEV SA	82,900	15.06	1,248,474.00
BRF SA	12,600	18.96	238,896.00
JBS SA	15,200	38.54	585,808.00
NATURA &CO HOLDING SA	14,800	23.03	340,844.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	75,292	12.19	917,809.48
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	47.75	343,800.00
HYPERA SA	6,400	32.16	205,824.00
BANCO BRADESCO S. A.	26,832	17.66	473,853.12
BANCO BRADESCO SA-PREF	85,579	21.17	1,811,707.43
BANCO DO BRASIL S. A.	15,800	33.54	529,932.00
BANCO INTER SA-UNITS	6,100	26.41	161,101.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,100	32.11	260,091.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	85,500	26.47	2,263,185.00
ITAUSA SA	80,955	10.48	848,408.40
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	107,800	14.12	1,522,136.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	23.35	488,015.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	23.37	320,169.00
TOTVS SA	9,200	28.67	263,764.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	9,700	49.83	483,351.00
TIM SA	17,100	13.88	237,348.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	32.85	157,680.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	33.42	163,758.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	16,642	12.63	210,188.46
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6,600	35.43	233,838.00
ENERGISA SA-UNITS	2,500	43.24	108,100.00

	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,775	40.52	193,483.00
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18,000	23.87	429,660.00
	ブラジルレアル 小計	1,318,816		34,290,751.09 (758,206,226)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	6,600.00	48,516,600.00
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,388.00	32,029,488.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,299	51,899.00	119,315,801.00
	FABELLA SA	14,299	2,561.10	36,621,168.90
	CENCOSUD SA	25,901	1,455.00	37,685,955.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	6,697.10	22,046,853.20
	BANCO DE CHILE	727,649	85.34	62,097,565.66
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	990	30,000.00	29,700,000.00
	BANCO SANTANDER CHILE	1,203,387	39.65	47,714,294.55
	ENEL AMERICAS SA	383,577	93.48	35,856,777.96
	ENEL CHILE SA	369,172	28.46	10,506,635.12
	チリペソ 小計	2,760,993		482,091,139.39 (68,387,520)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	89,323	2,946.00	263,145,558.00
	BANCOLOMBIA SA	4,637	37,500.00	173,887,500.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,517	33,330.00	250,541,610.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,150	35,900.00	77,185,000.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,188	22,100.00	180,954,800.00
	コロンビアペソ 小計	111,815		945,714,468.00 (27,685,791)
ユーロ	OPAP SA	3,467	13.45	46,631.15
	JUMBO SA	2,215	13.61	30,146.15
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	33,439	1.39	46,680.84
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	51,021	1.10	56,531.26
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	17.60	76,929.60
	PUBLIC POWER CORP	3,599	8.48	30,537.51
	ユーロ 小計	98,112		287,456.51 (37,530,321)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,948	11.31	67,301.62
	英ポンド 小計	5,948		67,301.62 (10,515,205)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,516	193.80	487,600.80

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,394	27.94	625,688.36	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	21.84	333,889.92	
	KOC HOLDING AS	14,295	33.48	478,596.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	18,415	13.34	245,656.10	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	242.20	264,482.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	73.25	606,217.00	
	AKBANK T. A. S.	62,081	7.98	495,406.38	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	44,864	11.81	529,843.84	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	8.58	214,834.62	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	18.49	352,992.59	
	トルコリラ 小計	233,351		4,635,208.61 (39,359,410)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,207	977.00	1,179,239.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	93.45	658,355.25	
	CEZ AS	2,959	846.50	2,504,793.50	
	チェココルナ 小計	11,211		4,342,387.75 (23,077,619)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,648.00	19,356,880.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	7,895.00	19,555,915.00	
	OTP BANK PLC	3,983	17,405.00	69,324,115.00	
	ハンガリーフォリント 小計	13,770		108,236,910.00 (39,528,444)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,618	70.58	396,518.44	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	33,451	5.25	175,617.75	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,316	150.70	349,021.20	
	LPP SA	18	15,400.00	277,200.00	
	CD PROJEKT SA	1,104	178.80	197,395.20	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	29.50	143,842.00	
	ALLEGRO. EU SA	5,653	34.94	197,544.08	
	DINO POLSKA SA	930	281.50	261,795.00	
	BANK PEKAO SA	3,378	131.00	442,518.00	
	MBANK SA	290	459.60	133,284.00	
	PKO BANK POLSKI SA	16,136	46.39	748,549.04	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	668	350.80	234,334.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,980	35.17	350,996.60	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	8.04	94,059.96	

	PGE SA	17,929	7.77	139,380.04
	ポーランドズロチ 小計	114,046		4,142,055.71 (118,879,069)
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	131,600	37.39	4,921,182.00
	ALROSA PJSC	46,260	115.67	5,350,894.20
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	55,000	83.48	4,591,400.00
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	22,980	133.83	3,075,413.40
	INTER RAO UES PJSC	725,000	3.63	2,631,750.00
	ロシアルーブル 小計	980,840		20,570,639.60 (30,855,959)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	45,000	5.09	229,050.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	30,000	8.78	263,400.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	430,000	4.18	1,797,400.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	59,500	21.80	1,297,100.00
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	38,000	4.69	178,220.00
	PETROCHINA CO LTD-H	374,000	4.25	1,589,500.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	26,000	19.26	500,760.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	5.25	346,500.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	43.65	960,300.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	10.54	400,520.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	66,000	4.69	309,540.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	76,000	10.98	834,480.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	40,000	7.10	284,000.00
	DONGYUE GROUP	28,000	8.95	250,600.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,600	121.40	558,440.00
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	19,000	4.55	86,450.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	14.80	266,400.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	5.55	122,100.00
	MMG LTD	68,000	2.96	201,280.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	33,000	8.14	268,620.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	14.32	136,040.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	102,000	11.74	1,197,480.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.66	205,040.00
	BOC AVIATION LTD	3,500	69.95	244,825.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	58,000	4.31	249,980.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	28,500	38.00	1,083,000.00	

CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	18,000	13.60	244,800.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	4.91	319,150.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40,000	10.28	411,200.00
CITIC LTD	102,000	8.90	907,800.00
CRRC CORP LTD - H	81,000	3.68	298,080.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	48,500	9.08	440,380.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	20.85	208,500.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.27	157,130.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	12.00	138,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	14.16	509,760.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	12.88	164,864.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	10,300	36.05	371,315.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	5.57	109,172.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	62,000	5.97	370,140.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.50	195,000.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	5.48	164,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	15.56	373,440.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	5.39	140,140.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	58,700	15.04	882,848.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.80	217,600.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.60	172,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	8.37	163,215.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.91	221,120.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00
BYD CO LTD-H	14,000	235.40	3,295,600.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.10	312,400.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	11,600	41.55	481,980.00
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	104,000	16.42	1,707,680.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	55,000	19.36	1,064,800.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56,000	7.84	439,040.00
MINTH GROUP LTD	14,000	33.95	475,300.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	11.00	220,000.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	19,200	127.60	2,449,920.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.04	218,160.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	39,800	28.35	1,128,330.00
LI NING CO LTD	40,000	82.15	3,286,000.00

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	14,700	145.00	2,131,500.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	7.98	103,740.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	2.04	48,960.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	20.10	422,100.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	11,000	19.36	212,960.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	16,000	17.12	273,920.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.84	168,000.00
CHINA LITERATURE LTD	6,800	46.65	317,220.00
KINGSOFT CORP LTD	17,800	33.30	592,740.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	8,600	89.75	771,850.00
NETEASE INC	35,700	154.20	5,504,940.00
TENCENT HOLDINGS LTD	102,400	472.00	48,332,800.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	269,640	118.70	32,006,268.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	38.75	387,500.00
CHINA RUYI HOLDINGS LIMITED	44,000	2.28	100,320.00
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	275,000	0.67	184,250.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,500	60.95	396,175.00
JD.COM INC - CL A	35,810	289.60	10,370,576.00
MEITUAN	72,600	219.60	15,942,960.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	7.79	186,960.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	11,000	58.10	639,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	3.41	107,415.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	114.63	252,186.00
CHINA FEIHE LTD	64,000	11.08	709,120.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	56,000	48.15	2,696,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	26,000	60.35	1,569,100.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.30	131,150.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	31,200	47.10	1,469,520.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	34.10	1,091,200.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	34,000	17.78	604,520.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	73.20	732,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	8.24	173,040.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	84,000	7.71	647,640.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	37.15	334,350.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	11,000	40.70	447,700.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	21.40	128,400.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	74,000	5.93	438,820.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6,400	36.65	234,560.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	8.05	161,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	21.55	258,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,400	25.15	186,110.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	48,800	9.82	479,216.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	15.32	251,248.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	19.22	507,408.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	24.50	85,750.00
3SBIO INC	20,500	6.45	132,225.00
AKESO INC	5,000	18.70	93,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,600	127.20	203,520.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	28,000	13.38	374,640.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	44,000	4.35	191,400.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	158,000	9.41	1,486,780.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20,000	24.70	494,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	74.20	140,980.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	16.86	404,640.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,000	28.65	573,000.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,600	85.65	222,690.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,000	30.80	308,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	183,250	5.47	1,002,377.50
WUXI APPTec CO LTD-H	6,168	90.70	559,437.60
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	64,000	56.00	3,584,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	462,000	3.12	1,441,440.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,410,000	3.18	4,483,800.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	5.52	888,720.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	69,000	1.84	126,960.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	167,000	3.86	644,620.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,709,000	6.14	10,493,260.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.03	142,410.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	69,500	68.45	4,757,275.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	3.20	353,920.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,002,000	4.88	4,889,760.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	148,000	6.63	981,240.00
(Right)CITIC SECURITIES CO LTD-RTS	6,525	1.98	12,919.50

CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	141,000	1.46	205,860.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.71	263,760.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,200	20.85	567,120.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	43,500	19.78	860,430.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	7.05	204,450.00
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	12.98	280,368.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	53,600	7.09	380,024.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	13.40	345,720.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	131,000	14.48	1,896,880.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	46,400	24.85	1,153,040.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,200	11.72	307,064.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,300	23.90	413,470.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.59	422,170.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	120,000	8.13	975,600.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	112,500	66.65	7,498,125.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,800	31.75	247,650.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	16.18	145,620.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	4.25	76,500.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	94,000	2.99	281,060.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	68,000	24.10	1,638,800.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	9.05	181,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	58,000	38.20	2,215,600.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,800	45.20	488,160.00
CHINA VANKE CO LTD-H	32,100	20.15	646,815.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	15.82	189,840.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	60,000	5.49	329,400.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	140,000	6.53	914,200.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	32,000	50.70	1,622,400.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	12.54	188,100.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	24,000	8.64	207,360.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,770	16.40	193,028.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	4.38	94,170.00
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	4.32	99,360.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	32,500	45.65	1,483,625.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	4.30	107,500.00
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	5.37	193,320.00

SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	6.15	123,000.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	7.06	70,600.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	57,000	9.68	551,760.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	22,000	8.92	196,240.00
WHARF HOLDINGS LTD	26,000	27.45	713,700.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	30,800	8.30	255,640.00
CHINA YOUZAN LTD	220,000	0.29	63,800.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	7.93	380,640.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	19.14	880,440.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	16.82	201,840.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	16.08	321,600.00
WEIMOB INC	38,000	6.29	239,020.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	23.50	329,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	11,000	23.45	257,950.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,000	39.00	507,000.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	13.74	226,710.00
LENOVO GROUP LTD	128,000	8.77	1,122,560.00
SUNNY OPTICAL TECH	12,600	192.80	2,429,280.00
XIAOMI CORP-CLASS B	253,800	16.34	4,147,092.00
ZTE CORP-H	15,400	20.05	308,770.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	834,000	0.97	808,980.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	28.15	239,275.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.09	234,840.00
CGN POWER CO LTD-H	202,000	2.28	460,560.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	53,600	13.80	739,680.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	59,000	15.60	920,400.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	99,000	3.89	385,110.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,000	39.05	624,800.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	36,000	18.52	666,720.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	14,000	122.10	1,709,400.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	10.94	612,640.00
HUANENG POWER INTL INC-H	60,000	4.04	242,400.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	8.49	560,340.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	28.70	200,900.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	36.85	368,500.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	86,000	13.52	1,162,720.00

