

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年10月25日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番6号
【事務連絡者氏名】	中越 正喜
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCりそな グローバルバランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCりそな グローバルバランス（以下「ファンド」といいます。）

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

### （７）【申込期間】

2018年10月26日から2019年4月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

( 9 ) 【払込期日】

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(株式、債 券、不動産投信) 資産配分変更 型))		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（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

#### < 商品分類の定義 >

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

##### 4. 独立した区分

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1) 株式

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

###### (2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

## 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 4. 投資形態による属性区分

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

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

う。

#### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

#### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

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

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

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



## 2 中長期的な運用に適したポートフォリオ構築を目指します。

### ポートフォリオの構築プロセス

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

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

#### 基本的資産配分比率の決定プロセス図

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

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

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

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

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

#### 市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)プロセス図 [適時]

##### <定点観測>

- 投資環境の分析(主に定量分析)
- 主要国・地域のマクロ分析

##### <定性判断>

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

- 市場見通しの策定
- 資産配分の見直し

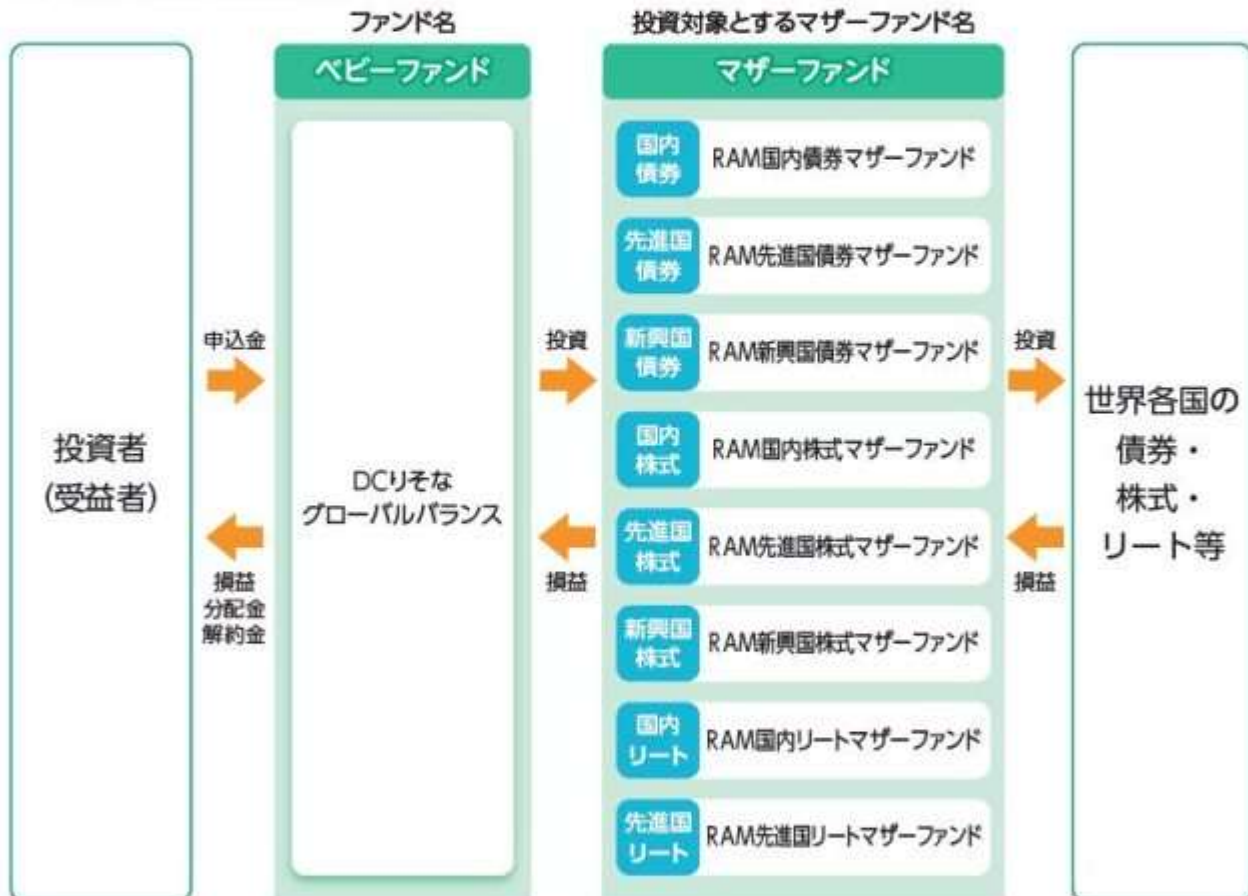
(3) 各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記(1)による独自の定量モデルを用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、(2)の市況動向に応じた資産配分の見直し(調整)を適時行い決定します。

### 3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

#### ファンドの仕組み

当ファンドは各マザーファンドを通じて世界各国の債券、株式およびリートなど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。



## 分配方針

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

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

### ●RAM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。

### ●RAM先進国債券マザーファンド

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

### ●RAM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。

### ●RAM国内株式マザーファンド

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

### ●RAM先進国株式マザーファンド

「MSCI-KOKUSA1指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSA1指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSA1指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

### ●RAM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。

### ●RAM国内リートマザーファンド

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

### ●RAM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時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

### 信託金限度額

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

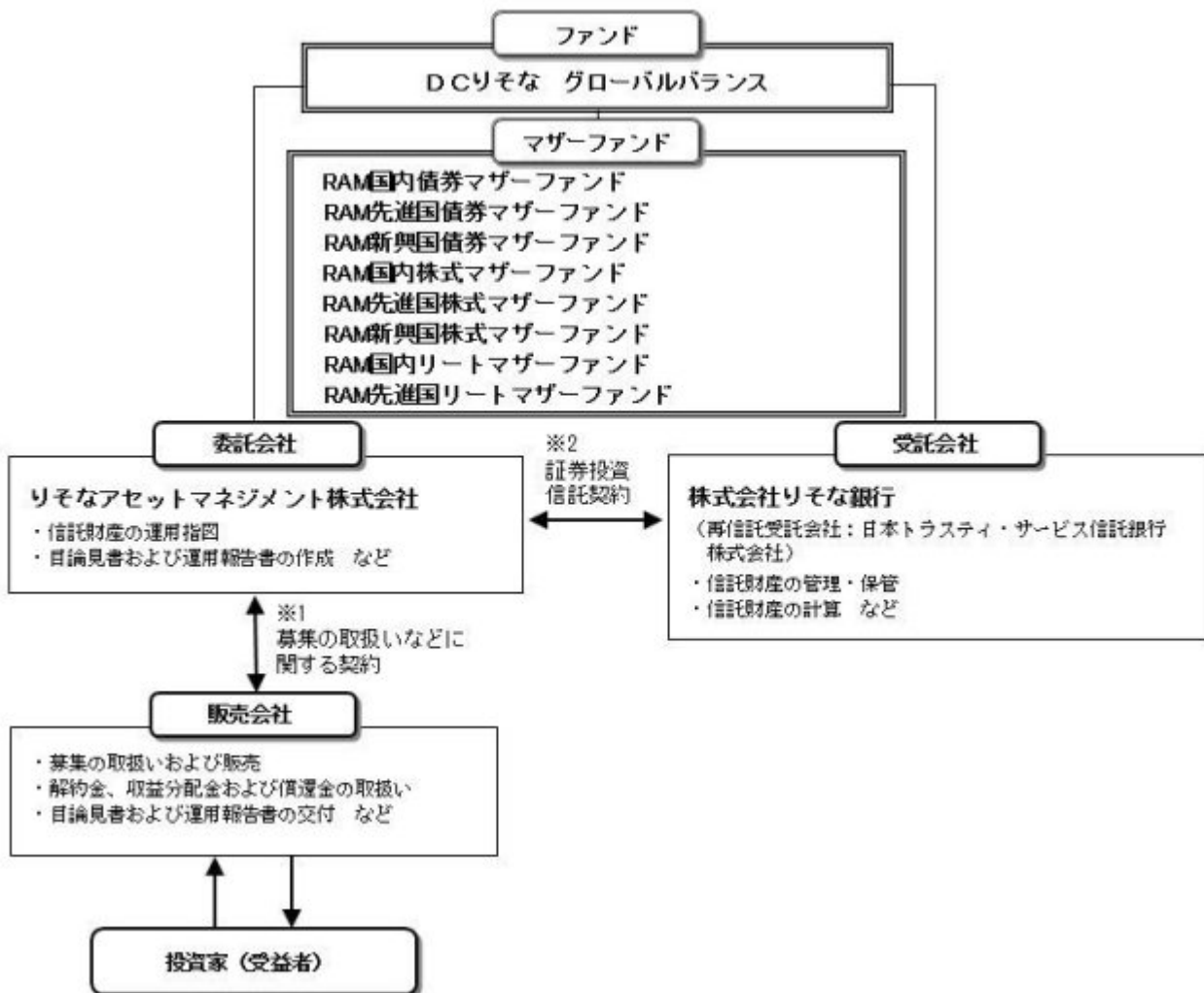
## (2)【ファンドの沿革】

2016年5月12日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## （３）【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2018年7月末現在）

- 資本金  
1,000百万円
- 沿革  
2015年8月3日： りそなアセットマネジメント株式会社設立
- 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

- RAM国内債券マザーファンド受益証券
- RAM先進国債券マザーファンド受益証券

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

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

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

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

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

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

## （2）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権

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

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

を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RAM国内債券マザーファンド >

#### 運用の基本方針

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

## &lt; RAM先進国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

< RAM新興国債券マザーファンド >

**運用の基本方針**



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

受託会社	株式会社りそな銀行
------	-----------

## &lt; R A M国内株式マザーファンド &gt;

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

## &lt; R A M先進国株式マザーファンド &gt;

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

その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R A M新興国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M国内リートマザーファンド &gt;

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

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

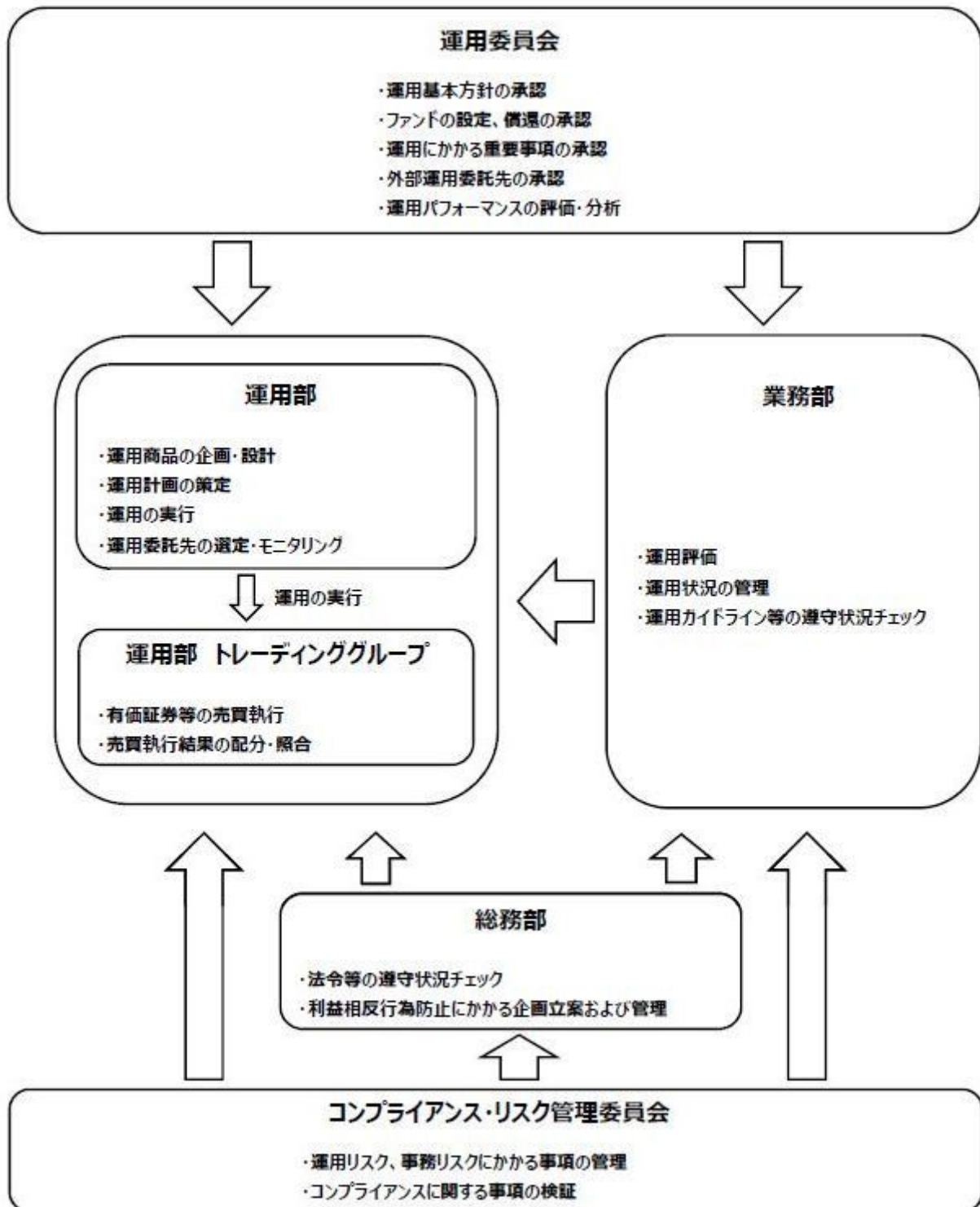
## &lt; R A M先進国リートマザーファンド &gt;

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



コンプライアンス・リスク管理委員会は6名程度、運用委員会は6名程度で構成されています。

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、今後変更となる可能性があります。



#### （４）【配分方針】

##### 収益配分方針

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

##### 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

#### （５）【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

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

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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

### 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

### 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンド

の信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 17) 資金の借入れ

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

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・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はその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### ・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

#### 資産配分リスク

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

#### 信用リスク

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

ことにより、基準価額の下落要因となります。

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

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

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

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

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

#### （２）リスク管理体制

##### 委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

運用委員会は、運用実績等を統括し運用部に対する管理・指導を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会では、審議事項を代表取締役または取締役会に報告します。

上記体制は2018年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## 【参考情報】

### ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

\* 年間騰落率は、2017年5月から2018年7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。

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	3.8	65.0	57.1	37.2	9.3	29.1	21.4
最小値	0.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.1	17.3	17.5	11.4	2.2	6.2	3.6

\* 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。

\* 2013年8月から2018年7月の5年間（当ファンドは2017年5月から2018年7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。

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

#### NOMURA-BPI国債

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

#### FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

#### JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.648%（税抜0.60%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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



## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

### 確定拠出年金の場合

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

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

### 確定拠出年金でない場合

#### 個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

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

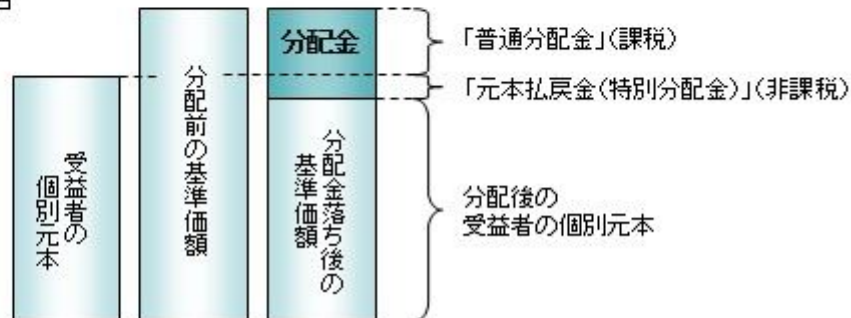
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年7月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【DCりそな グローバルバランス】

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	247,020,226	99.41
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,461,764	0.59
合計(純資産総額)		248,481,990	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	155,030,438	1.0359	160,602,861	1.0390	161,076,625	64.82

日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	33,855,408	0.9697	32,832,242	0.9652	32,677,239	13.15
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	19,124,107	1.1956	22,865,392	1.1851	22,663,979	9.12
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	9,153,383	1.2136	11,109,294	1.2438	11,384,977	4.58
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	4,449,098	1.1363	5,055,799	1.0868	4,835,279	1.95
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	4,246,524	1.1006	4,674,013	1.1333	4,812,585	1.94
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	3,579,628	1.4232	5,094,716	1.3402	4,797,417	1.93
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	4,560,082	0.9995	4,557,835	1.0465	4,772,125	1.92

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.41
合計	99.41

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

### 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 1月25日)	44	44	1.0004	1.0004
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	117	117	1.0382	1.0382
2017年 7月末日	65		1.0124	
8月末日	70		1.0177	
9月末日	74		1.0207	
10月末日	85		1.0241	
11月末日	91		1.0277	
12月末日	102		1.0335	
2018年 1月末日	123		1.0308	
2月末日	144		1.0177	
3月末日	171		1.0144	
4月末日	170		1.0216	

5月末日	193		1.0168
6月末日	227		1.0182
7月末日	248		1.0225

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
当中間期	2018年 1月26日～2018年 7月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.04
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.78
当中間期	2018年 1月26日～2018年 7月25日	1.55

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	47,045,838	2,987,019
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	94,737,024	26,010,237
当中間期	2018年 1月26日～2018年 7月25日	146,350,658	21,411,720

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## (参考)

## RAM国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	52,848,802,970	84.56
地方債証券	日本	3,180,320,800	5.09

特殊債券	日本	3,512,098,087	5.62
社債券	日本	2,021,662,000	3.23
	フランス	100,321,000	0.16
	オーストラリア	99,983,000	0.16
	小計	2,221,966,000	3.56
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		732,291,455	1.17
合計(純資産総額)		62,495,479,312	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312回利付国債(10年)	770,000,000	103.59	797,672,200	103.15	794,316,600	1.200	2020/12/20	1.27
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	780,000,000	101.04	788,160,800	100.95	787,441,200	0.100	2023/3/20	1.26
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	710,000,000	100.61	714,335,400	100.57	714,082,500	0.100	2028/3/20	1.14
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	680,000,000	100.98	686,673,400	100.90	686,140,400	0.100	2022/12/20	1.10
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	661,000,000	102.93	680,428,080	103.02	681,021,690	0.400	2025/3/20	1.09
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	660,000,000	100.89	665,895,800	100.85	665,616,600	0.100	2022/9/20	1.07
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	660,000,000	100.83	665,481,400	100.79	665,273,400	0.100	2022/6/20	1.06
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	620,000,000	104.34	646,926,700	103.73	643,163,200	1.300	2021/3/20	1.03
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	605,000,000	104.30	631,018,900	103.80	628,026,300	1.200	2021/6/20	1.00
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	571,000,000	104.11	594,500,360	103.92	593,428,880	0.600	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	580,000,000	100.45	582,657,700	100.81	584,750,200	0.100	2027/3/20	0.94
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	557,000,000	104.66	582,969,290	104.36	581,318,620	0.800	2023/6/20	0.93
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	534,000,000	103.01	550,121,380	103.18	551,013,240	0.400	2025/9/20	0.88
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	540,000,000	100.74	544,033,800	100.76	544,131,000	0.100	2022/3/20	0.87
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	530,000,000	102.91	545,449,800	102.39	542,714,700	1.000	2020/9/20	0.87
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	512,000,000	104.24	533,716,800	103.75	531,225,600	1.000	2021/12/20	0.85
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	490,000,000	104.52	512,172,900	104.09	510,065,500	1.100	2021/12/20	0.82
日本	国債証券	第308回利付国債(10年)	480,000,000	103.35	496,089,100	102.68	492,873,600	1.300	2020/6/20	0.79
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	462,000,000	103.83	479,724,000	103.65	478,863,000	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	460,000,000	100.39	461,797,400	100.79	463,670,800	0.100	2027/6/20	0.74

日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	450,000,000	100.63	452,840,300	100.93	454,212,000	0.100	2026/9/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	450,000,000	100.61	452,761,300	100.88	453,960,000	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	425,000,000	103.94	441,771,750	103.78	441,099,000	0.600	2024/3/20	0.71
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	407,000,000	104.83	426,658,900	104.56	425,583,620	0.800	2023/9/20	0.68
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	411,000,000	103.45	425,179,500	103.23	424,291,740	0.600	2023/3/20	0.68
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	420,000,000	100.66	422,800,500	100.94	423,977,400	0.100	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	410,000,000	100.39	411,627,700	100.31	411,279,200	0.100	2019/12/20	0.66
日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	400,000,000	100.62	402,512,000	100.62	402,488,000	0.100	2021/6/20	0.64
日本	国債証券	第389回利付国債（2年）	400,000,000	100.44	401,788,000	100.40	401,616,000	0.100	2020/6/1	0.64
日本	国債証券	第388回利付国債（2年）	400,000,000	100.48	401,939,000	100.39	401,572,000	0.100	2020/5/15	0.64

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.56
地方債証券	5.09
特殊債券	5.62
社債券	3.56
合計	98.83

## 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。

## RAM先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2018年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	9,016,571,012	43.40
	カナダ	420,213,091	2.02
	メキシコ	173,912,827	0.84
	ドイツ	1,477,960,584	7.11

	イタリア	1,912,956,302	9.21
	フランス	2,122,830,652	10.22
	オランダ	447,324,355	2.15
	スペイン	1,243,790,076	5.99
	ベルギー	532,369,237	2.56
	オーストリア	312,540,502	1.50
	フィンランド	145,465,516	0.70
	アイルランド	168,237,012	0.81
	イギリス	1,431,273,124	6.89
	スウェーデン	85,681,666	0.41
	ノルウェー	51,885,134	0.25
	デンマーク	117,841,664	0.57
	ポーランド	132,304,016	0.64
	オーストラリア	441,656,211	2.13
	シンガポール	85,488,139	0.41
	マレーシア	107,296,935	0.52
	南アフリカ	124,239,133	0.60
	小計	20,551,837,188	98.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		224,767,382	1.08
合計（純資産総額）		20,776,604,570	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		99,422,990	0.48

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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	780,000	10,866.78	84,760,904	10,795.94	84,208,367	1.375	2020/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,977.72	84,528,453	10,892.85	83,874,992	2.750	2028/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,586.72	83,635,111	10,444.47	82,511,359	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	780,000	10,729.78	83,692,331	10,552.23	82,307,419	2.125	2025/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,718.22	82,530,340	10,675.82	82,203,819	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	10,153.21	81,225,690	10,081.09	80,648,765	1.625	2026/5/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	370,000	21,145.72	78,239,168	21,250.03	78,625,144	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	11,242.87	79,824,442	11,038.77	78,375,330	2.750	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	10,848.96	78,112,519	10,775.99	77,587,171	2.125	2022/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,129.82	77,999,677	9,946.24	76,586,053	1.500	2026/8/15	0.37

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,633.01	77,621,044	10,469.63	76,428,303	2.250	2027/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,293.14	75,139,973	10,112.53	73,821,496	1.625	2026/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,507.18	74,600,985	10,319.81	73,270,662	2.000	2026/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	10,632.71	74,429,019	10,450.98	73,156,867	2.250	2027/11/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	500,000	14,697.21	73,486,069	14,582.46	72,912,337	3.000	2022/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	10,612.73	72,166,579	10,578.25	71,932,126	1.125	2021/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	11,075.95	71,993,704	11,049.83	71,823,930	2.375	2020/4/30	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	450,000	16,036.07	72,162,316	15,913.70	71,611,693	4.250	2023/10/25	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	340,000	20,754.16	70,564,165	20,867.01	70,947,861	4.500	2041/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	10,996.92	70,380,340	10,960.93	70,150,008	1.500	2019/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	660,000	10,761.04	71,022,888	10,599.50	69,956,709	2.250	2025/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	10,706.52	69,592,420	10,655.87	69,263,169	1.125	2021/2/28	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	10,787.11	70,116,269	10,598.42	68,889,758	2.375	2027/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	10,712.68	68,561,208	10,505.84	67,237,389	2.250	2027/2/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	340,000	19,434.75	66,078,182	19,396.22	65,947,159	5.500	2029/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	11,017.97	66,107,842	10,882.88	65,297,325	2.125	2021/9/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	10,912.70	65,476,212	10,861.85	65,171,107	1.375	2020/4/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	580,000	11,315.68	65,630,986	11,209.84	65,017,103	3.125	2021/5/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	580,000	11,214.80	65,045,894	11,076.71	64,244,924	2.625	2020/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	590,000	10,863.92	64,097,153	10,829.32	63,893,019	1.125	2020/3/31	0.31

#### □. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.92
合計	98.92

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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	403,700.00	44,831,582	44,808,617	0.22
	ユーロ	買建	293,300.00	37,965,898	38,108,469	0.18
	英ポンド	買建	95,700.00	13,922,244	13,941,576	0.07
	オーストラリアドル	買建	31,200.00	2,561,869	2,564,328	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。

#### R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。



## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	2,188,005,201	99.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,226,248	0.10
合計（純資産総額）		2,190,231,449	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		832,500	0.04

(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	投資信託受益 証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	1,128,865	2,142.03	2,418,073,821	1,938.23	2,188,005,201	99.90

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,500.00	833,422	832,500	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	20,544,214,320	96.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		700,042,753	3.30
合計(純資産総額)		21,244,257,073	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	707,940,000	3.33

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

## 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	99,900	7,340.19	733,285,797	7,305.00	729,769,500	3.44
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	566,600	783.51	443,937,857	689.40	390,614,040	1.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	36,500	8,843.47	322,787,019	9,260.00	337,990,000	1.59
日本	株式	ソニー	電気機器	55,000	5,296.04	291,282,258	5,828.00	320,540,000	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	57,900	5,195.16	300,800,198	5,168.00	299,227,200	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	61,300	4,852.12	297,435,278	4,445.00	272,478,500	1.28
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	73,900	3,794.22	280,392,961	3,355.00	247,934,500	1.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	4,000	67,701.52	270,806,080	58,910.00	235,640,000	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	71,000	2,818.04	200,081,094	3,113.00	221,023,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,098,800	203.32	223,416,687	194.60	213,826,480	1.01
日本	株式	任天堂	その他製品	5,100	46,117.34	235,198,473	36,760.00	187,476,000	0.88
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	60,600	2,732.66	165,599,646	3,055.00	185,133,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	56,800	3,107.83	176,524,826	3,117.00	177,045,600	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	7,400	21,231.25	157,111,313	23,245.00	172,013,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	7,800	28,111.09	219,266,549	21,920.00	170,976,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,600	15,838.74	136,213,194	19,500.00	167,700,000	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	57,900	2,764.94	160,090,588	2,873.00	166,346,700	0.78

日本	株式	花王	化学	20,200	7,791.61	157,390,627	8,137.00	164,367,400	0.77
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	30,500	5,243.21	159,918,058	5,301.00	161,680,500	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	9,900	17,426.88	172,526,122	16,180.00	160,182,000	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	14,200	11,815.27	167,776,959	11,270.00	160,034,000	0.75
日本	株式	キヤノン	電気機器	44,200	4,080.91	180,376,604	3,617.00	159,871,400	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	14,800	10,877.55	160,987,742	10,440.00	154,512,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	33,900	4,634.28	157,102,224	4,555.00	154,414,500	0.73
日本	株式	日立製作所	電気機器	197,000	861.81	169,777,570	778.60	153,384,200	0.72
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	47,500	3,367.05	159,934,875	3,176.00	150,860,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,200	13,112.86	146,864,133	13,320.00	149,184,000	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	80,800	1,507.54	121,809,780	1,817.50	146,854,000	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	30,200	5,882.87	177,662,961	4,675.00	141,185,000	0.66
日本	株式	パナソニック	電気機器	93,900	1,627.68	152,839,387	1,438.00	135,028,200	0.64

## 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	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.08
		食料品	4.10
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.24
		医薬品	4.64
		石油・石炭製品	0.80
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.01
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.63
		機械	5.00
		電気機器	13.12
		輸送用機器	8.39
		精密機器	1.70
		その他製品	1.98
		電気・ガス業	1.68
		陸運業	4.17
		海運業	0.19
		空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.51		
卸売業	4.60		

	小売業	4.67
	銀行業	6.70
	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	2.21
	その他金融業	1.16
	不動産業	2.31
	サービス業	4.38
合 計		96.70

## 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	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	40	日本円	695,631,600	699,200,000	3.29
	大阪証券取引所	ミニTOPIX先物	買建	5	日本円	8,865,540	8,740,000	0.04

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

## R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	9,261,872,581	59.23
	カナダ	570,571,914	3.65
	モーリシャス	132,510	0.00
	パナマ	10,522,662	0.07
	ドイツ	568,399,768	3.63
	イタリア	113,796,618	0.73
	フランス	582,912,068	3.73
	オランダ	296,925,782	1.90
	スペイン	181,223,388	1.16
	ベルギー	61,850,270	0.40
	オーストリア	13,311,318	0.09
	ルクセンブルク	15,094,960	0.10
	フィンランド	59,786,246	0.38
	アイルランド	209,865,076	1.34
ポルトガル	8,042,792	0.05	

	イギリス	974,737,504	6.23
	スイス	520,566,528	3.33
	スウェーデン	153,672,227	0.98
	ノルウェー	42,057,104	0.27
	デンマーク	99,075,344	0.63
	ケイマン	40,633,809	0.26
	リベリア	6,557,134	0.04
	オーストラリア	374,065,843	2.39
	バミューダ	61,513,105	0.39
	ニュージーランド	13,114,003	0.08
	パプアニューギニア	2,561,715	0.02
	香港	140,100,687	0.90
	シンガポール	72,334,847	0.46
	イスラエル	28,776,343	0.18
	キュラソー	37,952,900	0.24
	ジャージー	79,041,222	0.51
	英ヴァージン諸島	4,811,323	0.03
	マン島	2,521,894	0.02
	小計	14,608,401,485	93.41
投資証券	アメリカ	279,701,212	1.79
	カナダ	605,273	0.00
	フランス	19,777,333	0.13
	イギリス	12,188,795	0.08
	オーストラリア	25,590,241	0.16
	香港	10,993,850	0.07
	シンガポール	5,731,516	0.04
	小計	354,588,220	2.27
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		675,321,888	4.32
合計(純資産総額)		15,638,311,593	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	529,011,489	3.38
	買建	ドイツ	123,134,661	0.79
	買建	イギリス	44,540,345	0.28

(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		20,735,840	0.13

(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	18,256	19,559.85	357,084,657	21,081.90	384,871,333	2.46
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	26,307	10,388.43	273,288,526	11,697.12	307,716,233	1.97
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,481	159,993.21	236,949,951	197,511.21	292,514,105	1.87
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	8,633	19,987.07	172,548,383	18,989.37	163,935,236	1.05
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	12,364	12,676.65	156,734,112	12,958.19	160,215,151	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	1,135	125,512.49	142,456,684	135,403.33	153,682,788	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,076	126,291.53	135,889,694	136,546.74	146,924,293	0.94
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,667	15,161.59	146,567,116	14,672.19	141,836,077	0.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	15,281	9,373.78	143,240,881	9,073.95	138,659,143	0.89
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	35,099	3,487.48	122,407,100	3,475.72	121,994,405	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	16,881	6,774.18	114,354,971	6,492.97	109,607,909	0.70
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	11,357	9,007.69	102,300,441	9,112.39	103,489,481	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	4,632	23,153.70	107,247,950	22,100.98	102,371,744	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	6,511	13,863.53	90,265,482	15,150.64	98,645,848	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	3,496	26,660.63	93,205,588	28,178.77	98,513,009	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	6,906	14,063.87	97,125,115	14,190.40	97,998,960	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	26,371	3,858.73	101,758,666	3,552.32	93,678,231	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	4,224	21,830.32	92,211,279	21,900.05	92,505,823	0.59
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	21,494	4,081.45	87,726,781	4,283.87	92,077,629	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	16,873	5,309.05	89,579,693	5,294.06	89,326,791	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	15,003	5,763.06	86,463,308	5,826.91	87,421,204	0.56
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	17,493	4,721.34	82,590,435	4,681.29	81,889,836	0.52

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	9,120	9,367.86	85,434,925	8,903.00	81,195,378	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	2,033	37,475.61	76,187,928	38,971.17	79,228,390	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	73,157	1,085.85	79,437,541	1,057.41	77,357,529	0.49
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,124	9,316.24	75,685,179	9,332.62	75,818,218	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	14,729	5,139.12	75,694,186	5,131.99	75,589,115	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	9,299	8,459.36	78,663,616	8,024.91	74,623,665	0.48
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	3,379	19,190.92	64,846,150	21,965.54	74,221,589	0.47
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,754	6,658.25	64,944,578	7,194.55	70,175,720	0.45

## 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	6.87
		素材	4.55
		資本財	6.97
		商業・専門サービス	1.05
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.27
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	1.70
		メディア	1.90
		小売	4.64
		食品・生活必需品小売り	1.45
		食品・飲料・タバコ	4.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.81
		ヘルスケア機器・サービス	4.52
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
		銀行	8.77
		各種金融	4.22
		保険	3.67
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	11.08
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.09		
電気通信サービス	2.26		
公益事業	2.97		
半導体・半導体製造装置	2.94		
投資証券			2.27



合 計	95.68
-----	-------

## 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	SP500MIN1809	買建	34	米ドル	4,746,387.5	526,896,477	4,765,440	529,011,489	3.38
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EUROSTX 1809	買建	27	ユーロ	932,630	121,176,618	947,700	123,134,661	0.79
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1809	買建	4	英ポンド	305,215	44,466,773	305,720	44,540,345	0.28

(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	57,000.00	6,334,011	6,327,000	0.04
	ユーロ	買建	60,000.00	7,769,400	7,795,800	0.05
	英ポンド	買建	23,000.00	3,349,030	3,350,640	0.02
	シンガポールドル	買建	40,000.00	3,261,200	3,262,400	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	13,993,554	0.30
	メキシコ	136,682,513	2.96
	ブラジル	287,520,972	6.22
	チリ	50,322,207	1.09
	コロンビア	20,699,574	0.45
	ペルー	1,807,154	0.04
	オランダ	1,974,202	0.04
	ルクセンブルク	3,229,667	0.07