	香港ドル 小計	15,357,363		258,728,791.60 (3,826,598,827)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.86	199,628.00
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	20.90	123,310.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	44,400	9.26	411,144.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	53,500	6.70	358,450.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	12,300	7.60	93,480.00
	SIME DARBY BERHAD	32,000	2.28	72,960.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,700	6.20	140,740.00
	MISC BHD	26,800	6.98	187,064.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	3.93	77,028.00
	GENTING BHD	41,300	4.64	191,632.00
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.91	162,087.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	23.80	49,980.00
	IOI CORP BHD	49,600	4.14	205,344.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,300	24.36	202,188.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,300	133.90	174,070.00
	PPB GROUP BERHAD	11,120	16.60	184,592.00
	QL RESOURCES BHD	17,150	4.86	83,349.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.24	128,896.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	33,500	5.04	168,840.00
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.50	206,700.00
	TOP GLOVE CORP BHD	80,000	2.12	169,600.00
	AMMB HOLDINGS BHD	36,600	3.41	124,806.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	111,300	5.61	624,393.00
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	20.26	249,198.00
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	19.00	100,700.00
	MALAYAN BANKING BHD	80,300	8.60	690,580.00
	PUBLIC BANK BERHAD	253,200	4.36	1,103,952.00
	RHB BANK BHD	26,900	5.82	156,558.00
	INARI AMERTRON BHD	42,600	3.20	136,320.00
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.96	189,288.00
DIGI.COM BHD	52,900	4.19	221,651.00	
MAXIS BHD	45,700	4.48	204,736.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.29	97,336.00	
PETRONAS GAS BHD	14,000	17.38	243,320.00	

	TENAGA NASIONAL BHD	42,100	9.12	383,952.00
	マレーシアリングット 小計	1,438,670		8,117,872.00 (223,736,670)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	133.50	3,163,950.00
	PTT PCL-NVDR	174,400	40.50	7,063,200.00
	THAI OIL PCL-NVDR	16,000	53.50	856,000.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	25,900	50.75	1,314,425.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	57.25	2,410,225.00
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	19,800	62.00	1,227,600.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	383.00	5,170,500.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	73,800	63.75	4,704,750.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.65	1,339,885.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	9.30	1,463,820.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.94	941,564.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	59,300	31.75	1,882,775.00
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	38.00	1,262,550.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	111,200	14.80	1,645,760.00
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	25.25	1,376,125.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	32.50	536,250.00
	CP ALL PCL-NVDR	101,900	64.00	6,521,600.00
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	98.50	482,650.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	25.50	1,874,250.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	33.00	643,500.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	21.00	1,020,600.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	176,000	22.90	4,030,400.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	151.00	1,494,900.00
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	29.00	388,600.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	48,300	14.30	690,690.00
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	134.00	2,063,600.00
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	37,300	21.20	790,760.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	67.25	988,575.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	56.75	925,025.00
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	62.00	1,004,400.00
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	56.00	2,156,000.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	9.65	1,507,330.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	6,200	387.00	2,399,400.00	

	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,600	234.00	4,820,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	21,200	77.75	1,648,300.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	167,500	4.94	827,450.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	32.50	308,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	174.50	698,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	91.50	2,562,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	74.00	984,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	54,100	50.00	2,705,000.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	45.50	509,600.00	
	タイパーツ 小計	2,293,025		80,405,359.00 (287,047,131)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	29,260	58.05	1,698,543.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	852.00	4,047,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	560.00	873,600.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	58.85	3,030,245.35	
	SM INVESTMENTS CORP	4,000	940.00	3,760,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	16,350	208.60	3,410,610.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	249.00	1,730,550.00	
	MONDE NISSIN CORP	90,200	17.00	1,533,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,410	127.00	2,211,070.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	100.00	3,468,000.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	138.30	4,897,203.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	36,812	59.50	2,190,314.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	283,000	3.67	1,038,610.00	
	AYALA LAND INC	152,200	37.85	5,760,770.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	173,800	38.00	6,604,400.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,784.00	1,252,800.00	
	PLDT INC	1,175	1,820.00	2,138,500.00	
	AC ENERGY CORP	154,600	8.60	1,329,560.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	4,650	362.00	1,683,300.00	
	フィリピンペン 小計	1,098,748		52,658,475.35 (118,323,594)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	226,800	2,230.00	505,764,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	23,450.00	792,610,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	175,600	1,890.00	331,884,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	1,000.00	559,600,000.00	

	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,575.00	408,292,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	10,775.00	249,980,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	209,100	3,650.00	763,215,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	7,200.00	398,160,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	353,700	5,300.00	1,874,610,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	5,800.00	806,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	30,900.00	203,940,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	47,000	8,550.00	401,850,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,350.00	515,620,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	140,700	3,850.00	541,695,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,600.00	554,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	982,100	7,700.00	7,562,170,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	327,300	7,800.00	2,552,940,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	136,500	7,700.00	1,051,050,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,206,045	4,410.00	5,318,658,450.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,035.00	359,455,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	873,900	4,400.00	3,845,160,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,750.00	387,475,000.00	
	インドネシアルピア 小計	6,466,045		29,984,729,450.00 (242,876,308)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	41,400.00	35,107,200.00	
	S-OIL CORP	847	90,300.00	76,484,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	896	204,500.00	183,232,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,345	32,800.00	76,916,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,620	39,950.00	64,719,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	158	532,000.00	84,056,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	154,000.00	47,278,000.00	
	LG CHEM LTD	805	619,000.00	498,295,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	313,000.00	41,629,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	320	218,500.00	69,920,000.00	
	POSCO	1,302	284,000.00	369,768,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	576	109,000.00	62,784,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	263	125,500.00	33,006,500.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	361	117,000.00	42,237,000.00	
	SKC CO LTD	401	134,000.00	53,734,000.00	
	CJ CORP	193	81,800.00	15,787,400.00	

DOOSAN BOBCAT INC	883	38,400.00	33,907,200.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	6,396	15,600.00	99,777,600.00	
ECOPRO BM CO LTD	207	330,400.00	68,392,800.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	38,450.00	48,216,300.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,469	40,900.00	60,082,100.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	49,250.00	40,040,250.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,409	35,350.00	49,808,150.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	81,400.00	58,526,600.00	
LG CORP	1,582	75,500.00	119,441,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	374	463,000.00	173,162,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,449	107,500.00	155,767,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,961	23,000.00	68,103,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,107	5,320.00	64,409,240.00	
SK	724	221,500.00	160,366,000.00	
S-1 CORPORATION	228	67,800.00	15,458,400.00	
CJ LOGISTICS	135	117,500.00	15,862,500.00	
HMM CO LTD	4,920	25,000.00	123,000,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	287	167,500.00	48,072,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	29,900.00	95,261,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	6,080.00	32,564,480.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	35,150.00	48,963,950.00	
HANON SYSTEMS	3,541	11,500.00	40,721,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,161	223,000.00	258,903,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,447	176,500.00	431,895,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	95,600.00	58,316,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	93,700.00	31,483,200.00	
KIA CORP	4,629	77,000.00	356,433,000.00	
COWAY CO LTD	1,045	71,500.00	74,717,500.00	
F&F CO LTD / NEW	65	912,000.00	59,280,000.00	
HLB INC	1,659	29,700.00	49,272,300.00	
LG ELECTRONICS INC	1,859	123,000.00	228,657,000.00	
KANGWON LAND INC	1,879	25,750.00	48,384,250.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,950.00	24,097,500.00	
HYBE CO LTD	292	254,000.00	74,168,000.00	
KAKAO CORP	5,480	88,800.00	486,624,000.00	
KAKAO GAMES CORP	600	69,500.00	41,700,000.00	

KRAFTON INC	400	267,500.00	107,000,000.00	
NAVER CORP	2,175	322,000.00	700,350,000.00	
NCSOFT CORP	284	510,000.00	144,840,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	99,700.00	39,082,400.00	
PEARL ABYSS CORP	460	95,000.00	43,700,000.00	
CJ ENM CO LTD	195	124,000.00	24,180,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	78,800.00	47,437,600.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	84,500.00	18,759,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	165,500.00	22,839,000.00	
E-MART INC	374	131,500.00	49,181,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	160	371,500.00	59,440,000.00	
KT&G CORP	1,988	79,600.00	158,244,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	99,600.00	41,035,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	611	172,500.00	105,397,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	44,100.00	18,918,900.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	176	950,000.00	167,200,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	550,000.00	17,050,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,458	63,400.00	92,437,200.00	
SD BIOSENSOR INC	691	59,800.00	41,321,800.00	
ALTEOGEN INC	544	48,000.00	26,112,000.00	
CELLTRION INC	1,725	158,500.00	273,412,500.00	
CELLTRION PHARM INC	339	85,800.00	29,086,200.00	
GREEN CROSS CORP	90	185,000.00	16,650,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	137	255,000.00	34,935,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	289	763,000.00	220,507,000.00	
SEEGENE INC	734	51,800.00	38,021,200.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	652	23,950.00	15,615,400.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	78,800.00	41,685,200.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	417	162,500.00	67,762,500.00	
YUHAN CORP	794	56,500.00	44,861,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,241	50,000.00	262,050,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	11,050.00	49,227,750.00	
KAKAOBANK CORP	1,800	43,950.00	79,110,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	6,950	64,600.00	448,970,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	7,695	40,400.00	310,878,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	8,605	14,700.00	126,493,500.00	

	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	649	78,600.00	51,011,400.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	6,100.00	37,088,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,653	8,980.00	50,763,940.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	11,900.00	35,271,600.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	42,000.00	51,324,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	911	63,600.00	57,939,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	511	212,500.00	108,587,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,244	62,700.00	77,998,800.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	357	51,800.00	18,492,600.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	647	137,000.00	88,639,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	440	91,200.00	40,128,000.00	
	L&F CO LTD	420	179,000.00	75,180,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,329	19,200.00	83,116,800.00	
	LG INNOTEK CO LTD	235	315,000.00	74,025,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	973	162,500.00	158,112,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	84,863	73,700.00	6,254,403,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	14,570	67,100.00	977,647,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	972	526,000.00	511,272,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,303	13,400.00	44,260,200.00	
	SK TELECOM	476	54,700.00	26,037,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,725	22,200.00	104,895,000.00	
	SK HYNIX INC	9,673	132,500.00	1,281,672,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	308	54,600.00	16,816,800.00	
	韓国ウォン 小計	283,599		19,807,263,110.00 (1,909,420,163)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	98.90	1,879,100.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	45.30	1,857,300.00	
	CHINA STEEL CORP	209,000	35.50	7,419,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	65,000	80.20	5,213,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	67,000	105.00	7,035,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	91,000	88.40	8,044,400.00	
	TAIWAN CEMENT	91,477	47.15	4,313,140.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,600	940.00	2,444,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	29.45	1,619,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,299	272.00	1,441,328.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,280.00	1,280,000.00	

EVERGREEN MARINE CORP LTD	44,550	130.00	5,791,500.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.00	1,102,000.00	
WAN HAI LINES LTD	11,000	180.00	1,980,000.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	30,000	110.50	3,315,000.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.25	1,057,500.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	586.00	1,769,720.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	221.00	1,785,680.00	
GIANT MANUFACTURING	6,000	302.50	1,815,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	372.00	1,116,000.00	
POU CHEN	45,000	32.15	1,446,750.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	631.00	3,155,000.00	
MOMO.COM INC	1,000	1,110.00	1,110,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	261.00	2,610,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	85,000	68.10	5,788,500.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	4,000	243.00	972,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	72,332	18.00	1,301,976.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	328,000	28.65	9,397,200.00	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	211,900	30.35	6,431,165.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	182,263	26.40	4,811,743.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	159,991	22.85	3,655,794.35	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	192,000	38.45	7,382,400.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	17.40	3,166,713.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	177,708	20.30	3,607,472.40	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	167,361	27.45	4,594,059.45	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	67,000	49.15	3,293,050.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	22,996	266.50	6,128,434.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	170,920	25.45	4,349,914.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	140,000	64.20	8,988,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	282,000	19.20	5,414,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	133,500	76.10	10,159,350.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	11.30	2,438,935.50	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	23,072	67.50	1,557,360.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	9,000	256.00	2,304,000.00	
ACER INC	56,000	28.60	1,601,600.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	379.00	2,766,321.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	12,000	363.00	4,356,000.00	

AU OPTRONICS CORP	141,000	20.95	2,953,950.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,000	153.50	1,995,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	78,000	25.50	1,989,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	34,000	256.00	8,704,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	18,000	62.30	1,121,400.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	221,800	104.00	23,067,200.00	
INNOLUX CORP	163,000	16.90	2,754,700.00	
INVENTEC CORP	52,000	25.40	1,320,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,900	2,080.00	3,952,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	39,000	66.70	2,601,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	11,000	153.00	1,683,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	496.00	1,984,000.00	
PEGATRON CORP	37,000	69.60	2,575,200.00	
QUANTA COMPUTER INC	48,000	92.60	4,444,800.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	69.00	1,794,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	21,000	217.50	4,567,500.00	
WISTRON CORP	52,951	30.30	1,604,415.30	
WIWYNN CORP	1,500	989.00	1,483,500.00	
WPG HOLDINGS LTD	26,960	55.80	1,504,368.00	
YAGEO CORPORATION	7,198	464.00	3,339,872.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,000	92.50	1,202,500.00	
CHUNGWA TELECOM CO LTD	67,000	120.00	8,040,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	30,000	66.90	2,007,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	30,000	103.00	3,090,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	58,000	100.00	5,800,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,795.00	897,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,650.00	1,650,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	719.00	2,876,000.00	
MEDIATEK INC	26,800	1,105.00	29,614,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	78.70	1,652,700.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	454.50	4,545,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,400	2,045.00	2,863,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	487.50	3,900,000.00	
SILERGY CORP	1,410	3,825.00	5,393,250.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	438,000	637.00	279,006,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	209,000	53.00	11,077,000.00	

	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	124.00	1,860,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	312.50	1,875,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	50,000	32.10	1,605,000.00	
	新台湾ドル 小計	5,771,617		619,461,511.75 (2,564,880,389)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,143	361.70	5,838,923.10	
	COAL INDIA LTD	25,983	161.65	4,200,151.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,986	289.75	2,893,443.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	35,280	116.55	4,111,884.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,103	166.20	7,163,718.60	
	PETRONET LNG LTD	12,992	216.05	2,806,921.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	50,611	2,338.55	118,356,354.05	
	ACC LTD	1,469	2,153.90	3,164,079.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	13,774	355.10	4,891,147.40	
	ASIAN PAINTS LTD	6,736	3,143.45	21,174,279.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	699.80	2,852,384.80	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	4,892	1,642.95	8,037,311.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	27,397	521.25	14,280,686.25	
	JSW STEEL LTD	14,544	626.55	9,112,543.20	
	PI INDUSTRIES LTD	1,583	2,540.95	4,022,323.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,388.55	6,554,181.20	
	SHREE CEMENT LTD	197	23,589.20	4,647,072.40	
	SRF LTD	2,458	2,345.65	5,765,607.70	
	TATA STEEL LTD	12,591	1,186.85	14,943,628.35	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,758	7,089.10	12,462,637.80	
	UPL LTD	9,171	721.70	6,618,710.70	
	VEDANTA LTD	20,779	361.50	7,511,608.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,705	1,663.95	7,828,884.75	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	22,968	195.90	4,499,431.20	
	HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,156.05	5,217,253.65	
	LARSEN & TOUBRO LTD	12,072	1,799.00	21,717,528.00	
SIEMENS LTD	1,348	2,330.40	3,141,379.20		
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,422	798.35	3,530,303.70		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	9,517	695.75	6,621,452.75		
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,598	588.35	2,116,883.30		
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	2,092.30	4,033,954.40		

BAJAJ AUTO LTD	1, 154	3, 487. 95	4, 025, 094. 30
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1, 609	2, 084. 95	3, 354, 684. 55
BHARAT FORGE LTD	4, 571	700. 10	3, 200, 157. 10
EICHER MOTORS LTD	2, 527	2, 570. 80	6, 496, 411. 60
HERO MOTOCORP LTD	2, 256	2, 648. 50	5, 975, 016. 00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	15, 155	825. 05	12, 503, 632. 75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2, 383	8, 366. 40	19, 937, 131. 20
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	23, 659	197. 34	4, 668, 867. 06
MRF LTD	38	65, 929. 00	2, 505, 302. 00
TATA MOTORS LTD	28, 949	471. 45	13, 648, 006. 05
PAGE INDUSTRIES LTD	89	39, 129. 30	3, 482, 507. 70
TITAN CO LTD	6, 204	2, 398. 00	14, 877, 192. 00
JUBILANT FOODWORKS LTD	1, 498	2, 947. 70	4, 415, 654. 60
INFO EDGE INDIA LTD	1, 429	4, 511. 40	6, 446, 790. 60
TRENT LTD	3, 269	1, 036. 30	3, 387, 664. 70
ZOMATO LTD	27, 665	82. 45	2, 280, 979. 25
AVENUE SUPERMARTS LTD	2, 821	3, 979. 75	11, 226, 874. 75
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1, 847	3, 398. 00	6, 276, 106. 00
ITC LTD	54, 609	219. 45	11, 983, 945. 05
NESTLE INDIA LTD	623	17, 670. 25	11, 008, 565. 75
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11, 092	694. 30	7, 701, 175. 60
UNITED SPIRITS LTD	4, 671	813. 60	3, 800, 325. 60
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2, 394	1, 413. 30	3, 383, 440. 20
DABUR INDIA LTD	10, 503	553. 10	5, 809, 209. 30
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6, 424	799. 75	5, 137, 594. 00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	14, 503	2, 228. 55	32, 320, 660. 65
MARICO LTD	9, 787	489. 80	4, 793, 672. 60
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1, 882	4, 486. 35	8, 443, 310. 70
AUROBINDO PHARMA LTD	4, 528	680. 40	3, 080, 851. 20
BIOCON LTD	8, 322	393. 55	3, 275, 123. 10
CIPLA LTD	9, 018	954. 90	8, 611, 288. 20
DIVI' S LABORATORIES LTD	2, 293	4, 277. 90	9, 809, 224. 70
DR. REDDY' S LABORATORIES	2, 154	4, 204. 60	9, 056, 708. 40
LUPIN LTD	4, 421	761. 35	3, 365, 928. 35
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14, 592	864. 85	12, 619, 891. 20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	2, 551. 20	2, 224, 646. 40

AXIS BANK LTD	39,962	773.35	30,904,612.70
BANDHAN BANK LTD	12,468	310.60	3,872,560.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	30,413	2,296.80	69,852,578.40
ICICI BANK LTD	90,857	753.70	68,478,920.90
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	9,726	1,746.85	16,989,863.10
STATE BANK OF INDIA	31,195	501.40	15,641,173.00
YES BANK LTD	214,143	13.25	2,837,394.75
BAJAJ FINANCE LTD	4,790	6,785.95	32,504,700.50
BAJAJ FINSERV LTD	660	15,674.15	10,344,939.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,646	660.00	4,386,360.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,091	2,172.35	2,370,033.85
MUTHOOT FINANCE LTD	2,371	1,355.20	3,213,179.20
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,065	2,255.40	4,657,401.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	824.00	3,584,400.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,160.85	4,466,950.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	16,905	557.30	9,421,156.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,188	1,285.75	5,384,721.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	502.60	3,031,180.60
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	7,738	1,096.30	8,483,169.40
DLF LTD	11,721	355.05	4,161,541.05
GODREJ PROPERTIES LTD	2,400	1,472.20	3,533,280.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	19,104	1,146.45	21,901,780.80
INFOSYS LTD	60,457	1,682.20	101,700,765.40
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,030	5,885.35	6,061,910.50
MINDTREE LTD	1,148	3,776.45	4,335,364.60
MPHASIS LTD	1,375	2,899.95	3,987,431.25
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	16,384	3,733.75	61,173,760.00
TECH MAHINDRA LTD	11,055	1,390.15	15,368,108.25
WIPRO LTD	23,970	541.70	12,984,549.00
BHARTI AIRTEL LTD	43,560	689.70	30,043,332.00
INDUS TOWERS LTD	13,541	247.20	3,347,335.20
ADANI GREEN ENERGY LTD	6,776	1,862.15	12,617,928.40
ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	1,712.30	8,647,115.00
ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	1,915.25	9,672,012.50
GAIL INDIA LTD	29,821	137.55	4,101,878.55
INDRAPRASTHA GAS LTD	3,739	380.65	1,423,250.35

	NTPC LTD	83,762	132.50	11,098,465.00
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	54,298	201.85	10,960,051.30
	TATA POWER CO LTD	24,154	220.50	5,325,957.00
	インドルピー 小計	1,580,991		1,238,121,414.46 (1,906,706,978)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	19.48	191,585.80
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	48,704	3.47	169,002.88
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.70	204,898.06
	INDUSTRIES QATAR	27,513	18.03	496,059.39
	COMMERCIAL BANK PQSC	28,465	6.96	198,116.40
	MASRAF AL RAYAN	90,428	4.99	452,049.57
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	10.30	154,942.90
	QATAR ISLAMIC BANK	21,511	20.08	431,940.88
	QATAR NATIONAL BANK	78,249	21.07	1,648,706.43
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.43	139,749.54
	QOOREDOO QPSC	12,412	7.38	91,600.56
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	18.10	146,573.80
	カタールリアル 小計	456,774		4,325,226.21 (137,023,166)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	192.15	808,375.05
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,290	254.89	583,698.10
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	983	1,932.25	1,899,401.75
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,153	323.00	2,310,419.00
	GOLD FIELDS LTD	15,294	184.44	2,820,825.36
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	58.55	629,939.45
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	14,294	239.27	3,420,125.38
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	671.27	716,245.09
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,936	210.72	1,250,833.92
	SASOL LTD	9,875	339.31	3,350,686.25
	SIBANYE STILLWATER LTD	47,629	61.60	2,933,946.40
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	212.00	1,121,480.00
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,242	125.24	906,988.08
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	213.91	994,895.41
	NASPERS LTD-N SHS	3,817	2,287.19	8,730,204.23
	PEPKOR HOLDINGS LTD	24,000	22.73	545,520.00
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	18,906	53.31	1,007,878.86	