	ギリシャ	12,395,231	0.27
	トルコ	29,260,622	0.63
	チェコ	7,662,214	0.17
	ハンガリー	11,492,934	0.25
	ポーランド	53,215,137	1.15
	ロシア	141,548,946	3.06
	ケイマン	749,338,919	16.20
	バミューダ	44,785,364	0.97
	香港	159,391,877	3.45
	シンガポール	1,387,134	0.03
	マレーシア	105,050,485	2.27
	タイ	101,824,656	2.20
	フィリピン	44,107,740	0.95
	インドネシア	86,052,947	1.86
	韓国	621,386,685	13.44
	台湾	515,209,132	11.14
	中国	423,044,697	9.15
	インド	397,826,486	8.60
	カタール	39,660,578	0.86
	エジプト	4,201,506	0.09
	南アフリカ	279,864,801	6.05
	アラブ首長国連邦	29,318,409	0.63
	マン島	1,988,237	0.04
	小計	4,376,244,580	94.63
投資証券	メキシコ	4,019,883	0.09
	トルコ	322,305	0.01
	南アフリカ	12,338,788	0.27
	小計	16,680,976	0.36
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		231,441,220	5.00
合計（純資産総額）		4,624,366,776	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	224,057,030	4.85

(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		2,120,083	0.05
	売建		11,084	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	42,400	6,264.40	265,610,837	5,192.20	220,149,619	4.76
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	8,630	21,264.61	183,513,648	20,516.86	177,060,573	3.83
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	36,580	4,867.04	178,036,525	4,617.45	168,906,321	3.65
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	184,000	902.97	166,147,089	891.16	163,974,360	3.55
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	3,298	29,443.46	97,104,549	27,946.12	92,166,318	1.99
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	723,000	117.60	85,030,930	100.67	72,789,326	1.57
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	2,050	27,847.25	57,086,878	27,907.91	57,211,224	1.24
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	46,500	1,111.29	51,675,205	989.09	45,992,825	0.99
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	40,000	1,239.58	49,583,429	1,042.82	41,713,000	0.90
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	21,800	1,570.29	34,232,371	1,876.78	40,913,848	0.88
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	495,000	99.75	49,380,889	82.29	40,735,926	0.88
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	12,090	3,089.61	37,353,421	3,306.86	39,979,968	0.86
ブラジル	株式	VALE SA	素材	24,500	1,319.32	32,323,443	1,616.31	39,599,779	0.86
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	126,000	331.03	41,709,793	305.64	38,511,396	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	4,361	7,651.17	33,366,764	8,529.86	37,198,763	0.80
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	銀行	24,900	1,455.03	36,230,359	1,397.35	34,794,202	0.75
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	53,500	588.44	31,482,068	591.72	31,657,421	0.68
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	20,300	1,955.91	39,704,977	1,535.26	31,165,946	0.67
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	591,000	63.27	37,395,960	52.31	30,919,938	0.67
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	13,490	1,961.45	26,460,065	2,202.13	29,706,734	0.64
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	31,550	1,036.41	32,699,047	926.11	29,219,007	0.63
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	3,255	7,531.11	24,513,774	7,832.86	25,495,978	0.55
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	139,000	178.74	24,845,614	182.68	25,393,743	0.55
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	250,500	103.46	25,918,274	95.54	23,932,895	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	7,190	2,673.84	19,224,953	3,169.69	22,790,129	0.49

ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	5,620	4,792.43	26,933,476	3,903.11	21,935,487	0.47
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	37,300	639.15	23,840,333	586.07	21,860,597	0.47
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	202,000	97.41	19,678,757	106.19	21,450,663	0.46
韓国	株式	POSCO	素材	626	36,284.90	22,714,351	32,620.04	20,420,151	0.44
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	41,300	557.26	23,015,103	492.10	20,324,033	0.44

## 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	7.05
		素材	7.41
		資本財	3.35
		商業・専門サービス	0.13
		運輸	1.50
		自動車・自動車部品	2.52
		耐久消費財・アパレル	0.99
		消費者サービス	1.20
		メディア	2.32
		小売	1.89
		食品・生活必需品小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	3.45
		家庭用品・パーソナル用品	1.15
		ヘルスケア機器・サービス	0.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.18
		銀行	16.26
		各種金融	2.47
		保険	3.47
		不動産	2.46
		ソフトウェア・サービス	13.14
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.63		
電気通信サービス	4.05		
公益事業	2.38		
半導体・半導体製造装置	5.31		
投資証券			0.36
合計			95.00

### 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 1809	買建	37	米ドル	1,997,965	221,794,098	2,018,350	224,057,030	4.85

(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	19,099.85	2,122,454	2,120,083	0.05
	タイバーツ	売建	3,328.56	11,117	11,084	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	9,368,856,600	93.06
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		698,568,254	6.94
合計(純資産総額)		10,067,424,854	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	697,926,000	6.93

(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	1,071	600,532.83	643,170,671	622,000	666,162,000	6.62
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,106	567,609.12	627,775,697	585,000	647,010,000	6.43
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,279	152,841.75	501,168,120	158,400	519,393,600	5.16
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,091	211,445.92	442,133,436	203,900	426,354,900	4.23
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,440	171,353.49	418,102,535	173,400	423,096,000	4.20

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,204	171,269.93	377,478,930	174,200	383,936,800	3.81
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,385	264,855.54	366,824,931	276,000	382,260,000	3.80
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,484	241,207.4	357,951,796	226,100	335,532,400	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,078	282,239.75	304,254,458	290,900	313,590,200	3.11
日本	投資証券	G L P 投資法人	2,446	121,678.73	297,626,195	119,400	292,052,400	2.90
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	700	392,815.52	274,970,864	402,500	281,750,000	2.80
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	530	488,773.33	259,049,864	499,000	264,470,000	2.63
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,203	81,382.84	260,669,266	81,900	262,325,700	2.61
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	342	685,016.66	234,275,697	678,000	231,876,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,854	72,597	207,191,856	72,200	206,058,800	2.05
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	368	491,268.98	180,786,985	529,000	194,672,000	1.93
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	255	624,688.18	159,295,488	681,000	173,655,000	1.72
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	376	453,083.99	170,359,580	450,000	169,200,000	1.68
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,188	141,165.78	167,704,951	138,100	164,062,800	1.63
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,254	50,637.28	164,773,725	49,350	160,584,900	1.60
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	739	218,473.52	161,451,932	216,000	159,624,000	1.59
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,289	123,785.59	159,559,633	120,600	155,453,400	1.54
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	991	140,309.78	139,046,992	143,700	142,406,700	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	798	169,262.97	135,071,851	172,900	137,974,200	1.37
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,136	121,539.55	138,068,934	119,500	135,752,000	1.35
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	791	163,273.92	129,149,677	162,100	128,221,100	1.27
日本	投資証券	日本リート投資法人	357	331,172.24	118,228,489	346,500	123,700,500	1.23
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,052	112,926.24	118,798,407	112,800	118,665,600	1.18
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,244	86,200.97	107,234,011	91,000	113,204,000	1.12
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	742	146,092.25	108,400,451	152,500	113,155,000	1.12

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	93.06
合計	93.06

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	大阪証券取引所	東証REIT指数先物	買建	397	日本円	684,851,676	697,926,000	6.93

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

## R A M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	6,923,693,362	70.96
	カナダ	177,362,667	1.82
	ドイツ	26,067,430	0.27
	イタリア	11,314,073	0.12
	フランス	492,409,533	5.05
	オランダ	42,758,098	0.44
	スペイン	100,222,623	1.03
	ベルギー	78,763,696	0.81
	アイルランド	26,629,414	0.27
	イギリス	537,475,575	5.51
	オーストラリア	667,387,402	6.84
	ニュージーランド	43,012,480	0.44
	香港	216,584,147	2.22
	シンガポール	349,898,246	3.59
	イスラエル	6,154,856	0.06
	ガンジー	6,493,374	0.07
	マン島	5,925,317	0.06
	小計	9,712,152,293	99.54
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		44,633,413	0.46
合計（純資産総額）		9,756,785,706	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		6,711,000	0.07

(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	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,755	18,248.97	433,504,309	19,078.17	453,202,133	4.64
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	40,962	7,122.54	291,753,713	7,215.64	295,567,455	3.03
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	11,537	22,522.09	259,837,406	23,811.64	274,714,948	2.82

フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,406	25,498.02	265,332,454	24,608.74	256,078,569	2.62
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,833	12,184.13	192,911,447	13,404.45	212,232,776	2.18
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,596	18,790.89	199,108,291	19,112.59	202,517,022	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	28,362	6,847.70	194,214,519	7,079.10	200,777,653	2.06
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	28,899	6,577.79	190,091,670	6,849.31	197,938,412	2.03
香港	投資証券	LINK REIT	166,500	1,000.50	166,584,063	1,099.38	183,047,602	1.88
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	27,345	6,089.94	166,529,657	6,152.17	168,231,203	1.72
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	11,827	13,678.44	161,774,917	13,550.99	160,267,567	1.64
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	409,068	337.91	138,229,194	349.39	142,925,291	1.46
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	21,879	5,920.11	129,526,272	6,146.62	134,481,980	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,114	25,908.24	132,494,765	25,954.13	132,729,462	1.36
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	57,559	2,298.64	132,307,491	2,296.79	132,201,333	1.35
アメリカ	投資証券	GGP INC	48,803	2,476.82	120,876,660	2,348.97	114,636,861	1.17
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,027	13,937.01	111,872,401	13,634.24	109,442,110	1.12
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	13,456	7,919.68	106,567,293	7,777.36	104,652,164	1.07
アメリカ	投資証券	HCP INC	36,387	2,683.12	97,630,984	2,828.53	102,921,896	1.05
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,809	9,808.88	96,215,366	10,380.54	101,822,767	1.04
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	124,243	704.28	87,502,140	798.25	99,178,105	1.02
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,831	10,493.71	92,670,018	10,951.13	96,709,486	0.99
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	27,911	2,959.34	82,598,408	3,171.55	88,521,291	0.91
アメリカ	投資証券	UDR INC	20,322	4,041.57	82,132,865	4,112.92	83,582,770	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	21,355	3,868.66	82,615,445	3,875.35	82,758,294	0.85
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	11,558	6,887.80	79,609,300	6,960.32	80,447,459	0.82
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	57,626	1,423.52	82,031,893	1,357.39	78,221,171	0.80
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	6,893	10,839.73	74,718,265	11,159.83	76,924,745	0.79
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,659	13,484.42	76,308,388	13,592.06	76,917,492	0.79
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	76,678	879.23	67,418,119	970.58	74,422,652	0.76

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.54
合計	99.54

## 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	35,000.00	3,889,305	3,885,000	0.04
	香港ドル	買建	200,000.00	2,831,800	2,826,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。



## 参考情報

## 運用実績

2018年7月31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)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	64.8
RAM先進国債券マザーファンド	13.2
RAM国内株式マザーファンド	9.1
RAM先進国株式マザーファンド	4.6
RAM新興国株式マザーファンド	1.9
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内リートマザーファンド	1.9
RAM先進国リートマザーファンド	1.9
現金等	0.6
合計	100.0

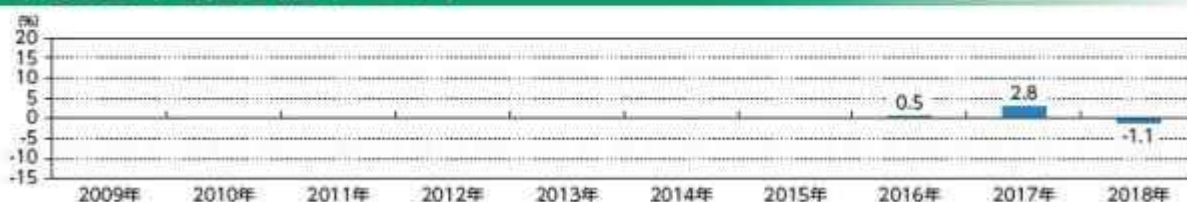
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第312回利付国債(10年)	2020/12/20	1.27
	日本	第135回利付国債(5年)	2023/3/20	1.26
	日本	第350回利付国債(10年)	2028/3/20	1.14
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/9/30	0.41
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/2/15	0.40
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/8/15	0.40
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.44
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	1.84
	日本	ソフトバンクグループ	—	1.59
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	2.46
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	1.97
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	1.87
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	4.76
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	3.83
新興国債券	韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	3.65
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	—	99.90
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.62
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	6.43
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.16
先進国リート	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	4.64
	アメリカ	PROLOGIS INC	—	3.03
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	—	2.82

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。

※2016年5月12日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は5月12日から12月末までの騰落率です。2018年は7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。

## 1【申込（販売）手続等】

### （1）申込方法

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

### （2）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

### （3）取扱時間

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

### （4）取得申込不可日

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

ニューヨークの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

### （5）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

### （6）申込単位

1円以上1円単位

### （7）申込代金の支払い

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

### （8）受付の中止および取消

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

### （3）解約請求不可日

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

ニューヨークの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

### （4）解約制限

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

## (5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

## 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## (6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

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

## (7) 解約単位

1口単位

## (8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

## (9) 受付の中止および取消

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

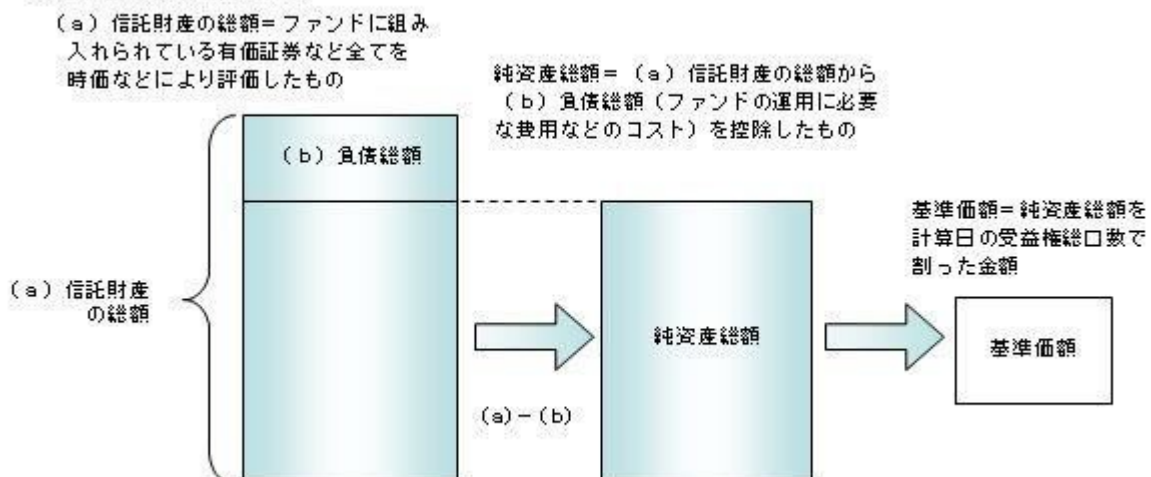
## 3【資産管理等の概要】

## (1) 【資産の評価】

## 基準価額の算出

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

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（2016年5月12日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

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

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約によりファンドの純資産総額が20億円を下回るようになった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)

ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更など

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

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

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

書面決議

1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知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。

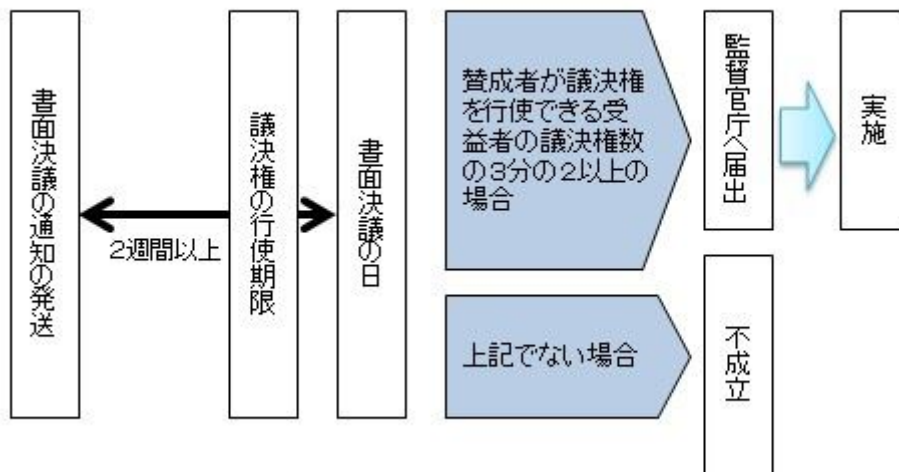
4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

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＞



## 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

## 運用報告書の作成

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年1月26日から平成30年1月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCりそな グローバルバランス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年 1月25日現在	第2期 平成30年 1月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	243,611	1,117,376
親投資信託受益証券	43,866,944	116,257,048
流動資産合計	44,110,555	117,374,424
資産合計	44,110,555	117,374,424
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	3,857
未払受託者報酬	2,327	18,103
未払委託者報酬	32,575	253,380
未払利息	-	3
その他未払費用	534	4,438
流動負債合計	35,436	279,781
負債合計	35,436	279,781
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	44,058,819	112,785,606
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,300	4,309,037
（分配準備積立金）	125,907	2,439,641
元本等合計	44,075,119	117,094,643
純資産合計	44,075,119	117,094,643
負債純資産合計	44,110,555	117,374,424



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成28年 5月12日 至 平成29年 1月25日	自	平成29年 1月26日 至 平成30年 1月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		175,944		3,117,104
営業収益合計		175,944		3,117,104
営業費用				
支払利息		8		447
受託者報酬		2,737		27,875
委託者報酬		38,476		390,056
その他費用		717		6,798
営業費用合計		41,938		425,176
営業利益又は営業損失（ ）		134,006		2,691,928
経常利益又は経常損失（ ）		134,006		2,691,928
当期純利益又は当期純損失（ ）		134,006		2,691,928
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（ ）		8,099		335,575
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		16,300
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,183		2,118,925
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		27,183		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,118,925
剰余金減少額又は欠損金増加額		136,790		182,541
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		182,541
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		136,790		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		16,300		4,309,037

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年 1月25日現在		第2期 平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円	期首元本額	44,058,819円
期中追加設定元本額	46,045,838円	期中追加設定元本額	94,737,024円
期中一部解約元本額	2,987,019円	期中一部解約元本額	26,010,237円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	44,058,819口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	112,785,606口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0004円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0382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)	(10,004円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,382円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年 5月12日 至 平成29年 1月25日		第2期 自 平成29年 1月26日 至 平成30年 1月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	76,077円	A 費用控除後の配当等収益額	740,492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	49,830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	1,615,861円
C 収益調整金額	59,758円	C 収益調整金額	1,869,396円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	83,288円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	185,665円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	4,309,037円
F 当ファンドの期末残存口数	44,058,819口	F 当ファンドの期末残存口数	112,785,606口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	42円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	382円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成28年 5月12日 至 平成29年 1月25日	第2期 自 平成29年 1月26日 至 平成30年 1月25日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成29年 1月25日現在	第2期 平成30年 1月25日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</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1期 自 平成28年 5月12日 至 平成29年 1月25日	第2期 自 平成29年 1月26日 至 平成30年 1月25日
該当事項はありません。	同左

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成28年 5月12日 至 平成29年 1月25日	第2期 自 平成29年 1月26日 至 平成30年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	132,173	2,602,783
合計	132,173	2,602,783

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	66,208,661	68,380,305	
	R A M先進国債券マザーファンド	8,548,009	8,425,772	
	R A M新興国債券マザーファンド	1,921,493	2,276,584	
	R A M国内株式マザーファンド	14,502,398	18,268,670	
	R A M先進国株式マザーファンド	9,572,947	12,003,518	
	R A M新興国株式マザーファンド	1,537,182	2,324,987	
	R A M国内リートマザーファンド	2,082,440	2,299,013	
	R A M先進国リートマザーファンド	2,232,435	2,278,199	
合計		106,605,565	116,257,048	

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	240,296
コール・ローン	372,325,942
国債証券	38,580,836,490
地方債証券	2,778,956,000
特殊債券	2,639,801,630
社債券	1,719,668,000
未収利息	85,548,018
前払費用	9,035,095
流動資産合計	46,186,411,471
資産合計	46,186,411,471
負債の部	
流動負債	
未払金	160,061,200
未払利息	1,009
流動負債合計	160,062,209
負債合計	160,062,209
純資産の部	
元本等	
元本	44,564,485,799
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,461,863,463
元本等合計	46,026,349,262
純資産合計	46,026,349,262
負債純資産合計	46,186,411,471

## 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)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	14,831,307,760円
期中追加設定元本額	37,371,390,762円
期中一部解約元本額	7,638,212,723円
期末元本額	44,564,485,799円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	12,810,654,867円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	242,942,919円
りそなラップ型ファンド(成長型)	101,088,182円

DCりそな グローバルバランス	66,208,661円
つみたてバランスファンド	4,467,972円
FWりそな国内債券インデックスファンド	31,337,398,898円
Smart-i 国内債券インデックス	744,093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）	980,207円
2. 計算日における受益権の総数	44,564,485,799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	1.0328円
(10,000口当たり純資産額)	(10,328円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在
該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	152,897,010
地方債証券	13,019,500
特殊債券	10,800,700
社債券	3,075,000
合計	179,792,210

(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373回利付国債(2年)	260,000,000	260,639,600	
	第374回利付国債(2年)	370,000,000	370,976,800	
	第375回利付国債(2年)	220,000,000	220,624,800	
	第376回利付国債(2年)	170,000,000	170,515,100	
	第377回利付国債(2年)	150,000,000	150,484,500	
	第378回利付国債(2年)	250,000,000	250,857,500	
	第379回利付国債(2年)	170,000,000	170,617,100	
	第380回利付国債(2年)	250,000,000	250,957,500	
	第381回利付国債(2年)	170,000,000	170,683,400	
	第382回利付国債(2年)	80,000,000	80,337,600	
	第383回利付国債(2年)	400,000,000	401,768,000	
	第117回利付国債(5年)	127,000,000	127,469,900	
	第118回利付国債(5年)	206,000,000	206,916,700	
	第119回利付国債(5年)	100,000,000	100,306,000	
	第120回利付国債(5年)	179,000,000	179,941,540	
	第121回利付国債(5年)	190,000,000	190,685,900	
	第122回利付国債(5年)	410,000,000	411,627,700	
	第123回利付国債(5年)	395,000,000	396,773,550	
	第124回利付国債(5年)	305,000,000	306,457,900	
	第125回利付国債(5年)	371,000,000	372,914,360	
	第126回利付国債(5年)	380,000,000	382,147,000	
	第127回利付国債(5年)	350,000,000	352,089,500	
	第128回利付国債(5年)	400,000,000	402,512,000	
	第129回利付国債(5年)	310,000,000	312,036,700	
	第130回利付国債(5年)	350,000,000	352,457,000	
	第131回利付国債(5年)	540,000,000	544,033,800	
	第132回利付国債(5年)	550,000,000	554,482,500	
	第133回利付国債(5年)	480,000,000	484,137,600	
	第134回利付国債(5年)	130,000,000	131,147,900	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	56,852,000	
	第2回利付国債(40年)	50,000,000	68,647,000	
	第3回利付国債(40年)	60,000,000	82,635,600	
	第4回利付国債(40年)	90,000,000	124,305,300	
	第5回利付国債(40年)	90,000,000	119,439,000	
第6回利付国債(40年)	90,000,000	116,991,900		
第7回利付国債(40年)	90,000,000	111,610,800		
第8回利付国債(40年)	120,000,000	137,464,800		

第9回利付国債(40年)	170,000,000	139,908,300
第10回利付国債(40年)	100,000,000	97,875,000
第299回利付国債(10年)	100,000,000	101,622,000
第300回利付国債(10年)	50,000,000	50,925,000
第301回利付国債(10年)	70,000,000	71,577,800
第302回利付国債(10年)	20,000,000	20,422,800
第303回利付国債(10年)	80,000,000	81,992,000
第304回利付国債(10年)	40,000,000	40,930,400
第305回利付国債(10年)	370,000,000	379,882,700
第306回利付国債(10年)	280,000,000	289,055,200
第307回利付国債(10年)	250,000,000	257,550,000
第308回利付国債(10年)	310,000,000	320,431,500
第309回利付国債(10年)	120,000,000	123,463,200
第310回利付国債(10年)	350,000,000	360,192,000
第311回利付国債(10年)	40,000,000	40,953,200
第312回利付国債(10年)	440,000,000	456,579,200
第313回利付国債(10年)	330,000,000	344,483,700
第314回利付国債(10年)	60,000,000	62,255,400
第315回利付国債(10年)	355,000,000	370,627,100
第316回利付国債(10年)	100,000,000	104,062,000
第317回利付国債(10年)	170,000,000	177,389,900
第318回利付国債(10年)	236,000,000	245,395,160
第319回利付国債(10年)	250,000,000	261,562,500
第320回利付国債(10年)	242,000,000	252,248,700
第321回利付国債(10年)	141,000,000	147,350,640
第322回利付国債(10年)	120,000,000	124,906,800
第323回利付国債(10年)	90,000,000	93,884,400
第324回利付国債(10年)	133,000,000	138,153,750
第325回利付国債(10年)	370,000,000	384,985,000
第326回利付国債(10年)	280,000,000	290,651,200
第327回利付国債(10年)	207,000,000	215,888,580
第328回利付国債(10年)	461,000,000	476,922,940
第329回利付国債(10年)	387,000,000	405,099,990
第330回利付国債(10年)	297,000,000	311,368,860
第331回利付国債(10年)	90,000,000	93,335,400
第332回利付国債(10年)	402,000,000	417,436,800
第333回利付国債(10年)	325,000,000	337,795,250
第334回利付国債(10年)	311,000,000	323,645,260
第335回利付国債(10年)	85,000,000	87,968,200
第336回利付国債(10年)	210,000,000	217,532,700
第337回利付国債(10年)	50,000,000	51,103,500
第338回利付国債(10年)	561,000,000	577,426,080

第339回利付国債(10年)	325,000,000	334,603,750
第340回利付国債(10年)	444,000,000	457,217,880
第341回利付国債(10年)	210,000,000	214,800,600
第342回利付国債(10年)	160,000,000	161,038,400
第343回利付国債(10年)	260,000,000	261,521,000
第344回利付国債(10年)	460,000,000	462,373,600
第345回利付国債(10年)	260,000,000	261,149,200
第346回利付国債(10年)	460,000,000	461,669,800
第347回利付国債(10年)	340,000,000	341,268,200
第348回利付国債(10年)	190,000,000	190,636,500
第349回利付国債(10年)	160,000,000	160,313,600
第1回利付国債(30年)	10,000,000	13,039,400
第11回利付国債(30年)	10,000,000	12,006,400
第12回利付国債(30年)	10,000,000	12,623,200
第13回利付国債(30年)	20,000,000	24,967,400
第14回利付国債(30年)	20,000,000	26,242,400
第15回利付国債(30年)	20,000,000	26,603,000
第16回利付国債(30年)	20,000,000	26,657,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,978,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	78,219,600
第19回利付国債(30年)	50,000,000	65,286,000
第20回利付国債(30年)	20,000,000	26,832,400
第21回利付国債(30年)	50,000,000	65,423,500
第22回利付国債(30年)	50,000,000	67,243,500
第23回利付国債(30年)	60,000,000	80,821,200
第24回利付国債(30年)	40,000,000	53,963,200
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,304,400
第26回利付国債(30年)	45,000,000	60,037,650
第27回利付国債(30年)	105,000,000	142,303,350
第28回利付国債(30年)	100,000,000	135,844,000
第29回利付国債(30年)	110,000,000	147,996,200
第30回利付国債(30年)	130,000,000	172,914,300
第31回利付国債(30年)	120,000,000	157,681,200
第32回利付国債(30年)	135,000,000	180,729,900
第33回利付国債(30年)	170,000,000	217,657,800
第34回利付国債(30年)	145,000,000	192,329,450
第35回利付国債(30年)	146,000,000	187,735,560
第36回利付国債(30年)	185,000,000	238,348,450
第37回利付国債(30年)	180,000,000	228,272,400
第38回利付国債(30年)	120,000,000	149,654,400
第39回利付国債(30年)	110,000,000	139,812,200
第40回利付国債(30年)	85,000,000	106,133,550
第41回利付国債(30年)	85,000,000	104,200,650

第42回利付国債(30年)	110,000,000	134,899,600	
第43回利付国債(30年)	100,000,000	122,684,000	
第44回利付国債(30年)	90,000,000	110,456,100	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	141,564,000	
第46回利付国債(30年)	130,000,000	153,366,200	
第47回利付国債(30年)	130,000,000	156,708,500	
第48回利付国債(30年)	143,000,000	165,225,060	
第49回利付国債(30年)	120,000,000	138,630,000	
第50回利付国債(30年)	140,000,000	140,483,000	
第51回利付国債(30年)	140,000,000	122,529,400	
第52回利付国債(30年)	140,000,000	129,458,000	
第53回利付国債(30年)	130,000,000	123,319,300	
第54回利付国債(30年)	150,000,000	149,821,500	
第55回利付国債(30年)	20,000,000	19,952,400	
第56回利付国債(30年)	130,000,000	129,533,300	
第57回利付国債(30年)	10,000,000	9,951,900	
第46回利付国債(20年)	10,000,000	10,554,500	
第47回利付国債(20年)	10,000,000	10,612,500	
第48回利付国債(20年)	20,000,000	21,515,000	
第49回利付国債(20年)	30,000,000	32,085,600	
第50回利付国債(20年)	10,000,000	10,632,100	
第51回利付国債(20年)	20,000,000	21,425,600	
第52回利付国債(20年)	40,000,000	43,202,400	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	21,705,600	
第54回利付国債(20年)	10,000,000	10,891,900	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,916,100	
第57回利付国債(20年)	10,000,000	10,872,000	
第58回利付国債(20年)	50,000,000	54,611,500	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	43,495,600	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	32,179,800	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	52,771,500	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	83,764,800	
第63回利付国債(20年)	10,000,000	11,011,500	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,218,800	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	156,128,000	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	22,393,800	
第69回利付国債(20年)	20,000,000	22,640,000	
第70回利付国債(20年)	40,000,000	46,236,800	
第71回利付国債(20年)	20,000,000	22,862,200	
第72回利付国債(20年)	80,000,000	91,308,000	
第73回利付国債(20年)	30,000,000	34,169,400	
第75回利付国債(20年)	20,000,000	23,005,600	

第76回利付国債(20年)	20,000,000	22,720,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	22,862,800
第78回利付国債(20年)	50,000,000	57,019,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,955,600
第80回利付国債(20年)	130,000,000	150,170,800
第81回利付国債(20年)	30,000,000	34,558,200
第82回利付国債(20年)	40,000,000	46,382,800
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,643,200
第84回利付国債(20年)	20,000,000	23,128,600
第85回利付国債(20年)	50,000,000	58,448,500
第86回利付国債(20年)	20,000,000	23,704,400
第87回利付国債(20年)	10,000,000	11,770,900
第88回利付国債(20年)	45,000,000	53,547,750
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,631,600
第90回利付国債(20年)	50,000,000	59,300,000
第91回利付国債(20年)	10,000,000	11,946,100
第92回利付国債(20年)	105,000,000	124,051,200
第93回利付国債(20年)	20,000,000	23,536,400
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,295,500
第95回利付国債(20年)	35,000,000	42,319,550
第96回利付国債(20年)	20,000,000	23,809,200
第97回利付国債(20年)	80,000,000	96,364,000
第98回利付国債(20年)	70,000,000	83,647,900
第99回利付国債(20年)	125,000,000	149,850,000
第100回利付国債(20年)	151,000,000	183,096,560
第101回利付国債(20年)	20,000,000	24,653,200
第102回利付国債(20年)	145,000,000	179,382,400
第103回利付国債(20年)	20,000,000	24,536,600
第104回利付国債(20年)	10,000,000	12,062,600
第105回利付国債(20年)	162,000,000	196,010,280
第106回利付国債(20年)	40,000,000	48,818,400
第108回利付国債(20年)	190,000,000	226,476,200
第109回利付国債(20年)	130,000,000	155,344,800
第110回利付国債(20年)	65,000,000	79,100,450
第111回利付国債(20年)	130,000,000	160,110,600
第112回利付国債(20年)	55,000,000	67,122,000
第113回利付国債(20年)	185,000,000	226,403,000
第114回利付国債(20年)	140,000,000	171,791,200
第115回利付国債(20年)	60,000,000	74,325,000
第116回利付国債(20年)	120,000,000	148,968,000
第117回利付国債(20年)	105,000,000	129,097,500
第118回利付国債(20年)	111,000,000	135,482,160
第119回利付国債(20年)	60,000,000	71,779,200

第120回利付国債(20年)	50,000,000	58,604,000	
第121回利付国債(20年)	185,000,000	224,051,650	
第122回利付国債(20年)	20,000,000	23,974,800	
第123回利付国債(20年)	185,000,000	229,170,600	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	61,309,500	
第125回利付国債(20年)	100,000,000	125,440,000	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	61,441,500	
第128回利付国債(20年)	205,000,000	249,628,500	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	24,094,200	
第130回利付国債(20年)	160,000,000	192,968,000	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	35,785,200	
第132回利付国債(20年)	150,000,000	179,197,500	
第133回利付国債(20年)	95,000,000	114,766,650	
第134回利付国債(20年)	95,000,000	114,949,050	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,821,600	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,552,800	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	203,529,100	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	58,437,000	
第139回利付国債(20年)	30,000,000	35,501,700	
第140回利付国債(20年)	220,000,000	263,751,400	
第141回利付国債(20年)	105,000,000	125,952,750	
第142回利付国債(20年)	80,000,000	97,104,000	
第143回利付国債(20年)	255,000,000	302,340,750	
第145回利付国債(20年)	205,000,000	246,131,200	
第146回利付国債(20年)	210,000,000	252,413,700	
第147回利付国債(20年)	225,000,000	267,135,750	
第148回利付国債(20年)	235,000,000	275,436,450	
第149回利付国債(20年)	260,000,000	304,925,400	
第150回利付国債(20年)	240,000,000	277,660,800	
第151回利付国債(20年)	195,000,000	219,160,500	
第152回利付国債(20年)	190,000,000	213,349,100	
第153回利付国債(20年)	180,000,000	205,003,800	
第154回利付国債(20年)	258,000,000	289,388,280	
第155回利付国債(20年)	190,000,000	206,617,400	
第156回利付国債(20年)	190,000,000	186,684,500	
第157回利付国債(20年)	210,000,000	198,387,000	
第158回利付国債(20年)	200,000,000	198,982,000	
第159回利付国債(20年)	220,000,000	222,261,600	
第160回利付国債(20年)	250,000,000	256,492,500	
第161回利付国債(20年)	180,000,000	180,941,400	
第162回利付国債(20年)	140,000,000	140,492,800	
第163回利付国債(20年)	80,000,000	80,142,400	