	BID CORP LTD	6,193	329.81	2,042,513.33
	CLICKS GROUP LTD	4,114	298.66	1,228,687.24
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,578	222.35	1,907,318.30
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	170.50	627,440.00
	TIGER BRANDS LTD	3,270	173.52	567,410.40
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,294	202.44	1,476,597.36
	ABSA GROUP LTD	13,383	175.77	2,352,329.91
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,414	2,113.37	2,988,305.18
	NEDBANK GROUP LTD	7,694	206.60	1,589,580.40
	STANDARD BANK GROUP LTD	22,686	154.58	3,506,801.88
	FIRSTRAND LTD	88,928	63.78	5,671,827.84
	REINET INVESTMENTS SCA	2,729	319.90	873,007.10
	REMGRO LTD	10,067	133.90	1,347,971.30
	DISCOVERY LTD	8,270	161.50	1,335,605.00
	OLD MUTUAL LTD	90,974	13.62	1,239,065.88
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	15,014	48.90	734,184.60
	SANLAM LTD	32,128	65.11	2,091,854.08
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,950	105.27	836,896.50
	MTN GROUP LTD	29,863	187.44	5,597,520.72
	VODACOM GROUP LTD	11,161	148.29	1,655,064.69
	南アフリカランド 小計	558,783		73,701,444.04 (562,342,018)
アラブディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	48,436	4.09	198,103.24
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,749	9.57	485,667.93
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	27,087	8.05	218,050.35
	DUBAI ISLAMIC BANK	54,804	5.68	311,286.72
	EMIRATES NBD PJSC	49,345	13.90	685,895.50
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	75,394	20.74	1,563,671.56
	ALDAR PROPERTIES PJSC	72,043	4.22	304,021.46
	EMAAR PROPERTIES PJSC	74,686	4.84	361,480.24
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	60,264	33.10	1,994,738.40
	アラブディールハム 小計	512,808		6,122,915.40 (192,749,376)
クウェートディール	AGILITY	23,191	1.01	23,562.05
	BOUBYAN BANK K. S. C	21,129	0.81	17,241.26
	KUWAIT FINANCE HOUSE	81,445	0.90	73,544.83

	NATIONAL BANK OF KUWAIT	120,535	1.03	124,392.12
	MABANEE CO KPSC	11,548	0.80	9,330.78
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,960	0.61	22,007.52
	クウェートディナール 小計	293,808		270,078.56 (103,253,734)
オフショア人民 元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.44	144,300.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	8,900	25.77	229,353.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.79	19,686.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	6.68	7,348.00
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.75	2,375.00
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.82	126,294.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	13.97	132,715.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	9.21	78,469.20
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	2,900	13.07	37,903.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	991	29.67	29,402.97
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	46.22	41,598.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	6.06	76,962.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	42.45	165,555.00
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	50.17	25,085.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	24,500	7.36	180,320.00
	BBMG CORPORATION-A	900	2.92	2,628.00
	BEIJING EASPRING MATERIAL-A	700	75.53	52,871.00
	CHENGTUN MINING GROUP CO -A	4,400	9.67	42,548.00
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	1,400	48.24	67,536.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.02	36,048.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	16.72	55,410.08
	CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	1,900	34.46	65,474.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	5.69	97,868.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	43.99	153,965.00
	CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	3,300	10.45	34,485.00
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	1,500	41.28	61,920.00
	GEM CO LTD-A	3,500	9.19	32,165.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	87.20	103,768.00
	HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	29.57	59,140.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	25.16	143,915.20
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.28	20,046.00	

HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.50	3,750.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	700	106.06	74,242.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	9.81	45,126.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	20.74	22,814.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	1,900	33.57	63,783.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.85	20,475.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.50	110,750.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.02	17,570.00
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	5,900	9.22	54,398.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	17.30	55,360.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	123.49	37,047.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	54.97	27,485.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	22.18	44,360.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	136.50	150,150.00
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	3,200	10.76	34,432.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	25.14	42,738.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	15.94	30,286.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	17.52	106,872.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.71	26,712.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	19.67	197,683.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	1,680	46.26	77,716.80
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	19.97	69,255.96
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	35.17	64,009.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	4.70	47,000.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.57	25,454.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	128.00	92,160.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	13.72	50,764.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	7.30	35,040.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	17.81	30,277.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	87.29	52,374.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	1,200	31.24	37,488.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	14,200	3.77	53,534.00
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	2,400	21.58	51,792.00
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	1,900	25.41	48,279.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	28.68	63,096.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	4.03	2,418.00

SKSHU PAINT CO LTD-A	560	109.16	61,129.60
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	7,500	8.94	67,050.00
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	1,500	29.85	44,775.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	22.38	33,570.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	10,400	3.86	40,144.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.90	10,270.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	99.12	376,656.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	68.98	27,592.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	1,000	76.50	76,500.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	20.69	24,828.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	4,100	11.02	45,182.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	8.71	20,729.80
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	700	126.84	88,788.00
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	12.90	39,990.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	1,000	227.36	227,360.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	3,500	23.05	80,675.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	101.00	117,160.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	13.30	30,590.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.82	41,024.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	1,500	31.10	46,650.00
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	4,500	9.08	40,860.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,500	11.06	293,090.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	23.77	23,770.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	47.55	118,875.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	12.38	37,140.00
AVICOPTER PLC-A	500	55.91	27,955.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	33.61	47,054.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	109.92	43,968.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	13.19	59,355.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	21.55	94,820.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	10.43	101,171.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.47	138,458.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	45,100	5.35	241,285.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,500	508.00	1,270,000.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	18,400	3.23	59,432.00
CRRC CORP LTD-A	26,200	5.96	156,152.00

DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,400	15.99	70,356.00
EVE ENERGY CO LTD-A	2,020	83.50	168,670.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	9.73	4,057.41
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	400	201.05	80,420.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	39.42	70,956.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	143.90	57,560.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	35.96	21,576.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	59.08	17,724.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,436	65.00	93,340.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	15.72	40,872.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	19.95	43,890.00
LUOYANG XINQIANGLIAN SLEWI-A	200	131.00	26,200.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	4.10	89,380.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	1,800	24.00	43,200.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	5,946	31.94	189,915.24
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	2,400	18.08	43,392.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	16,500	9.12	150,480.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	24.36	48,720.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	9,100	20.46	186,186.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.54	19,824.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.50	46,800.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	60.56	163,512.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	4,500	10.81	48,645.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	1,500	42.89	64,335.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	95.58	143,370.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	34.22	44,486.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	448.75	71,800.00
TBEA CO LTD-A	5,500	18.82	103,510.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	2,800	19.40	54,320.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	5,900	15.25	89,975.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	121.93	60,965.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	5.74	44,198.00
XIAMEN C & D INC-A	300	9.83	2,949.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	14.44	49,096.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	30.91	30,291.80
YOUNGY CO LTD-A	400	102.00	40,800.00

ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.07	32,171.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	42.53	85,060.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	63.15	26,523.00
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	76.48	61,184.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	18.94	56,630.60
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	22.27	28,951.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	16.42	65,680.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	7.39	47,296.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	6.88	17,888.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	54.55	43,640.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	1,800	30.74	55,332.00
AIR CHINA LTD-A	6,400	10.82	69,248.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	44,000	5.30	233,200.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	5.84	63,072.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	7.41	67,431.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	16.15	207,850.50
S F HOLDING CO LTD-A	5,600	60.88	340,928.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	57.45	57,450.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.88	52,332.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.35	8,700.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	16.14	64,560.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	4,870	18.38	89,510.60
AUTEL INTELLIGENT TECHNOLO-A	1,000	53.88	53,880.00
BYD CO LTD -A	2,100	231.98	487,158.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	158.10	31,620.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	12.47	75,069.40
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	9.71	31,072.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	46.06	87,514.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	38.10	125,730.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	26.28	78,840.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	117.70	58,850.00
MIANYANG FULIN PRECISION C-A	1,100	23.41	25,751.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	16.66	19,992.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,100	51.80	56,980.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,610	18.80	161,868.00
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	10.98	34,038.00

SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	27.70	36,010.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	400	129.83	51,932.00
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	200	817.00	163,400.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	124.50	74,700.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	6,900	25.89	178,641.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	24.00	26,400.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	34.33	34,330.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	70.88	56,704.00
NAVINFO CO LTD-A	900	16.58	14,922.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	129.92	70,156.80
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	4.39	19,755.00
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	800	75.39	60,312.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	5.76	81,216.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	31.14	15,881.40
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.47	2,988.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	51.03	15,309.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	60.28	36,168.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	7.31	60,673.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	16.51	17,830.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	10.21	13,273.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	15,900	7.99	127,041.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	354.99	35,499.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	9.91	1,982.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	18.49	14,792.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	37.15	115,536.50
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	13.78	18,603.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	3,900	25.10	97,890.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	7,100	6.99	49,629.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	2,100	227.50	477,750.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.17	50,850.00
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	3.80	34,580.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.58	33,480.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	36.37	26,186.40
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	43.52	12,185.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	49.69	27,130.74
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	3.86	11,966.00

ANGEL YEAST CO LTD-A	700	55.67	38,969.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	600	236.90	142,140.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	74.40	37,200.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	600	68.01	40,806.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD	400	135.86	54,344.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	8.23	4,115.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	28.13	16,878.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	56.59	22,636.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	138.32	55,328.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	31.90	22,330.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,190	96.00	402,240.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	21.40	19,260.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,800	66.75	120,150.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	13.74	34,350.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	30.88	74,112.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	6,900	40.00	276,000.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	54.14	54,140.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,600	172.96	276,736.00
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	2,000	7.24	14,480.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	162.20	64,880.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	35.53	10,659.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	55.20	16,560.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,300	1,868.67	2,429,271.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,600	219.40	351,040.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,716	59.18	338,272.88
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	7,600	16.56	125,856.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	43.25	42,385.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,320	293.10	386,892.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	97.97	39,188.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	26.55	18,585.00
TONGWEI CO LTD-A	4,900	37.45	183,505.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	94.89	85,401.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	7,060	21.20	149,672.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,200	198.01	831,642.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	56.76	124,872.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	18.62	20,482.00

BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	26.63	34,619.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	15.20	15,200.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	171.71	17,171.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	40.49	24,294.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	33.40	185,871.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	48.65	30,649.50
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	28.34	11,336.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	75.75	53,025.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	36.06	62,744.40
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	450	51.14	23,013.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	47.55	56,109.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	30.20	15,100.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	13.71	2,742.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	1,900	21.00	39,900.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.25	3,480.00
OVCTEK CHINA INC-A	920	39.79	36,606.80
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	19.00	38,000.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,300	298.90	388,570.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	1,000	36.87	36,870.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	148.70	44,610.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	11.41	11,866.40
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	26.06	23,454.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	276.60	55,320.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	27.57	29,775.60
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	500	206.19	103,095.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	58.50	17,550.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	86.00	25,800.00
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	252.98	50,596.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	163.55	65,420.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	34.22	3,422.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	122.48	244,960.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	17.74	17,030.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	36.80	3,680.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	29.50	41,300.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	93.16	27,948.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	25.73	45,799.40

HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	19.05	26,670.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	412.62	123,786.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,916	39.75	274,911.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.90	19,040.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	90.45	50,652.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	35.70	17,850.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	33.95	28,687.75
PHARMABLOCK SCIENCES NANJI-A	400	82.28	32,912.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	107.14	74,998.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.94	5,184.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	41.58	79,002.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	835	60.08	50,166.80
SHANGHAI MEDICILON INC-A	200	325.36	65,072.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	6.81	19,749.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	78.20	46,920.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	24.58	2,458.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	21.81	30,534.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	18.04	3,608.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	50.00	75,000.00
WUXI APTEC CO LTD-A	3,128	85.30	266,818.40
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,400	92.17	129,038.00
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	700	342.50	239,750.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	19.86	24,030.60
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	40.13	52,169.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	32.21	68,800.56
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	42.37	16,948.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	3.04	215,536.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.62	86,394.00
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	7,500	8.11	60,825.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	14.34	21,510.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.17	106,512.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.92	184,500.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.65	84,970.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.78	101,022.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	10.12	90,068.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	39.81	314,499.00

BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.21	98,128.10
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	6.26	57,592.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	56,300	3.44	193,672.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	22,100	51.20	1,131,520.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	3.96	118,008.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.51	59,319.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	4.01	34,085.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.76	70,848.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.80	371,520.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	22,400	22.25	498,400.00
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	16.58	381,340.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	29,400	5.84	171,696.00
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.83	20,299.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	36,600	8.60	314,760.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.96	3,564.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	11.80	35,400.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	9.79	14,685.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.08	48,144.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.64	29,792.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	11.00	33,000.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	43.43	52,116.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	8,200	16.63	136,366.00
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	24.80	275,280.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	26.00	130,000.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	6,200	10.60	65,720.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	11,204	27.49	307,997.96
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	13.88	44,416.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.60	3,300.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	7.52	54,144.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	18.80	110,920.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	3,240	8.59	27,831.60
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	15.16	33,352.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	10.97	50,462.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8,300	17.66	146,578.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.39	3,695.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.71	104,219.00

HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	109.54	54,770.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,100	16.87	136,647.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.25	2,775.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.50	56,950.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	9.02	14,432.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.58	25,740.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	12.39	64,428.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	7.67	41,970.24
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.07	10,175.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.04	2,416.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.74	128,928.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	10.44	44,892.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	9,700	8.04	77,988.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.84	18,392.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	3.80	16,340.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	7.77	3,885.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	11.92	15,496.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	8.75	91,875.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	30.80	77,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.92	187,064.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	39.79	75,601.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	4.74	16,590.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,400	53.90	668,360.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	13.84	110,720.00
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	20.24	259,072.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	33.88	81,312.00
GEMDALE CORP-A	3,300	12.28	40,524.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.48	66,796.80
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.82	3,374.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	15.31	195,968.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.19	2,514.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	14.60	24,528.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	14.23	12,807.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.89	21,359.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.68	60,840.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	8,400	10.61	89,124.00

BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	25.55	12,264.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	212.79	127,674.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	24.50	3,430.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.00	9,800.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	13.99	9,793.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	8.15	3,260.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	2,364	52.22	123,448.08
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	49.15	122,875.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	29.06	23,248.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	144.50	57,800.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,920	51.22	98,342.40
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	125.60	37,680.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	15.13	13,617.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	3,708	32.00	118,656.00
ADDSINO CO LTD -A	1,700	14.87	25,279.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	34.26	78,798.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	35.13	17,565.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	152.30	30,460.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	41,400	4.93	204,102.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	34.64	62,352.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	12.90	33,540.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	4.94	54,340.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	108.07	54,035.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	16.86	18,546.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.26	79,946.00
GOERTEK INC -A	3,300	40.91	135,003.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	12.94	28,468.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	6.10	42,090.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.64	2,892.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	76.42	38,210.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	3,700	13.62	50,394.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	23.52	23,520.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	30.82	18,492.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	14.71	67,666.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	9.01	20,723.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	7,633	41.90	319,822.70

MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	247.50	89,100.00
NINESTAR CORP-A	1,800	48.50	87,300.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	7.38	2,952.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	64.70	45,290.00
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	200	302.92	60,584.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,300	19.44	44,712.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	112.70	31,556.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	13.63	13,630.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	32.27	25,816.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	21.98	19,782.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	1,000	131.93	131,930.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	23.53	16,471.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	37.52	26,264.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	12.09	29,016.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	20.41	38,289.16
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	14.13	18,369.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	1,300	38.89	50,557.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	106.47	127,764.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	21.57	41,069.28
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	9.43	23,575.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	15.89	27,966.40
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	61.25	39,200.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	400	179.70	71,880.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	75.46	67,914.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	19.01	45,624.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	34.84	17,420.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	700	83.35	58,345.00
ZTE CORP-A	3,800	29.30	111,340.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	3.96	184,140.00
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	6,500	8.89	57,785.00
CECEP WIND POWER CORP-A	7,900	5.29	41,791.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	15,600	7.42	115,752.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	24,300	23.39	568,377.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	17.75	33,725.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	31,000	2.77	85,870.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.18	5,434.00

	HUANENG POWER INTL INC-A	11,300	8.15	92,095.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	10.25	67,650.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	7.27	4,362.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.97	62,244.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	111.39	105,040.77	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	41.17	45,287.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.57	15,351.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	139.54	105,492.24	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	100.37	120,444.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	49.20	98,400.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	104.45	41,780.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	2,200	75.60	166,320.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	27.44	52,136.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,240	65.33	407,659.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	71.06	50,736.84	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	22.59	81,324.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	251.50	125,750.00	
	SG MICRO CORP-A	250	299.10	74,775.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	90.75	22,687.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	74.17	22,251.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	200	305.70	61,140.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	4,300	42.33	182,019.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	11.69	22,211.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	17.81	14,248.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	800	188.81	151,048.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,100	229.00	251,900.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	54.30	48,870.00	
	オフショア人民元 小計	2,346,113		43,397,029.46 (787,860,050)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	23.52	92,457.12	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	38,627	37.30	1,440,787.10	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	75.40	141,676.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	4,640	21.74	100,873.60	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	43.80	87,600.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,710	165.00	612,150.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	6,674	43.80	292,321.20	

SAUDI ARABIAN MINING CO	7,462	93.50	697,697.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	15,860	120.60	1,912,716.00	
SAUDI CEMENT	1,265	57.90	73,243.50	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	4,366	34.25	149,535.50	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	19.50	269,685.00	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	67.10	304,231.40	
JARIR MARKETING CO	1,096	200.20	219,419.20	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	973	108.00	105,084.00	
ALMARAI CO	4,232	49.85	210,965.20	
SAVOLA	4,558	33.25	151,553.50	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	165.20	129,847.20	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	955	198.40	189,472.00	
AL RAJHI BANK	21,662	150.00	3,249,300.00	
ALINMA BANK	18,025	30.40	547,960.00	
ARAB NATIONAL BANK	11,172	29.00	323,988.00	
BANK AL-JAZIRA	7,856	25.50	200,328.00	
BANK ALBILAD	6,762	56.40	381,376.80	
BANQUE SAUDI FRANSI	10,854	52.80	573,091.20	
RIYAD BANK	23,469	33.70	790,905.30	
SAUDI BRITISH BANK	14,183	39.35	558,101.05	
THE SAUDI NATIONAL BANK	38,769	71.00	2,752,599.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	170.60	199,260.80	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,298	81.60	105,916.80	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	7,066	10.26	72,497.16	
EMAAR ECONOMIC CITY	8,295	12.20	101,199.00	
ETIHAD ETISALAT CO	7,054	35.15	247,948.10	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	13.36	121,375.60	
SAUDI TELECOM CO	10,529	116.20	1,223,469.80	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	26.45	411,535.55	
サウジアラビアリアル 小計	334,184		19,042,167.28 (586,689,173)	
合計	46,367,822		15,991,542,781 (15,991,542,781)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	58,900	1,314,059.00	
	メキシコペソ 小計		58,900	1,314,059.00 (7,432,711)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	887,551.83	
	南アフリカランド 小計		63,261	887,551.83 (6,772,020)	
合計				14,204,731 (14,204,731)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 64 銘柄	100.0%	—	6.7%
メキシコペソ	株式 23 銘柄	97.7%	—	2.0%
	投資証券 1 銘柄	—	2.3%	0.0%
ブラジルリアル	株式 49 銘柄	100.0%	—	4.7%
チリペソ	株式 11 銘柄	100.0%	—	0.4%
コロンビアペソ	株式 5 銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式 6 銘柄	100.0%	—	0.2%
英ポンド	株式 1 銘柄	100.0%	—	0.1%
トルコリラ	株式 11 銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.0%	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.0%	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式 15 銘柄	100.0%	—	0.7%
ロシアルーブル	株式 5 銘柄	100.0%	—	0.2%
香港ドル	株式 206 銘柄	100.0%	—	24.0%
マレーシアリングgit	株式 35 銘柄	100.0%	—	1.4%
タイバーツ	株式 42 銘柄	100.0%	—	1.8%
フィリピンペソ	株式 19 銘柄	100.0%	—	0.7%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.0%	—	1.5%
韓国ウォン	株式 111 銘柄	100.0%	—	12.0%
新台湾ドル	株式 86 銘柄	100.0%	—	16.1%
インドルピー	株式 106 銘柄	100.0%	—	12.0%
カタールリアル	株式 12 銘柄	100.0%	—	0.9%
南アフリカランド	株式 37 銘柄	98.8%	—	3.5%

	投資証券	1 銘柄	—	1.2%	0.0%
アラブディルハム	株式	9 銘柄	100.0%	—	1.2%
クウェートディナール	株式	6 銘柄	100.0%	—	0.6%
オフショア人民元	株式	490 銘柄	100.0%	—	4.9%
サウジアラビアリアル	株式	36 銘柄	100.0%	—	3.7%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	5,828,275,304円
期中追加設定元本額	1,589,127,275円
期中一部解約元本額	999,438,032円
期末元本額	6,417,964,547円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,008,327,185円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	849,687,493円
りそなラップ型ファンド(成長型)	490,687,519円
DCりそな グローバルバランス	17,938,122円
つみたてバランスファンド	905,452,459円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	264,874,796円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	155,756,116円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	104,355,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	35,763,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	22,773,610円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,283,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	21,559,526円
リスクコントロール・オープン	3,232,249円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	126,198,464円
九州SDGs・グローバルバランス	46,988,611円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	122,026,755円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,413,679,306円
Smart-i 8資産バランス 安定型	50,133,957円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	139,220,166円
Smart-i 8資産バランス 成長型	164,723,234円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	70,598,927円

りそな・リスクコントロールファンド2019-09	104,583,069円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	63,842,413円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	40,280,694円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	131,592,926円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	22,310,094円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,162,210円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	366,631円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	2,535,071円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	1,608,511円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	23,421,881円
2. 計算日における受益権の総数	6,417,964,547口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1031円
(10,000口当たり純資産額)	(11,031円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在	
該当事項はありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	857,147	43,817,354.64	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	608,032	17,499,160.96	
		米ドル 小計	1,465,179	61,316,515.60 (7,077,152,230)	
合計				7,077,152,230 (7,077,152,230)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	788,232,988
投資証券	27,962,572,800
未収配当金	248,783,405
前払金	14,659,300
差入委託証拠金	18,500,500
流動資産合計	29,032,748,993
資産合計	29,032,748,993
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,159,730
未払金	123,396,750
未払解約金	656,022,000
未払利息	2,137
流動負債合計	798,580,617
負債合計	798,580,617
純資産の部	
元本等	
元本	20,706,040,047
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	7,528,128,329
元本等合計	28,234,168,376
純資産合計	28,234,168,376
負債純資産合計	29,032,748,993

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年8月17日
期首元本額	20,967,186,061円
期中追加設定元本額	5,662,627,611円
期中一部解約元本額	5,923,773,625円
期末元本額	20,706,040,047円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	950,022,966円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	941,888,323円
りそなラップ型ファンド(成長型)	827,150,528円
DCりそな グローバルバランス	20,415,101円
つみたてバランスファンド	1,436,467,161円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	201,177,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	119,000,829円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	83,352,022円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	27,394,050円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	18,100,411円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,501,139円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	17,159,752円
リスクコントロール・オープン	2,529,731円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	90,293,569円
九州SDGs・グローバルバランス	42,116,411円
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	680,041円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,192,997,588円
FWりそな国内リートインデックスファンド	4,386,200,254円
Smart-i Jリートインデックス	2,610,977,847円
Smart-i 8資産バランス 安定型	38,591,577円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	108,832,338円
Smart-i 8資産バランス 成長型	130,048,764円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	56,931,917円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	82,060,446円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	50,092,577円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	32,499,935円