	国債証券合計	35,571,000,000	38,580,836,490
地方債証券	第678回東京都公募公債	100,000,000	102,557,000
	第680回東京都公募公債	100,000,000	102,906,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	104,197,000
	第729回東京都公募公債	100,000,000	103,668,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	98,709,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,752,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	102,177,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	99,236,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	114,499,000
	平成27年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	100,292,000
	平成20年度第10回愛知県公募公債	100,000,000	101,685,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	103,666,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	99,904,000
	平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,051,000
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	99,336,000
	平成21年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,146,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,905,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,222,000
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,282,000
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,669,000
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,954,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,484,000
	平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	102,482,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,144,000
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,808,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,416,000
平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,809,000	
	地方債証券合計	2,710,000,000	2,778,956,000
特殊債券	第27回道路債券	100,000,000	113,936,000
	第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,796,000
	第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,349,060
	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	118,332,000
	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	131,046,220
	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	102,728,000
	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	99,732,000
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	131,809,490
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,178,000
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,275,000

	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,536,000	
	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,337,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	119,279,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,538,000	98,811,935	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,157,000	99,088,581	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,827,000	99,628,344	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,880,000	
	い第772号商工債	100,000,000	100,242,000	
	第310回信金中金債	100,000,000	100,412,000	
	第327回信金中金債	100,000,000	99,776,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,563,000	
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,016,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
	第61回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,556,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,592,000	
	特殊債券合計	2,566,522,000	2,639,801,630	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,434,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,547,000	
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,746,000	
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,069,000	
	第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,528,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,834,000	
	第37回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,319,000	
	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	99,362,000	
	第49回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,683,000	
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,153,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,542,000	
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,455,000	
	第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,214,000	
	第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,914,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,444,000	
	第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,536,000	
	第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,888,000	
	社債券合計	1,700,000,000	1,719,668,000	
	合計		45,719,262,120	

## 第2 信用取引契約残高明細表



該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### R A M先進国債券マザーファンド

##### 貸借対照表

(単位：円)	
平成30年 1月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	49,028,564
コール・ローン	72,572,330
国債証券	17,850,398,285
派生商品評価勘定	62,353
未収利息	123,652,066
前払費用	24,764,947
流動資産合計	18,120,478,545
資産合計	
18,120,478,545	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	289,973
未払金	76,114,907
未払利息	196
流動負債合計	76,405,076
負債合計	
76,405,076	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,306,428,860
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	262,355,391
元本等合計	18,044,073,469
純資産合計	
18,044,073,469	
負債純資産合計	
18,120,478,545	

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	7,565,488,405円
期中追加設定元本額	15,224,545,549円
期中一部解約元本額	4,483,605,094円
期末元本額	18,306,428,860円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,647,493,452円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,846,276,901円
りそなラップ型ファンド(成長型)	105,470,509円
DCりそな グローバルバランス	8,548,009円
つみたてバランスファンド	1,142,133円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	9,697,200,542円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	159,033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)	138,281円
2. 計算日における受益権の総数	18,306,428,860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	262,355,391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	0.9857円
(10,000口当たり純資産額)	(9,857円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

### 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		166,023,648
合計		166,023,648

(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)

(平成30年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	57,989,587	-	57,761,967	227,620
	米ドル	29,253,354	-	28,979,975	273,379
	ユーロ	22,007,953	-	22,020,272	12,319
	英ポンド	6,728,280	-	6,761,720	33,440
合計		57,989,587	-	57,761,967	227,620

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	220,000.00	218,749.52	
		US TREASURY N/B	590,000.00	587,660.65	
		US TREASURY N/B	210,000.00	208,638.36	
		US TREASURY N/B	290,000.00	286,505.21	
		US TREASURY N/B	280,000.00	277,615.52	
		US TREASURY N/B	480,000.00	477,843.84	
		US TREASURY N/B	240,000.00	237,506.16	
		US TREASURY N/B	350,000.00	348,714.80	
		US TREASURY N/B	280,000.00	277,768.68	
		US TREASURY N/B	230,000.00	227,035.07	
		US TREASURY N/B	500,000.00	497,929.50	
		US TREASURY N/B	250,000.00	246,523.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	506,822.70	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,164.10	
		US TREASURY N/B	260,000.00	256,084.66	
		US TREASURY N/B	390,000.00	384,675.72	
		US TREASURY N/B	250,000.00	247,436.50	
		US TREASURY N/B	230,000.00	225,871.73	
		US TREASURY N/B	610,000.00	599,897.18	
		US TREASURY N/B	330,000.00	328,188.96	
		US TREASURY N/B	250,000.00	247,695.25	
		US TREASURY N/B	390,000.00	382,527.60	
		US TREASURY N/B	400,000.00	397,546.80	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,390.70	
		US TREASURY N/B	350,000.00	343,519.75	
		US TREASURY N/B	370,000.00	368,265.44	
US TREASURY N/B	440,000.00	435,247.56			

US TREASURY N/B	380,000.00	373,409.28	
US TREASURY N/B	640,000.00	634,000.00	
US TREASURY N/B	550,000.00	539,934.45	
US TREASURY N/B	250,000.00	255,874.00	
US TREASURY N/B	380,000.00	376,162.76	
US TREASURY N/B	240,000.00	235,453.20	
US TREASURY N/B	130,000.00	129,294.10	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,214.90	
US TREASURY N/B	410,000.00	402,793.02	
US TREASURY N/B	200,000.00	197,351.60	
US TREASURY N/B	510,000.00	501,722.70	
US TREASURY N/B	230,000.00	226,725.26	
US TREASURY N/B	300,000.00	309,252.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	472,884.48	
US TREASURY N/B	260,000.00	257,435.62	
US TREASURY N/B	190,000.00	186,047.81	
US TREASURY N/B	230,000.00	226,918.46	
US TREASURY N/B	350,000.00	344,182.65	
US TREASURY N/B	380,000.00	391,711.60	
US TREASURY N/B	290,000.00	285,910.42	
US TREASURY N/B	500,000.00	491,211.00	
US TREASURY N/B	230,000.00	226,585.88	
US TREASURY N/B	690,000.00	681,401.91	
US TREASURY N/B	250,000.00	246,103.50	
US TREASURY N/B	310,000.00	305,985.81	
US TREASURY N/B	450,000.00	455,089.05	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,113.30	
US TREASURY N/B	540,000.00	529,337.16	
US TREASURY N/B	410,000.00	401,775.81	
US TREASURY N/B	480,000.00	470,052.96	
US TREASURY N/B	400,000.00	394,124.80	
US TREASURY N/B	240,000.00	237,173.52	
US TREASURY N/B	430,000.00	420,652.66	
US TREASURY N/B	430,000.00	434,980.26	
US TREASURY N/B	270,000.00	266,809.68	

US TREASURY N/B	210,000.00	208,859.70	
US TREASURY N/B	460,000.00	452,785.36	
US TREASURY N/B	400,000.00	396,453.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	493,525.50	
US TREASURY N/B	490,000.00	477,893.57	
US TREASURY N/B	430,000.00	447,703.96	
US TREASURY N/B	470,000.00	454,366.86	
US TREASURY N/B	400,000.00	387,765.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,982.30	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,650.40	
US TREASURY N/B	280,000.00	279,967.24	
US TREASURY N/B	280,000.00	287,628.88	
US TREASURY N/B	350,000.00	347,060.70	
US TREASURY N/B	560,000.00	543,888.80	
US TREASURY N/B	550,000.00	529,224.85	
US TREASURY N/B	490,000.00	470,840.02	
US TREASURY N/B	400,000.00	397,687.60	
US TREASURY N/B	520,000.00	498,935.84	
US TREASURY N/B	320,000.00	306,637.76	
US TREASURY N/B	250,000.00	248,330.00	
US TREASURY N/B	560,000.00	538,616.96	
US TREASURY N/B	550,000.00	543,876.85	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,654.40	
US TREASURY N/B	290,000.00	285,377.98	
US TREASURY N/B	600,000.00	592,371.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,302.80	
US TREASURY N/B	340,000.00	333,817.44	
US TREASURY N/B	270,000.00	266,514.30	
US TREASURY N/B	320,000.00	312,537.60	
US TREASURY N/B	330,000.00	323,754.42	
US TREASURY N/B	290,000.00	282,976.49	
US TREASURY N/B	310,000.00	303,927.10	
US TREASURY N/B	220,000.00	214,482.84	
US TREASURY N/B	350,000.00	342,842.85	
US TREASURY N/B	240,000.00	233,939.04	

US TREASURY N/B	290,000.00	284,041.37	
US TREASURY N/B	300,000.00	292,154.40	
US TREASURY N/B	130,000.00	128,542.57	
US TREASURY N/B	280,000.00	272,458.48	
US TREASURY N/B	490,000.00	481,693.03	
US TREASURY N/B	280,000.00	273,678.16	
US TREASURY N/B	180,000.00	174,030.48	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,039.10	
US TREASURY N/B	280,000.00	270,473.56	
US TREASURY N/B	270,000.00	262,005.57	
US TREASURY N/B	350,000.00	341,578.30	
US TREASURY N/B	300,000.00	292,687.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	294,269.40	
US TREASURY N/B	330,000.00	318,127.59	
US TREASURY N/B	570,000.00	558,911.79	
US TREASURY N/B	350,000.00	344,927.80	
US TREASURY N/B	260,000.00	251,519.58	
US TREASURY N/B	470,000.00	460,021.90	
US TREASURY N/B	280,000.00	267,268.68	
US TREASURY N/B	290,000.00	276,502.53	
US TREASURY N/B	230,000.00	220,476.62	
US TREASURY N/B	470,000.00	453,237.92	
US TREASURY N/B	320,000.00	306,449.92	
US TREASURY N/B	310,000.00	292,622.95	
US TREASURY N/B	350,000.00	327,769.40	
US TREASURY N/B	460,000.00	460,476.10	
US TREASURY N/B	260,000.00	244,786.10	
US TREASURY N/B	340,000.00	319,746.20	
US TREASURY N/B	250,000.00	238,276.25	
US TREASURY N/B	460,000.00	466,154.34	
US TREASURY N/B	340,000.00	332,901.14	
US TREASURY N/B	270,000.00	265,976.46	
US TREASURY N/B	290,000.00	285,531.10	
US TREASURY N/B	500,000.00	506,172.00	
US TREASURY N/B	240,000.00	234,478.08	



US TREASURY N/B	290,000.00	283,118.30	
US TREASURY N/B	290,000.00	280,863.84	
US TREASURY N/B	620,000.00	618,316.70	
US TREASURY N/B	330,000.00	319,345.95	
US TREASURY N/B	270,000.00	261,124.83	
US TREASURY N/B	270,000.00	262,970.55	
US TREASURY N/B	460,000.00	454,834.20	
US TREASURY N/B	400,000.00	383,546.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,873.00	
US TREASURY N/B	340,000.00	333,299.62	
US TREASURY N/B	390,000.00	382,146.57	
US TREASURY N/B	230,000.00	223,531.25	
US TREASURY N/B	630,000.00	606,190.41	
US TREASURY N/B	680,000.00	658,803.04	
US TREASURY N/B	500,000.00	479,277.50	
US TREASURY N/B	650,000.00	633,166.30	
US TREASURY N/B	730,000.00	676,875.71	
US TREASURY N/B	640,000.00	591,862.40	
US TREASURY N/B	570,000.00	520,214.49	
US TREASURY N/B	700,000.00	664,466.60	
US TREASURY N/B	630,000.00	609,672.42	
US TREASURY N/B	620,000.00	605,807.58	
US TREASURY N/B	650,000.00	627,859.70	
US TREASURY N/B	360,000.00	347,533.56	
US TREASURY N/B	150,000.00	189,184.50	
US TREASURY N/B	120,000.00	149,674.20	
US TREASURY N/B	70,000.00	96,183.01	
US TREASURY N/B	190,000.00	246,439.69	
US TREASURY N/B	200,000.00	249,730.40	
US TREASURY N/B	60,000.00	74,337.90	
US TREASURY N/B	50,000.00	63,017.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,521.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	245,105.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	126,714.80	
US TREASURY N/B	510,000.00	657,680.70	

US TREASURY N/B	130,000.00	162,398.47	
US TREASURY N/B	140,000.00	163,329.74	
US TREASURY N/B	130,000.00	159,925.35	
US TREASURY N/B	150,000.00	197,349.60	
US TREASURY N/B	130,000.00	163,015.45	
US TREASURY N/B	130,000.00	149,162.26	
US TREASURY N/B	130,000.00	135,149.17	
US TREASURY N/B	180,000.00	187,055.82	
US TREASURY N/B	110,000.00	111,914.22	
US TREASURY N/B	220,000.00	213,829.66	
US TREASURY N/B	220,000.00	213,649.26	
US TREASURY N/B	290,000.00	300,818.45	
US TREASURY N/B	420,000.00	416,513.58	
US TREASURY N/B	360,000.00	405,689.04	
US TREASURY N/B	370,000.00	425,514.43	
US TREASURY N/B	440,000.00	496,254.88	
US TREASURY N/B	390,000.00	422,175.00	
US TREASURY N/B	370,000.00	383,542.74	
US TREASURY N/B	390,000.00	395,256.03	
US TREASURY N/B	430,000.00	395,146.35	
US TREASURY N/B	410,000.00	415,365.26	
US TREASURY N/B	380,000.00	375,754.64	
US TREASURY N/B	310,000.00	313,996.21	
US TREASURY N/B	380,000.00	348,263.92	
US TREASURY N/B	310,000.00	283,880.33	
US TREASURY N/B	380,000.00	329,590.72	
US TREASURY N/B	370,000.00	365,555.56	
US TREASURY N/B	370,000.00	374,675.69	
US TREASURY N/B	380,000.00	384,609.02	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,779.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,925.80	
	68,870,000.00	68,375,044.72	
	米ドル 小計	(7,487,067,396)	
カナダドル	GOV OF CANADA	160,000.00	158,196.80
	GOV OF CANADA	100,000.00	100,129.00

	GOV OF CANADA	140,000.00	138,362.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	123,246.00
	GOV OF CANADA	170,000.00	167,439.80
	GOV OF CANADA	180,000.00	179,969.40
	GOV OF CANADA	140,000.00	138,712.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	89,001.00
	GOV OF CANADA	220,000.00	218,578.80
	GOV OF CANADA	170,000.00	176,443.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	194,354.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	192,936.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	114,612.30
	GOV OF CANADA	120,000.00	114,966.00
	GOV OF CANADA	130,000.00	122,335.20
	GOV OF CANADA	110,000.00	113,361.60
	GOV OF CANADA	180,000.00	171,747.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	88,496.10
	GOV OF CANADA	90,000.00	87,292.80
	GOV OF CANADA	140,000.00	142,837.80
	GOV OF CANADA	130,000.00	130,373.10
	GOV OF CANADA	100,000.00	94,353.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	98,356.50
	GOV OF CANADA	60,000.00	88,890.60
	GOV OF CANADA	60,000.00	58,377.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	120,937.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	172,950.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	169,116.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	193,177.50
	GOV OF CANADA	150,000.00	183,654.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	151,494.00
	GOV OF CANADA	50,000.00	55,728.50
	カナダドル 小計	4,140,000.00	4,350,424.30 (385,969,643)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	1,820,000.00	1,744,724.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,860,000.00	2,900,526.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,760,000.00	2,690,944.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,990,000.00	1,926,121.00

	UNITED MEXICAN STATE	770,000.00	792,792.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,380,000.00	2,713,319.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,260,000.00	1,131,152.40
	UNITED MEXICAN STATE	1,630,000.00	1,631,026.90
	UNITED MEXICAN STATE	1,060,000.00	1,137,592.00
	UNITED MEXICAN STATE	950,000.00	963,737.00
	UNITED MEXICAN STATE	810,000.00	820,578.60
	UNITED MEXICAN STATE	1,010,000.00	1,246,380.40
	UNITED MEXICAN STATE	950,000.00	1,032,412.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,510,000.00	1,522,487.70
	UNITED MEXICAN STATE	450,000.00	466,326.90
	メキシコペソ 小計	22,210,000.00	22,720,122.20 (134,275,922)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	105,575.20
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	82,789.28
	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	91,238.67
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	132,806.64
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	170,456.70
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	69,544.92
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	80,192.00
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	93,214.08
	GOV OF AUSTRIA	50,000.00	49,623.30
	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	76,424.60
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	119,934.98
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	116,293.32
	GOV OF AUSTRIA	50,000.00	67,720.90
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	141,716.82
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	98,260.00
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	121,628.88
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	118,227.80
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	149,702.00
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	82,550.52
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	39,477.72
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	66,010.00
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	30,910.23

GOV OF AUSTRIA	20,000.00	16,951.84
GOV OF BELGIUM	110,000.00	115,900.40
GOV OF BELGIUM	120,000.00	127,105.80
GOV OF BELGIUM	190,000.00	211,083.73
GOV OF BELGIUM	160,000.00	186,453.44
GOV OF BELGIUM	140,000.00	164,443.02
GOV OF BELGIUM	150,000.00	180,226.05
GOV OF BELGIUM	140,000.00	156,427.18
GOV OF BELGIUM	50,000.00	50,070.70
GOV OF BELGIUM	150,000.00	172,281.90
GOV OF BELGIUM	70,000.00	70,739.41
GOV OF BELGIUM	130,000.00	133,503.63
GOV OF BELGIUM	100,000.00	132,448.00
GOV OF BELGIUM	110,000.00	113,847.58
GOV OF BELGIUM	130,000.00	130,919.36
GOV OF BELGIUM	140,000.00	205,855.30
GOV OF BELGIUM	220,000.00	217,368.58
GOV OF BELGIUM	60,000.00	83,182.32
GOV OF BELGIUM	80,000.00	100,842.64
GOV OF BELGIUM	170,000.00	269,869.90
GOV OF BELGIUM	20,000.00	20,116.68
GOV OF BELGIUM	80,000.00	86,440.80
GOV OF BELGIUM	150,000.00	231,615.00
GOV OF BELGIUM	90,000.00	132,445.44
GOV OF BELGIUM	90,000.00	87,305.85
GOV OF BELGIUM	20,000.00	21,812.60
GOV OF BELGIUM	20,000.00	20,925.40
GOV OF FINLAND	110,000.00	117,863.90
GOV OF FINLAND	110,000.00	112,216.50
GOV OF FINLAND	40,000.00	44,866.96
GOV OF FINLAND	30,000.00	30,109.83
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,637.04
GOV OF FINLAND	50,000.00	53,703.10
GOV OF FINLAND	40,000.00	39,652.32
GOV OF FINLAND	40,000.00	44,358.48

GOV OF FINLAND	110,000.00	113,737.69	
GOV OF FINLAND	60,000.00	59,988.36	
GOV OF FINLAND	40,000.00	39,235.00	
GOV OF FINLAND	30,000.00	36,081.63	
GOV OF FINLAND	70,000.00	68,026.63	
GOV OF FINLAND	40,000.00	51,725.24	
GOV OF FRANCE	170,000.00	171,095.65	
GOV OF FRANCE	210,000.00	222,700.59	
GOV OF FRANCE	250,000.00	255,232.00	
GOV OF FRANCE	320,000.00	344,215.68	
GOV OF FRANCE	370,000.00	376,984.49	
GOV OF FRANCE	170,000.00	171,649.00	
GOV OF FRANCE	220,000.00	239,654.14	
GOV OF FRANCE	290,000.00	292,924.94	
GOV OF FRANCE	290,000.00	312,952.63	
GOV OF FRANCE	470,000.00	477,697.19	
GOV OF FRANCE	380,000.00	429,914.52	
GOV OF FRANCE	230,000.00	231,769.39	
GOV OF FRANCE	350,000.00	395,330.60	
GOV OF FRANCE	400,000.00	452,780.00	
GOV OF FRANCE	260,000.00	260,588.90	
GOV OF FRANCE	320,000.00	354,248.00	
GOV OF FRANCE	160,000.00	159,224.00	
GOV OF FRANCE	400,000.00	435,374.00	
GOV OF FRANCE	430,000.00	531,480.86	
GOV OF FRANCE	280,000.00	315,369.32	
GOV OF FRANCE	380,000.00	416,561.70	
GOV OF FRANCE	320,000.00	322,321.28	
GOV OF FRANCE	290,000.00	414,298.93	
GOV OF FRANCE	230,000.00	239,299.82	
GOV OF FRANCE	290,000.00	360,823.22	
GOV OF FRANCE	350,000.00	348,559.40	
GOV OF FRANCE	260,000.00	251,598.10	
GOV OF FRANCE	270,000.00	276,909.30	
GOV OF FRANCE	390,000.00	463,436.22	

GOV OF FRANCE	100,000.00	98,886.60	
GOV OF FRANCE	300,000.00	448,444.50	
GOV OF FRANCE	290,000.00	339,767.77	
GOV OF FRANCE	320,000.00	335,324.80	
GOV OF FRANCE	320,000.00	520,809.28	
GOV OF FRANCE	260,000.00	400,583.04	
GOV OF FRANCE	250,000.00	243,670.50	
GOV OF FRANCE	250,000.00	365,614.50	
GOV OF FRANCE	120,000.00	125,496.00	
GOV OF FRANCE	250,000.00	396,324.50	
GOV OF FRANCE	240,000.00	322,105.92	
GOV OF FRANCE	120,000.00	126,016.56	
GOV OF FRANCE	140,000.00	220,645.32	
GOV OF FRANCE	130,000.00	210,103.40	
GOV OF FRANCE	70,000.00	66,005.24	
GOV OF GERMANY	150,000.00	156,342.75	
GOV OF GERMANY	180,000.00	183,281.04	
GOV OF GERMANY	100,000.00	100,765.70	
GOV OF GERMANY	170,000.00	172,414.34	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,381.50	
GOV OF GERMANY	180,000.00	190,884.60	
GOV OF GERMANY	140,000.00	141,449.28	
GOV OF GERMANY	190,000.00	192,869.00	
GOV OF GERMANY	70,000.00	70,790.72	
GOV OF GERMANY	200,000.00	215,130.60	
GOV OF GERMANY	230,000.00	232,847.40	
GOV OF GERMANY	230,000.00	249,943.99	
GOV OF GERMANY	160,000.00	171,613.28	
GOV OF GERMANY	100,000.00	102,011.10	
GOV OF GERMANY	190,000.00	206,654.64	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,914.60	
GOV OF GERMANY	190,000.00	213,816.50	
GOV OF GERMANY	160,000.00	175,002.88	
GOV OF GERMANY	190,000.00	192,102.54	
GOV OF GERMANY	200,000.00	217,964.60	

GOV OF GERMANY	170,000.00	171,538.50	
GOV OF GERMANY	220,000.00	239,115.80	
GOV OF GERMANY	190,000.00	204,624.49	
GOV OF GERMANY	170,000.00	170,996.37	
GOV OF GERMANY	180,000.00	194,399.82	
GOV OF GERMANY	180,000.00	194,653.80	
GOV OF GERMANY	230,000.00	255,427.88	
GOV OF GERMANY	190,000.00	209,206.91	
GOV OF GERMANY	210,000.00	228,313.05	
GOV OF GERMANY	190,000.00	200,591.74	
GOV OF GERMANY	240,000.00	244,839.60	
GOV OF GERMANY	230,000.00	242,675.76	
GOV OF GERMANY	270,000.00	273,712.50	
GOV OF GERMANY	260,000.00	251,400.50	
GOV OF GERMANY	240,000.00	235,576.80	
GOV OF GERMANY	110,000.00	170,932.52	
GOV OF GERMANY	260,000.00	259,385.62	
GOV OF GERMANY	140,000.00	208,924.66	
GOV OF GERMANY	130,000.00	184,515.63	
GOV OF GERMANY	60,000.00	98,300.64	
GOV OF GERMANY	200,000.00	316,924.00	
GOV OF GERMANY	170,000.00	269,022.62	
GOV OF GERMANY	220,000.00	332,520.32	
GOV OF GERMANY	150,000.00	240,467.10	
GOV OF GERMANY	150,000.00	258,355.95	
GOV OF GERMANY	130,000.00	187,034.12	
GOV OF GERMANY	230,000.00	294,708.20	
GOV OF GERMANY	190,000.00	245,488.36	
GOV OF GERMANY	30,000.00	29,403.06	
GOV OF IRELAND	70,000.00	74,829.65	
GOV OF IRELAND	50,000.00	55,555.00	
GOV OF IRELAND	90,000.00	100,035.00	
GOV OF IRELAND	80,000.00	91,886.72	
GOV OF IRELAND	60,000.00	62,173.80	
GOV OF IRELAND	40,000.00	39,846.52	



GOV OF IRELAND	70,000.00	83,609.05	
GOV OF IRELAND	80,000.00	95,084.64	
GOV OF IRELAND	120,000.00	161,237.52	
GOV OF IRELAND	90,000.00	92,168.28	
GOV OF IRELAND	80,000.00	91,479.44	
GOV OF IRELAND	40,000.00	40,887.08	
GOV OF IRELAND	80,000.00	83,747.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	210,626.40	
GOV OF ITALY	150,000.00	150,778.50	
GOV OF ITALY	260,000.00	269,317.88	
GOV OF ITALY	150,000.00	154,044.75	
GOV OF ITALY	330,000.00	353,823.03	
GOV OF ITALY	150,000.00	150,703.50	
GOV OF ITALY	140,000.00	143,190.04	
GOV OF ITALY	210,000.00	229,762.89	
GOV OF ITALY	100,000.00	109,249.10	
GOV OF ITALY	230,000.00	234,021.32	
GOV OF ITALY	160,000.00	161,435.52	
GOV OF ITALY	230,000.00	253,808.68	
GOV OF ITALY	80,000.00	80,303.36	
GOV OF ITALY	220,000.00	223,627.36	
GOV OF ITALY	210,000.00	233,376.36	
GOV OF ITALY	170,000.00	189,640.44	
GOV OF ITALY	130,000.00	131,072.50	
GOV OF ITALY	250,000.00	280,440.00	
GOV OF ITALY	120,000.00	139,081.80	
GOV OF ITALY	230,000.00	230,168.82	
GOV OF ITALY	270,000.00	288,240.12	
GOV OF ITALY	170,000.00	201,339.16	
GOV OF ITALY	180,000.00	185,140.80	
GOV OF ITALY	170,000.00	175,832.53	
GOV OF ITALY	130,000.00	131,644.63	
GOV OF ITALY	140,000.00	170,988.44	
GOV OF ITALY	210,000.00	217,770.42	
GOV OF ITALY	190,000.00	233,050.39	

GOV OF ITALY	270,000.00	272,106.27	
GOV OF ITALY	150,000.00	178,432.50	
GOV OF ITALY	360,000.00	435,065.76	
GOV OF ITALY	100,000.00	98,293.70	
GOV OF ITALY	210,000.00	251,913.90	
GOV OF ITALY	130,000.00	135,379.14	
GOV OF ITALY	190,000.00	220,065.79	
GOV OF ITALY	90,000.00	90,788.85	
GOV OF ITALY	230,000.00	247,617.08	
GOV OF ITALY	210,000.00	261,311.82	
GOV OF ITALY	180,000.00	180,582.30	
GOV OF ITALY	220,000.00	226,781.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	256,124.82	
GOV OF ITALY	270,000.00	268,454.25	
GOV OF ITALY	200,000.00	192,021.60	
GOV OF ITALY	130,000.00	133,829.80	
GOV OF ITALY	170,000.00	172,234.99	
GOV OF ITALY	260,000.00	366,344.68	
GOV OF ITALY	220,000.00	276,532.30	
GOV OF ITALY	280,000.00	369,537.84	
GOV OF ITALY	270,000.00	305,830.08	
GOV OF ITALY	170,000.00	241,625.76	
GOV OF ITALY	250,000.00	229,783.00	
GOV OF ITALY	220,000.00	311,352.36	
GOV OF ITALY	100,000.00	99,593.50	
GOV OF ITALY	220,000.00	293,410.48	
GOV OF ITALY	160,000.00	151,430.24	
GOV OF ITALY	230,000.00	275,660.29	
GOV OF ITALY	200,000.00	270,109.60	
GOV OF ITALY	210,000.00	281,749.02	
GOV OF ITALY	170,000.00	224,330.81	
GOV OF ITALY	150,000.00	157,690.20	
GOV OF ITALY	120,000.00	112,933.68	
GOV OF ITALY	90,000.00	96,302.16	
GOV OF ITALY	50,000.00	44,960.35	

GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	152,719.50	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	170,927.68	
GOV OF NETHERLANDS	100,000.00	101,632.50	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	186,859.75	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	168,689.10	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	171,260.21	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	188,183.37	
GOV OF NETHERLANDS	100,000.00	118,888.50	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	196,707.78	
GOV OF NETHERLANDS	60,000.00	59,393.16	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	122,649.56	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	158,627.84	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	150,096.60	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	111,194.82	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	176,374.92	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	157,853.93	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	195,734.24	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	245,299.20	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	174,432.31	
GOV OF SPAIN	160,000.00	161,083.68	
GOV OF SPAIN	200,000.00	208,008.20	
GOV OF SPAIN	200,000.00	215,136.00	
GOV OF SPAIN	200,000.00	216,399.20	
GOV OF SPAIN	350,000.00	361,875.85	
GOV OF SPAIN	120,000.00	131,487.00	
GOV OF SPAIN	210,000.00	217,014.42	
GOV OF SPAIN	140,000.00	159,319.02	
GOV OF SPAIN	80,000.00	80,258.48	
GOV OF SPAIN	230,000.00	271,339.97	
GOV OF SPAIN	200,000.00	205,252.00	
GOV OF SPAIN	210,000.00	258,422.01	
GOV OF SPAIN	230,000.00	232,290.11	
GOV OF SPAIN	70,000.00	70,551.88	
GOV OF SPAIN	210,000.00	262,656.24	
GOV OF SPAIN	190,000.00	231,735.97	

	GOV OF SPAIN	170,000.00	212,385.42
	GOV OF SPAIN	160,000.00	190,823.68
	GOV OF SPAIN	250,000.00	283,061.75
	GOV OF SPAIN	180,000.00	189,539.28
	GOV OF SPAIN	210,000.00	267,078.84
	GOV OF SPAIN	210,000.00	228,031.44
	GOV OF SPAIN	180,000.00	192,208.32
	GOV OF SPAIN	190,000.00	263,860.79
	GOV OF SPAIN	200,000.00	202,337.20
	GOV OF SPAIN	180,000.00	183,777.30
	GOV OF SPAIN	200,000.00	201,602.00
	GOV OF SPAIN	160,000.00	217,768.64
	GOV OF SPAIN	230,000.00	334,445.53
	GOV OF SPAIN	160,000.00	164,196.80
	GOV OF SPAIN	210,000.00	315,228.69
	GOV OF SPAIN	70,000.00	73,185.00
	GOV OF SPAIN	190,000.00	251,310.53
	GOV OF SPAIN	150,000.00	217,617.15
	GOV OF SPAIN	160,000.00	227,725.28
	GOV OF SPAIN	120,000.00	181,945.92
	GOV OF SPAIN	120,000.00	128,166.24
	GOV OF SPAIN	90,000.00	102,794.76
	ユーロ 小計	48,380,000.00	55,322,357.59 (7,510,563,266)
英bond	UK TREASURY	170,000.00	177,426.45
	UK TREASURY	290,000.00	295,001.34
	UK TREASURY	130,000.00	136,605.56
	UK TREASURY	170,000.00	184,711.12
	UK TREASURY	250,000.00	258,162.50
	UK TREASURY	170,000.00	183,566.00
	UK TREASURY	280,000.00	286,186.60
	UK TREASURY	230,000.00	254,245.68
	UK TREASURY	80,000.00	90,242.80
	UK TREASURY	290,000.00	284,665.74
	UK TREASURY	250,000.00	259,302.50

	UK TREASURY	140,000.00	137,723.60
	UK TREASURY	160,000.00	170,632.00
	UK TREASURY	150,000.00	165,505.50
	UK TREASURY	180,000.00	226,938.96
	UK TREASURY	140,000.00	147,988.96
	UK TREASURY	200,000.00	203,021.20
	UK TREASURY	220,000.00	216,151.32
	UK TREASURY	120,000.00	151,297.44
	UK TREASURY	70,000.00	101,710.00
	UK TREASURY	120,000.00	163,729.92
	UK TREASURY	160,000.00	212,208.00
	UK TREASURY	240,000.00	334,097.28
	UK TREASURY	190,000.00	261,352.98
	UK TREASURY	80,000.00	78,288.48
	UK TREASURY	160,000.00	239,748.48
	UK TREASURY	120,000.00	170,259.60
	UK TREASURY	160,000.00	229,706.56
	UK TREASURY	190,000.00	287,420.22
	UK TREASURY	230,000.00	292,330.00
	UK TREASURY	200,000.00	266,400.00
	UK TREASURY	150,000.00	227,814.90
	UK TREASURY	200,000.00	182,438.00
	UK TREASURY	130,000.00	204,659.00
	UK TREASURY	170,000.00	254,541.00
	UK TREASURY	170,000.00	287,246.96
	UK TREASURY	50,000.00	50,222.50
	UK TREASURY	130,000.00	218,869.82
	UK TREASURY	180,000.00	228,421.80
	UK TREASURY	170,000.00	275,694.10
	英bond 小計	6,890,000.00	8,396,534.87 (1,308,264,098)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	730,000.00	771,704.17
	GOV OF SWEDEN	900,000.00	1,038,118.50
	GOV OF SWEDEN	880,000.00	1,015,124.00
	GOV OF SWEDEN	860,000.00	922,027.50
	GOV OF SWEDEN	620,000.00	710,830.00

	GOV OF SWEDEN	620,000.00	638,292.48
	GOV OF SWEDEN	290,000.00	286,985.16
	GOV OF SWEDEN	410,000.00	554,214.63
	スウェーデンクローナ 小計	5,310,000.00	5,937,296.44 (81,994,063)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	870,000.00	915,327.00
	GOV OF NORWAY	640,000.00	697,011.20
	GOV OF NORWAY	650,000.00	673,182.25
	GOV OF NORWAY	240,000.00	262,445.28
	GOV OF NORWAY	450,000.00	456,662.70
	GOV OF NORWAY	440,000.00	436,084.00
	GOV OF NORWAY	340,000.00	340,923.10
	ノルウェークローネ 小計	3,630,000.00	3,781,635.53 (53,396,693)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	860,000.00	931,182.20
	GOV OF DENMARK	200,000.00	203,577.60
	GOV OF DENMARK	880,000.00	988,438.00
	GOV OF DENMARK	580,000.00	627,359.32
	GOV OF DENMARK	990,000.00	1,097,316.00
	GOV OF DENMARK	430,000.00	425,606.26
	GOV OF DENMARK	1,250,000.00	2,080,067.50
	デンマーククローネ 小計	5,190,000.00	6,353,546.88 (115,825,159)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	340,000.00	348,731.20
	GOV OF POLAND	160,000.00	170,834.56
	GOV OF POLAND	320,000.00	318,624.00
	GOV OF POLAND	200,000.00	217,776.00
	GOV OF POLAND	120,000.00	119,556.00
	GOV OF POLAND	350,000.00	344,820.00
	GOV OF POLAND	180,000.00	202,644.00
	GOV OF POLAND	200,000.00	198,520.00
	GOV OF POLAND	310,000.00	353,400.00
	GOV OF POLAND	260,000.00	276,653.00
	GOV OF POLAND	280,000.00	282,814.00
	GOV OF POLAND	280,000.00	264,810.00

	GOV OF POLAND	310,000.00	289,481.72
	GOV OF POLAND	80,000.00	99,007.20
	ポーランドズロチ 小計	3,390,000.00	3,487,671.68 (113,942,233)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	176,534.46
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	233,202.52
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	252,473.76
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	266,681.16
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	344,178.43
	GOV OF AUSTRALIA	120,000.00	118,433.16
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	251,235.16
	GOV OF AUSTRALIA	60,000.00	59,435.82
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	263,859.91
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	242,148.00
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	280,002.15
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	322,116.34
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	301,375.36
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	268,805.79
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	227,704.08
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	198,201.20
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	197,071.23
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	153,220.08
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	66,199.98
	GOV OF AUSTRALIA	90,000.00	97,025.58
GOV OF AUSTRALIA	60,000.00	59,771.10	
GOV OF AUSTRALIA	100,000.00	92,007.20	
	オーストラリアドル 小計	4,260,000.00	4,471,682.47 (394,849,562)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,055.25
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	70,217.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,327.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	31,275.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	61,116.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,502.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,005.85
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,925.00

	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	31,275.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,460.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,575.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	40,120.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	55,658.75	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,540.00	
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	21,240.00	
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	22,559.20	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,242.80	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	31,155.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,844.00	
	シンガポールドル 小計	790,000.00	816,092.85 (68,306,971)	
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,714.70	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	275,535.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,363.70	
	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	110,858.00	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	122,446.20	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	223,253.80	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,500.00	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,575.28	
	GOV OF MALAYSIA	50,000.00	49,321.35	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,363.00	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	157,492.32	
	GOV OF MALAYSIA	30,000.00	29,915.10	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,302.40	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,746.50	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	249,688.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,950.00	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	177,984.00	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	119,597.40	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	155,423.20	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	170,991.10	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	147,000.00	
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	84,059.19	



	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	67,227.72	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	80,906.56	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	78,302.96	
	マレーシアリングット 小計	3,150,000.00	3,147,517.48 (88,319,340)	
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	480,000.00	482,764.80	
	GOV OF SOUTH AFRICA	540,000.00	532,359.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	580,000.00	582,868.68	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,740,000.00	1,971,009.36	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,030,000.00	966,354.24	
	GOV OF SOUTH AFRICA	890,000.00	760,344.80	
	GOV OF SOUTH AFRICA	790,000.00	740,583.92	
	GOV OF SOUTH AFRICA	640,000.00	617,066.24	
	GOV OF SOUTH AFRICA	730,000.00	539,302.10	
	GOV OF SOUTH AFRICA	960,000.00	887,428.80	
	GOV OF SOUTH AFRICA	550,000.00	526,583.75	
	GOV OF SOUTH AFRICA	800,000.00	581,640.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,100,000.00	1,023,844.80	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,570,000.00	1,460,728.00	
	南アフリカランド 小計	12,400,000.00	11,672,878.49 (107,623,939)	
	合計		17,850,398,285 (17,850,398,285)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 198銘柄	100.0%	41.9%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 289銘柄	100.0%	42.1%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	7.3%

スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	25銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,370,148
コール・ローン	3,594,637
投資信託受益証券	1,677,245,688
流動資産合計	1,684,210,473
資産合計	1,684,210,473
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,835
未払金	5,869,685
未払利息	9
流動負債合計	5,881,529
負債合計	5,881,529
純資産の部	
元本等	
元本	1,416,556,538

平成30年 1月25日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	261,772,406
元本等合計	1,678,328,944
純資産合計	1,678,328,944
負債純資産合計	1,684,210,473

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

(貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	694,594,908円
期中追加設定元本額	1,019,886,088円
期中一部解約元本額	297,924,458円
期末元本額	1,416,556,538円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	379,366,493円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	221,239,888円
りそなラップ型ファンド(成長型)	88,268,026円
DCりそな グローバルバランス	1,921,493円
つみたてバランスファンド	953,171円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	724,698,287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）	109,180円
2. 計算日における受益権の総数	1,416,556,538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	1.1848円
(10,000口当たり純資産額)	(11,848円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		117,959,944
合計		117,959,944

(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)

（平成30年 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,891,422	-	2,879,587	11,835
	米ドル	2,891,422	-	2,879,587	11,835
	合計	2,891,422	-	2,879,587	11,835

## （注）時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	772,821	15,317,312.22	
		米ドル 小計	772,821	15,317,312.22 (1,677,245,688)	
合計				1,677,245,688 (1,677,245,688)	

(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	1銘柄	100.0%	100.0%
-----	----------	-----	--------	--------

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	374,894,244
株式	15,872,387,875
派生商品評価勘定	221,028
未収入金	745,260
未収配当金	16,264,457
差入委託証拠金	7,812,000
流動資産合計	16,272,324,864
資産合計	
16,272,324,864	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	709,572
前受金	1,705,500
未払金	101,143,012
未払解約金	42,000
未払利息	1,016
流動負債合計	103,601,100
負債合計	
103,601,100	
純資産の部	
元本等	
元本	12,835,574,668
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,333,149,096
元本等合計	16,168,723,764
純資産合計	
16,168,723,764	
負債純資産合計	
16,272,324,864	

### 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）

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	5,648,897,513円
期中追加設定元本額	12,597,845,319円
期中一部解約元本額	5,411,168,164円
期末元本額	12,835,574,668円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,796,268,564円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,640,045,805円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,311,033,478円
DCりそな グローバルバランス	14,502,398円
つみたてバランスファンド	5,472,835円
FWりそな国内株式インデックスファンド	7,064,926,525円
Smart-i TOPIXインデックス	2,506,776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）	818,287円
2. 計算日における受益権の総数	12,835,574,668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	1.2597円
(10,000口当たり純資産額)	(12,597円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項



平成30年 1月25日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,940,311,956
合計		1,940,311,956

(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)

(平成30年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	317,252,544	-	316,764,000	488,544
合計		317,252,544	-	316,764,000	488,544

(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	300	4,280.00	1,284,000	

日本水産	7,400	591.00	4,373,400	
マルハニチロ	1,300	3,280.00	4,264,000	
カネコ種苗	200	1,697.00	339,400	
サカタのタネ	1,000	3,900.00	3,900,000	
ホクト	700	2,066.00	1,446,200	
ホクリヨウ	100	1,613.00	161,300	
住石ホールディングス	1,700	196.00	333,200	
日鉄鉱業	200	8,120.00	1,624,000	
三井松島産業	300	1,581.00	474,300	
国際石油開発帝石	32,100	1,523.00	48,888,300	
日本海洋掘削	200	3,435.00	687,000	
石油資源開発	1,000	3,270.00	3,270,000	
K & O エナジーグループ	400	1,849.00	739,600	
ショーボンドホールディングス	600	8,610.00	5,166,000	
ミライト・ホールディングス	2,000	1,640.00	3,280,000	
タマホーム	500	1,155.00	577,500	
サンヨーホームズ	100	969.00	96,900	
ファーストコーポレーション	100	1,670.00	167,000	
ベステラ	100	2,109.00	210,900	
インベスターズクラウド	600	1,792.00	1,075,200	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,308.00	130,800	
安藤・間	5,100	927.00	4,727,700	
東急建設	2,500	1,155.00	2,887,500	
コムシスホールディングス	2,300	3,120.00	7,176,000	
ミサワホーム	500	988.00	494,000	
ピーアールホールディングス	500	512.00	256,000	
高松コンストラクショングループ	400	3,160.00	1,264,000	
東建コーポレーション	200	13,450.00	2,690,000	
ソネック	100	830.00	83,000	
ヤマウラ	300	949.00	284,700	
大成建設	6,600	5,740.00	37,884,000	
大林組	19,800	1,390.00	27,522,000	
清水建設	20,200	1,171.00	23,654,200	
飛島建設	6,000	183.00	1,098,000	
長谷工コーポレーション	7,700	1,843.00	14,191,100	
松井建設	700	957.00	669,900	

銭高組	100	6,540.00	654,000
鹿島建設	29,000	1,136.00	32,944,000
不動テトラ	5,000	186.00	930,000
大末建設	200	1,116.00	223,200
鉄建建設	400	3,295.00	1,318,000
西松建設	1,600	3,170.00	5,072,000
三井住友建設	4,700	633.00	2,975,100
大豊建設	2,000	557.00	1,114,000
前田建設工業	4,700	1,559.00	7,327,300
佐田建設	300	461.00	138,300
ナカノフドー建設	400	691.00	276,400
奥村組	1,100	4,790.00	5,269,000
東鉄工業	800	3,640.00	2,912,000
イチケン	100	2,432.00	243,200
浅沼組	2,000	400.00	800,000
戸田建設	8,000	884.00	7,072,000
熊谷組	1,000	3,140.00	3,140,000
青木あすなる建設	400	1,026.00	410,400
北野建設	1,000	419.00	419,000
植木組	100	2,774.00	277,400
三井ホーム	1,000	778.00	778,000
矢作建設工業	800	918.00	734,400
ピーエス三菱	700	958.00	670,600
日本ハウスホールディングス	1,200	705.00	846,000
大東建託	2,400	20,560.00	49,344,000
新日本建設	800	1,037.00	829,600
N I P P O	2,000	2,517.00	5,034,000
東亜道路工業	100	4,420.00	442,000
前田道路	2,000	2,510.00	5,020,000
日本道路	200	6,060.00	1,212,000
東亜建設工業	600	3,075.00	1,845,000
若築建設	400	1,734.00	693,600
東洋建設	2,100	639.00	1,341,900
五洋建設	7,800	876.00	6,832,800
世紀東急工業	800	646.00	516,800
福田組	200	6,700.00	1,340,000

住友林業	4,200	1,983.00	8,328,600	
日本基礎技術	600	412.00	247,200	
日成ビルド工業	1,000	1,406.00	1,406,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	85.00	255,000	
巴コーポレーション	700	612.00	428,400	
大和ハウス工業	19,600	4,574.00	89,650,400	
ライト工業	1,300	1,285.00	1,670,500	
積水ハウス	21,500	2,156.50	46,364,750	
日特建設	500	699.00	349,500	
北陸電気工事	300	1,150.00	345,000	
ユアテック	1,000	897.00	897,000	
西部電気工業	100	2,959.00	295,900	
四電工	100	2,864.00	286,400	
中電工	900	3,210.00	2,889,000	
関電工	2,600	1,215.00	3,159,000	
きんでん	4,400	1,879.00	8,267,600	
東京エネシス	700	1,265.00	885,500	
トーエネック	200	3,340.00	668,000	
住友電設	500	2,326.00	1,163,000	
日本電設工業	1,000	2,461.00	2,461,000	
協和エクシオ	2,400	2,883.00	6,919,200	
新日本空調	500	1,554.00	777,000	
N D S	100	4,125.00	412,500	
九電工	1,300	5,670.00	7,371,000	
三機工業	1,400	1,266.00	1,772,400	
日揮	5,700	2,389.00	13,617,300	
中外炉工業	200	2,640.00	528,000	
ヤマト	500	843.00	421,500	
太平電業	400	2,733.00	1,093,200	
高砂熱学工業	1,800	2,108.00	3,794,400	
三晃金属工業	100	4,175.00	417,500	
朝日工業社	100	3,440.00	344,000	
明星工業	1,100	828.00	910,800	
大気社	900	3,835.00	3,451,500	
ダイダン	400	2,807.00	1,122,800	
日比谷総合設備	800	2,377.00	1,901,600	

東芝プラントシステム	1,400	2,073.00	2,902,200	
OSJBホールディングス	2,900	320.00	928,000	
東洋エンジニアリング	800	1,315.00	1,052,000	
千代田化工建設	4,300	946.00	4,067,800	
新興プランテック	1,200	1,146.00	1,375,200	
日本製粉	2,000	1,727.00	3,454,000	
日清製粉グループ本社	7,200	2,221.00	15,991,200	
日東富士製粉	100	4,995.00	499,500	
昭和産業	500	2,886.00	1,443,000	
鳥越製粉	500	994.00	497,000	
中部飼料	700	2,391.00	1,673,700	
フィード・ワン	4,000	261.00	1,044,000	
東洋精糖	100	1,217.00	121,700	
日本甜菜製糖	300	2,748.00	824,400	
三井製糖	500	4,775.00	2,387,500	
塩水港精糖	600	271.00	162,600	
日新製糖	300	2,213.00	663,900	
森永製菓	1,400	5,850.00	8,190,000	
中村屋	200	4,990.00	998,000	
江崎グリコ	1,700	5,620.00	9,554,000	
名糖産業	300	1,535.00	460,500	
不二家	400	2,579.00	1,031,600	
山崎製パン	4,800	2,211.00	10,612,800	
第一屋製パン	100	1,205.00	120,500	
モロゾフ	100	7,500.00	750,000	
亀田製菓	400	5,450.00	2,180,000	
寿スピリッツ	600	6,500.00	3,900,000	
カルビー	2,700	3,860.00	10,422,000	
森永乳業	1,200	5,240.00	6,288,000	
六甲バター	300	2,925.00	877,500	
ヤクルト本社	3,500	8,870.00	31,045,000	
明治ホールディングス	3,900	9,360.00	36,504,000	
雪印メグミルク	1,400	3,260.00	4,564,000	
プリマハム	4,000	744.00	2,976,000	
日本ハム	5,000	2,636.00	13,180,000	
林兼産業	200	887.00	177,400	

丸大食品	3,000	502.00	1,506,000	
S Foods	400	4,750.00	1,900,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	3,800	1,017.00	3,864,600	
サッポロホールディングス	2,200	3,365.00	7,403,000	
アサヒグループホールディングス	12,400	5,772.00	71,572,800	
キリンホールディングス	28,400	2,830.00	80,372,000	
宝ホールディングス	4,800	1,406.00	6,748,800	
オエノンホールディングス	1,700	377.00	640,900	
養命酒製造	200	2,606.00	521,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	4,200	4,230.00	17,766,000	
サントリー食品インターナショナル	4,500	5,270.00	23,715,000	
ダイドーグループホールディングス	300	6,120.00	1,836,000	
伊藤園	2,000	4,600.00	9,200,000	
キーコーヒー	600	2,180.00	1,308,000	
ユニカフェ	200	1,223.00	244,600	
ジャパンフーズ	100	1,594.00	159,400	
日清オイリオグループ	700	3,405.00	2,383,500	
不二製油グループ本社	1,600	3,320.00	5,312,000	
かどや製油	100	7,080.00	708,000	
J - オイルミルズ	300	3,930.00	1,179,000	
キッコーマン	4,600	4,485.00	20,631,000	
味の素	13,600	2,084.50	28,349,200	
キューピー	3,300	2,964.00	9,781,200	
ハウス食品グループ本社	2,300	3,660.00	8,418,000	
カゴメ	2,400	4,115.00	9,876,000	
焼津水産化学工業	300	1,231.00	369,300	
アリアケジャパン	500	9,290.00	4,645,000	
ピエトロ	100	1,663.00	166,300	
エバラ食品工業	100	2,168.00	216,800	
ニチレイ	2,800	2,981.00	8,346,800	
東洋水産	3,300	4,710.00	15,543,000	
イトアンド	200	2,314.00	462,800	
大冷	100	2,276.00	227,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	10,370.00	1,037,000	
日清食品ホールディングス	2,600	8,100.00	21,060,000	

永谷園ホールディングス	1,000	1,499.00	1,499,000	
一正蒲鉾	200	1,284.00	256,800	
フジッコ	600	2,550.00	1,530,000	
ロック・フィールド	600	2,272.00	1,363,200	
日本たばこ産業	36,600	3,673.00	134,431,800	
ケンコーマヨネーズ	400	4,110.00	1,644,000	
わらべや日洋ホールディングス	400	2,845.00	1,138,000	
なとり	300	2,049.00	614,700	
イフジ産業	100	799.00	79,900	
ピクルスコーポレーション	100	1,975.00	197,500	
北の達人コーポレーション	600	2,452.00	1,471,200	
ユーグレナ	2,300	1,101.00	2,532,300	
ミヨシ油脂	200	1,489.00	297,800	
理研ビタミン	200	4,370.00	874,000	
片倉工業	700	1,478.00	1,034,600	
グンゼ	500	6,620.00	3,310,000	
東洋紡	2,300	2,062.00	4,742,600	
ユニチカ	1,800	814.00	1,465,200	
富士紡ホールディングス	300	3,810.00	1,143,000	
倉敷紡績	6,000	365.00	2,190,000	
シキボウ	300	1,417.00	425,100	
日本毛織	1,700	1,177.00	2,000,900	
ダイトウボウ	1,000	125.00	125,000	
トーア紡コーポレーション	200	606.00	121,200	
ガイドーリミテッド	700	465.00	325,500	
帝国繊維	700	2,483.00	1,738,100	
帝人	5,000	2,471.00	12,355,000	
東レ	44,800	1,103.50	49,436,800	
サカイオーベックス	200	2,616.00	523,200	
住江織物	200	3,210.00	642,000	
日本フェルト	300	559.00	167,700	
イチカワ	1,000	404.00	404,000	
日東製網	100	1,867.00	186,700	
アツギ	400	1,305.00	522,000	
ダイニック	200	1,176.00	235,200	
セーレン	1,400	2,293.00	3,210,200	



ソトー	200	1,132.00	226,400	
東海染工	100	1,552.00	155,200	
小松精練	900	946.00	851,400	
ワコールホールディングス	1,700	3,490.00	5,933,000	
ホギメディカル	400	8,280.00	3,312,000	
レナウン	700	189.00	132,300	
クラウドシアホールディングス	100	600.00	60,000	
T S Iホールディングス	2,300	776.00	1,784,800	
三陽商会	300	2,181.00	654,300	
ナイガイ	100	623.00	62,300	
オンワードホールディングス	3,700	926.00	3,426,200	
ルックホールディングス	1,000	391.00	391,000	
キムラタン	200	47.00	9,400	
ゴールドウイン	200	11,390.00	2,278,000	
デサント	1,400	1,958.00	2,741,200	
キング	200	636.00	127,200	
ヤマトインターナショナル	300	479.00	143,700	
特種東海製紙	300	4,350.00	1,305,000	
王子ホールディングス	26,000	775.00	20,150,000	
日本製紙	2,800	2,084.00	5,835,200	
三菱製紙	800	727.00	581,600	
北越紀州製紙	3,400	739.00	2,512,600	
中越パルプ工業	200	2,054.00	410,800	
巴川製紙所	1,000	325.00	325,000	
大王製紙	2,500	1,525.00	3,812,500	
阿波製紙	100	712.00	71,200	
レンゴー	5,900	899.00	5,304,100	
トーモク	400	2,252.00	900,800	
ザ・パック	400	3,930.00	1,572,000	
クラレ	10,400	2,058.00	21,403,200	
旭化成	38,500	1,472.50	56,691,250	
共和レザー	300	1,000.00	300,000	
昭和電工	4,100	5,180.00	21,238,000	
住友化学	45,000	832.00	37,440,000	
住友精化	300	5,920.00	1,776,000	
日産化学工業	3,600	4,520.00	16,272,000	

ラサ工業	200	2,622.00	524,400	
クレハ	500	7,900.00	3,950,000	
多木化学	100	5,630.00	563,000	
テイカ	500	3,240.00	1,620,000	
石原産業	1,100	2,082.00	2,290,200	
片倉コープアグリ	100	1,422.00	142,200	
日東エフシー	300	818.00	245,400	
日本曹達	4,000	771.00	3,084,000	
東ソー	8,900	2,485.00	22,116,500	
トクヤマ	1,800	3,560.00	6,408,000	
セントラル硝子	1,300	2,435.00	3,165,500	
東亜合成	3,600	1,419.00	5,108,400	
大阪ソーダ	600	2,833.00	1,699,800	
関東電化工業	1,500	1,294.00	1,941,000	
デンカ	2,300	4,415.00	10,154,500	
信越化学工業	10,300	12,510.00	128,853,000	
日本カーバイド工業	200	2,136.00	427,200	
堺化学工業	400	3,090.00	1,236,000	
エア・ウォーター	5,100	2,425.00	12,367,500	
大陽日酸	4,700	1,732.00	8,140,400	
日本化学工業	200	2,769.00	553,800	
東邦アセチレン	100	1,614.00	161,400	
日本パーカライズング	3,200	1,995.00	6,384,000	
高圧ガス工業	900	959.00	863,100	
チタン工業	100	3,315.00	331,500	
四国化成工業	900	1,843.00	1,658,700	
戸田工業	100	4,700.00	470,000	
ステラ ケミファ	300	3,785.00	1,135,500	
保土谷化学工業	200	6,260.00	1,252,000	
日本触媒	1,000	7,800.00	7,800,000	
大日精化工業	500	5,420.00	2,710,000	
カネカ	8,000	1,021.00	8,168,000	
三菱瓦斯化学	5,100	3,135.00	15,988,500	
三井化学	5,600	3,480.00	19,488,000	
J S R	6,200	2,288.00	14,185,600	
東京応化工業	1,100	5,110.00	5,621,000	

大阪有機化学工業	400	1,730.00	692,000	
三菱ケミカルホールディングス	41,300	1,202.00	49,642,600	
KHネオケム	1,000	2,949.00	2,949,000	
ダイセル	8,300	1,336.00	11,088,800	
住友ベークライト	5,000	968.00	4,840,000	
積水化学工業	12,800	2,257.00	28,889,600	
日本ゼオン	5,200	1,621.00	8,429,200	
アイカ工業	1,700	4,140.00	7,038,000	
宇部興産	3,100	3,285.00	10,183,500	
積水樹脂	1,000	2,367.00	2,367,000	
タキロンシーアイ	1,100	785.00	863,500	
旭有機材	400	2,027.00	810,800	
日立化成	3,000	2,927.00	8,781,000	
ニチバン	300	3,255.00	976,500	
リケンテクノス	1,200	623.00	747,600	
大倉工業	1,000	674.00	674,000	
積水化成品工業	800	1,425.00	1,140,000	
群栄化学工業	200	3,975.00	795,000	
タイガースポリマー	300	937.00	281,100	
ミライアル	200	2,413.00	482,600	
ダイキアクシス	200	1,512.00	302,400	
ダイキョーニシカワ	1,200	1,860.00	2,232,000	
竹本容器	100	2,413.00	241,300	
日本化薬	4,000	1,632.00	6,528,000	
カーリットホールディングス	600	1,332.00	799,200	
日本精化	500	1,161.00	580,500	
扶桑化学工業	500	3,210.00	1,605,000	
ADEKA	2,700	1,919.00	5,181,300	
日油	2,400	2,970.00	7,128,000	
新日本理化	700	300.00	210,000	
ハリマ化成グループ	400	920.00	368,000	
花王	14,500	7,686.00	111,447,000	
第一工業製薬	1,000	906.00	906,000	
日華化学	200	1,259.00	251,800	
ニイタカ	100	1,847.00	184,700	
三洋化成工業	400	5,640.00	2,256,000	

有機合成薬品工業	200	311.00	62,200
大日本塗料	700	1,784.00	1,248,800
日本ペイントホールディングス	4,800	3,870.00	18,576,000
関西ペイント	6,500	2,798.00	18,187,000
神東塗料	600	275.00	165,000
中国塗料	1,800	952.00	1,713,600
日本特殊塗料	400	2,352.00	940,800
藤倉化成	700	724.00	506,800
太陽ホールディングス	500	5,380.00	2,690,000
D I C	2,400	4,355.00	10,452,000
サカタインクス	1,300	1,860.00	2,418,000
東洋インキＳＣホールディングス	6,000	662.00	3,972,000
T & K T O K A	400	1,498.00	599,200
富士フイルムホールディングス	12,300	4,647.00	57,158,100
資生堂	11,000	5,816.00	63,976,000
ライオン	8,200	2,092.00	17,154,400
高砂香料工業	400	3,480.00	1,392,000
マンダム	1,100	3,810.00	4,191,000
ミルボン	800	3,825.00	3,060,000
ファンケル	1,400	3,380.00	4,732,000
コーセー	1,000	19,010.00	19,010,000
コタ	300	1,849.00	554,700
シーズ・ホールディングス	800	5,860.00	4,688,000
シーボン	100	3,850.00	385,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,500	4,450.00	11,125,000
ノエビアホールディングス	400	8,910.00	3,564,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,067.00	106,700
エステー	400	2,813.00	1,125,200
アグロ カネショウ	300	2,089.00	626,700
コニシ	1,000	2,064.00	2,064,000
長谷川香料	800	2,280.00	1,824,000
星光P M C	300	1,227.00	368,100
小林製薬	1,700	7,440.00	12,648,000
荒川化学工業	500	2,212.00	1,106,000
メック	400	2,363.00	945,200
日本高純度化学	200	2,705.00	541,000

タカラバイオ	1,500	1,830.00	2,745,000	
J C U	400	5,620.00	2,248,000	
新田ゼラチン	400	844.00	337,600	
O A Tアグリオ	100	2,843.00	284,300	
デクセリアルズ	1,500	1,515.00	2,272,500	
アース製薬	400	5,680.00	2,272,000	
北興化学工業	500	796.00	398,000	
大成ラミック	200	3,310.00	662,000	
クミアイ化学工業	2,700	717.00	1,935,900	
日本農薬	1,500	641.00	961,500	
アキレス	500	2,347.00	1,173,500	
有沢製作所	1,000	1,211.00	1,211,000	
日東電工	4,500	9,981.00	44,914,500	
レック	400	3,240.00	1,296,000	
きもと	800	316.00	252,800	
藤森工業	500	4,060.00	2,030,000	
前澤化成工業	400	1,230.00	492,000	
J S P	400	3,790.00	1,516,000	
エフピコ	500	5,870.00	2,935,000	
天馬	500	2,262.00	1,131,000	
信越ポリマー	1,200	1,330.00	1,596,000	
東リ	1,200	440.00	528,000	
ニフコ	1,100	7,690.00	8,459,000	
日本バルカー工業	500	3,255.00	1,627,500	
ユニ・チャーム	12,500	3,012.00	37,650,000	
協和発酵キリン	7,400	2,214.00	16,383,600	
武田薬品工業	21,700	6,545.00	142,026,500	
アステラス製薬	60,600	1,418.00	85,930,800	
大日本住友製薬	4,400	1,600.00	7,040,000	
塩野義製薬	8,400	6,237.00	52,390,800	
田辺三菱製薬	7,200	2,315.00	16,668,000	
わかもと製薬	1,000	285.00	285,000	
あすか製薬	700	2,100.00	1,470,000	
日本新薬	1,500	7,790.00	11,685,000	
バイオフェルミン製薬	100	3,090.00	309,000	
中外製薬	6,200	5,960.00	36,952,000	

科研製薬	1,100	5,900.00	6,490,000	
エーザイ	7,100	6,352.00	45,099,200	
ロート製薬	3,200	3,030.00	9,696,000	
小野薬品工業	13,900	2,708.00	37,641,200	
久光製薬	1,700	7,680.00	13,056,000	
持田製薬	400	8,500.00	3,400,000	
参天製薬	11,100	1,842.00	20,446,200	
扶桑薬品工業	200	2,919.00	583,800	
日本ケミファ	100	4,820.00	482,000	
ツムラ	2,100	3,760.00	7,896,000	
日医工	1,600	1,744.00	2,790,400	
キッセイ薬品工業	1,100	3,160.00	3,476,000	
生化学工業	1,100	1,713.00	1,884,300	
栄研化学	500	5,040.00	2,520,000	
日水製薬	200	1,530.00	306,000	
鳥居薬品	400	3,205.00	1,282,000	
JCRファーマ	400	5,530.00	2,212,000	
東和薬品	300	6,280.00	1,884,000	
富士製薬工業	200	4,210.00	842,000	
沢井製薬	1,200	5,010.00	6,012,000	
ゼリア新薬工業	1,300	2,247.00	2,921,100	
第一三共	16,900	3,512.00	59,352,800	
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	2,095.00	3,352,000	
大幸薬品	300	2,485.00	745,500	
ダイト	400	3,445.00	1,378,000	
大塚ホールディングス	12,300	4,909.00	60,380,700	
大正製薬ホールディングス	1,300	9,190.00	11,947,000	
ペプチドリーム	2,400	4,475.00	10,740,000	
日本コークス工業	5,000	130.00	650,000	
昭和シェル石油	5,500	1,625.00	8,937,500	
ニチレキ	700	1,367.00	956,900	
ユシロ化学工業	300	1,757.00	527,100	
ビーピー・カストロール	300	2,111.00	633,300	
富士石油	1,300	587.00	763,100	
MORESCO	200	2,096.00	419,200	
出光興産	5,000	4,375.00	21,875,000	

J X T Gホールディングス	94,000	770.50	72,427,000	
コスモエネルギーホールディングス	1,700	4,475.00	7,607,500	
横浜ゴム	3,400	2,816.00	9,574,400	
東洋ゴム工業	3,500	2,355.00	8,242,500	
ブリヂストン	20,900	5,449.00	113,884,100	
住友ゴム工業	6,100	2,177.00	13,280,135	
藤倉ゴム工業	500	922.00	461,000	
オカモト	2,000	1,232.00	2,464,000	
フコク	200	1,108.00	221,600	
ニッタ	600	4,690.00	2,814,000	
住友理工	1,100	1,287.00	1,415,700	
三ツ星ベルト	1,000	1,488.00	1,488,000	
バンドー化学	1,100	1,356.00	1,491,600	
日東紡績	900	3,305.00	2,974,500	
旭硝子	6,000	4,890.00	29,340,000	
日本板硝子	3,000	1,008.00	3,024,000	
石塚硝子	100	3,055.00	305,500	
日本山村硝子	3,000	189.00	567,000	
日本電気硝子	2,600	4,545.00	11,817,000	
オハラ	200	3,970.00	794,000	
住友大阪セメント	12,000	532.00	6,384,000	
太平洋セメント	3,700	4,860.00	17,982,000	
日本ヒューム	600	842.00	505,200	
日本コンクリート工業	1,300	502.00	652,600	
三谷セキサン	300	2,667.00	800,100	
アジアパイルホールディングス	700	716.00	501,200	
東海カーボン	5,300	1,608.00	8,522,400	
日本カーボン	300	5,220.00	1,566,000	
東洋炭素	400	3,740.00	1,496,000	
ノリタケカンパニーリミテド	300	5,870.00	1,761,000	
T O T O	4,500	6,350.00	28,575,000	
日本碍子	7,200	2,238.00	16,113,600	
日本特殊陶業	5,100	2,953.00	15,060,300	
ダントーホールディングス	1,000	151.00	151,000	
M A R U W A	200	8,150.00	1,630,000	
品川リフラクトリーズ	200	3,325.00	665,000	

黒崎播磨	100	4,835.00	483,500
ヨータイ	400	612.00	244,800
イソライト工業	300	1,206.00	361,800
東京窯業	700	447.00	312,900
ニッカトー	200	1,016.00	203,200
フジインコーポレーテッド	500	2,433.00	1,216,500
エーアンドエーマテリアル	100	1,399.00	139,900
ニチアス	3,000	1,534.00	4,602,000
ニチハ	900	4,955.00	4,459,500
新日鐵住金	26,100	2,877.50	75,102,750
神戸製鋼所	10,500	1,153.00	12,106,500
中山製鋼所	700	757.00	529,900
合同製鐵	300	2,249.00	674,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,700	2,667.00	41,871,900
日新製鋼	1,600	1,912.00	3,059,200
東京製鐵	3,100	962.00	2,982,200
共英製鋼	700	2,147.00	1,502,900
大和工業	1,300	3,325.00	4,322,500
東京鐵鋼	200	2,002.00	400,400
大阪製鐵	400	2,376.00	950,400
淀川製鋼所	900	3,360.00	3,024,000
東洋鋼鈹	1,400	486.00	680,400
丸一鋼管	2,100	3,305.00	6,940,500
モリ工業	200	3,800.00	760,000
大同特殊鋼	1,000	6,780.00	6,780,000
日本高周波鋼業	200	955.00	191,000
日本冶金工業	4,800	319.00	1,531,200
山陽特殊製鋼	700	2,826.00	1,978,200
愛知製鋼	300	4,445.00	1,333,500
日立金属	6,300	1,625.00	10,237,500
日本金属	200	2,782.00	556,400
大平洋金属	400	3,640.00	1,456,000
新日本電工	3,500	515.00	1,802,500
栗本鐵工所	300	2,555.00	766,500
虹技	100	2,203.00	220,300
日本鑄鉄管	1,000	185.00	185,000