りそな・リスクコントロールファンド2020-03	102,736,911円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	17,699,892円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,303,936,076円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,920,547円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	631,952,851円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	335,878円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	3,828,799円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	4,063,015円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	18,387,836円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	144,695,308円
2. 計算日における受益権の総数	20,706,040,047口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3636円
(10,000口当たり純資産額)	(13,636円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

2022年2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		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	321,361,730	—	302,202,000	△19,159,730
	合計	321,361,730	—	302,202,000	△19,159,730

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	547	73,298,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	860	94,858,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,263	184,776,900	
	東海道リート投資法人	208	22,651,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	937	563,137,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,192	438,580,800	
	産業ファンド投資法人	3,854	662,502,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,714	868,480,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,854	350,220,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,447	549,860,000	
	G L P 投資法人	8,792	1,499,036,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,263	386,478,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,441	1,485,514,500	
	星野リゾート・リート投資法人	455	288,470,000	
	O n e リート投資法人	471	135,459,600	
	イオンリート投資法人	3,192	451,029,600	
	ヒューリックリート投資法人	2,532	400,562,400	
	日本リート投資法人	838	319,697,000	
	積水ハウス・リート投資法人	8,240	622,944,000	
	トーセイ・リート投資法人	567	71,782,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,084	284,008,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	665	91,304,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	615	70,356,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8,778	1,370,245,800	
いちごホテルリート投資法人	450	36,000,000		
ラサールロジポート投資法人	3,323	566,903,800		
スターアジア不動産投資法人	2,805	164,092,500		

マリモ地方創生リート投資法人	318	38,986,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,069	571,915,000	
大江戸温泉リート投資法人	438	28,776,600	
投資法人みらい	3,288	154,864,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	637	77,395,500	
三菱地所物流リート投資法人	690	294,975,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,051	206,206,200	
ザイマックス・リート投資法人	394	47,477,000	
タカラレーベン不動産投資法人	1,070	121,766,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,058	156,478,200	
日本ビルファンド投資法人	3,165	2,022,435,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,715	1,642,575,000	
日本都市ファンド投資法人	13,696	1,262,771,200	
オリックス不動産投資法人	5,409	886,535,100	
日本プライムリアルティ投資法人	1,855	678,002,500	
NTT都市開発リート投資法人	2,602	382,494,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,820	325,234,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,885	205,653,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,111	796,263,300	
森トラスト総合リート投資法人	1,940	261,512,000	
インヴィンシブル投資法人	11,948	459,400,600	
フロンティア不動産投資法人	952	438,872,000	
平和不動産リート投資法人	1,759	243,621,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,774	538,409,000	
福岡リート投資法人	1,404	222,955,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	840	566,160,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,224	180,588,800	
大和証券オフィス投資法人	574	391,468,000	
阪急阪神リート投資法人	1,226	176,789,200	
スターツプロシード投資法人	423	92,848,500	
大和ハウスリート投資法人	4,076	1,259,484,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,316	481,496,400	
大和証券リビング投資法人	3,668	383,306,000	
ジャパンエクセレント投資法人	2,519	312,607,900	
合計	158,301	27,962,572,800	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年2月15日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月 15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月 17日
期首元本額	19,346,017,324 円
期中追加設定元本額	4,754,805,603 円
期中一部解約元本額	4,808,049,212 円
期末元本額	19,292,773,715 円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,353,578,074 円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,350,373,035 円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,156,171,832 円
DCりそな グローバルバランス	20,815,324 円
つみたてバランスファンド	676,384,398 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	400,862,316 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	234,762,851 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	161,200,625 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	56,176,968 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	35,778,612 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	18,864,051 円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	33,774,317 円
リスクコントロール・オープン	9,909,450 円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	187,239,175 円
九州SDGs・グローバルバランス	83,931,109 円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,245,744,996 円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,307,682,904 円

S m a r t - i 先進国リートインデックス	2,083,618,811 円
S m a r t - i 8資産バランス 安定型	77,968,899 円
S m a r t - i 8資産バランス 安定成長型	215,778,290 円
S m a r t - i 8資産バランス 成長型	253,686,200 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	109,372,205 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	159,847,801 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	97,576,447 円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	62,377,100 円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	200,085,936 円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,099,801 円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,061,144 円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	570,220,887 円
りそなV Iグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	204,953 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)	6,145,244 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)	6,781,755 円
りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	78,698,205 円
2. 計算日における受益権の総数	19,292,773,715 口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3992 円
(10,000口当たり純資産額)	(13,992 円)

(注) ※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2022年2月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2022年2月15日現在)

(単位:円)

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	24,377	21.84	532,393.68	
米ドル 小計		24,377		532,393.68 (61,448,878)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	99,058	2.94	291,230.52	
オーストラリアドル 小計		99,058		291,230.52 (23,971,184)	
合 計		123,435		85,420,062 (85,420,062)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	13,471	262,684.50	
		AGREE REALTY CORP	10,530	660,862.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,055	245,421.00	
		ALEXANDER'S INC	312	79,566.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,414	3,932,038.68	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	30,666.36	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,003	279,144.64	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,117	1,054,582.98	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,329	159,077.67	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,064	1,657,964.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	40,445	1,125,584.35	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,825	1,239,614.75	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,755	157,495.65	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,751	544,976.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,796	135,674.60	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,318	35,493.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,221	5,053,781.15	

	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,936	103,713.60
	BOSTON PROPERTIES INC	21,547	2,519,921.65
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,084	46,483.00
	BRANDYWINE REALTY TRUST	26,447	348,571.46
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,050	1,109,581.50
	BRT APARTMENTS CORP	1,668	36,946.20
	CAMDEN PROPERTY TRUST	15,595	2,526,857.85
	CARETRUST REIT INC	14,733	284,641.56
	CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	42,161.11
	CENTERSPACE	2,173	200,024.65
	CHATHAM LODGING TRUST	7,087	98,792.78
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	15,000.00
	CITY OFFICE REIT INC	6,494	114,489.22
	CLIPPER REALTY INC	1,350	11,988.00
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,705	156,980.85
	COREPOINT LODGING INC	6,315	99,019.20
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,016	429,143.52
	COUSINS PROPERTIES INC	22,528	859,893.76
	CTO REALTY GROWTH INC	900	52,416.00
	CUBESMART	33,092	1,647,650.68
	CYRUSONE INC	19,264	1,729,329.28
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,493	302,332.80
	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,111	5,869,131.54
	DIGITALBRIDGE GROUP INC	77,384	537,818.80
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	34,590	100,656.90
	DOUGLAS EMMETT INC	26,557	829,109.54
	DUKE REALTY CORP	58,084	3,168,482.20
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,347	273,213.09
	EASTGROUP PROPERTIES INC	6,169	1,183,399.27
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,071	200,404.68
	EPR PROPERTIES	11,525	513,554.00
	EQUINIX INC	13,684	9,159,795.92
	EQUITY COMMONWEALTH	18,314	477,445.98
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,952	1,986,625.60

	EQUITY RESIDENTIAL	51,796	4,450,312.32
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,743	464,076.68
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,928	3,140,722.80
	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,409	3,963,631.89
	FARMLAND PARTNERS INC	4,291	47,243.91
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,622	1,254,670.64
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,755	1,152,901.80
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,950	310,102.50
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,910	76,922.30
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,369	1,490,239.84
	GETTY REALTY CORP	6,200	173,290.00
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,758	122,702.98
	GLADSTONE LAND CORP	4,670	139,913.20
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,087	145,937.22
	GLOBAL NET LEASE INC	15,387	216,648.96
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,648	698,690.80
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,492	1,028,204.40
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,249	2,640,192.90
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	55,311.98
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,032	673,824.96
	HOST HOTELS & RESORTS INC	109,115	1,956,431.95
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,963	550,652.74
	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,821	370,686.03
	INDUS REALTY TRUST INC	935	71,901.50
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,982	216,010.48
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,671	693,892.42
	INVITATION HOMES INC	90,602	3,750,922.80
	IRON MOUNTAIN INC	43,954	1,918,592.10
	JBG SMITH PROPERTIES	17,601	481,387.35
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	111,100	81,103.00
	KILROY REALTY CORP	15,871	1,075,418.96
	KIMCO REALTY CORP	94,096	2,192,436.80
	KITE REALTY GROUP TRUST	33,050	706,278.50
	LIFE STORAGE INC	12,520	1,654,768.40
	LTC PROPERTIES INC	5,856	195,531.84
	LXP INDUSTRIAL TRUST	43,452	659,601.36

	MACERICH CO/THE	32,786	513,756.62
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	139,777.00
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,051	1,892,039.78
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,558	3,644,689.64
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,862	310,764.42
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,641	1,127,979.94
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,355	746,365.55
	NATL HEALTH INVESTORS INC	7,063	376,669.79
	NETSTREIT CORP	5,746	122,964.40
	NEXPOINT RESIDENTIAL	3,447	270,727.38
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	173,349.34
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,245	1,031,895.15
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	64,906.15
	ORION OFFICE REIT INC	7,881	131,218.65
	PARAMOUNT GROUP INC	25,119	224,061.48
	PARK HOTELS & RESORTS INC	35,773	666,450.99
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,310	465,099.00
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	8,013.31
	PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,825	88,535.50
	PHYSICIANS REALTY TRUST	33,270	571,245.90
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,233	322,345.08
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,087	141,164.25
	POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,959	33,733.98
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,897	175,234.43
	PRIME US REIT	91,700	75,652.50
	PROLOGIS INC	112,353	16,329,385.02
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,098	490,723.20
	PUBLIC STORAGE	23,187	8,246,224.68
	REALTY INCOME CORP	85,931	5,747,924.59
	REGENCY CENTERS CORP	23,384	1,523,701.44
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,142	324,378.96
	RETAIL VALUE INC	2,135	6,618.50
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,979	1,605,312.94
	RLJ LODGING TRUST	25,353	366,350.85
	RPT REALTY	12,721	156,595.51
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,332	724,050.80

	SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,191	450,444.80
	SAFEHOLD INC	2,155	134,752.15
	SAUL CENTERS INC	2,026	93,398.60
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,971	44,739.00
	SERVICE PROPERTIES TRUST	25,323	209,167.98
	SIMON PROPERTY GROUP INC	49,926	6,984,647.40
	SITE CENTERS CORP	27,707	418,375.70
	SL GREEN REALTY CORP	10,242	789,555.78
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,898	860,992.88
	STAG INDUSTRIAL INC	26,776	1,074,520.88
	STORE CAPITAL CORP	37,204	1,117,608.16
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,489	160,437.97
	SUN COMMUNITIES INC	17,688	3,346,923.36
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,352	379,545.76
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,831	259,786.71
	TERRENO REALTY CORP	11,465	798,422.60
	UDR INC	44,352	2,422,062.72
	UMH PROPERTIES INC	6,767	154,355.27
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,860	104,364.60
	URBAN EDGE PROPERTIES	16,468	285,225.76
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,380	82,694.40
	VENTAS INC	60,592	3,033,235.52
	VERIS RESIDENTIAL INC	12,245	207,185.40
	VICI PROPERTIES INC	95,967	2,702,430.72
	VORNADO REALTY TRUST	24,075	980,815.50
	WASHINGTON REIT	12,665	296,994.25
	WELLTOWER INC	66,097	5,265,947.99
	WHITESTONE REIT	6,335	71,142.05
	WP CAREY INC	28,243	2,141,384.26
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,080	310,514.40
	米ドル 小計	3,859,758	176,532,943.76 (20,375,432,368)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,579	402,988.53
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,169	115,712.78
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	50,120.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,608	196,816.40