三菱製鋼	400	2,806.00	1,122,400
日亜鋼業	700	376.00	263,200
日本精線	100	5,570.00	557,000
シンニッタン	400	841.00	336,400
新家工業	100	2,343.00	234,300
大紀アルミニウム工業所	900	893.00	803,700
日本軽金属ホールディングス	16,900	307.00	5,188,300
三井金属鉱業	1,600	6,400.00	10,240,000
東邦亜鉛	300	6,640.00	1,992,000
三菱マテリアル	3,800	4,080.00	15,504,000
住友金属鉱山	7,500	5,270.00	39,525,000
D O W Aホールディングス	1,500	4,665.00	6,997,500
古河機械金属	1,000	2,520.00	2,520,000
エス・サイエンス	1,800	90.00	162,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	2,987.00	1,792,200
東邦チタニウム	1,000	1,610.00	1,610,000
U A C J	900	2,926.00	2,633,400
古河電気工業	1,900	6,240.00	11,856,000
住友電気工業	21,800	1,902.50	41,474,500
フジクラ	7,000	1,137.00	7,959,000
昭和電線ホールディングス	700	965.00	675,500
東京特殊電線	100	2,955.00	295,500
タツタ電線	1,100	937.00	1,030,700
沖電線	100	3,625.00	362,500
カナレ電気	100	2,497.00	249,700
平河ヒューテック	300	1,386.00	415,800
リョービ	700	3,255.00	2,278,500
アーレスティ	700	917.00	641,900
アサヒホールディングス	1,000	2,241.00	2,241,000
稲葉製作所	300	1,431.00	429,300
宮地エンジニアリンググループ	200	2,748.00	549,600
トーカロ	400	5,560.00	2,224,000
アルファC o	200	2,253.00	450,600
S U M C O	5,400	3,125.00	16,875,000
川田テクノロジーズ	100	6,290.00	629,000
R S Technologies	100	7,140.00	714,000

東洋製罐グループホールディングス	4,000	1,794.00	7,176,000	
ホッカカンホールディングス	2,000	433.00	866,000	
コロナ	300	1,436.00	430,800	
横河ブリッジホールディングス	1,100	2,667.00	2,933,700	
駒井ハルテック	100	2,619.00	261,900	
高田機工	100	3,430.00	343,000	
三和ホールディングス	5,600	1,567.00	8,775,200	
文化シャッター	1,700	987.00	1,677,900	
三協立山	800	1,529.00	1,223,200	
アルインコ	400	1,279.00	511,600	
東洋シャッター	100	636.00	63,600	
LIXILグループ	8,600	3,220.00	27,692,000	
日本フィルコン	400	742.00	296,800	
ノーリツ	1,300	2,161.00	2,809,300	
長府製作所	700	2,581.00	1,806,700	
リンナイ	1,000	10,370.00	10,370,000	
ダイニチ工業	300	861.00	258,300	
日東精工	700	676.00	473,200	
三洋工業	100	2,231.00	223,100	
岡部	1,100	1,104.00	1,214,400	
ジーテクト	700	2,251.00	1,575,700	
中国工業	100	869.00	86,900	
東プレ	1,100	3,375.00	3,712,500	
高周波熱錬	1,100	1,218.00	1,339,800	
東京製綱	400	1,892.00	756,800	
サンコール	300	752.00	225,600	
モリテック スチール	300	1,158.00	347,400	
パイオラックス	900	3,310.00	2,979,000	
エイチワン	400	1,786.00	714,400	
日本発條	5,800	1,226.00	7,110,800	
中央発條	100	3,705.00	370,500	
アドバネクス	100	3,970.00	397,000	
立川ブラインド工業	300	1,519.00	455,700	
三益半導体工業	500	2,253.00	1,126,500	
日本ドライケミカル	100	2,571.00	257,100	
日本製鋼所	1,900	3,505.00	6,659,500	

三浦工業	2,500	3,185.00	7,962,500	
タクマ	2,000	1,473.00	2,946,000	
ツガミ	2,000	1,710.00	3,420,000	
オークマ	700	7,640.00	5,348,000	
東芝機械	3,000	889.00	2,667,000	
アマダホールディングス	9,000	1,641.00	14,769,000	
アイダエンジニアリング	1,500	1,531.00	2,296,500	
滝澤鉄工所	200	2,377.00	475,400	
富士機械製造	1,700	2,360.00	4,012,000	
牧野フライス製作所	3,000	1,214.00	3,642,000	
オーエスジー	2,700	2,840.00	7,668,000	
ダイジェット工業	100	2,000.00	200,000	
旭ダイヤモンド工業	1,700	1,372.00	2,332,400	
D M G 森精機	3,200	2,546.00	8,147,200	
ソディック	1,300	1,552.00	2,017,600	
ディスコ	800	26,330.00	21,064,000	
日東工器	400	3,015.00	1,206,000	
日進工具	200	3,060.00	612,000	
パンチ工業	500	1,442.00	721,000	
富士ダイス	200	1,157.00	231,400	
豊和工業	300	1,518.00	455,400	
O K K	200	1,383.00	276,600	
石川製作所	200	2,994.00	598,800	
東洋機械金属	400	982.00	392,800	
津田駒工業	2,000	304.00	608,000	
エンシュウ	2,000	206.00	412,000	
島精機製作所	700	7,810.00	5,467,000	
N C ホールディングス	100	817.00	81,700	
フリー	400	1,122.00	448,800	
ヤマシンフィルタ	800	1,488.00	1,190,400	
日阪製作所	800	1,154.00	923,200	
やまびこ	1,100	1,859.00	2,044,900	
平田機工	200	12,140.00	2,428,000	
ペガサスマシン製造	500	801.00	400,500	
ナプテスコ	3,200	5,050.00	16,160,000	
三井海洋開発	600	3,015.00	1,809,000	

レオン自動機	500	2,262.00	1,131,000	
S M C	1,900	54,550.00	103,645,000	
新川	500	1,641.00	820,500	
ホソカワミクロン	200	8,330.00	1,666,000	
ユニオンツール	300	4,375.00	1,312,500	
オイレス工業	800	2,284.00	1,827,200	
日精エー・エス・ビー機械	200	7,270.00	1,454,000	
サトーホールディングス	800	3,555.00	2,844,000	
技研製作所	300	2,950.00	885,000	
日本エアテック	200	948.00	189,600	
日精樹脂工業	500	1,756.00	878,000	
オカダアイヨン	200	2,126.00	425,200	
ワイエイシイホールディングス	200	1,133.00	226,600	
小松製作所	28,500	4,194.00	119,529,000	
住友重機械工業	3,400	4,945.00	16,813,000	
日立建機	2,800	4,340.00	12,152,000	
日工	200	2,528.00	505,600	
巴工業	300	2,037.00	611,100	
井関農機	600	2,840.00	1,704,000	
T O W A	500	2,307.00	1,153,500	
丸山製作所	100	2,053.00	205,300	
北川鉄工所	300	3,145.00	943,500	
ローツェ	300	2,740.00	822,000	
タカキタ	200	1,208.00	241,600	
クボタ	31,700	2,265.50	71,816,350	
荏原実業	200	1,936.00	387,200	
三菱化工機	200	2,348.00	469,600	
月島機械	1,200	1,407.00	1,688,400	
帝国電機製作所	400	1,503.00	601,200	
東京機械製作所	100	603.00	60,300	
新東工業	1,400	1,446.00	2,024,400	
澁谷工業	500	4,810.00	2,405,000	
アイチ コーポレーション	1,000	815.00	815,000	
小森コーポレーション	1,500	1,556.00	2,334,000	
鶴見製作所	500	2,123.00	1,061,500	
住友精密工業	1,000	417.00	417,000	

酒井重工業	100	4,165.00	416,500	
荏原製作所	2,400	4,605.00	11,052,000	
石井鐵工所	100	1,998.00	199,800	
西島製作所	600	1,173.00	703,800	
北越工業	600	1,203.00	721,800	
ダイキン工業	8,100	13,730.00	111,213,000	
オルガノ	200	3,735.00	747,000	
トーヨーカネツ	300	4,350.00	1,305,000	
栗田工業	3,200	3,690.00	11,808,000	
椿本チエイン	4,000	933.00	3,732,000	
大同工業	200	1,761.00	352,200	
木村化工機	400	586.00	234,400	
アネスト岩田	1,000	1,274.00	1,274,000	
ダイフク	3,000	7,410.00	22,230,000	
サムコ	200	1,362.00	272,400	
加藤製作所	300	3,295.00	988,500	
油研工業	100	2,858.00	285,800	
タダノ	2,800	1,885.00	5,278,000	
フジテック	1,900	1,513.00	2,874,700	
C K D	1,600	2,874.00	4,598,400	
キトー	500	1,819.00	909,500	
平和	1,800	2,128.00	3,830,400	
理想科学工業	600	2,089.00	1,253,400	
S A N K Y O	1,500	3,455.00	5,182,500	
日本金銭機械	500	1,179.00	589,500	
マースエンジニアリング	400	2,416.00	966,400	
福島工業	400	5,100.00	2,040,000	
オーイズミ	100	541.00	54,100	
ダイコク電機	300	1,762.00	528,600	
竹内製作所	1,000	2,799.00	2,799,000	
アマノ	1,800	3,040.00	5,472,000	
J U K I	900	1,946.00	1,751,400	
サンデンホールディングス	700	2,437.00	1,705,900	
蛇の目ミシン工業	500	845.00	422,500	
マックス	900	1,584.00	1,425,600	
グローリー	1,800	4,335.00	7,803,000	

新晃工業	600	2,147.00	1,288,200	
大和冷機工業	900	1,449.00	1,304,100	
セガサミーホールディングス	5,800	1,453.00	8,427,400	
日本ピストンリング	200	2,305.00	461,000	
リケン	300	6,200.00	1,860,000	
T P R	700	3,630.00	2,541,000	
ツバキ・ナカシマ	600	3,095.00	1,857,000	
ホシザキ	1,900	10,580.00	20,102,000	
大豊工業	500	1,679.00	839,500	
日本精工	12,100	1,832.00	22,167,200	
N T N	13,600	570.00	7,752,000	
ジェイテクト	6,300	1,969.00	12,404,700	
不二越	5,000	788.00	3,940,000	
日本トムソン	1,900	879.00	1,670,100	
T H K	3,700	4,575.00	16,927,500	
ユーシン精機	300	3,570.00	1,071,000	
前澤給装工業	200	1,996.00	399,200	
イーグル工業	700	2,181.00	1,526,700	
前澤工業	300	442.00	132,600	
日本ピラー工業	600	1,898.00	1,138,800	
キッツ	2,600	947.00	2,462,200	
マキタ	7,700	5,090.00	39,193,000	
日立造船	4,600	606.00	2,787,600	
三菱重工業	9,900	4,262.00	42,193,800	
I H I	4,500	3,845.00	17,302,500	
スター精密	900	2,265.00	2,038,500	
日清紡ホールディングス	3,600	1,570.00	5,652,000	
イビデン	3,600	1,706.00	6,141,600	
コニカミノルタ	13,800	1,094.00	15,097,200	
ブラザー工業	7,200	2,902.00	20,894,400	
ミネベアミツミ	10,900	2,477.00	26,999,300	
日立製作所	142,000	918.10	130,370,200	
三菱電機	59,000	2,049.50	120,920,500	
富士電機	18,000	894.00	16,092,000	
東洋電機製造	300	1,993.00	597,900	
安川電機	6,800	5,800.00	39,440,000	

シンフォニアテクノロジー	4,000	492.00	1,968,000	
明電舎	5,000	461.00	2,305,000	
オリジン電気	200	1,831.00	366,200	
山洋電気	300	9,110.00	2,733,000	
デンヨー	600	1,945.00	1,167,000	
東芝テック	4,000	689.00	2,756,000	
芝浦メカトロニクス	1,000	466.00	466,000	
マブチモーター	1,600	6,640.00	10,624,000	
日本電産	7,100	18,035.00	128,048,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	3,215.00	643,000	
東光高岳	300	1,940.00	582,000	
ダブル・スコープ	800	2,140.00	1,712,000	
宮越ホールディングス	200	713.00	142,600	
ダイヘン	3,000	1,072.00	3,216,000	
田淵電機	900	320.00	288,000	
ヤーマン	800	1,889.00	1,511,200	
JVCケンウッド	4,300	417.00	1,793,100	
ミマキエンジニアリング	500	1,209.00	604,500	
第一精工	300	3,155.00	946,500	
日新電機	1,400	1,316.00	1,842,400	
大崎電気工業	1,300	846.00	1,099,800	
オムロン	6,300	7,250.00	45,675,000	
日東工業	1,000	1,829.00	1,829,000	
I D E C	800	3,325.00	2,660,000	
不二電機工業	100	1,433.00	143,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	599.00	6,589,000	
サクサホールディングス	200	2,150.00	430,000	
メルコホールディングス	300	4,190.00	1,257,000	
テクノメディカ	200	1,958.00	391,600	
日本電気	7,600	3,160.00	24,016,000	
富士通	61,000	802.90	48,976,900	
沖電気工業	2,400	1,606.00	3,854,400	
岩崎通信機	200	849.00	169,800	
電気興業	400	3,190.00	1,276,000	
サンケン電気	3,000	811.00	2,433,000	
ナカヨ	100	2,202.00	220,200	

アイホン	300	2,008.00	602,400	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	1,298.00	3,894,000	
セイコーエプソン	8,800	2,695.00	23,716,000	
ワコム	4,500	640.00	2,880,000	
アルバック	1,000	7,640.00	7,640,000	
アクセル	200	831.00	166,200	
E I Z O	500	5,280.00	2,640,000	
ジャパンディスプレイ	12,000	239.00	2,868,000	
日本信号	1,600	1,159.00	1,854,400	
京三製作所	1,000	809.00	809,000	
能美防災	800	2,070.00	1,656,000	
ホーチキ	400	2,497.00	998,800	
エレコム	500	2,631.00	1,315,500	
パナソニック	67,400	1,679.00	113,164,600	
アンリツ	4,300	1,318.00	5,667,400	
富士通ゼネラル	1,800	2,355.00	4,239,000	
日立国際電気	800	3,115.00	2,492,000	
ソニー	39,400	5,249.00	206,810,600	
T D K	3,100	10,360.00	32,116,000	
帝国通信工業	200	1,346.00	269,200	
タムラ製作所	2,300	886.00	2,037,800	
アルプス電気	5,100	3,150.00	16,065,000	
池上通信機	2,000	180.00	360,000	
パイオニア	9,800	238.00	2,332,400	
日本電波工業	500	795.00	397,500	
鈴木	200	1,253.00	250,600	
日本トリム	100	5,720.00	572,000	
ローランド ディー . ジー .	300	3,195.00	958,500	
フォスター電機	700	2,762.00	1,933,400	
クラリオン	3,000	405.00	1,215,000	
S M K	2,000	623.00	1,246,000	
ヨコオ	400	2,135.00	854,000	
ティアック	3,000	46.00	138,000	
ホシデン	1,500	1,805.00	2,707,500	
ヒロセ電機	1,000	16,970.00	16,970,000	
日本航空電子工業	2,000	1,859.00	3,718,000	



TOA	600	1,432.00	859,200	
マクセルホールディングス	1,200	2,440.00	2,928,000	
古野電気	700	845.00	591,500	
ユニデンホールディングス	2,000	342.00	684,000	
アルパイン	1,400	2,288.00	3,203,200	
スミダコーポレーション	600	2,059.00	1,235,400	
アイコム	300	2,657.00	797,100	
リオン	300	2,506.00	751,800	
本多通信工業	400	1,418.00	567,200	
船井電機	500	838.00	419,000	
横河電機	5,900	2,224.00	13,121,600	
新電元工業	200	10,040.00	2,008,000	
アズビル	1,800	5,180.00	9,324,000	
東亜ディーケーケー	300	1,250.00	375,000	
日本光電工業	2,500	2,587.00	6,467,500	
チノー	200	1,802.00	360,400	
共和電業	600	468.00	280,800	
日本電子材料	300	629.00	188,700	
堀場製作所	1,200	7,250.00	8,700,000	
アドバンテスト	3,300	2,274.00	7,504,200	
小野測器	300	785.00	235,500	
エスベック	500	2,884.00	1,442,000	
キーエンス	2,900	69,890.00	202,681,000	
日置電機	300	3,395.00	1,018,500	
シスメックス	4,600	9,160.00	42,136,000	
日本マイクロニクス	1,000	1,230.00	1,230,000	
メガチップス	500	3,885.00	1,942,500	
OBARA GROUP	300	7,800.00	2,340,000	
澤藤電機	100	2,229.00	222,900	
コーセル	800	1,875.00	1,500,000	
イリソ電子工業	500	7,080.00	3,540,000	
新日本無線	300	993.00	297,900	
オブテックスグループ	500	7,000.00	3,500,000	
千代田インテグレ	300	2,605.00	781,500	
アイ・オー・データ機器	200	1,177.00	235,400	
レーザーテック	1,300	3,910.00	5,083,000	

スタンレー電気	4,500	4,570.00	20,565,000	
岩崎電気	200	1,688.00	337,600	
ウシオ電機	3,600	1,684.00	6,062,400	
岡谷電機産業	400	850.00	340,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	500	1,129.00	564,500	
日本セラミック	600	3,055.00	1,833,000	
遠藤照明	300	1,294.00	388,200	
古河電池	400	1,182.00	472,800	
双信電機	200	798.00	159,600	
山一電機	400	2,268.00	907,200	
図研	400	1,914.00	765,600	
日本電子	2,000	678.00	1,356,000	
カシオ計算機	4,700	1,688.00	7,933,600	
ファナック	5,600	30,470.00	170,632,000	
日本シイエムケイ	900	1,032.00	928,800	
エンプラス	300	4,950.00	1,485,000	
大真空	200	1,711.00	342,200	
ローム	2,600	12,360.00	32,136,000	
浜松ホトニクス	4,300	4,090.00	17,587,000	
三井ハイテック	700	2,075.00	1,452,500	
新光電気工業	2,200	938.00	2,063,600	
京セラ	9,700	7,432.00	72,090,400	
太陽誘電	2,600	1,885.00	4,901,000	
村田製作所	6,200	15,975.00	99,045,000	
ユーシン	800	738.00	590,400	
双葉電子工業	900	2,388.00	2,149,200	
北陸電気工業	200	1,835.00	367,000	
ニチコン	1,900	1,510.00	2,869,000	
日本ケミコン	500	3,710.00	1,855,000	
K O A	800	2,461.00	1,968,800	
市光工業	700	1,013.00	709,100	
小糸製作所	3,500	8,070.00	28,245,000	
ミツバ	1,100	1,615.00	1,776,500	
S C R E E Nホールディングス	1,100	9,920.00	10,912,000	
キヤノン電子	500	2,479.00	1,239,500	
キヤノン	31,800	4,296.00	136,612,800	

リコー	17,700	1,108.00	19,611,600	
MUTOHホールディングス	100	2,493.00	249,300	
東京エレクトロン	3,900	22,285.00	86,911,500	
トヨタ紡織	1,700	2,414.00	4,103,800	
芦森工業	100	2,942.00	294,200	
ユニプレス	1,200	3,035.00	3,642,000	
豊田自動織機	4,800	7,230.00	34,704,000	
モリタホールディングス	900	2,130.00	1,917,000	
三櫻工業	700	887.00	620,900	
デンソー	13,100	7,060.00	92,486,000	
東海理化電機製作所	1,600	2,394.00	3,830,400	
三井造船	2,100	1,972.00	4,141,200	
川崎重工業	4,600	4,500.00	20,700,000	
名村造船所	1,800	751.00	1,351,800	
サノヤスホールディングス	500	305.00	152,500	
日本車輛製造	2,000	350.00	700,000	
三菱ロジスネクスト	700	1,076.00	753,200	
近畿車輛	100	3,125.00	312,500	
日産自動車	69,500	1,169.00	81,245,500	
いすゞ自動車	17,100	1,882.50	32,190,750	
トヨタ自動車	71,700	7,594.00	544,489,800	
日野自動車	8,400	1,478.00	12,415,200	
三菱自動車工業	21,700	886.00	19,226,200	
エフテック	400	1,662.00	664,800	
レシップホールディングス	200	934.00	186,800	
GMB	100	2,149.00	214,900	
ファルテック	100	1,489.00	148,900	
武蔵精密工業	600	3,615.00	2,169,000	
日産車体	2,300	1,162.00	2,672,600	
新明和工業	2,500	1,059.00	2,647,500	
極東開発工業	1,100	1,933.00	2,126,300	
日信工業	1,200	2,169.00	2,602,800	
トピー工業	500	3,450.00	1,725,000	
ティラド	200	3,925.00	785,000	
曙ブレーキ工業	2,500	326.00	815,000	
タチエス	1,000	2,026.00	2,026,000	

N O K	3,200	2,628.00	8,409,600
フタバ産業	1,800	1,092.00	1,965,600
K Y B	600	6,920.00	4,152,000
大同メタル工業	700	1,134.00	793,800
プレス工業	3,100	690.00	2,139,000
ミクニ	700	820.00	574,000
太平洋工業	1,200	1,688.00	2,025,600
ケーヒン	1,400	2,323.00	3,252,200
河西工業	700	1,772.00	1,240,400
アイシン精機	4,900	6,530.00	31,997,000
マツダ	18,500	1,575.50	29,146,750
今仙電機製作所	500	1,330.00	665,000
本田技研工業	53,100	3,942.00	209,320,200
スズキ	11,700	6,409.00	74,985,300
S U B A R U	18,300	3,681.00	67,362,300
安永	300	2,928.00	878,400
ヤマハ発動機	8,300	3,710.00	30,793,000
ショーワ	1,500	1,411.00	2,116,500
T B K	600	562.00	337,200
エクセディ	700	3,430.00	2,401,000
豊田合成	2,200	2,929.00	6,443,800
愛三工業	1,000	1,320.00	1,320,000
盟和産業	100	1,403.00	140,300
ヨロズ	600	2,401.00	1,440,600
エフ・シー・シー	1,000	2,939.00	2,939,000
シマノ	2,400	16,010.00	38,424,000
テイ・エス テック	1,400	4,890.00	6,846,000
ジャムコ	300	2,891.00	867,300
テルモ	9,000	5,430.00	48,870,000
クリエートメディック	200	1,303.00	260,600
日機装	2,000	1,323.00	2,646,000
島津製作所	7,000	2,793.00	19,551,000
J M S	500	634.00	317,000
クボテック	100	582.00	58,200
長野計器	400	1,301.00	520,400
ブイ・テクノロジー	100	22,480.00	2,248,000

東京計器	400	1,399.00	559,600
愛知時計電機	100	4,745.00	474,500
インターアクション	200	1,039.00	207,800
オーバル	400	316.00	126,400
東京精密	1,100	4,790.00	5,269,000
マニー	700	3,835.00	2,684,500
ニコン	10,300	2,243.00	23,102,900
トプコン	3,200	2,685.00	8,592,000
オリンパス	8,800	4,245.00	37,356,000
理研計器	600	2,515.00	1,509,000
タムロン	500	2,425.00	1,212,500
H O Y A	12,000	5,700.00	68,400,000
シード	100	5,720.00	572,000
ノーリツ鋼機	600	2,779.00	1,667,400
エー・アンド・デイ	500	827.00	413,500
シチズン時計	7,000	863.00	6,041,000
リズム時計工業	200	2,323.00	464,600
大研医器	500	784.00	392,000
メニコン	800	3,180.00	2,544,000
松風	300	1,463.00	438,900
セイコーホールディングス	900	3,195.00	2,875,500
ニプロ	4,100	1,695.00	6,949,500
中本パックス	100	4,640.00	464,000
スノーピーク	200	1,498.00	299,600
パラマウントベッドホールディングス	600	5,650.00	3,390,000
トランザクション	200	1,214.00	242,800
S H O - B I	100	434.00	43,400
ニホンフラッシュ	300	2,775.00	832,500
前田工織	600	2,058.00	1,234,800
永大産業	1,000	581.00	581,000
アートネイチャー	600	769.00	461,400
バンダイナムコホールディングス	6,100	3,650.00	22,265,000
アイフィスジャパン	100	636.00	63,600
共立印刷	800	388.00	310,400
S H O E I	300	5,120.00	1,536,000
フランスベッドホールディングス	700	1,076.00	753,200

パイロットコーポレーション	1,000	5,630.00	5,630,000	
萩原工業	300	2,056.00	616,800	
トッパン・フォームズ	1,300	1,252.00	1,627,600	
フジシールインターナショナル	1,300	3,920.00	5,096,000	
タカラトミー	2,500	1,681.00	4,202,500	
廣濟堂	400	497.00	198,800	
A s - m e エステール	100	997.00	99,700	
アーク	1,300	153.00	198,900	
タカノ	200	1,148.00	229,600	
プロネクサス	500	1,516.00	758,000	
ホクシン	100	204.00	20,400	
ウッドワン	200	1,760.00	352,000	
大建工業	500	3,000.00	1,500,000	
凸版印刷	17,000	1,050.00	17,850,000	
大日本印刷	7,700	2,510.00	19,327,000	
図書印刷	400	1,013.00	405,200	
共同印刷	200	3,570.00	714,000	
N I S S H A	1,200	2,946.00	3,535,200	
光村印刷	100	2,427.00	242,700	
宝印刷	300	1,770.00	531,000	
アシックス	5,900	1,843.00	10,873,700	
ツツミ	200	2,210.00	442,000	
小松ウオール工業	200	2,459.00	491,800	
ヤマハ	4,000	4,635.00	18,540,000	
河合楽器製作所	200	3,265.00	653,000	
クリナップ	500	915.00	457,500	
ピジョン	3,600	4,435.00	15,966,000	
兼松サステック	100	2,242.00	224,200	
キングジム	500	1,009.00	504,500	
リンテック	1,400	3,170.00	4,438,000	
イトーキ	1,200	792.00	950,400	
任天堂	3,600	47,770.00	171,972,000	
三菱鉛筆	1,000	2,514.00	2,514,000	
タカラスタンダード	1,200	1,834.00	2,200,800	
コクヨ	2,800	2,091.00	5,854,800	
ナカバヤシ	500	729.00	364,500	

グロープライド	300	2,595.00	778,500	
岡村製作所	2,100	1,548.00	3,250,800	
美津濃	600	3,290.00	1,974,000	
東京電力ホールディングス	47,000	458.00	21,526,000	
中部電力	18,000	1,403.00	25,254,000	
関西電力	24,000	1,407.50	33,780,000	
中国電力	8,100	1,242.00	10,060,200	
北陸電力	5,700	920.00	5,244,000	
東北電力	13,800	1,474.00	20,341,200	
四国電力	5,300	1,261.00	6,683,300	
九州電力	13,000	1,220.00	15,860,000	
北海道電力	5,900	732.00	4,318,800	
沖縄電力	1,000	2,817.00	2,817,000	
電源開発	4,700	3,165.00	14,875,500	
エフオン	300	1,345.00	403,500	
イーレックス	900	1,084.00	975,600	
東京瓦斯	12,600	2,673.00	33,679,800	
大阪瓦斯	11,400	2,246.00	25,604,400	
東邦瓦斯	2,900	3,135.00	9,091,500	
北海道瓦斯	2,000	301.00	602,000	
広島ガス	1,100	378.00	415,800	
西部瓦斯	700	2,885.00	2,019,500	
静岡ガス	1,700	996.00	1,693,200	
メタウォーター	300	3,020.00	906,000	
SBSホールディングス	600	1,139.00	683,400	
東武鉄道	6,300	3,800.00	23,940,000	
相鉄ホールディングス	1,900	3,060.00	5,814,000	
東京急行電鉄	16,000	1,904.00	30,464,000	
京浜急行電鉄	8,100	2,245.00	18,184,500	
小田急電鉄	8,800	2,495.00	21,956,000	
京王電鉄	3,300	5,320.00	17,556,000	
京成電鉄	4,100	3,860.00	15,826,000	
富士急行	800	3,330.00	2,664,000	
新京成電鉄	200	2,180.00	436,000	
東日本旅客鉄道	10,600	11,505.00	121,953,000	
西日本旅客鉄道	5,300	8,614.00	45,654,200	

東海旅客鉄道	5,300	21,385.00	113,340,500	
西武ホールディングス	7,500	2,257.00	16,927,500	
鴻池運輸	800	2,052.00	1,641,600	
西日本鉄道	1,600	3,150.00	5,040,000	
ハマキョウレックス	400	3,300.00	1,320,000	
サカイ引越センター	300	6,140.00	1,842,000	
近鉄グループホールディングス	5,600	4,490.00	25,144,000	
阪急阪神ホールディングス	7,500	4,575.00	34,312,500	
南海電気鉄道	2,600	2,953.00	7,677,800	
京阪ホールディングス	2,500	3,565.00	8,912,500	
神戸電鉄	100	4,005.00	400,500	
名古屋鉄道	4,300	2,954.00	12,702,200	
山陽電気鉄道	400	2,828.00	1,131,200	
日本通運	2,200	7,710.00	16,962,000	
ヤマトホールディングス	9,800	2,653.50	26,004,300	
山九	1,400	4,825.00	6,755,000	
丸運	200	368.00	73,600	
丸全昭和運輸	2,000	517.00	1,034,000	
センコーグループホールディングス	3,300	797.00	2,630,100	
トナミホールディングス	100	5,700.00	570,000	
ニッコンホールディングス	2,100	3,045.00	6,394,500	
日本石油輸送	100	3,880.00	388,000	
福山通運	800	4,225.00	3,380,000	
セイノーホールディングス	4,200	1,855.00	7,791,000	
神奈川中央交通	200	3,700.00	740,000	
日立物流	1,200	2,941.00	3,529,200	
丸和運輸機関	300	3,760.00	1,128,000	
C & F ロジホールディングス	600	1,642.00	985,200	
九州旅客鉄道	4,700	3,610.00	16,967,000	
日本郵船	4,700	2,894.00	13,601,800	
商船三井	3,500	3,945.00	13,807,500	
川崎汽船	2,600	2,950.00	7,670,000	
N S ユナイテッド海運	300	2,677.00	803,100	
明治海運	500	455.00	227,500	
飯野海運	2,800	646.00	1,808,800	
共栄タンカー	100	2,156.00	215,600	



乾汽船	400	836.00	334,400	
日本航空	10,400	4,233.00	44,023,200	
A N Aホールディングス	11,000	4,579.00	50,369,000	
パスコ	1,000	347.00	347,000	
ランコム	200	8,300.00	1,660,000	
日新	500	3,070.00	1,535,000	
三菱倉庫	1,900	2,913.00	5,534,700	
三井倉庫ホールディングス	3,000	382.00	1,146,000	
住友倉庫	4,000	802.00	3,208,000	
澁澤倉庫	300	2,067.00	620,100	
東陽倉庫	800	341.00	272,800	
日本トランスシティ	1,000	507.00	507,000	
ケイヒン	100	1,717.00	171,700	
中央倉庫	300	1,197.00	359,100	
川西倉庫	100	2,312.00	231,200	
安田倉庫	500	999.00	499,500	
東洋埠頭	200	1,870.00	374,000	
宇徳	400	530.00	212,000	
上組	3,500	2,463.00	8,620,500	
サンリツ	100	891.00	89,100	
キムラユニティー	100	1,202.00	120,200	
キューソー流通システム	200	2,889.00	577,800	
近鉄エクスプレス	1,100	2,450.00	2,695,000	
東海運	200	431.00	86,200	
エーアイティー	400	1,290.00	516,000	
内外トランスライン	200	2,060.00	412,000	
日本コンセプト	100	1,409.00	140,900	
N E C ネットエスアイ	700	3,015.00	2,110,500	
システナ	500	3,770.00	1,885,000	
デジタルアーツ	300	4,570.00	1,371,000	
新日鉄住金ソリューションズ	900	3,165.00	2,848,500	
キューブシステム	300	846.00	253,800	
コア	200	1,473.00	294,600	
ソリトンシステムズ	200	1,733.00	346,600	
ソフトクリエイイトホールディングス	300	1,485.00	445,500	
T I S	1,900	4,015.00	7,628,500	

ネオス	100	442.00	44,200
電算システム	200	2,141.00	428,200
グリー	3,500	708.00	2,478,000
コーエーテクモホールディングス	1,000	2,480.00	2,480,000
三菱総合研究所	200	3,890.00	778,000
ボルテージ	100	1,068.00	106,800
電算	100	2,651.00	265,100
A G S	300	901.00	270,300
ファインデックス	400	771.00	308,400
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,243.00	224,300
ブレインパッド	100	1,922.00	192,200
K L a b	1,100	1,988.00	2,186,800
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	400	2,331.00	932,400
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,223.00	122,300
ネクソン	6,500	3,725.00	24,212,500
アイスタイル	1,300	1,148.00	1,492,400
エムアップ	200	1,274.00	254,800
エイチーム	400	2,802.00	1,120,800
テクノスジャパン	500	942.00	471,000
e n i s h	200	1,239.00	247,800
コロプラ	1,900	985.00	1,871,500
モバイルクリエイト	300	365.00	109,500
オルトプラス	300	1,054.00	316,200
ブロードリーフ	1,400	1,119.00	1,566,600
ハーツユナイテッドグループ	300	1,924.00	577,200
メディアドゥホールディングス	200	2,297.00	459,400
ブイキューブ	300	551.00	165,300
サイバーリンクス	100	1,353.00	135,300
ディー・エル・イー	100	481.00	48,100
フィックスターズ	100	6,530.00	653,000
VOYAGE GROUP	300	1,463.00	438,900
オブティム	100	2,705.00	270,500
セレス	200	2,029.00	405,800
ベリサーブ	100	3,900.00	390,000
ティーガイア	600	2,714.00	1,628,400