	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	23,335.04
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,790	709,717.10
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,926	342,141.80
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,741	160,220.06
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,887	118,249.79
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,649	130,185.98
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,317	274,647.62
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	94,798.44
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	30,166.50
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,666	294,321.56
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,963	463,147.16
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,951	267,544.27
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	25,608.01
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	164,509.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	170,822.40
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,991	64,485.96
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	45,219.62
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,635	32,621.30
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	16,650	222,277.50
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	47,600.00
	PRIMARIS REIT	5,227	72,393.95
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,368	554,288.96
	SLATE GROCERY REIT	4,386	66,491.76
	SLATE OFFICE REIT	4,169	21,053.45
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,042	337,112.26
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,422	291,928.50
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	39,271.80
	カナダドル 小計	289,925	5,829,797.90 (528,646,073)
ユーロ	AEDIFICA	5,499	531,203.40
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,209	36,470.59
	ALTAREA	684	102,873.60
	BEFIMMO	3,898	125,515.60
	CARE PROPERTY INVEST	3,794	85,365.00
	CARMILA	6,580	96,989.20

	COFINIMMO	4,458	507,766.20
	COIMA RES SPA	3,638	28,376.40
	COVIVIO	7,141	517,008.40
	CROMWELL REIT EUR	43,440	101,649.60
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,881	130,822.84
	GECINA SA	8,239	917,000.70
	HAMBORNER REIT AG	10,215	99,238.72
	HIBERNIA REIT PLC	107,669	130,494.82
	ICADE	4,972	288,376.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	28,985.67
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	41,362	309,594.57
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,446	88,906.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	63,839	98,695.09
	KLEPIERRE	29,761	704,145.26
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,012	51,762.04
	MERCIALYS	7,777	71,859.48
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,533	507,351.32
	MONTEA NV	1,535	161,175.00
	NSI NV	2,616	92,475.60
	RETAIL ESTATES	1,787	121,694.70
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,667	1,209,482.82
	VASTNED RETAIL NV	2,828	75,083.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,262	730,987.56
	WERELDHAVE NV	6,589	105,160.44
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,006	143,085.60
	ユーロ 小計	489,288	8,199,596.42 (1,070,539,308)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	23,200.00
	ASSURA PLC	441,362	273,865.12
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,960	371,228.00
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	125,514	140,324.65
	BRITISH LAND CO PLC	143,604	773,163.93
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	130,732	222,113.66
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	83,454.73
	CUSTODIAN REIT PLC	60,787	64,069.49
	DERWENT LONDON PLC	17,212	550,611.88

	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	87,550	77,744.40	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	38,050	270,345.25	
	HAMMERSON PLC	652,218	243,016.42	
	HOME REIT PLC	87,702	98,664.75	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,490	63,369.58	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	114,938	906,630.94	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	140,203	365,369.01	
	LXI REIT PLC	108,442	152,686.33	
	NEWRIVER REIT PLC	48,868	44,323.27	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	79,142	80,883.12	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205,608	274,692.28	
	PRS REIT PLC/THE	86,720	88,020.80	
	REGIONAL REIT LTD	63,471	56,489.19	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,652	400,397.80	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	86,166	47,735.96	
	SEGRO PLC	182,495	2,253,813.25	
	SHAFTESBURY PLC	43,170	255,566.40	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,875	45,670.62	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	148,459	175,181.62	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	54,174.56	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	282,592	643,179.39	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	135,613	109,575.30	
	UNITE GROUP PLC	60,426	598,459.10	
	WORKSPACE GROUP PLC	19,933	152,387.78	
	英債券 小計	4,050,131	9,960,408.58 (1,556,214,236)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	60,535	212,477.85	
	ARENA REIT	52,273	249,864.94	
	AVENTUS GROUP	60,193	195,025.32	
	BWP TRUST	74,391	290,868.81	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,812	309,716.88	
	CENTURIA OFFICE REIT	63,819	138,487.23	
	CHARTER HALL GROUP	70,569	1,104,404.85	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	90,932	443,748.16	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	81,252	329,883.12	

	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	48,631	185,284.11	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	221,920	193,070.40	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	32,499	103,021.83	
	DEXUS/AU	163,223	1,658,345.68	
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	68,988.40	
	GOODMAN GROUP	259,257	5,916,244.74	
	GPT GROUP	290,936	1,472,136.16	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	47,137	190,433.48	
	HOME CONSORTIUM LTD	29,343	181,926.60	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	81,478	109,587.91	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	29,868	106,628.76	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	54,932	299,928.72	
	IRONGATE GROUP	80,328	148,606.80	
	MIRVAC GROUP	598,808	1,491,031.92	
	NATIONAL STORAGE REIT	162,171	390,832.11	
	RURAL FUNDS GROUP	61,194	179,298.42	
	SCENTRE GROUP	793,535	2,340,928.25	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,439	476,015.54	
	STOCKLAND	362,562	1,421,243.04	
	VICINITY CENTRES	594,920	1,011,364.00	
	WAYPOINT REIT	111,621	303,609.12	
	オーストラリアドル 小計	4,893,913	21,523,003.15 (1,771,558,389)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	134,637	189,838.17	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	159,358	396,004.63	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	244,365	270,023.32	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	201,503	319,382.25	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,632	190,384.48	
	ニュージーランドドル 小計	800,495	1,365,632.85 (104,375,318)	
香港ドル	CHAMPION REIT	276,000	1,104,000.00	
	FORTUNE REIT	219,000	1,767,330.00	
	LINK REIT	319,100	21,220,150.00	
	PROSPERITY REIT	198,000	595,980.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	141,000	602,070.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	350,000	1,148,000.00	

	香港ドル 小計	1,503,100	26,437,530.00 (391,011,068)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	70,900	97,133.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	207,400	167,994.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	513,700	1,453,771.00
	ASCOTT TRUST	301,896	304,914.96
	CAPITALAND CHINA TRUST	167,700	199,563.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	763,732	1,565,650.60
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	112,100	130,036.00
	EC WORLD REIT	50,000	38,000.00
	ESR REIT	428,400	184,212.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	91,314.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	51,863.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	161,900	365,894.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	448,779	628,290.60
	IREIT GLOBAL	95,000	61,750.00
	KEPPEL DC REIT	199,900	431,784.00
	KEPPEL REIT	296,500	335,045.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	114,757.50
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	330,100	597,481.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	292,600	731,500.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	450,600	779,538.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	330,500	360,245.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	156,145.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57,300	261,288.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	85,600	70,620.00
SPH REIT	153,000	146,880.00	
STARHILL GLOBAL REIT	211,700	127,020.00	
SUNTEC REIT	329,700	527,520.00	
	シンガポールドル 小計	6,893,007	9,980,209.66 (855,204,165)
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,100	128,077,000.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	23,280,000.00
	JR REIT XXVII	18,000	95,220,000.00
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	27,587,430.00
	LOTTE REIT CO LTD	20,693	111,121,410.00

		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	46,207,270.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	40,513,120.00	
		韓国ウォン 小計	83,117	472,006,230.00 (45,501,400)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	27,424	600,311.36	
		イスラエルシェケル 小計	27,424	600,311.36 (21,282,658)	
		合計		26,719,764,983 (26,719,764,983)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 1 銘柄	0.3%	—	0.2%
	投資証券 154 銘柄	—	99.7%	75.9%
カナダドル	投資証券 31 銘柄	—	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 31 銘柄	—	100.0%	4.0%
英ポンド	投資証券 34 銘柄	—	100.0%	5.8%
オーストラリアドル	株式 1 銘柄	1.3%	—	0.1%
	投資証券 30 銘柄	—	98.7%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5 銘柄	—	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	—	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 27 銘柄	—	100.0%	3.2%
韓国ウォン	投資証券 7 銘柄	—	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	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2022年2月28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】

I 資産総額	714,131,220円
II 負債総額	82,547,823円
III 純資産総額 (I - II)	631,583,397円
IV 発行済口数	647,569,020口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	0.9753円

(参考)

RM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

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

RM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)

純資産額計算書

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

RM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

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

RM先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

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

RM新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

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

RM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

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

RM国内リートマザーファンド

純資産額計算書

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

RM先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2022年2月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 委託会社の機構(2022年2月末現在)

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

経営会議は、経営に関する全般的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。

② 投資運用の意思決定機構

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

○PLAN：計画

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

○DO：実行

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

○CHECK：検証→ACTION：改善

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年2月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	111	1,229,374
単位型株式投資信託	8	84,340
合計	119	1,313,714

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。
- (2) 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 6 期事業年度（自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受け、第 7 期事業年度に係る中間会計期間（自 2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 畑中 建二 印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月3日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第7期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

(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		当事業年度	
	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	3,170,025		3,539,887	
運用受託報酬	1,201,400		4,624,333	
投資助言報酬	1,166,500		839,669	
その他営業収益	—		261	
営業収益計	5,537,925		9,004,153	
営業費用				
支払手数料	1,050,201		1,166,440	
広告宣伝費	63,238		37,315	
調査費				
調査費	500,578		1,297,321	
委託調査費	128,044		98,375	
委託計算費	188,413		207,635	
事務委託費	—		23,815	
営業雑経費				
印刷費	68,686		75,269	
協会費	5,690		9,101	
販売促進費	5,255		3,264	
その他	55,169		55,514	
営業費用計	2,065,279		2,974,056	
一般管理費				
給料				
役員報酬	82,651		110,648	
給料・手当	490,014		1,104,231	
賞与	3,982		143,217	
賞与引当金繰入額	132,198		224,862	
旅費交通費	13,634		4,372	
租税公課	48,964		73,538	
不動産賃借料	48,771		97,751	
固定資産減価償却費	16,096		21,729	
諸経費	119,502		256,552	
一般管理費計	955,815		2,036,904	
営業利益	2,516,831		3,993,191	
営業外収益				
受取配当金	23		189	
投資有価証券売却益	73		—	
雑収入	46		1,694	
営業外収益計	142		1,883	
営業外費用				
投資有価証券売却損	—		277	
雑損失	13		273	
営業外費用計	13		550	
経常利益	2,516,960		3,994,525	
税引前当期純利益	2,516,960		3,994,525	
法人税、住民税及び事業税	※1 769,705		1,281,563	
法人税等調整額	△38,032		△57,337	
法人税等計	731,672		1,224,226	

当期純利益

1,785,287	2,770,298
-----------	-----------

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	△7,236	△7,236	1,482,763
当期変動額						
当期純利益	—	—	—	1,785,287	1,785,287	1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	—	—	—	—	—	—
当期変動額合計	—	—	—	1,785,287	1,785,287	1,785,287
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 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 | <u>△1.64%</u> |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | <u>29.07%</u> |
- 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 | <u>△0.03%</u> |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | <u>30.65%</u> |
- (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）
- 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。
 - 関連情報
 - 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。
 - 地域ごとの情報
 - ①営業収益
本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。
 - ②有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
 - 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

- 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。
- 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。
- 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主(会社等に限る)等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第7期中間会計期間
(2021年9月30日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		4,945,303
前払費用		174,912
未収入金		247
未収委託者報酬		930,833
未収運用受託報酬		2,912,072
未収投資助言報酬		486,805
流動資産計		9,450,176
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	8,043
器具備品	※1	15,483
有形固定資産計		23,526
無形固定資産		
ソフトウェア		5,470
無形固定資産計		5,470
投資その他の資産		
投資有価証券		34,513
繰延税金資産		104,468
投資その他の資産計		138,982
固定資産計		167,979
資産合計		9,618,155