セック	100	3,150.00	315,000	
日本アジアグループ	500	514.00	257,000	
豆蔵ホールディングス	400	1,351.00	540,400	
テクマトリックス	300	2,162.00	648,600	
プロシップ	100	2,353.00	235,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,600	315.00	4,914,000	
GMOペイメントゲートウェイ	400	9,630.00	3,852,000	
ザッパラス	200	427.00	85,400	
システムリサーチ	100	2,177.00	217,700	
インターネットイニシアティブ	1,000	2,281.00	2,281,000	
さくらインターネット	600	886.00	531,600	
ヴィンクス	100	1,358.00	135,800	
GMOクラウド	100	2,394.00	239,400	
SRAホールディングス	300	3,945.00	1,183,500	
Minorityソリューションズ	100	1,494.00	149,400	
システムインテグレータ	100	1,190.00	119,000	
朝日ネット	400	540.00	216,000	
アドソル日進	200	1,314.00	262,800	
フリービット	400	1,050.00	420,000	
コムチュア	300	3,455.00	1,036,500	
サイバーコム	100	1,452.00	145,200	
メディカル・データ・ビジョン	200	2,367.00	473,400	
gumi	500	1,076.00	538,000	
ショーケース・ティービー	100	2,006.00	200,600	
モバイルファクトリー	100	1,498.00	149,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	3,315.00	331,500	
PCIホールディングス	100	3,815.00	381,500	
パイプドHD	100	1,237.00	123,700	
アイピーシー	100	1,498.00	149,800	
オープンドア	100	8,700.00	870,000	
アカツキ	100	6,990.00	699,000	
LINE	1,700	4,920.00	8,364,000	
シンクロ・フード	100	3,200.00	320,000	
オークネット	200	1,525.00	305,000	
AOI TYO Holdings	500	1,419.00	709,500	

マクロミル	800	2,752.00	2,201,600	
ソルクシーズ	200	1,439.00	287,800	
フェイス	200	1,347.00	269,400	
ハイマックス	100	1,974.00	197,400	
野村総合研究所	3,900	5,340.00	20,826,000	
サイバネットシステム	400	721.00	288,400	
C Eホールディングス	200	890.00	178,000	
日本システム技術	100	1,392.00	139,200	
インテージホールディングス	700	1,418.00	992,600	
東邦システムサイエンス	200	860.00	172,000	
ソースネクスト	400	1,591.00	636,400	
フォーカスシステムズ	300	914.00	274,200	
クレスコ	100	4,820.00	482,000	
フジ・メディア・ホールディングス	6,000	1,733.00	10,398,000	
オービック	1,800	8,680.00	15,624,000	
ジャストシステム	900	2,102.00	1,891,800	
T D Cソフト	200	1,322.00	264,400	
ヤフー	41,700	536.00	22,351,200	
トレンドマイクロ	2,800	6,070.00	16,996,000	
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,349.00	269,800	
日本オラクル	900	8,940.00	8,046,000	
アルファシステムズ	200	2,519.00	503,800	
フューチャー	800	1,163.00	930,400	
C A C Holdings	400	1,111.00	444,400	
ソフトバンク・テクノロジー	300	2,070.00	621,000	
トーセ	200	2,069.00	413,800	
オービックビジネスコンサルタント	300	6,290.00	1,887,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	4,920.00	6,396,000	
アイティフォー	700	967.00	676,900	
東計電算	100	3,200.00	320,000	
エクスネット	100	930.00	93,000	
大塚商会	1,700	9,360.00	15,912,000	
サイボウズ	700	617.00	431,900	
ソフトブレーン	400	431.00	172,400	
電通国際情報サービス	400	2,823.00	1,129,200	
デジタルガレージ	1,100	3,625.00	3,987,500	

EMシステムズ	200	2,538.00	507,600
ウェザーニューズ	200	3,375.00	675,000
C I J	400	726.00	290,400
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,821.00	182,100
日本エンタープライズ	600	241.00	144,600
WOWOW	300	3,275.00	982,500
スカラ	300	819.00	245,700
イマジカ・ロボット ホールディングス	500	1,285.00	642,500
ネットワンシステムズ	2,400	1,693.00	4,063,200
システムソフト	1,200	151.00	181,200
アルゴグラフィックス	300	3,595.00	1,078,500
マーベラス	1,000	1,064.00	1,064,000
エイベックス	1,100	1,559.00	1,714,900
日本ユニシス	1,600	2,374.00	3,798,400
兼松エレクトロニクス	400	3,490.00	1,396,000
東京放送ホールディングス	3,500	2,648.00	9,268,000
日本テレビホールディングス	5,300	1,909.00	10,117,700
朝日放送	500	913.00	456,500
テレビ朝日ホールディングス	1,600	2,246.00	3,593,600
スカパーJ S A Tホールディングス	4,400	512.00	2,252,800
テレビ東京ホールディングス	500	2,435.00	1,217,500
日本BS放送	200	1,451.00	290,200
ビジョン	200	3,245.00	649,000
USEN-NEXT HOLDINGS	100	1,095.00	109,500
ワイヤレスゲート	300	1,320.00	396,000
コネクシオ	400	2,440.00	976,000
日本通信	3,600	123.00	442,800
クロップス	100	1,084.00	108,400
日本電信電話	41,600	5,294.00	220,230,400
KDDI	52,100	2,811.50	146,479,150
光通信	700	16,200.00	11,340,000
NTTドコモ	42,800	2,749.50	117,678,600
エムティーアイ	700	659.00	461,300
GMOインターネット	2,100	2,029.00	4,260,900
アイドママーケティングコミュニケーション	100	728.00	72,800
カドカワ	1,700	1,407.00	2,391,900

学研ホールディングス	200	6,250.00	1,250,000	
ゼンリン	700	4,230.00	2,961,000	
昭文社	200	772.00	154,400	
インプレスホールディングス	100	206.00	20,600	
アイネット	300	1,751.00	525,300	
松竹	400	17,050.00	6,820,000	
東宝	3,800	3,775.00	14,345,000	
東映	200	11,600.00	2,320,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	17,900	1,332.00	23,842,800	
ピー・シー・エー	100	1,890.00	189,000	
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,713.00	171,300	
D T S	600	3,920.00	2,352,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,700	5,250.00	14,175,000	
シーイーシー	300	3,350.00	1,005,000	
カブコン	1,200	3,800.00	4,560,000	
アイ・エス・ピー	100	1,417.00	141,700	
ジャステック	300	1,380.00	414,000	
S C S K	1,300	5,140.00	6,682,000	
日本システムウエア	200	2,643.00	528,600	
アイネス	700	1,211.00	847,700	
T K C	600	4,110.00	2,466,000	
富士ソフト	800	3,765.00	3,012,000	
N S D	1,000	2,412.00	2,412,000	
コナミホールディングス	2,400	6,140.00	14,736,000	
福井コンピュータホールディングス	200	3,140.00	628,000	
J B C Cホールディングス	400	1,218.00	487,200	
ミロク情報サービス	500	3,440.00	1,720,000	
ソフトバンクグループ	26,200	9,281.00	243,162,200	
ハウスイ	100	1,197.00	119,700	
高千穂交易	200	1,218.00	243,600	
伊藤忠食品	100	6,590.00	659,000	
エレマテック	200	2,662.00	532,400	
J A L U X	100	3,025.00	302,500	
あらた	300	5,830.00	1,749,000	
トーメンデバイス	100	3,530.00	353,000	
東京エレクトロン デバイス	200	2,141.00	428,200	

フィールズ	400	1,223.00	489,200
双日	34,200	363.00	12,414,600
アルフレッサ ホールディングス	6,400	2,714.00	17,369,600
横浜冷凍	1,300	1,129.00	1,467,700
神栄	100	1,556.00	155,600
ラサ商事	200	1,020.00	204,000
ラクーン	300	766.00	229,800
アルコニックス	600	2,627.00	1,576,200
神戸物産	400	4,450.00	1,780,000
ペッパーフードサービス	300	4,805.00	1,441,500
あい ホールディングス	800	2,947.00	2,357,600
ディーブイエックス	200	1,393.00	278,600
ダイワボウホールディングス	500	4,860.00	2,430,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,100	2,511.00	2,762,100
ラクト・ジャパン	100	4,410.00	441,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	991.00	991,000
八洲電機	400	981.00	392,400
メディアスホールディングス	100	2,707.00	270,700
U K C ホールディングス	400	2,333.00	933,200
ジューテックホールディングス	100	1,348.00	134,800
大光	100	942.00	94,200
O C H I ホールディングス	200	1,511.00	302,200
T O K A I ホールディングス	3,100	1,027.00	3,183,700
大阪工機	100	1,202.00	120,200
三洋貿易	300	2,779.00	833,700
ビューティガレージ	100	2,125.00	212,500
ウイン・パートナーズ	400	1,542.00	616,800
ミタチ産業	100	1,921.00	192,100
シップヘルスケアホールディングス	1,200	3,625.00	4,350,000
明治電機工業	200	1,949.00	389,800
デリカフーズホールディングス	100	1,544.00	154,400
スターティア	200	1,162.00	232,400
コメダホールディングス	1,100	2,089.00	2,297,900
富士興産	300	641.00	192,300
協栄産業	100	2,237.00	223,700
小野建	500	2,005.00	1,002,500

佐島電機	400	1,212.00	484,800
エコートレーディング	100	790.00	79,000
伯東	400	1,969.00	787,600
コンドーテック	400	1,080.00	432,000
中山福	300	798.00	239,400
ナガイレーベン	800	2,856.00	2,284,800
三菱食品	700	3,260.00	2,282,000
松田産業	400	1,999.00	799,600
第一興商	900	5,920.00	5,328,000
メディパルホールディングス	5,800	2,182.00	12,655,600
S P K	100	3,250.00	325,000
萩原電気	200	3,840.00	768,000
アズワン	500	7,130.00	3,565,000
スズデン	200	1,851.00	370,200
尾家産業	200	1,428.00	285,600
シモジマ	300	1,228.00	368,400
ドウシシャ	600	2,659.00	1,595,400
小津産業	100	2,222.00	222,200
高速	300	1,350.00	405,000
たけびし	200	1,882.00	376,400
黒田電気	400	2,713.00	1,085,200
リックス	100	1,905.00	190,500
丸文	500	1,125.00	562,500
ハビネット	400	2,094.00	837,600
橋本総業ホールディングス	100	1,801.00	180,100
日本ライフライン	1,600	2,812.00	4,499,200
エクセル	300	2,767.00	830,100
マルカキカイ	200	2,481.00	496,200
I D O M	1,800	773.00	1,391,400
日本エム・ディ・エム	300	935.00	280,500
進和	400	2,519.00	1,007,600
エスケイジャパン	100	651.00	65,100
ダイトロン	300	2,342.00	702,600
シークス	400	5,060.00	2,024,000
田中商事	100	872.00	87,200
オーハシテクニカ	300	1,771.00	531,300



白銅	200	2,605.00	521,000
伊藤忠商事	42,600	2,229.50	94,976,700
丸紅	47,700	845.10	40,311,270
高島	100	2,361.00	236,100
長瀬産業	3,500	2,033.00	7,115,500
蝶理	400	2,016.00	806,400
豊田通商	6,500	4,605.00	29,932,500
三共生興	900	495.00	445,500
兼松	2,500	1,545.00	3,862,500
ツカモトコーポレーション	100	1,486.00	148,600
三井物産	49,300	1,961.50	96,701,950
日本紙パルプ商事	300	4,390.00	1,317,000
日立ハイテクノロジーズ	2,000	5,140.00	10,280,000
カメイ	800	1,889.00	1,511,200
東都水産	100	2,028.00	202,800
OUGホールディングス	100	2,671.00	267,100
スターゼン	200	5,690.00	1,138,000
山善	2,300	1,355.00	3,116,500
椿本興業	200	3,215.00	643,000
住友商事	36,600	1,963.00	71,845,800
内田洋行	300	3,375.00	1,012,500
三菱商事	40,800	3,207.00	130,845,600
第一実業	300	3,495.00	1,048,500
キヤノンマーケティングジャパン	1,700	2,978.00	5,062,600
西華産業	400	3,005.00	1,202,000
佐藤商事	500	1,297.00	648,500
菱洋エレクトロ	500	2,002.00	1,001,000
東京産業	500	580.00	290,000
ユアサ商事	600	4,000.00	2,400,000
神鋼商事	100	3,550.00	355,000
小林産業	200	376.00	75,200
阪和興業	1,100	5,420.00	5,962,000
正栄食品工業	300	4,555.00	1,366,500
カナデン	600	1,582.00	949,200
菱電商事	400	1,925.00	770,000
フルサト工業	300	1,896.00	568,800

岩谷産業	1,300	3,845.00	4,998,500	
すてきナイスグループ	200	1,555.00	311,000	
昭光通商	2,000	142.00	284,000	
ニチモウ	100	1,992.00	199,200	
極東貿易	1,000	503.00	503,000	
イワキ	1,000	520.00	520,000	
三愛石油	1,600	1,711.00	2,737,600	
稲畑産業	1,400	1,667.00	2,333,800	
G S Iクレオス	200	1,598.00	319,600	
明和産業	400	494.00	197,600	
ワキタ	1,200	1,350.00	1,620,000	
東邦ホールディングス	1,700	2,566.00	4,362,200	
サンゲツ	2,000	2,237.00	4,474,000	
ミツウロコグループホールディングス	800	846.00	676,800	
シナネンホールディングス	300	2,714.00	814,200	
伊藤忠エネクス	1,300	1,082.00	1,406,600	
サンリオ	1,600	1,896.00	3,033,600	
サンワテクノス	400	2,531.00	1,012,400	
リョーサン	700	4,370.00	3,059,000	
新光商事	600	2,142.00	1,285,200	
トーホー	300	2,732.00	819,600	
三信電気	500	2,065.00	1,032,500	
東陽テクニカ	600	1,007.00	604,200	
モスフードサービス	800	3,355.00	2,684,000	
加賀電子	500	3,005.00	1,502,500	
ソーダニッカ	500	639.00	319,500	
立花エレテック	400	2,148.00	859,200	
フォーバル	200	875.00	175,000	
P A L T A C	800	5,010.00	4,008,000	
三谷産業	500	469.00	234,500	
太平洋興発	200	1,058.00	211,600	
西本Wismettacホールディングス	100	4,640.00	464,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,586.00	158,600	
ヤマタネ	300	2,173.00	651,900	
丸紅建材リース	1,000	252.00	252,000	
日鉄住金物産	500	6,600.00	3,300,000	

泉州電業	200	3,295.00	659,000	
トラスコ中山	1,200	3,335.00	4,002,000	
オートバックスセブン	2,300	2,219.00	5,103,700	
モリト	400	1,027.00	410,800	
加藤産業	900	4,005.00	3,604,500	
イノテック	500	1,092.00	546,000	
イエローハット	600	3,360.00	2,016,000	
J Kホールディングス	500	965.00	482,500	
日伝	500	2,273.00	1,136,500	
北沢産業	600	296.00	177,600	
杉本商事	300	1,967.00	590,100	
因幡電機産業	800	5,230.00	4,184,000	
バイテックホールディングス	300	1,862.00	558,600	
ミスミグループ本社	6,700	3,555.00	23,818,500	
アルテック	300	367.00	110,100	
タキヒヨー	200	2,342.00	468,400	
蔵王産業	100	2,004.00	200,400	
スズケン	2,700	4,675.00	12,622,500	
ジェコス	400	1,347.00	538,800	
ルネサスイーストン	500	742.00	371,000	
ローソン	1,500	7,230.00	10,845,000	
サンエー	400	5,530.00	2,212,000	
カワチ薬品	400	2,626.00	1,050,400	
エービーシー・マート	1,100	7,140.00	7,854,000	
ハードオフコーポレーション	200	1,252.00	250,400	
アスクル	600	3,455.00	2,073,000	
ゲオホールディングス	1,100	2,200.00	2,420,000	
アダストリア	900	2,414.00	2,172,600	
ジーフット	300	804.00	241,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	100	759.00	75,900	
くらコーポレーション	300	6,600.00	1,980,000	
キャンドウ	300	1,780.00	534,000	
パルグループホールディングス	300	3,325.00	997,500	
エディオン	2,200	1,387.00	3,051,400	
サーラコーポレーション	900	705.00	634,500	
ワッツ	200	1,175.00	235,000	

ハローズ	200	2,570.00	514,000	
あみやき亭	100	5,360.00	536,000	
ひらまつ	700	597.00	417,900	
大黒天物産	100	5,010.00	501,000	
ハニーズホールディングス	500	1,157.00	578,500	
ファーマライズホールディングス	100	616.00	61,600	
アルペン	400	2,562.00	1,024,800	
クオール	600	2,123.00	1,273,800	
ジンズ	400	4,810.00	1,924,000	
ビックカメラ	3,300	1,666.00	5,497,800	
D C Mホールディングス	3,100	1,087.00	3,369,700	
Monotaro	2,100	3,835.00	8,053,500	
東京一番フーズ	100	731.00	73,100	
D Dホールディングス	100	4,245.00	424,500	
きちり	200	778.00	155,600	
アークランドサービスホールディングス	500	2,562.00	1,281,000	
J . フロント リテイリング	6,900	2,025.00	13,972,500	
ドトール・日レスホールディングス	1,000	2,634.00	2,634,000	
マツモトキヨシホールディングス	2,400	4,640.00	11,136,000	
ブロンコピリー	300	3,405.00	1,021,500	
スタートトゥデイ	5,700	3,210.00	18,297,000	
トレジャー・ファクトリー	100	979.00	97,900	
物語コーポレーション	200	10,440.00	2,088,000	
ココカラファイン	600	6,880.00	4,128,000	
三越伊勢丹ホールディングス	10,800	1,308.00	14,126,400	
H a m e e	200	2,076.00	415,200	
ウエルシアホールディングス	1,500	4,695.00	7,042,500	
クリエイトSDホールディングス	900	2,704.00	2,433,600	
丸善C H Iホールディングス	500	346.00	173,000	
ミサワ	100	516.00	51,600	
ティーライフ	100	1,358.00	135,800	
エー・ピーカンパニー	100	846.00	84,600	
チムニー	200	2,903.00	580,600	
シュッピン	300	1,489.00	446,700	
ネクステージ	600	919.00	551,400	
ジョイフル本田	900	3,555.00	3,199,500	

鳥貴族	200	3,470.00	694,000
麒麟堂ホールディングス	200	1,926.00	385,200
ホットランド	300	1,446.00	433,800
すかいらーく	3,600	1,590.00	5,724,000
綿半ホールディングス	200	4,095.00	819,000
ヨシックス	100	3,635.00	363,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,900	1,122.00	2,131,800
ブックオフコーポレーション	300	844.00	253,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	1,184.00	236,800
B E E N O S	100	1,951.00	195,100
あさひ	400	1,394.00	557,600
日本調剤	200	3,410.00	682,000
コスモス薬品	300	19,770.00	5,931,000
トーエル	300	1,079.00	323,700
一六堂	100	501.00	50,100
オンリー	100	978.00	97,800
セブン&アイ・ホールディングス	24,400	4,634.00	113,069,600
薬王堂	200	3,345.00	669,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,600	1,228.00	1,964,800
ツルハホールディングス	1,200	15,390.00	18,468,000
サンマルクホールディングス	400	3,120.00	1,248,000
フェリシモ	100	1,318.00	131,800
トリドールホールディングス	700	3,980.00	2,786,000
T O K Y O B A S E	100	4,415.00	441,500
サツドラホールディングス	100	2,229.00	222,900
ダイユー・リックホールディングス	300	1,537.00	461,100
バロックジャパンリミテッド	400	1,107.00	442,800
クスリのアオキホールディングス	500	5,740.00	2,870,000
スシローグローバルホールディングス	600	4,555.00	2,733,000
L I X I L ビバ	500	2,007.00	1,003,500
メディカルシステムネットワーク	600	607.00	364,200
総合メディカル	300	6,410.00	1,923,000
はるやまホールディングス	300	1,116.00	334,800
ノジマ	1,000	2,694.00	2,694,000
カッパ・クリエイト	600	1,264.00	758,400

ライトオン	500	960.00	480,000
ジーンズメイト	100	1,024.00	102,400
良品計画	800	35,400.00	28,320,000
三城ホールディングス	600	502.00	301,200
アドヴァン	600	1,061.00	636,600
アルビス	100	3,855.00	385,500
コナカ	700	653.00	457,100
ハウス オブ ローゼ	100	1,860.00	186,000
G - 7ホールディングス	200	2,422.00	484,400
イオン北海道	500	858.00	429,000
コジマ	800	373.00	298,400
ヒマラヤ	100	1,330.00	133,000
コーナン商事	800	2,727.00	2,181,600
エコス	200	1,282.00	256,400
ワタミ	600	1,655.00	993,000
マルシェ	100	822.00	82,200
ドンキホーテホールディングス	3,800	6,220.00	23,636,000
西松屋チェーン	1,300	1,279.00	1,662,700
ゼンショーホールディングス	3,000	1,965.00	5,895,000
幸楽苑ホールディングス	400	1,815.00	726,000
ハークスレイ	200	1,202.00	240,400
サイゼリヤ	900	3,335.00	3,001,500
V Tホールディングス	2,000	593.00	1,186,000
魚力	100	1,209.00	120,900
ポプラ	100	819.00	81,900
フジ・コーポレーション	100	2,505.00	250,500
ユナイテッドアローズ	700	4,695.00	3,286,500
ハイデイ日高	600	3,470.00	2,082,000
京都きもの友禅	300	791.00	237,300
コロワイド	1,900	2,241.00	4,257,900
ピーシーデポコーポレーション	800	798.00	638,400
壱番屋	400	4,575.00	1,830,000
トップカルチャー	100	496.00	49,600
P L A N T	100	1,398.00	139,800
スギホールディングス	1,300	5,880.00	7,644,000
ヴィア・ホールディングス	400	745.00	298,000

スクロール	700	536.00	375,200
ヨンドシーホールディングス	600	2,787.00	1,672,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,900	7,440.00	14,136,000
木曽路	700	2,708.00	1,895,600
S R Sホールディングス	600	949.00	569,400
千趣会	900	601.00	540,900
タカキュー	200	236.00	47,200
ケーヨー	900	678.00	610,200
上新電機	700	3,700.00	2,590,000
日本瓦斯	1,100	4,595.00	5,054,500
ロイヤルホールディングス	1,000	3,015.00	3,015,000
東天紅	100	2,042.00	204,200
いなげや	700	1,815.00	1,270,500
島忠	1,400	3,410.00	4,774,000
チヨダ	700	2,807.00	1,964,900
ライフコーポレーション	400	2,818.00	1,127,200
リンガーハット	700	2,463.00	1,724,100
さが美グループホールディングス	1,000	138.00	138,000
MrMaxHD	700	813.00	569,100
テンアライド	400	482.00	192,800
AOKIホールディングス	1,200	1,629.00	1,954,800
オークワ	1,000	1,142.00	1,142,000
コメリ	900	3,380.00	3,042,000
青山商事	1,100	4,285.00	4,713,500
しまむら	700	12,330.00	8,631,000
はせがわ	200	512.00	102,400
高島屋	9,000	1,151.00	10,359,000
松屋	1,200	1,588.00	1,905,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	2,309.00	6,234,300
近鉄百貨店	200	4,020.00	804,000
パルコ	600	1,560.00	936,000
丸井グループ	5,600	2,038.00	11,412,800
アクシアル リテイリング	500	4,010.00	2,005,000
井筒屋	200	472.00	94,400
イオン	22,300	1,899.00	42,347,700
イズミ	1,100	7,060.00	7,766,000

東武ストア	100	3,085.00	308,500
平和堂	1,200	2,421.00	2,905,200
フジ	700	2,353.00	1,647,100
ヤオコー	700	5,400.00	3,780,000
ゼビオホールディングス	800	2,370.00	1,896,000
ケーズホールディングス	2,500	3,215.00	8,037,500
Olympicグループ	300	619.00	185,700
日産東京販売ホールディングス	700	405.00	283,500
Genky DrugStores	200	3,580.00	716,000
アインホールディングス	800	6,840.00	5,472,000
元気寿司	200	3,370.00	674,000
ヤマダ電機	19,400	647.00	12,551,800
アークランドサカモト	900	1,946.00	1,751,400
ニトリホールディングス	2,300	17,730.00	40,779,000
グルメ杵屋	1,000	1,159.00	1,159,000
愛眼	300	558.00	167,400
ケーユーホールディングス	300	1,184.00	355,200
吉野家ホールディングス	1,900	1,941.00	3,687,900
松屋フーズ	300	4,000.00	1,200,000
サガミチェーン	800	1,414.00	1,131,200
関西スーパーマーケット	400	1,223.00	489,200
王将フードサービス	400	5,360.00	2,144,000
プレナス	600	2,186.00	1,311,600
ミニストップ	400	2,301.00	920,400
アークス	1,100	2,507.00	2,757,700
パローホールディングス	1,300	2,620.00	3,406,000
藤久	100	1,728.00	172,800
ベルク	300	6,430.00	1,929,000
大庄	300	1,743.00	522,900
ファーストリテイリング	1,000	49,320.00	49,320,000
サンドラッグ	2,500	4,800.00	12,000,000
サックスパーホールディングス	500	1,353.00	676,500
ヤマザワ	100	1,770.00	177,000
やまや	100	3,235.00	323,500
ベルーナ	1,400	1,366.00	1,912,400
島根銀行	100	1,396.00	139,600



じもとホールディングス	3,900	193.00	752,700	
めぶきフィナンシャルグループ	30,200	506.00	15,281,200	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	800	3,105.00	2,484,000	
九州フィナンシャルグループ	9,500	671.00	6,374,500	
ゆうちょ銀行	16,500	1,534.00	25,311,000	
富山第一銀行	1,400	519.00	726,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	35,300	664.00	23,439,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	3,900	1,446.00	5,639,400	
新生銀行	5,000	1,939.00	9,695,000	
あおぞら銀行	3,500	4,485.00	15,697,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	411,200	853.30	350,876,960	
りそなホールディングス	63,500	694.30	44,088,050	
三井住友トラスト・ホールディングス	11,400	4,662.00	53,146,800	
三井住友フィナンシャルグループ	44,100	5,146.00	226,938,600	
第四銀行	700	5,240.00	3,668,000	
北越銀行	600	2,554.00	1,532,400	
千葉銀行	21,000	970.00	20,370,000	
群馬銀行	11,700	683.00	7,991,100	
武蔵野銀行	900	3,920.00	3,528,000	
千葉興業銀行	1,600	566.00	905,600	
筑波銀行	2,400	393.00	943,200	
七十七銀行	1,800	2,888.00	5,198,400	
青森銀行	500	3,555.00	1,777,500	
秋田銀行	400	3,030.00	1,212,000	
山形銀行	700	2,403.00	1,682,100	
岩手銀行	400	4,555.00	1,822,000	
東邦銀行	5,200	399.00	2,074,800	
東北銀行	300	1,503.00	450,900	
みちのく銀行	400	1,873.00	749,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	24,000	647.00	15,528,000	
静岡銀行	15,000	1,189.00	17,835,000	
十六銀行	800	3,190.00	2,552,000	
スルガ銀行	5,900	2,250.00	13,275,000	
八十二銀行	10,500	661.00	6,940,500	
山梨中央銀行	4,000	471.00	1,884,000	
大垣共立銀行	900	2,842.00	2,557,800	

福井銀行	500	2,659.00	1,329,500	
北國銀行	700	4,640.00	3,248,000	
清水銀行	200	3,210.00	642,000	
富山銀行	100	4,285.00	428,500	
滋賀銀行	5,000	604.00	3,020,000	
南都銀行	700	3,115.00	2,180,500	
百五銀行	5,600	554.00	3,102,400	
京都銀行	2,200	6,480.00	14,256,000	
紀陽銀行	2,200	1,846.00	4,061,200	
三重銀行	300	2,502.00	750,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	3,900	1,675.00	6,532,500	
広島銀行	8,500	931.00	7,913,500	
山陰合同銀行	3,400	1,111.00	3,777,400	
中国銀行	4,000	1,484.00	5,936,000	
鳥取銀行	200	1,845.00	369,000	
伊予銀行	8,300	925.00	7,677,500	
百十四銀行	6,000	385.00	2,310,000	
四国銀行	900	1,660.00	1,494,000	
阿波銀行	5,000	748.00	3,740,000	
大分銀行	300	4,325.00	1,297,500	
宮崎銀行	400	3,655.00	1,462,000	
佐賀銀行	400	2,596.00	1,038,400	
十八銀行	4,000	301.00	1,204,000	
沖縄銀行	600	4,370.00	2,622,000	
琉球銀行	1,100	1,729.00	1,901,900	
セブン銀行	21,700	414.00	8,983,800	
みずほフィナンシャルグループ	790,800	211.50	167,254,200	
高知銀行	200	1,331.00	266,200	
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,312.00	6,560,000	
長野銀行	200	1,932.00	386,400	
名古屋銀行	500	4,310.00	2,155,000	
北洋銀行	8,700	381.00	3,314,700	
愛知銀行	200	5,660.00	1,132,000	
第三銀行	300	1,768.00	530,400	
中京銀行	300	2,308.00	692,400	
大光銀行	200	2,508.00	501,600	

愛媛銀行	800	1,382.00	1,105,600	
トマト銀行	200	1,564.00	312,800	
みなと銀行	400	2,077.00	830,800	
京葉銀行	5,000	520.00	2,600,000	
関西アーバン銀行	600	1,422.00	853,200	
栃木銀行	3,000	453.00	1,359,000	
北日本銀行	200	3,100.00	620,000	
東和銀行	900	1,547.00	1,392,300	
福島銀行	500	889.00	444,500	
大東銀行	300	1,621.00	486,300	
トモニホールディングス	4,800	561.00	2,692,800	
フィデアホールディングス	5,600	202.00	1,131,200	
池田泉州ホールディングス	6,100	420.00	2,562,000	
F P G	2,000	1,577.00	3,154,000	
S B Iホールディングス	6,600	2,628.00	17,344,800	
日本アジア投資	400	415.00	166,000	
ジャフコ	800	6,720.00	5,376,000	
大和証券グループ本社	50,000	799.10	39,955,000	
野村ホールディングス	104,200	733.70	76,451,540	
岡三証券グループ	5,000	811.00	4,055,000	
丸三証券	1,800	1,084.00	1,951,200	
東洋証券	2,000	375.00	750,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,400	823.00	5,267,200	
光世証券	100	1,566.00	156,600	
水戸証券	1,700	457.00	776,900	
いちよし証券	1,200	1,477.00	1,772,400	
松井証券	2,800	1,017.00	2,847,600	
だいこう証券ビジネス	300	785.00	235,500	
マネックスグループ	6,100	353.00	2,153,300	
カブドットコム証券	3,700	399.00	1,476,300	
極東証券	800	1,745.00	1,396,000	
岩井コスモホールディングス	600	1,585.00	951,000	
藍澤証券	1,000	798.00	798,000	
マネーパートナーズグループ	600	427.00	256,200	
小林洋行	100	321.00	32,100	
かんぽ生命保険	2,200	2,964.00	6,520,800	

S O M P Oホールディングス	11,400	4,713.00	53,728,200	
アニコム ホールディングス	400	3,485.00	1,394,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	15,200	3,900.00	59,280,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	4,800	2,080.00	9,984,000	
第一生命ホールディングス	32,900	2,386.50	78,515,850	
東京海上ホールディングス	21,900	5,391.00	118,062,900	
T & Dホールディングス	18,000	1,995.00	35,910,000	
アドバンスクリエイト	100	1,978.00	197,800	
全国保証	1,600	5,300.00	8,480,000	
クレディセゾン	4,400	2,080.00	9,152,000	
アクリーティブ	400	381.00	152,400	
芙蓉総合リース	700	7,910.00	5,537,000	
興銀リース	1,100	2,961.00	3,257,100	
東京センチュリー	1,200	6,050.00	7,260,000	
日本証券金融	2,400	663.00	1,591,200	
アイフル	9,700	404.00	3,918,800	
リコーリース	500	4,075.00	2,037,500	
イオンフィナンシャルサービス	4,100	2,807.00	11,508,700	
アコム	11,600	480.00	5,568,000	
ジャックス	700	2,836.00	1,985,200	
オリエントコーポレーション	12,500	184.00	2,300,000	
日立キャピタル	1,600	3,080.00	4,928,000	
アプラスフィナンシャル	2,000	116.00	232,000	
オリックス	38,800	2,166.00	84,040,800	
三菱UFJリース	14,700	730.00	10,731,000	
日本取引所グループ	17,100	2,082.00	35,602,200	
イー・ギャランティ	200	3,725.00	745,000	
アサックス	100	1,923.00	192,300	
N E Cキャピタルソリューション	300	2,306.00	691,800	
いちご	8,300	470.00	3,901,000	
日本駐車場開発	7,000	196.00	1,372,000	
ヒューリック	12,100	1,336.00	16,165,600	
三栄建築設計	200	2,351.00	470,200	
スター・マイカ	200	1,898.00	379,600	
野村不動産ホールディングス	3,900	2,907.00	11,337,300	

三重交通グループホールディングス	1,100	488.00	536,800	
サムティ	500	1,976.00	988,000	
ディア・ライフ	500	702.00	351,000	
コーセーアールイー	100	1,347.00	134,700	
エー・ディー・ワークス	6,100	48.00	292,800	
日本商業開発	300	1,846.00	553,800	
プレサンスコーポレーション	800	1,629.00	1,303,200	
ユニゾホールディングス	700	3,165.00	2,215,500	
THEグローバル社	200	1,104.00	220,800	
日本管理センター	400	1,752.00	700,800	
サンセイランディック	200	1,407.00	281,400	
エストラスト	100	1,149.00	114,900	
オープンハウス	1,000	6,770.00	6,770,000	
東急不動産ホールディングス	14,100	885.00	12,478,500	
飯田グループホールディングス	4,900	2,260.00	11,074,000	
ムゲンエステート	300	1,274.00	382,200	
ファーストブラザーズ	200	1,672.00	334,400	
ハウスドゥ	100	2,803.00	280,300	
シーアールイー	100	1,633.00	163,300	
ケイアイスター不動産	200	3,215.00	643,000	
パーク24	3,200	2,767.00	8,854,400	
パラカ	200	2,600.00	520,000	
三井不動産	29,100	2,951.50	85,888,650	
三菱地所	43,300	2,210.50	95,714,650	
平和不動産	1,000	2,124.00	2,124,000	
東京建物	6,400	1,829.00	11,705,600	
ダイビル	1,500	1,453.00	2,179,500	
京阪神ビルディング	900	942.00	847,800	
住友不動産	14,000	4,348.00	60,872,000	
大京	900	2,290.00	2,061,000	
テーオーシー	2,000	982.00	1,964,000	
東京楽天地	100	5,980.00	598,000	
レオパレス21	6,900	881.00	6,078,900	
スターツコーポレーション	800	3,115.00	2,492,000	
フジ住宅	700	932.00	652,400	
空港施設	500	675.00	337,500	