(単位：千円)

第7期中間会計期間
(2021年9月30日現在)

負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料		291,230
その他未払金		887,740
未払費用		110,090
未払法人税等		201,586
未払消費税等	※2	175,117
賞与引当金		191,651
預り金		1,431
流動負債計		1,858,848
負債合計		1,858,848
純資産の部		
株主資本		
資本金		1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		490,000
資本剰余金計		490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,267,354
利益剰余金計		6,267,354
株主資本計		7,757,354
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,952
評価・換算差額等計		1,952
純資産合計		7,759,307
負債・純資産合計		9,618,155

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第7期中間会計期間

(自 2021年4月1日

至 2021年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		2,259,321
運用受託報酬		2,677,522
投資助言報酬		483,723
営業収益計		5,420,567
営業費用		
支払手数料		705,906
広告宣伝費		30,034
調査費		
調査費		737,068
委託調査費		72,531
委託計算費		126,468
事務委託費		11,871
営業雑経費		
印刷費		42,328
協会費		10,425
販売促進費		1,998
その他		32,395
営業費用計		1,771,030
一般管理費		
給料		
役員報酬		60,377
給料・手当		623,676
賞与		9,550
賞与引当金繰入額		191,651
旅費交通費		2,122
租税公課		44,957
不動産賃借料		50,181
固定資産減価償却費	※1	7,896
諸経費		123,089
一般管理費計		1,113,502
営業利益		2,536,034
営業外収益		
受取配当金		352
投資有価証券売却益		827
雑収入		1,478
営業外収益計		2,658
営業外費用		
為替差損		170
営業外費用計		170
経常利益		2,538,522
税引前中間純利益		2,538,522
法人税、住民税及び事業税		795,396
法人税等調整額		24,121
法人税等計		819,517
中間純利益		1,719,004

(3) 中間株主資本等変動計算書

第7期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350
当中間期変動額						
当中間純利益				1,719,004	1,719,004	1,719,004
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						
当中間期変動額合計	-	-	-	1,719,004	1,719,004	1,719,004
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	6,267,354	6,267,354	7,757,354

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,804	1,804	6,040,155
当中間期変動額			
当中間純利益			1,719,004
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	147	147	147
当中間期変動額合計	147	147	1,719,152
当中間期末残高	1,952	1,952	7,759,307

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. 収益および費用の計上基準

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

①投資運用業（投資信託委託業）

投資信託約款に基づき、信託財産の運用指図等を行っております。

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

②投資運用業（投資一任業）

投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。

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

③投資助言・代理業

投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 連結納税制度の適用

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

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

(会計方針の変更)

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。

この結果、当中間財務諸表に与える影響はありません。

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	第7期中間会計期間 (2021年9月30日)
建物	1,670千円
器具備品	26,901千円

※2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	第7期中間会計期間 (2021年9月30日)
有形固定資産	4,778千円
無形固定資産	3,118千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第7期中間会計期間(自2021年4月1日至2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,960,000	-	-	3,960,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、未払手数料、その他未払金は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

第7期中間会計期間（2021年9月30日現在）

(単位：千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
投資有価証券	34,513	34,513	—
資産計	34,513	34,513	—

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

当社が保有する投資信託については注記を省略しております。当該投資信託の中間貸借対照表計上額は34,513千円であります。

(有価証券関係)

1. その他有価証券

第7期中間会計期間（2021年9月30日現在）

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	21,221	18,100	3,121
	小計	21,221	18,100	3,121
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	—	—	—
	(2)債券	—	—	—
	(3)その他	13,292	13,600	△307
	小計	13,292	13,600	△307
合計		34,513	31,700	2,813

(収益認識関係)

収益認識に関する注記における開示目的に照らし、定量面・定性面の両面において収益の分解情報を記載する重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

第7期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,952,705

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第7期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1株当たり純資産額	1,959円42銭
1株当たり中間純利益金額	434円09銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第7期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益 (千円)	1,719,004
普通株主に帰属しない金額 (千円)	—
普通株式に係る中間純利益 (千円)	1,719,004
普通株式の期中平均株式数 (株)	3,960,000

(重要な後発事象)

第7期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

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

追加型証券投資信託

リスクコントロール・オープン

約 款

りそなアセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第 18 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

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

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

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

RM国内リートマザーファンド	国内リート	東証REIT指数（配当込み）
RM先進国リートマザーファンド	先進国リート	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

- ③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。
- ④ 投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値（以下『確保ライン』といいます。）に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、RMマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。
- ※ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないよう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。
- ⑤ 『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。
- ⑥ 上記の方針に関わらず、以下の場合は、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。
- イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
- ロ 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
- ⑦ 一の会社（以下「保証会社」といいます。）との間で、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回ることがないよう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。
- ⑧ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 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 有価証券先物取引等は、約款第21条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は、約款第22条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第23条の範囲で行います。
- ⑧ 直物為替先渡取引は、約款第24条の範囲で行います。
- ⑨ 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。
- ⑩ 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。
- ⑪ 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。

3. 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 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
リスクコントロール・オープン
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、りそなアセットマネジメント株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者とします。

- ② この信託は、信託法（平成 18 年法律第 108 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第 28 条第 1 号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第 17 条第 1 項、同条第 2 項および第 30 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金 1,000 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第 3 条 委託者は、受託者と合意のうえ、500 億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から 2030 年 2 月 15 日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第 5 条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、次条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第 2 条の規定による受益権については、1,000 億口を上限として、追加信託によって

生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、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または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
- ③ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④ 第 28 条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 10 条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 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。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等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、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- ③ 委託者は、第 7 条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備え

る振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第 11 条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額)

第 12 条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第 7 条第 1 項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、最低単位を 1 円単位または 1 口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資約款に従い契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1 口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 4 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ③ 第 1 項の規定にかかわらず、指定販売会社は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、受益権の取得申込の受付を行いません。
- ④ 第 1 項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に指定販売会社がそれぞれ独自に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1 口につき 1 円に、指定販売会社がそれぞれ独自に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第 38 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による

市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)が発生し、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、受益権の取得申込の受付を中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込を取消することができるものとします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 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かかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかか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、前項の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。)に社振法の規定に従い、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われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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かか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等において、委託者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)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、信託金を、主として、りそなアセットマネジメント株式会社を委託者とし、株式会社りそな銀行を受託者として締結された親投資信託である「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」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）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、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
17. 預託証券（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第19号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、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第14号の証券のうち投資法人債券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（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。

- ② 委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項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、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。
- ④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券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が、取得時において信託財産の純資産総額の20%を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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が、信託財産

の純資産総額の5%を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑥ 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、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に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(利害関係人等との取引等)

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第30条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとし、なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第24条まで、第26条、第28条、第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第19条 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、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 前項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。

(信用取引の指図範囲)

第20条 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ます。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 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
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 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
 6. 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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図および範囲)

第21条 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。）。)

1. 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。

2. 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。
 3. 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、本条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。
1. 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。
 2. 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。
 3. 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、かつ本条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。
1. 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。

2. 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(以下本号において「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。
3. 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、かつ本条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。

(スワップ取引の運用指図および範囲)

- 第 22 条 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、第 4 条に定める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(以下本項において「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 前項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。

(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)

第 23 条 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、第 4 条に定める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（以下本項において「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（以下本項において「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（以下本項において「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 2 項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。

(直物為替先渡取引の運用指図)

第 24 条 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、第 4 条に定める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（以下本項において「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 前項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。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第 25 条 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に従い、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ることとなる投資の指図をしません。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第 26 条 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各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 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。

2. 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。

3. 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 前項各号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。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 27 条 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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第 28 条 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。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第 29 条 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。

(信託業務の委託等)

第 30 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第31条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う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。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第32条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、すみやかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第33条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第34条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金ならびにその他の収入金を再投資

することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第 35 条 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。

(損益の帰属)

第 36 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 37 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 38 条 この信託の計算期間は、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、第 1 計算期間は、2020 年 3 月 31 日から 2020 年 5 月 15 日までとします。最終計算期間の終了日は、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(信託財産に関する報告等)

第 39 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査費用)

第 40 条 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者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産にかかる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、受益者の負担とし、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 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、当該益金から支弁します。
- ④ その他諸費用(法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等)および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

(保証契約の目的、保証料の金額および支弁の方法)

第 41 条 委託者および受託者(第 1 条第 3 項の規定に基づき信託事務の処理の委託を受ける金融機関(当該委託が行われている場合に限り)を含みます。)は、保証会社との間で、基準価額が『確保ライン』を下回らないように保証契約を締結します。

- ② 前項の保証契約に基づき保証会社が受ける保証料に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 前項の保証料は、第 38 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年 0.25% を乗じて得た金額とします。ただし、第 49 条第 2 項の規定により信託契約を解約し信託を終了させることを委託者が決定した場合には、その翌日以降の保証料は、0 円とします。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第 42 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 38 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次の各号に掲げる率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。ただし、第 49 条第 2 項の規定により信託契約を解約し信託を終了させること

を委託者が決定した場合には、その翌日以降の信託報酬の総額は、0円とします。

1. 信託契約締結日から2020年5月11日まで……年1.13%
2. 2020年5月12日以降

1ヵ月に一度見直すものとし、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。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計が、信託財産の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、次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。

リスク性資産割合が50%以上のとき……年1.13%

リスク性資産割合が25%以上50%未満のとき……年0.51%

リスク性資産割合が25%未満のとき……年0.27%

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第43条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、その他諸費用、当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、その他諸費用、当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申

込者とします。)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとし、当該取得申込により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5 営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第 2 項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金（所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、）は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、）に応じて計算されるものとし、

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第 45 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については、前条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第 4 項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第 46 条 受益者が、収益分配金については第 44 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払い

を請求しないときならびに信託終了による償還金については第 44 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第 47 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を 1 口単位として指定販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1 口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、一部解約請求の受付を行いません。なお、前項の一部解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 第 49 条第 2 項の規定により信託契約を解約し信託を終了させることを委託者が決定した場合は、償還日前の一定期間について一部解約の実行の請求を受け付けない場合があります。
- ⑤ 受益者が第 1 項の一部解約請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、第 1 項による一部解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部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った当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第 3 項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第 48 条 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第 49 条 委託者は、信託期間中において、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、この信託契約を解約することが受益者のため有利である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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、基準価額が『確保ライン』まで下落した場合、または基準価額と『確保ライン』との差が 20 営業日連続して 50 円未満となった場合は、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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③ 委託者は、第 41 条第 1 項に規定する保証契約が、解約その他の理由により終了した場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ④ 委託者は、第 1 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この信託契約にかかる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發します。
- ⑤ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ⑥ 第 4 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあたる多数をもって行います。
- ⑦ 第 4 項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかる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には適用しません。また、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あって、第 4 項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じとします。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第 50 条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、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、第 54 条の規定に従います。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第 51 条 委託者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は、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 54 条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 52 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 53 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 54 条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第 54 条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この信託約款にかかる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發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）

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

- ④ 第 2 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあたる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第 2 項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかる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には適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対受益者の受益権買取請求の不適用)

第 55 条 この信託は、受益者が第 47 条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第 49 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第 18 条第 1 項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第 56 条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行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

(信託期間の延長)

第 57 条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 58 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第 59 条 委託者が行う公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.resona-am.co.jp/>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 60 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1 条 この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2 条 第 23 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 3 条 第 23 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 4 条 第 24 条に規定する「直物為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

2020 年 3 月 31 日

委託者	りそなアセットマネジメント株式会社
受託者	株式会社りそな銀行

(付 表)

I 別に定める日

約款第 12 条第 3 項および第 47 条第 2 項の「別に定める日」とは、次のものをいいます。

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