明和地所	300	893.00	267,900	
ゴールドクレスト	500	2,470.00	1,235,000	
日本エスリード	200	2,549.00	509,800	
日神不動産	700	978.00	684,600	
日本エスコン	1,000	748.00	748,000	
タカラレーベン	2,700	535.00	1,444,500	
サンヨーハウジング名古屋	300	1,256.00	376,800	
イオンモール	3,800	2,462.00	9,355,600	
ファースト住建	200	1,795.00	359,000	
ランド	200	17.00	3,400	
トーセイ	700	1,449.00	1,014,300	
穴吹興産	100	3,305.00	330,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,600	1,431.00	5,151,600	
サンフロンティア不動産	700	1,433.00	1,003,100	
エフ・ジェー・ネクスト	400	986.00	394,400	
インテリックス	200	1,270.00	254,000	
ランドビジネス	200	338.00	67,600	
グランディハウス	400	583.00	233,200	
日本空港ビルデング	1,700	4,325.00	7,352,500	
日本工営	400	3,740.00	1,496,000	
L I F U L L	1,900	959.00	1,822,100	
ジェイエイシーリクルートメント	500	2,309.00	1,154,500	
日本M&Aセンター	2,000	6,500.00	13,000,000	
メンバーズ	100	799.00	79,900	
中広	100	774.00	77,400	
タケエイ	600	1,437.00	862,200	
トラスト・テック	200	3,265.00	653,000	
コシダカホールディングス	300	5,820.00	1,746,000	
パソナグループ	500	2,300.00	1,150,000	
C D S	100	1,378.00	137,800	
リンクアンドモチベーション	1,000	951.00	951,000	
G C A	600	1,125.00	675,000	
エス・エム・エス	1,100	3,520.00	3,872,000	
パーソルホールディングス	5,200	2,806.00	14,591,200	
リニカル	400	1,600.00	640,000	
クックパッド	1,800	643.00	1,157,400	

エスクリ	200	1,082.00	216,400	
アイ・ケイ・ケイ	300	822.00	246,600	
学情	300	1,791.00	537,300	
スタジオアリス	300	2,813.00	843,900	
シミックホールディングス	300	2,165.00	649,500	
N J S	100	1,600.00	160,000	
総合警備保障	2,200	6,270.00	13,794,000	
カカクコム	4,300	1,903.00	8,182,900	
アイロムグループ	200	1,900.00	380,000	
セントケア・ホールディング	300	833.00	249,900	
サイネックス	100	948.00	94,800	
ルネサンス	300	1,878.00	563,400	
ディップ	800	3,380.00	2,704,000	
オプトホールディング	400	1,427.00	570,800	
新日本科学	600	635.00	381,000	
ツクイ	1,300	1,012.00	1,315,600	
キャリアデザインセンター	100	2,403.00	240,300	
エムスリー	5,900	3,855.00	22,744,500	
ツカダ・グローバルホールディング	400	648.00	259,200	
プラス	100	1,065.00	106,500	
アウトソーシング	1,700	2,150.00	3,655,000	
ウェルネット	400	1,226.00	490,400	
ワールドホールディングス	200	3,850.00	770,000	
ディー・エヌ・エー	3,000	2,429.00	7,287,000	
博報堂D Yホールディングス	7,800	1,674.00	13,057,200	
ぐるなび	900	1,374.00	1,236,600	
エスアールジータカミヤ	600	690.00	414,000	
ジャパンベストレスキューシステム	600	872.00	523,200	
ファンコミュニケーションズ	1,600	894.00	1,430,400	
ライク	200	2,452.00	490,400	
ビジネス・ブレークスルー	200	553.00	110,600	
W D Bホールディングス	300	3,920.00	1,176,000	
ティア	300	1,172.00	351,600	
C D G	100	1,872.00	187,200	
バリューコマース	400	795.00	318,000	
インフォマート	2,800	744.00	2,083,200	

J Pホールディングス	1,600	335.00	536,000
エコナックホールディングス	500	131.00	65,500
E P Sホールディングス	800	2,730.00	2,184,000
レッグス	100	856.00	85,600
プレステージ・インターナショナル	1,200	1,393.00	1,671,600
アミューズ	400	3,410.00	1,364,000
ドリームインキュベータ	200	2,458.00	491,600
クイック	400	1,729.00	691,600
T A C	200	358.00	71,600
ケネディクス	7,800	740.00	5,772,000
電通	6,900	5,150.00	35,535,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	1,119.00	223,800
ぴあ	200	7,190.00	1,438,000
イオンファンタジー	200	5,480.00	1,096,000
シーティーエス	500	900.00	450,000
ネクシィーズグループ	200	1,954.00	390,800
みらかホールディングス	1,700	4,975.00	8,457,500
アルプス技研	500	2,285.00	1,142,500
サニックス	600	249.00	149,400
ダイオーズ	100	1,448.00	144,800
日本空調サービス	500	825.00	412,500
オリエンタルランド	6,700	10,960.00	73,432,000
ダスキン	1,500	2,979.00	4,468,500
明光ネットワークジャパン	700	1,290.00	903,000
ファルコホールディングス	300	1,790.00	537,000
秀英予備校	100	501.00	50,100
田谷	100	680.00	68,000
ラウンドワン	1,700	2,031.00	3,452,700
リゾートトラスト	2,400	2,669.00	6,405,600
ビー・エム・エル	700	2,948.00	2,063,600
ワタベウェディング	100	669.00	66,900
りらいあコミュニケーションズ	900	1,318.00	1,186,200
リソー教育	900	841.00	756,900
早稲田アカデミー	100	1,775.00	177,500
ユー・エス・エス	6,900	2,531.00	17,463,900
東京個別指導学院	200	1,160.00	232,000



サイバーエージェント	3,700	4,420.00	16,354,000
楽天	28,900	976.30	28,215,070
クリーク・アンド・リバー社	300	1,075.00	322,500
テー・オー・ダブリュー	500	979.00	489,500
セントラルスポーツ	200	4,195.00	839,000
フルキャストホールディングス	500	2,582.00	1,291,000
リソルホールディングス	100	4,745.00	474,500
テクノプロ・ホールディングス	1,000	6,170.00	6,170,000
アトラ	100	706.00	70,600
インターワークス	100	1,365.00	136,500
Keepers 技研	200	1,475.00	295,000
ファーストロジック	100	972.00	97,200
三機サービス	100	1,936.00	193,600
デザインワン・ジャパン	100	1,279.00	127,900
イー・ガーディアン	300	2,842.00	852,600
リブセンス	300	589.00	176,700
ジャパンマテリアル	500	4,275.00	2,137,500
ベクトル	700	2,188.00	1,531,600
ウチヤマホールディングス	300	593.00	177,900
ライクキッズネクスト	100	2,285.00	228,500
キャリアリンク	100	603.00	60,300
I B J	400	1,034.00	413,600
アサント	200	1,878.00	375,600
N・フィールド	300	1,611.00	483,300
バリューHR	100	2,334.00	233,400
M&Aキャピタルパートナーズ	100	9,350.00	935,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	1,043.00	208,600
E R Iホールディングス	100	1,028.00	102,800
アビスト	100	5,280.00	528,000
シグマクシス	200	1,476.00	295,200
ウィルグループ	200	1,901.00	380,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	600	526.00	315,600
日本ビューホテル	100	1,595.00	159,500
リクルートホールディングス	43,500	2,745.00	119,407,500
エラン	100	1,643.00	164,300
土木管理総合試験所	200	685.00	137,000

日本郵政	31,900	1,321.00	42,139,900
ベルシステム24ホールディングス	900	1,581.00	1,422,900
鎌倉新書	100	2,293.00	229,300
一蔵	100	1,196.00	119,600
LITALICO	100	2,066.00	206,600
グローバルグループ	100	1,655.00	165,500
エボラブルアジア	100	2,473.00	247,300
ストライク	100	6,530.00	653,000
ソラスト	400	3,090.00	1,236,000
セラク	100	825.00	82,500
インソース	100	4,515.00	451,500
リログループ	3,100	3,310.00	10,261,000
東祥	400	3,795.00	1,518,000
エイチ・アイ・エス	900	4,060.00	3,654,000
ラックランド	100	2,204.00	220,400
共立メンテナンス	1,000	4,675.00	4,675,000
イチネンホールディングス	600	1,795.00	1,077,000
建設技術研究所	400	1,229.00	491,600
スペース	400	1,568.00	627,200
長大	100	907.00	90,700
燦ホールディングス	200	2,988.00	597,600
スバル興業	100	7,590.00	759,000
東京テアトル	200	1,498.00	299,600
タナベ経営	100	1,800.00	180,000
ナガワ	100	4,805.00	480,500
よみうりランド	100	4,980.00	498,000
東京都競馬	400	4,525.00	1,810,000
常磐興産	200	1,885.00	377,000
カナモト	900	3,445.00	3,100,500
東京ドーム	2,300	1,085.00	2,495,500
西尾レントオール	500	3,625.00	1,812,500
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	2,000	40.00	80,000
トランス・コスモス	600	3,010.00	1,806,000
乃村工藝社	1,300	2,431.00	3,160,300
藤田観光	200	3,560.00	712,000
KNT-CTホールディングス	400	1,796.00	718,400

日本管財	600	2,061.00	1,236,600	
トーカイ	500	2,736.00	1,368,000	
白洋舎	100	4,330.00	433,000	
セコム	6,000	8,685.00	52,110,000	
セントラル警備保障	300	2,665.00	799,500	
丹青社	1,000	1,250.00	1,250,000	
メイテック	700	6,020.00	4,214,000	
アサツー ディ・ケイ	200	3,645.00	729,000	
応用地質	600	1,454.00	872,400	
船井総研ホールディングス	1,200	2,631.00	3,157,200	
進学会ホールディングス	300	664.00	199,200	
オオバ	400	543.00	217,200	
いであ	100	1,173.00	117,300	
学究社	200	1,651.00	330,200	
ベネッセホールディングス	2,100	4,250.00	8,925,000	
イオンディライト	700	4,060.00	2,842,000	
ナック	300	1,004.00	301,200	
ニチイ学館	1,100	1,458.00	1,603,800	
ダイセキ	1,000	3,305.00	3,305,000	
ステップ	200	1,941.00	388,200	
合 計	7,099,400		15,872,387,875	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	715,562,147
コール・ローン	25,721,552
株式	10,935,609,945
投資証券	255,954,545
派生商品評価勘定	10,086,788
未収配当金	8,791,439
差入委託証拠金	216,889,440
流動資産合計	12,168,615,856
資産合計	
12,168,615,856	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	426,132
未払金	506,378,835
未払解約金	27,000
未払利息	69
流動負債合計	506,832,036
負債合計	
506,832,036	
純資産の部	
元本等	
元本	9,300,090,859
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,361,692,961
元本等合計	11,661,783,820
純資産合計	
11,661,783,820	
負債純資産合計	
12,168,615,856	

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引

	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	1,886,041,745円
期中追加設定元本額	9,293,334,567円
期中一部解約元本額	1,879,285,453円
期末元本額	9,300,090,859円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,860,553,001円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	702,886,864円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,455,302,944円
DCりそな グローバルバランス	9,572,947円
つみたてバランスファンド	3,664,730円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	5,261,037,970円
Smart-i 先進国株式インデックス	6,287,490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)	784,913円
2. 計算日における受益権の総数	9,300,090,859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	1.2539円
(10,000口当たり純資産額)	(12,539円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,138,032,436
投資証券		1,509,287
合計		1,139,541,723

(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)

(平成30年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	477,527,640	-	487,218,386	9,690,746
合計		477,527,640	-	487,218,386	9,690,746

(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)

(平成30年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	22,968,470	-	22,938,380	30,090
	米ドル	16,051,240	-	15,985,540	65,700
	ユーロ	4,602,580	-	4,615,840	13,260
	英ポンド	2,314,650	-	2,337,000	22,350
	合計	22,968,470	-	22,938,380	30,090

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	1,541	61.43	94,663.63	
	ANDEAVOR	418	116.57	48,726.26	
	ANTERO RESOURCES CORP	124	20.19	2,503.56	
	APACHE CORP	1,222	48.12	58,802.64	
	BAKER HUGHES A GE CO	1,268	33.78	42,833.04	
	CABOT OIL & GAS CORP	853	28.11	23,977.83	
	CHENIERE ENERGY INC	414	57.90	23,970.60	
	CHEVRON CORP	5,098	131.39	669,826.22	
	CIMAREX ENERGY CO	258	124.23	32,051.34	
	CONCHO RESOURCES INC	406	160.90	65,325.40	
	CONOCOPHILLIPS	3,154	60.49	190,785.46	



CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	57.44	4,365.44
DEVON ENERGY CORP	1,296	44.52	57,697.92
DIAMONDBACK ENERGY INC	240	130.36	31,286.40
EOG RESOURCES INC	1,510	118.47	178,889.70
EQT CORP	585	58.76	34,374.60
EXXON MOBIL CORP	11,291	88.53	999,592.23
HALLIBURTON CO	2,236	55.34	123,740.24
HELMERICH & PAYNE	153	71.38	10,921.14
HESS CORP	769	53.88	41,433.72
HOLLYFRONTIER CORP	486	49.26	23,940.36
KINDER MORGAN INC	5,211	19.14	99,738.54
MARATHON OIL CORP	2,242	19.28	43,225.76
MARATHON PETROLEUM CORP	1,516	71.59	108,530.44
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,090	38.29	41,736.10
NEWFIELD EXPLORATION CO	288	34.13	9,829.44
NOBLE ENERGY INC	1,056	33.09	34,943.04
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,995	77.56	154,732.20
ONEOK INC	1,004	60.71	60,952.84
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	640	29.52	18,892.80
PHILLIPS 66	1,123	104.63	117,499.49
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	450	188.33	84,748.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	200	22.82	4,564.00
RANGE RESOURCES CORP	139	17.00	2,363.00
SCHLUMBERGER LTD	3,608	78.18	282,073.44
TARGA RESOURCES CORP	380	50.79	19,300.20
TECHNIPFMC PLC	1,200	34.65	41,580.00
VALERO ENERGY CORP	1,143	97.66	111,625.38
WILLIAMS COS INC	2,130	33.10	70,503.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	588	170.81	100,436.28
ALBEMARLE CORP	319	112.40	35,855.60
AVERY DENNISON CORP	182	120.06	21,850.92
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	486	31.06	15,095.16
BALL CORP	1,140	38.84	44,277.60
CELANESE CORP-SERIES A	369	110.10	40,626.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	358	41.64	14,907.12

CHEMOURS CO/THE	410	52.99	21,725.90
CROWN HOLDINGS INC	195	58.18	11,345.10
DOWDUPONT INC	6,350	76.01	482,663.50
EASTMAN CHEMICAL CO	413	98.64	40,738.32
ECOLAB INC	703	137.31	96,528.93
FMC CORP	298	89.73	26,739.54
FREEMPORT-MCMORAN INC	3,596	19.60	70,481.60
INTERNATIONAL PAPER CO	1,071	63.66	68,179.86
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	150	152.86	22,929.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	882	118.94	104,905.08
MARTIN MARIETTA MATERIALS	169	232.26	39,251.94
MONSANTO CO	1,158	122.18	141,484.44
MOSAIC CO/THE	652	27.20	17,734.40
NEWMONT MINING CORP	1,422	41.57	59,112.54
NUCOR CORP	848	69.01	58,520.48
PACKAGING CORP OF AMERICA	263	126.20	33,190.60
PPG INDUSTRIES INC	660	118.94	78,500.40
PRAXAIR INC	748	160.87	120,330.76
SEALED AIR CORP	504	48.90	24,645.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	214	429.38	91,887.32
STEEL DYNAMICS INC	650	46.96	30,524.00
VULCAN MATERIALS CO	403	135.49	54,602.47
WESTROCK CO	681	68.75	46,818.75
WR GRACE & CO	57	74.35	4,237.95
3M CO	1,538	247.69	380,947.22
ACUITY BRANDS INC	59	166.89	9,846.51
AERCAP HOLDINGS NV	312	54.55	17,019.60
AGCO CORP	54	72.96	3,939.84
ALLEGION PLC	370	85.58	31,664.60
AMETEK INC	616	76.90	47,370.40
ARCONIC INC	1,445	30.48	44,043.60
BOEING CO/THE	1,524	334.69	510,067.56
CATERPILLAR INC	1,546	168.34	260,253.64
CUMMINS INC	424	188.35	79,860.40
DEERE & CO	735	169.60	124,656.00

DOVER CORP	342	104.78	35,834.76
EATON CORP PLC	1,171	84.50	98,949.50
EMERSON ELECTRIC CO	1,729	72.63	125,577.27
FASTENAL CO	895	56.86	50,889.70
FLOWSERVE CORP	456	45.34	20,675.04
FLUOR CORP	200	61.28	12,256.00
FORTIVE CORP	863	75.36	65,035.68
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	289	73.13	21,134.57
GENERAL DYNAMICS CORP	676	219.27	148,226.52
GENERAL ELECTRIC CO	23,639	16.44	388,625.16
HD SUPPLY HOLDINGS INC	300	39.55	11,865.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,894	159.97	302,983.18
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	92	238.14	21,908.88
IDEX CORP	270	138.20	37,314.00
ILLINOIS TOOL WORKS	828	173.76	143,873.28
INGERSOLL-RAND PLC	683	91.98	62,822.34
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	205	70.24	14,399.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	700	64.85	45,395.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	500	40.78	20,390.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,454	40.60	99,632.40
L3 TECHNOLOGIES INC	181	209.79	37,971.99
LENNOX INTERNATIONAL INC	60	217.25	13,035.00
LOCKHEED MARTIN CORP	673	330.49	222,419.77
MASCO CORP	1,082	45.91	49,674.62
MIDDLEBY CORP	227	136.25	30,928.75
NORTHROP GRUMMAN CORP	433	313.46	135,728.18
OWENS CORNING	260	95.60	24,856.00
PACCAR INC	928	78.29	72,653.12
PARKER HANNIFIN CORP	361	208.83	75,387.63
PENTAIR PLC	504	73.45	37,018.80
RAYTHEON COMPANY	751	198.09	148,765.59
ROCKWELL AUTOMATION INC	342	200.47	68,560.74
ROCKWELL COLLINS INC	431	137.85	59,413.35
ROPER TECHNOLOGIES INC	268	276.51	74,104.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	348	56.12	19,529.76

SMITH (A.O.) CORP	414	66.80	27,655.20
SNAP-ON INC	133	182.77	24,308.41
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	270	99.84	26,956.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	397	170.59	67,724.23
TEXTRON INC	796	59.71	47,529.16
TRANSDIGM GROUP INC	169	303.90	51,359.10
UNITED RENTALS INC	234	185.52	43,411.68
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,953	135.68	264,983.04
WABCO HOLDINGS INC	114	157.74	17,982.36
WABTEC CORP	127	82.73	10,506.71
WW GRAINGER INC	132	271.97	35,900.04
XYLEM INC	476	72.57	34,543.32
CINTAS CORP	306	164.98	50,483.88
EQUIFAX INC	319	125.73	40,107.87
IHS MARKIT LTD	1,100	48.68	53,548.00
MANPOWERGROUP INC	138	132.82	18,329.16
NIELSEN HOLDINGS PLC	983	37.53	36,891.99
REPUBLIC SERVICES INC	794	68.13	54,095.22
ROBERT HALF INTL INC	346	57.43	19,870.78
ROLLINS INC	155	50.49	7,825.95
STERICYCLE INC	149	70.69	10,532.81
TRANSUNION	340	60.07	20,423.80
VERISK ANALYTICS INC	413	99.00	40,887.00
WASTE CONNECTIONS INC	698	72.33	50,486.34
WASTE MANAGEMENT INC	1,147	88.50	101,509.50
AMERCO	6	380.35	2,282.10
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	54.79	10,848.42
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	457	96.18	43,954.26
CSX CORP	2,455	56.87	139,615.85
DELTA AIR LINES INC	679	56.80	38,567.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	509	67.05	34,128.45
FEDEX CORP	670	270.41	181,174.70
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	216	125.65	27,140.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	4,000	0.41	1,660.00
KANSAS CITY SOUTHERN	323	112.69	36,398.87

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	250	46.38	11,595.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	115	66.10	7,601.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	752	149.94	112,754.88
OLD DOMINION FREIGHT LINE	150	148.30	22,245.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	380	62.21	23,639.80
UNION PACIFIC CORP	2,206	141.19	311,465.14
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	121	69.05	8,355.05
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,779	131.69	234,276.51
APTIV PLC	772	93.54	72,212.88
AUTOLIV INC	196	138.39	27,124.44
BORGWARNER INC	458	56.74	25,986.92
FORD MOTOR CO	9,751	12.05	117,499.55
GENERAL MOTORS CO	3,464	44.16	152,970.24
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	537	35.37	18,993.69
HARLEY-DAVIDSON INC	232	55.95	12,980.40
LEAR CORP	108	192.35	20,773.80
TESLA INC	350	345.89	121,061.50
DR HORTON INC	1,178	51.85	61,079.30
GARMIN LTD	173	64.21	11,108.33
HANESBRANDS INC	521	23.24	12,108.04
HASBRO INC	427	95.77	40,893.79
LEGGETT & PLATT INC	366	47.33	17,322.78
LENNAR CORP-A	625	70.86	44,287.50
LULULEMON ATHLETICA INC	133	79.20	10,533.60
MATTEL INC	408	17.27	7,046.16
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	582	67.27	39,151.14
MOHAWK INDUSTRIES INC	214	274.56	58,755.84
NEWELL RUBBERMAID INC	1,345	31.23	42,004.35
NIKE INC -CL B	3,391	68.00	230,588.00
NVR INC	8	3,587.20	28,697.60
POLARIS INDUSTRIES INC	141	134.56	18,972.96
PULTEGROUP INC	567	34.81	19,737.27
PVH CORP	147	151.34	22,246.98
RALPH LAUREN CORP	168	117.74	19,780.32
TAPESTRY INC	761	47.54	36,177.94

TOLL BROTHERS INC	362	51.43	18,617.66
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	14.93	6,106.37
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	152	13.61	2,068.72
VF CORP	932	80.97	75,464.04
WHIRLPOOL CORP	201	178.97	35,972.97
ARAMARK	577	45.48	26,241.96
CARNIVAL CORP	940	71.17	66,899.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	92	329.53	30,316.76
DARDEN RESTAURANTS INC	299	97.55	29,167.45
DOMINO'S PIZZA INC	95	218.72	20,778.40
H&R BLOCK INC	571	27.16	15,508.36
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	519	85.79	44,525.01
LAS VEGAS SANDS CORP	1,056	77.44	81,776.64
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	844	144.39	121,865.16
MCDONALD'S CORP	2,210	176.12	389,225.20
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	400	28.51	11,404.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,410	37.63	53,058.30
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	372	59.77	22,234.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	458	132.51	60,689.58
STARBUCKS CORP	3,743	60.83	227,686.69
VAIL RESORTS INC	63	232.65	14,656.95
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	186	125.27	23,300.22
WYNN RESORTS LTD	189	200.58	37,909.62
YUM! BRANDS INC	853	85.24	72,709.72
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	927	59.23	54,906.21
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	510	376.18	191,851.80
COMCAST CORP-CLASS A	12,729	42.99	547,219.71
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	622	26.01	16,178.22
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	320	24.67	7,894.40
DISH NETWORK CORP-A	555	47.73	26,490.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	688	21.82	15,012.16
LIBERTY BROADBAND-C	265	95.80	25,387.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	356	37.42	13,321.52
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,522	35.58	54,152.76
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	450	38.10	17,145.00

LIBERTY SIRIUS GROUP-C	667	42.17	28,127.39
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	75	42.45	3,183.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	330	44.99	14,846.70
NEWS CORP - CLASS A	910	17.09	15,551.90
OMNICOM GROUP	632	76.58	48,398.56
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	196	88.32	17,310.72
SIRIUS XM HOLDINGS INC	4,458	5.73	25,544.34
TIME WARNER INC	1,989	93.83	186,627.87
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	1,393	37.49	52,223.57
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	2,876	38.00	109,288.00
VIACOM INC-CLASS B	842	33.13	27,895.46
WALT DISNEY CO/THE	4,116	110.50	454,818.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	120	120.99	14,518.80
AMAZON.COM INC	1,083	1,357.51	1,470,183.33
AUTONATION INC	61	61.02	3,722.22
AUTOZONE INC	87	793.36	69,022.32
BEST BUY CO INC	735	76.79	56,440.65
CARMAX INC	405	70.95	28,734.75
DOLLAR GENERAL CORP	748	102.69	76,812.12
DOLLAR TREE INC	615	114.34	70,319.10
EXPEDIA INC	261	130.43	34,042.23
GAP INC/THE	696	34.88	24,276.48
GENUINE PARTS CO	344	106.63	36,680.72
HOME DEPOT INC	3,173	206.22	654,336.06
KOHL'S CORP	564	67.70	38,182.80
L BRANDS INC	683	53.19	36,328.77
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	963	27.48	26,463.24
LKQ CORP	1,053	42.87	45,142.11
LOWE'S COS INC	2,189	106.72	233,610.08
MACY'S INC	437	27.25	11,908.25
NETFLIX INC	1,118	261.30	292,133.40
NORDSTROM INC	105	50.62	5,315.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	238	275.93	65,671.34
PRICELINE GROUP INC/THE	128	1,955.24	250,270.72
ROSS STORES INC	1,035	84.59	87,550.65

TARGET CORP	1,335	76.89	102,648.15
TIFFANY & CO	409	109.12	44,630.08
TJX COMPANIES INC	1,681	79.25	133,219.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	279	80.68	22,509.72
TRIPADVISOR INC	171	36.31	6,209.01
ULTA BEAUTY INC	132	224.31	29,608.92
COSTCO WHOLESALE CORP	1,139	194.24	221,239.36
CVS HEALTH CORP	2,660	80.92	215,247.20
KROGER CO	2,716	29.48	80,067.68
SYSCO CORP	1,299	63.73	82,785.27
WAL-MART STORES INC	4,070	105.79	430,565.30
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,375	77.33	183,658.75
ALTRIA GROUP INC	4,898	71.56	350,500.88
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,455	42.84	62,332.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	390	68.84	26,847.60
BUNGE LTD	267	80.03	21,368.01
CAMPBELL SOUP CO	616	47.10	29,013.60
COCA-COLA CO/THE	10,897	47.83	521,203.51
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	500	39.83	19,915.00
CONAGRA BRANDS INC	1,282	37.60	48,203.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	455	222.03	101,023.65
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	484	95.96	46,444.64
GENERAL MILLS INC	1,531	59.72	91,431.32
HERSHEY CO/THE	392	110.31	43,241.52
HORMEL FOODS CORP	834	34.39	28,681.26
INGREDION INC	99	140.31	13,890.69
JM SMUCKER CO/THE	314	126.94	39,859.16
KELLOGG CO	544	67.30	36,611.20
KRAFT HEINZ CO/THE	1,602	79.86	127,935.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	215	100.09	21,519.35
MOLSON COORS BREWING CO -B	513	83.89	43,035.57
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	3,868	44.59	172,474.12
MONSTER BEVERAGE CORP	1,161	68.28	79,273.08
PEPSICO INC	3,839	121.14	465,056.46
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,176	110.60	461,865.60



TYSON FOODS INC-CL A	755	79.78	60,233.90
CHURCH & DWIGHT CO INC	444	49.11	21,804.84
CLOROX COMPANY	347	142.25	49,360.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,172	76.80	166,809.60
COTY INC-CL A	785	20.38	15,998.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	592	136.25	80,660.00
KIMBERLY-CLARK CORP	1,019	119.71	121,984.49
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6,821	88.31	602,362.51
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	25	124.04	3,101.00
ABBOTT LABORATORIES	4,490	61.72	277,122.80
AETNA INC	885	190.14	168,273.90
ALIGN TECHNOLOGY INC	157	272.28	42,747.96
AMERISOURCEBERGEN CORP	449	104.62	46,974.38
ANTHEM INC	692	252.99	175,069.08
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,302	70.14	91,322.28
BECTON DICKINSON AND CO	683	238.64	162,991.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,692	27.91	103,043.72
CARDINAL HEALTH INC	938	74.69	70,059.22
CENTENE CORP	478	111.02	53,067.56
CERNER CORP	865	67.70	58,560.50
CIGNA CORP	674	221.00	148,954.00
COOPER COS INC/THE	115	239.33	27,522.95
DANAHER CORP	1,635	101.38	165,756.30
DAVITA INC	412	78.64	32,399.68
DENTSPLY SIRONA INC	752	61.83	46,496.16
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	574	124.79	71,629.46
ENVISION HEALTHCARE CORP	130	35.99	4,678.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,539	80.96	124,597.44
HCA HEALTHCARE INC	853	91.49	78,040.97
HENRY SCHEIN INC	444	77.41	34,370.04
HOLOGIC INC	584	42.90	25,053.60
HUMANA INC	390	286.32	111,664.80
IDEXX LABORATORIES INC	249	184.08	45,835.92
INTUITIVE SURGICAL INC	301	437.48	131,681.48
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	220	174.84	38,464.80

MCKESSON CORP	548	174.58	95,669.84
MEDTRONIC PLC	3,502	85.76	300,331.52
QUEST DIAGNOSTICS INC	265	104.62	27,724.30
RESMED INC	274	100.22	27,460.28
STRYKER CORP	878	164.49	144,422.22
TELEFLEX INC	104	275.08	28,608.32
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,596	244.85	635,630.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	242	117.99	28,553.58
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	258	113.05	29,166.90
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	170	59.21	10,065.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	519	125.02	64,885.38
ABBVIE INC	4,337	105.51	457,596.87
AGILENT TECHNOLOGIES INC	643	73.58	47,311.94
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	644	125.01	80,506.44
ALKERMES PLC	258	58.84	15,180.72
ALLERGAN PLC	893	186.72	166,740.96
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	190	133.89	25,439.10
AMGEN INC	1,870	190.63	356,478.10
BIOGEN INC	550	346.50	190,575.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	482	91.29	44,001.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,208	63.76	268,302.08
CELGENE CORP	2,029	103.11	209,210.19
ELI LILLY & CO	2,561	84.30	215,892.30
GILEAD SCIENCES INC	3,354	81.30	272,680.20
ILLUMINA INC	384	242.49	93,116.16
INCYTE CORP	352	95.34	33,559.68
IQVIA HOLDINGS INC	389	103.50	40,261.50
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	128	152.86	19,566.08
JOHNSON & JOHNSON	7,144	142.07	1,014,948.08
MERCK & CO. INC.	7,403	61.18	452,915.54
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	81	672.69	54,487.89
MYLAN NV	1,397	46.12	64,429.64
PERRIGO CO PLC	394	93.61	36,882.34
PFIZER INC	15,963	36.93	589,513.59
REGENERON PHARMACEUTICALS	200	383.32	76,664.00

SEATTLE GENETICS INC	146	55.96	8,170.16
TESARO INC	60	71.73	4,303.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,265	20.57	46,591.05
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,031	215.32	221,994.92
UNITED THERAPEUTICS CORP	22	138.33	3,043.26
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	648	167.45	108,507.60
WATERS CORP	143	214.30	30,644.90
ZOETIS INC	1,245	78.33	97,520.85
BANK OF AMERICA CORP	26,572	32.09	852,695.48
BB&T CORP	2,067	55.00	113,685.00
CIT GROUP INC	280	52.26	14,632.80
CITIGROUP INC	7,333	79.45	582,606.85
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,292	47.38	61,214.96
COMERICA INC	363	95.53	34,677.39
EAST WEST BANCORP INC	220	68.42	15,052.40
FIFTH THIRD BANCORP	1,551	33.33	51,694.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	502	90.43	45,395.86
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,880	16.11	46,396.80
JPMORGAN CHASE & CO	9,362	115.67	1,082,902.54
KEYCORP	2,236	21.73	48,588.28
M & T BANK CORP	280	189.46	53,048.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	1,054	13.88	14,629.52
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	251	19.94	5,004.94
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,223	157.74	192,916.02
REGIONS FINANCIAL CORP	3,133	19.43	60,874.19
SIGNATURE BANK	41	155.00	6,355.00
SUNTRUST BANKS INC	1,223	71.20	87,077.60
SVB FINANCIAL GROUP	80	260.72	20,857.60
US BANCORP	4,262	57.75	246,130.50
WELLS FARGO & CO	12,583	65.48	823,934.84
ZIONS BANCORPORATION	310	53.74	16,659.40
AFFILIATED MANAGERS GROUP	110	211.45	23,259.50
ALLY FINANCIAL INC	1,249	30.24	37,769.76
AMERICAN EXPRESS CO	1,951	99.30	193,734.30
AMERIPRISE FINANCIAL INC	410	180.31	73,927.10

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,741	57.77	158,347.57
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,402	215.61	733,505.22
BLACKROCK INC	319	587.67	187,466.73
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,291	105.26	135,890.66
CBOE GLOBAL MARKETS INC	285	135.57	38,637.45
CME GROUP INC	909	154.99	140,885.91
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,098	78.74	86,456.52
E*TRADE FINANCIAL CORP	769	55.19	42,441.11
EATON VANCE CORP	362	60.03	21,730.86
FRANKLIN RESOURCES INC	899	45.52	40,922.48
GOLDMAN SACHS GROUP INC	953	265.68	253,193.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,563	75.42	117,881.46
INVESCO LTD	1,112	37.61	41,822.32
LEUCADIA NATIONAL CORP	455	27.54	12,530.70
MOODY'S CORP	451	162.19	73,147.69
MORGAN STANLEY	3,583	57.24	205,090.92
MSCI INC	208	138.07	28,718.56
NASDAQ INC	353	81.17	28,653.01
NORTHERN TRUST CORP	575	106.17	61,047.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	458	96.90	44,380.20
S&P GLOBAL INC	677	183.11	123,965.47
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,152	55.39	174,589.28
SEI INVESTMENTS COMPANY	488	76.57	37,366.16
STATE STREET CORP	985	112.71	111,019.35
SYNCHRONY FINANCIAL	2,046	39.74	81,308.04
T ROWE PRICE GROUP INC	627	117.71	73,804.17
TD AMERITRADE HOLDING CORP	881	55.77	49,133.37
VOYA FINANCIAL INC	672	53.98	36,274.56
AFLAC INC	1,059	88.43	93,647.37
ALLEGHANY CORP	36	619.78	22,312.08
ALLSTATE CORP	962	99.87	96,074.94
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	118	112.75	13,304.50
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,389	64.32	153,660.48
AON PLC	710	138.83	98,569.30
ARCH CAPITAL GROUP LTD	374	93.41	34,935.34

ARTHUR J GALLAGHER & CO	624	65.12	40,634.88
ASSURANT INC	53	95.58	5,065.74
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	120	51.89	6,226.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	77	51.46	3,962.42
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	121	64.62	7,819.02
CHUBB LTD	1,234	154.98	191,245.32
CINCINNATI FINANCIAL CORP	548	77.24	42,327.52
EVEREST RE GROUP LTD	97	231.96	22,500.12
FNF GROUP	887	41.05	36,411.35
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,005	58.15	58,440.75
LINCOLN NATIONAL CORP	605	83.34	50,420.70
LOEWS CORP	637	53.04	33,786.48
MARKEL CORP	38	1,116.76	42,436.88
MARSH & MCLENNAN COS	1,359	83.42	113,367.78
METLIFE INC	2,387	54.10	129,136.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	918	74.00	67,932.00
PROGRESSIVE CORP	1,501	55.33	83,050.33
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,124	124.83	140,308.92
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	150	162.42	24,363.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	35	129.81	4,543.35
TORCHMARK CORP	367	93.07	34,156.69
TRAVELERS COS INC/THE	743	147.62	109,681.66
UNUM GROUP	535	55.96	29,938.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	336	159.02	53,430.72
WR BERKLEY CORP	280	71.79	20,101.20
XL GROUP LTD	354	36.86	13,048.44
CBRE GROUP INC - A	684	45.21	30,923.64
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	3,800	7.11	27,018.00
JONES LANG LASALLE INC	107	153.59	16,434.13
ACCENTURE PLC-CL A	1,606	160.60	257,923.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,900	70.08	133,152.00
ADOBE SYSTEMS INC	1,300	197.78	257,114.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	366	66.02	24,163.32
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	136	259.49	35,290.64
ALPHABET INC-CL A	818	1,171.29	958,115.22

ALPHABET INC-CL C	785	1,164.24	913,928.40
ANSYS INC	234	161.54	37,800.36
AUTODESK INC	551	116.90	64,411.90
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,188	120.86	143,581.68
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	340	96.18	32,701.20
CA INC	570	34.90	19,893.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	789	45.38	35,804.82
CDK GLOBAL INC	185	73.95	13,680.75
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES INC	434	105.14	45,630.76
CITRIX SYSTEMS INC	333	93.78	31,228.74
COGNIZANT TECHNOLOGIES SOLUTIONS-A	1,576	78.45	123,637.20
COSTAR GROUP INC	99	352.80	34,927.20
DELL TECHNOLOGIES INC-CLASS V	551	88.37	48,691.87
DXC TECHNOLOGY CO	761	101.19	77,005.59
EBAY INC	2,698	39.82	107,434.36
ELECTRONIC ARTS INC	835	114.66	95,741.10
FACEBOOK INC-A	6,314	186.55	1,177,876.70
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	886	100.56	89,096.16
FIRST DATA CORPORATION- CLASS A	880	18.17	15,989.60
FISERV INC	562	140.14	78,758.68
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	252	207.83	52,373.16
FORTINET INC	568	45.25	25,702.00
GARTNER INC	254	140.19	35,608.26
GLOBAL PAYMENTS INC	416	112.17	46,662.72
IAC/INTERACTIVECORP	160	141.98	22,716.80
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORPORATION	2,305	165.37	381,177.85
INTUIT INC	651	167.55	109,075.05
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	120	125.15	15,018.00
LEIDOS HOLDINGS INC	220	65.84	14,484.80
MASTERCARD INC-CLASS A	2,432	167.01	406,168.32
MERCADOLIBRE INC	115	355.60	40,894.00
MICROSOFT CORP	19,398	91.82	1,781,124.36
ORACLE CORP	7,995	51.45	411,342.75
PAYCHEX INC	977	68.02	66,455.54
PAYPAL HOLDINGS INC	2,947	83.71	246,693.37

RED HAT INC	375	128.89	48,333.75
SABRE CORP	168	20.52	3,447.36
SALESFORCE.COM INC	1,791	112.85	202,114.35
SERVICENOW INC	516	145.44	75,047.04
SPLUNK INC	445	92.16	41,011.20
SQUARE INC - A	560	44.32	24,819.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	260	50.25	13,065.00
SYMANTEC CORP	1,586	26.80	42,504.80
SYNOPSYS INC	467	92.84	43,356.28
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	230	116.24	26,735.20
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	439	87.28	38,315.92
TWITTER INC	1,320	22.37	29,528.40
VERISIGN INC	249	115.77	28,826.73
VISA INC-CLASS A SHARES	4,919	124.55	612,661.45
VMWARE INC-CLASS A	160	137.07	21,931.20
WESTERN UNION CO	1,599	20.52	32,811.48
WORKDAY INC-CLASS A	436	115.87	50,519.32
WORLDPAY INC-CLASS A	790	79.63	62,907.70
ZILLOW GROUP INC - C	92	43.72	4,022.24
AMPHENOL CORP-CL A	802	91.20	73,142.40
APPLE INC	13,640	174.22	2,376,360.80
ARISTA NETWORKS INC	75	273.14	20,485.50
ARROW ELECTRONICS INC	224	84.46	18,919.04
AVNET INC	107	42.79	4,578.53
CDW CORP/DE	423	75.04	31,741.92
CISCO SYSTEMS INC	13,505	42.17	569,505.85
COGNEX CORP	380	67.34	25,589.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	300	38.66	11,598.00
CORNING INC	2,457	34.12	83,832.84
F5 NETWORKS INC	186	142.13	26,436.18
FLEX LTD	1,502	18.95	28,462.90
FLIR SYSTEMS INC	391	51.84	20,269.44
HARRIS CORP	325	143.10	46,507.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	4,569	16.68	76,210.92
HP INC	4,520	23.66	106,943.20

IPG PHOTONICS CORP	85	255.73	21,737.05
JUNIPER NETWORKS INC	766	27.97	21,425.02
MOTOROLA SOLUTIONS INC	310	95.84	29,710.40
NETAPP INC	848	62.93	53,364.64
PALO ALTO NETWORKS INC	166	158.28	26,274.48
SEAGATE TECHNOLOGY	787	52.97	41,687.39
TE CONNECTIVITY LTD	934	102.39	95,632.26
TRIMBLE INC	684	44.83	30,663.72
WESTERN DIGITAL CORP	778	86.97	67,662.66
XEROX CORP	555	32.36	17,959.80
AT&T INC	16,314	37.02	603,944.28
CENTURYLINK INC	2,597	17.39	45,161.83
SPRINT CORP	1,246	5.26	6,553.96
T-MOBILE US INC	790	65.00	51,350.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,414	54.22	564,647.08
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	418	36.38	15,206.84
AES CORP	1,018	11.16	11,360.88
ALLIANT ENERGY CORP	517	39.85	20,602.45
AMEREN CORPORATION	814	55.74	45,372.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,311	68.48	89,777.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	401	83.75	33,583.75
ATMOS ENERGY CORP	303	82.25	24,921.75
CENTERPOINT ENERGY INC	1,146	28.14	32,248.44
CMS ENERGY CORP	777	44.26	34,390.02
CONSOLIDATED EDISON INC	818	79.42	64,965.56
DOMINION ENERGY INC	1,694	75.56	127,998.64
DTE ENERGY COMPANY	583	104.43	60,882.69
DUKE ENERGY CORP	1,841	77.24	142,198.84
EDISON INTERNATIONAL	860	61.70	53,062.00
ENERGY CORP	605	76.70	46,403.50
EVERSOURCE ENERGY	854	61.13	52,205.02
EXELON CORP	2,541	38.21	97,091.61
FIRSTENERGY CORP	1,487	31.10	46,245.70
NEXTERA ENERGY INC	1,232	150.85	185,847.20
NISOURCE INC	683	24.18	16,514.94



	OGE ENERGY CORP	204	32.13	6,554.52	
	P G & E CORP	1,345	43.68	58,749.60	
	PINNACLE WEST CAPITAL	237	80.22	19,012.14	
	PPL CORP	1,903	32.00	60,896.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,316	50.42	66,352.72	
	SCANA CORP	146	40.72	5,945.12	
	SEMPRA ENERGY	631	105.68	66,684.08	
	SOUTHERN CO/THE	2,592	44.08	114,255.36	
	UGI CORP	499	46.63	23,268.37	
	VISTRA ENERGY CORP	650	19.48	12,662.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	818	63.24	51,730.32	
	WESTAR ENERGY INC	558	51.19	28,564.02	
	XCEL ENERGY INC	1,301	45.55	59,260.55	
	ADVANCED MICRO DEVICES	1,550	12.71	19,700.50	
	ANALOG DEVICES INC	983	95.34	93,719.22	
	APPLIED MATERIALS INC	2,777	56.88	157,955.76	
	BROADCOM LTD	1,036	256.86	266,106.96	
	INTEL CORP	12,604	45.51	573,608.04	
	KLA-TENCOR CORP	336	114.93	38,616.48	
	LAM RESEARCH CORP	424	209.73	88,925.52	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	908	23.29	21,147.32	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	869	56.35	48,968.15	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	608	95.36	57,978.88	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,829	43.08	121,873.32	
	NVIDIA CORP	1,626	235.80	383,410.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	859	120.46	103,475.14	
	QORVO INC	422	66.90	28,231.80	
	QUALCOMM INC	3,815	67.98	259,343.70	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	538	97.13	52,255.94	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,553	109.70	280,064.10	
	XILINX INC	651	73.48	47,835.48	
	米ドル 小計	800,421		65,189,994.23	(7,138,304,368)
カナダドル	ALTAGAS LTD	131	28.91	3,787.21	
	ARC RESOURCES LTD	570	13.74	7,831.80	

CAMECO CORP	601	11.92	7,163.92
CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,025	44.63	135,005.75
CENOVUS ENERGY INC	3,225	13.22	42,634.50
CRESCENT POINT ENERGY CORP	815	11.21	9,136.15
ENBRIDGE INC	4,381	48.72	213,442.32
ENCANA CORP	2,330	16.94	39,470.20
HUSKY ENERGY INC	1,391	18.40	25,594.40
IMPERIAL OIL LTD	922	40.18	37,045.96
INTER PIPELINE LTD	811	25.66	20,810.26
KEYERA CORP	288	35.81	10,313.28
PEMBINA PIPELINE CORP	1,135	43.10	48,918.50
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	31.27	16,166.59
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	460	18.94	8,712.40
SUNCOR ENERGY INC	4,452	45.95	204,569.40
TOURMALINE OIL CORP	465	21.71	10,095.15
TRANSCANADA CORP	2,352	59.27	139,403.04
VERMILION ENERGY INC	90	49.62	4,465.80
AGNICO EAGLE MINES LTD	559	60.57	33,858.63
BARRICK GOLD CORP	3,467	18.54	64,278.18
CCL INDUSTRIES INC - CL B	250	59.13	14,782.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,487	19.00	28,253.00
FRANCO-NEVADA CORP	601	96.39	57,930.39
GOLDCORP INC	1,929	18.38	35,455.02
KINROSS GOLD CORP	3,281	5.68	18,636.08
LUNDIN MINING CORP	1,800	9.09	16,362.00
METHANEX CORP	342	74.83	25,591.86
NUTRIEN LTD	1,640	66.11	108,420.40
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,260	35.86	45,183.60
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	828	4.02	3,328.56
WEST FRASER TIMBER CO LTD	55	85.90	4,724.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,332	27.54	36,683.28
BOMBARDIER INC-B	8,071	3.14	25,342.94
CAE INC	869	22.70	19,726.30
FINNING INTERNATIONAL INC	736	33.56	24,700.16
SNC-LAVALIN GROUP INC	347	54.43	18,887.21

CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,061	98.01	201,998.61
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	416	231.21	96,183.36
LINAMAR CORP	39	74.44	2,903.16
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,012	73.40	74,280.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	486	41.58	20,207.88
RESTAURANT BRANDS INTERN	660	76.00	50,160.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,007	27.18	27,370.26
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	230	170.03	39,106.90
DOLLARAMA INC	325	163.28	53,066.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,210	66.30	80,223.00
EMPIRE CO LTD 'A'	133	25.53	3,395.49
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	68	24.48	1,664.64
LOBLAW COMPANIES LTD	713	69.26	49,382.38
METRO INC	786	41.31	32,469.66
WESTON (GEORGE) LTD	52	109.60	5,699.20
SAPUTO INC	344	42.70	14,688.80
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	1,200	24.51	29,412.00
BANK OF MONTREAL	1,766	103.70	183,134.20
BANK OF NOVA SCOTIA	3,148	81.82	257,569.36
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,194	122.21	145,918.74
NATIONAL BANK OF CANADA	1,043	64.91	67,701.13
ROYAL BANK OF CANADA	3,763	106.01	398,915.63
TORONTO-DOMINION BANK	4,771	74.04	353,244.84
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,320	52.31	121,359.20
CI FINANCIAL CORP	775	29.96	23,219.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	313	8.78	2,748.14
IGM FINANCIAL INC	81	43.73	3,542.13
ONEX CORPORATION	102	92.15	9,399.30
THOMSON REUTERS CORP	652	53.77	35,058.04
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	82	662.30	54,308.60
GREAT-WEST LIFECO INC	888	35.34	31,381.92
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	304	60.67	18,443.68
INTACT FINANCIAL CORP	423	102.64	43,416.72
MANULIFE FINANCIAL CORP	5,646	26.86	151,651.56
POWER CORP OF CANADA	1,247	31.96	39,854.12

	POWER FINANCIAL CORP	385	34.67	13,347.95	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,640	54.29	89,035.60	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	101	20.94	2,114.94	
	CGI GROUP INC - CLASS A	498	68.86	34,292.28	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	57	785.00	44,745.00	
	OPEN TEXT CORP	792	42.33	33,525.36	
	SHOPIFY INC - CLASS A	248	147.52	36,584.96	
	BLACKBERRY LTD	1,407	16.36	23,018.52	
	BCE INC	404	57.20	23,108.80	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,125	60.92	68,535.00	
	TELUS CORP	320	46.21	14,787.20	
	ATCO LTD -CLASS I	63	43.50	2,740.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	105	35.71	3,749.55	
	EMERA INC	50	46.37	2,318.50	
	FORTIS INC	1,219	43.21	52,672.99	
	HYDRO ONE LTD	550	21.93	12,061.50	
	カナダドル 小計	105,039		4,746,428.34 (421,103,122)	
ユーロ	ENAGAS SA	618	23.30	14,399.40	
	ENI SPA	6,888	14.91	102,700.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA	1,766	16.43	29,015.38	
	NESTE OYJ	294	56.58	16,634.52	
	OMV AG	261	55.20	14,407.20	
	REPSOL SA	3,343	15.82	52,886.26	
	SNAM SPA	5,331	3.96	21,110.76	
	TENARIS SA	1,257	14.37	18,063.09	
	TOTAL SA	6,425	47.55	305,508.75	
	VOPAK	56	38.25	2,142.00	
	AIR LIQUIDE SA	1,148	107.55	123,467.40	
	AKZO NOBEL	781	74.90	58,496.90	
	ARCELORMITTAL	1,870	29.21	54,622.70	
	ARKEMA	230	106.45	24,483.50	
	BASF SE	2,368	96.24	227,896.32	
	COVESTRO AG	507	93.30	47,303.10	
	CRH PLC	2,273	31.04	70,553.92	

EVONIK INDUSTRIES AG	393	32.01	12,579.93
FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	42.88	2,401.28
HEIDELBERGCEMENT AG	469	90.40	42,397.60
IMERYS SA	29	82.50	2,392.50
K+S AG-REG	153	22.82	3,491.46
KONINKLIJKE DSM NV	506	84.38	42,696.28
LANXESS AG	313	71.56	22,398.28
LINDE AG - TENDER	478	196.50	93,927.00
SOLVAY SA	188	118.35	22,249.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,835	14.09	25,864.32
SYMRISE AG	275	67.70	18,617.50
THYSSENKRUPP AG	1,218	25.75	31,363.50
UMICORE	352	43.32	15,248.64
UPM-KYMMENE OYJ	1,183	26.94	31,870.02
VOESTALPINE AG	187	53.58	10,019.46
(Right)ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	663	0.44	292.78
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	663	33.05	21,912.15
AIRBUS SE	1,570	90.50	142,085.00
ALSTOM	344	36.41	12,525.04
ANDRITZ AG	216	49.24	10,635.84
BOSKALIS WESTMINSTER	71	32.13	2,281.23
BOUYGUES SA	702	45.46	31,912.92
BRENTAG AG	525	53.90	28,297.50
CNH INDUSTRIAL NV	2,356	11.93	28,107.08
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	1,421	47.15	67,000.15
DASSAULT AVIATION SA	2	1,352.00	2,704.00
EIFFAGE	126	96.50	12,159.00
FERROVIAL SA	1,385	18.73	25,947.97
GEA GROUP AG	434	40.60	17,620.40
HOCHTIEF AG	17	150.30	2,555.10
KION GROUP AG	150	76.26	11,439.00
KONE OYJ-B	977	45.79	44,736.83
LEGRAND SA	730	66.52	48,559.60
LEONARDO SPA	873	10.96	9,568.08
MAN SE	28	96.00	2,688.00

METSO OYJ	90	28.42	2,557.80
MTU AERO ENGINES AG	120	150.40	18,048.00
OSRAM LICHT AG	172	73.46	12,635.12
PRYSMIAN SPA	363	29.16	10,585.08
REXEL SA	790	14.92	11,786.80
SAFRAN SA	915	90.02	82,368.30
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,528	75.66	115,608.48
SIEMENS AG-REG	1,985	123.30	244,750.50
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	12.85	5,140.00
THALES SA	211	88.86	18,749.46
VINCI SA	1,350	86.96	117,396.00
WARTSILA OYJ ABP	445	54.78	24,377.10
ZODIAC AEROSPACE	744	25.02	18,614.88
BUREAU VERITAS SA	842	23.75	19,997.50
EDENRED	716	26.00	18,616.00
RANDSTAD HOLDING NV	211	57.32	12,094.52
RELX NV	2,572	18.03	46,386.02
SOCIETE BIC SA	23	95.60	2,198.80
TELEPERFORMANCE	135	120.80	16,308.00
WOLTERS KLUWER	954	43.14	41,155.56
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,913	19.04	36,423.52
ADP	115	162.70	18,710.50
AENA SME SA	162	177.60	28,771.20
ATLANTIA SPA	1,322	26.62	35,191.64
BOLLORE	740	4.67	3,455.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	526	29.00	15,254.00
DEUTSCHE POST AG-REG	2,595	39.95	103,670.25
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	35	95.50	3,342.50
GETLINK	1,078	11.16	12,030.48
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	2,724	7.46	20,331.93
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	905	93.91	84,988.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	224	80.10	17,942.40
CONTINENTAL AG	306	245.80	75,214.80
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,526	75.41	190,485.66
FAURECIA	200	73.62	14,724.00

FERRARI NV	335	95.60	32,026.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,963	19.44	57,600.72
MICHELIN (CGDE)	462	126.60	58,489.20
NOKIAN RENKAAT OYJ	123	39.81	4,896.63
PEUGEOT SA	1,844	18.52	34,150.88
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	427	76.80	32,793.60
RENAULT SA	537	90.48	48,587.76
SCHAEFFLER AG	135	15.84	2,139.07
VALEO SA	649	64.64	41,951.36
VOLKSWAGEN AG	79	185.00	14,615.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	508	184.50	93,726.00
ADIDAS AG	528	184.55	97,442.40
HERMES INTERNATIONAL	92	444.00	40,848.00
HUGO BOSS AG -ORD	184	75.26	13,847.84
KERING	214	406.20	86,926.80
LUXOTTICA GROUP SPA	514	50.80	26,111.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	745	241.20	179,694.00
SEB SA	21	167.90	3,525.90
ACCOR SA	567	45.54	25,821.18
PADDY POWER BETFAIR PLC	291	93.95	27,339.45
SODEXO	260	105.65	27,469.00
ALTICE NV - A	1,205	9.25	11,155.89
AXEL SPRINGER SE	35	69.70	2,439.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	19.19	7,850.75
JC DECAUX SA	60	36.18	2,170.80
LAGARDERE SCA	94	25.40	2,387.60
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	836	29.60	24,745.60
PUBLICIS GROUPE	609	56.70	34,530.30
RTL GROUP	32	68.90	2,204.80
SES	1,135	13.42	15,231.70
TELENET GROUP HOLDING NV	192	61.10	11,731.20
VIVENDI	2,866	23.59	67,608.94
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2,922	29.00	84,738.00
ZALANDO SE	220	47.53	10,456.60
CARREFOUR SA	1,308	19.33	25,283.64

CASINO GUICHARD PERRACHON	45	47.75	2,148.75
COLRUYT SA	54	44.68	2,412.72
JERONIMO MARTINS	703	17.38	12,218.14
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	3,570	18.13	64,745.52
METRO AG	170	17.17	2,918.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,024	92.03	186,268.72
DANONE	1,572	70.22	110,385.84
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	1,400	6.28	8,799.00
HEINEKEN HOLDING NV	257	83.85	21,549.45
HEINEKEN NV	713	89.32	63,685.16
KERRY GROUP PLC-A	445	87.80	39,071.00
PERNOD RICARD SA	560	128.40	71,904.00
REMY COINTREAU	18	105.60	1,900.80
BEIERSDORF AG	287	96.60	27,724.20
HENKEL AG & CO KGAA	335	102.60	34,371.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	487	112.50	54,787.50
L'OREAL	665	184.10	122,426.50
UNILEVER NV-CVA	4,117	46.87	192,984.37
BIOMERIEUX	110	74.50	8,195.00
ESSILOR INTERNATIONAL	599	112.80	67,567.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	598	90.86	54,334.28
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,127	68.56	77,267.12
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,549	33.29	84,856.21
BAYER AG-REG	2,135	108.60	231,861.00
EUROFINS SCIENTIFIC	19	533.00	10,127.00
GRIFOLS SA	422	26.45	11,161.90
IPSEN	65	114.45	7,439.25
MERCK KGAA	345	90.24	31,132.80
ORION OYJ-CLASS B	184	32.85	6,044.40
QIAGEN N.V.	673	27.25	18,339.25
RECORDATI SPA	180	37.82	6,807.60
SANOFI	2,913	72.00	209,736.00
UCB SA	442	70.24	31,046.08
ABN AMRO GROUP NV-CVA	956	27.16	25,964.96
AIB GROUP PLC	2,000	5.56	11,120.00



BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	17,606	7.48	131,692.88
BANCO DE SABADELL SA	17,468	1.89	33,075.65
BANCO SANTANDER SA	41,978	5.98	251,112.39
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,600	7.99	12,792.00
BANKIA SA	1,600	4.27	6,835.20
BANKINTER SA	1,044	8.67	9,057.74
BNP PARIBAS	2,930	67.18	196,837.40
CAIXABANK S.A	11,205	4.31	48,315.96
COMMERZBANK AG	3,378	13.53	45,717.85
CREDIT AGRICOLE SA	3,169	15.30	48,485.70
ERSTE GROUP BANK AG	993	40.81	40,524.33
ING GROEP NV-CVA	10,117	16.21	164,077.50
INTESA SANPAOLO	36,003	3.08	110,961.24
INTESA SANPAOLO-RSP	804	2.99	2,403.96
KBC GROEP NV	705	76.20	53,721.00
MEDIOBANCA SPA	1,301	9.97	12,970.97
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	603	34.86	21,020.58
SOCIETE GENERALE SA	2,103	46.00	96,738.00
UNICREDIT SPA	5,386	17.69	95,278.34
AMUNDI SA	140	72.60	10,164.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,427	15.80	85,746.60
DEUTSCHE BOERSE AG	510	104.15	53,116.50
EURAZEO	33	85.70	2,828.10
EXOR NV	398	62.80	24,994.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	287	96.32	27,643.84
NATIXIS	3,105	7.35	22,821.75
WENDEL	24	150.30	3,607.20
AEGON NV	4,056	5.62	22,802.83
AGEAS	466	43.12	20,093.92
ALLIANZ SE-REG	1,168	204.55	238,914.40
ASSICURAZIONI GENERALI	3,339	16.19	54,058.41
AXA SA	5,172	27.07	140,031.90
CNP ASSURANCES	139	20.38	2,832.82
HANNOVER RUECK SE	166	112.60	18,691.60
MAPFRE SA	942	2.89	2,727.09

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	428	191.90	82,133.20
NN GROUP NV	627	38.48	24,126.96
POSTE ITALIANE SPA	418	6.65	2,779.70
SAMPO OYJ-A SHS	1,249	48.22	60,226.78
SCOR SE	382	36.26	13,851.32
UNIPOLSAI SPA	887	2.05	1,818.35
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,118	35.95	40,192.10
VONOVIA SE	1,333	40.50	53,986.50
AMADEUS IT GROUP SA	1,181	63.64	75,158.84
ATOS SE	214	128.05	27,402.70
CAPGEMINI SA	454	107.05	48,600.70
DASSAULT SYSTEMES SA	299	93.14	27,848.86
SAP SE	2,543	92.17	234,388.31
UBISOFT ENTERTAINMENT	145	68.36	9,912.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	260	58.00	15,080.00
WIRECARD AG	250	96.72	24,180.00
INGENICO GROUP	134	90.86	12,175.24
NOKIA OYJ	15,976	3.97	63,424.72
1&1 DRILLISCH AG	130	68.10	8,853.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,867	14.67	130,078.89
ELISA OYJ	300	32.86	9,858.00
ILIAD SA	98	213.50	20,923.00
KONINKLIJKE KPN NV	9,944	2.86	28,459.72
ORANGE	5,352	14.67	78,540.60
PROXIMUS	252	27.87	7,023.24
TELECOM ITALIA SPA	34,468	0.73	25,333.98
TELECOM ITALIA-RSP	9,717	0.62	6,048.83
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	4.06	2,522.78
TELEFONICA SA	12,132	8.42	102,187.83
E.ON SE	5,815	8.84	51,439.49
EDF	1,002	11.24	11,262.48
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	4,450	2.88	12,829.35
ENDESA SA	547	18.68	10,220.69
ENEL SPA	21,833	5.18	113,094.94
ENGIE	5,151	14.17	73,015.42

	FORTUM OYJ	1,376	18.13	24,946.88
	GAS NATURAL SDG SA	1,082	19.92	21,558.85
	IBERDROLA SA	15,415	6.75	104,112.91
	INNOGY SE	220	32.52	7,154.40
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,050	17.68	18,569.25
	RWE AG	1,501	17.16	25,764.66
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	667	11.71	7,813.90
	TERNA SPA	5,075	4.87	24,725.40
	UNIPER SE	490	24.58	12,044.20
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,308	20.53	26,853.24
	ASML HOLDING NV	1,018	163.30	166,239.40
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,016	23.94	72,203.04
	STMICROELECTRONICS NV	1,955	18.79	36,734.45
	ユーロ 小計	510,495		10,920,379.95 (1,482,550,782)
英債券	BP PLC	53,767	5.15	277,168.88
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	12,350	25.03	309,182.25
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	9,407	25.53	240,207.74
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	1,050	6.92	7,266.00
	ANGLO AMERICAN PLC	3,713	17.36	64,487.38
	ANTOFAGASTA PLC	1,120	9.59	10,743.04
	BHP BILLITON PLC	5,401	15.60	84,288.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	296	44.80	13,260.80
	FRESNILLO PLC	180	13.84	2,492.10
	GLENCORE PLC	33,338	3.97	132,351.86
	JOHNSON MATTHEY PLC	482	32.20	15,520.40
	MONDI PLC	1,010	18.99	19,179.90
	RANDGOLD RESOURCES LTD	268	72.62	19,462.16
	RIO TINTO PLC	3,238	39.18	126,881.03
	ASHTREAD GROUP PLC	1,159	20.86	24,176.74
	BAE SYSTEMS PLC	8,993	5.65	50,828.43
	BUNZL PLC	1,003	19.41	19,468.23
	COBHAM PLC	1,372	1.31	1,801.43
	DCC PLC	182	75.15	13,677.30
	FERGUSON PLC	575	54.70	31,452.50

IMI PLC	819	13.34	10,925.46
MEGGITT PLC	2,323	4.72	10,964.56
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,673	8.61	40,262.56
SMITHS GROUP PLC	661	16.39	10,833.79
TRAVIS PERKINS PLC	751	14.62	10,979.62
WEIR GROUP PLC/THE	572	22.16	12,675.52
BABCOCK INTL GROUP PLC	204	7.22	1,474.51
CAPITA PLC	2,039	3.54	7,230.29
EXPERIAN PLC	2,573	16.31	41,978.49
G4S PLC	2,741	2.86	7,844.74
INTERTEK GROUP PLC	466	50.48	23,523.68
RELX PLC	2,928	15.86	46,438.08
EASYJET PLC	130	16.79	2,182.70
ROYAL MAIL PLC	732	4.66	3,411.85
GKN PLC	5,570	4.34	24,207.22
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,771	6.09	10,799.55
BERKELEY GROUP HOLDINGS	280	41.18	11,530.40
BURBERRY GROUP PLC	1,245	16.21	20,181.45
PERSIMMON PLC	752	26.40	19,852.80
TAYLOR WIMPEY PLC	9,369	1.97	18,541.25
CARNIVAL PLC	433	49.04	21,234.32
COMPASS GROUP PLC	4,270	15.06	64,327.55
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	424	48.23	20,449.52
MERLIN ENTERTAINMENT	2,373	3.40	8,068.20
TUI AG-DI	1,248	16.16	20,167.68
WHITBREAD PLC	513	39.34	20,181.42
ITV PLC	5,160	1.68	8,668.80
PEARSON PLC	2,390	6.91	16,519.68
SKY PLC	2,898	10.23	29,661.03
WPP PLC	3,951	13.02	51,461.77
KINGFISHER PLC	6,032	3.42	20,653.56
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,884	3.05	8,801.96
NEXT PLC	446	49.12	21,907.52
SAINSBURY (J) PLC	3,694	2.58	9,563.76
TESCO PLC	21,865	2.08	45,675.98

WM MORRISON SUPERMARKETS	3,127	2.26	7,079.52
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,145	27.84	31,876.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	6,210	49.76	309,009.60
COCA-COLA HBC AG-DI	149	24.10	3,590.90
DIAGEO PLC	6,605	25.42	167,932.12
IMPERIAL BRANDS PLC	2,607	29.20	76,124.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,765	69.09	121,943.85
UNILEVER PLC	3,246	40.36	131,024.79
CONVATEC GROUP PLC	2,000	2.01	4,034.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	301	6.16	1,856.56
SMITH & NEPHEW PLC	2,919	12.42	36,253.98
ASTRAZENECA PLC	3,270	49.71	162,551.70
GLAXOSMITHKLINE PLC	12,793	13.47	172,321.71
SHIRE PLC	2,391	34.24	81,867.84
BARCLAYS PLC	46,075	2.08	96,066.37
HSBC HOLDINGS PLC	53,907	7.71	415,892.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	193,358	0.72	139,217.76
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	11,628	2.97	34,616.55
STANDARD CHARTERED PLC	8,949	8.25	73,909.79
3I GROUP PLC	2,221	9.25	20,544.25
HARGREAVES LANSDOWN PLC	692	18.93	13,099.56
INVESTEC PLC	502	5.53	2,776.06
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	680	39.88	27,118.40
SCHRODERS PLC	320	36.62	11,718.40
ST JAMES'S PLACE PLC	1,749	12.39	21,678.85
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	5,860	4.35	25,532.02
ADMIRAL GROUP PLC	172	18.49	3,181.14
AVIVA PLC	12,062	5.21	62,867.14
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	3,088	3.70	11,428.68
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	18,019	2.74	49,390.07
OLD MUTUAL PLC	15,932	2.38	38,061.54
PRUDENTIAL PLC	6,871	19.36	133,056.91
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,912	6.16	11,777.92
AUTO TRADER GROUP PLC	805	3.46	2,785.30
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	860	21.71	18,670.60

	SAGE GROUP PLC/THE	3,559	7.68	27,340.23
	BT GROUP PLC	23,103	2.61	60,391.24
	VODAFONE GROUP PLC	70,050	2.25	157,822.65
	CENTRICA PLC	10,312	1.36	14,075.88
	NATIONAL GRID PLC	9,348	8.05	75,335.53
	SEVERN TRENT PLC	282	19.93	5,621.67
	SSE PLC	2,236	12.79	28,609.62
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,011	7.47	15,038.25
	英ポンド 小計	793,175		5,072,170.09 (790,294,821)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	28.38	16,460.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	23	691.50	15,904.50
	GIVAUDAN-REG	26	2,258.00	58,708.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,223	58.60	71,667.80
	SIKA AG-BR	5	8,250.00	41,250.00
	ABB LTD-REG	4,986	26.91	134,173.26
	GEBERIT AG-REG	106	457.60	48,505.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	52	230.80	12,001.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	117	237.20	27,752.40
	ADECCO SA-REG	451	78.22	35,277.22
	SGS SA-REG	12	2,543.00	30,516.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	155	175.60	27,218.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1,415	88.70	125,510.50
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	96	406.30	39,004.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	41	77.30	3,169.30
	DUFREY AG-REG	57	153.00	8,721.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	1,927.00	3,854.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	5	5,830.00	29,150.00
	NESTLE SA-REG	8,353	82.50	689,122.50
	SONOVA HOLDING AG-REG	89	150.90	13,430.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	16	717.00	11,472.00
	LONZA GROUP AG-REG	203	268.00	54,404.00
	NOVARTIS AG-REG	5,983	85.90	513,939.70
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,893	234.50	443,908.50
	VIFOR PHARMA AG	30	136.90	4,107.00

	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	6,512	18.53	120,667.36	
	JULIUS BAER GROUP LTD	471	64.18	30,228.78	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	87.30	2,531.70	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	49	728.50	35,696.50	
	UBS GROUP AG-REG	9,708	19.43	188,626.44	
	BALOISE HOLDING AG - REG	58	156.80	9,094.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	93	358.30	33,321.90	
	SWISS RE AG	858	94.90	81,424.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	409	316.30	129,366.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	195	90.10	17,569.50	
	SWISSCOM AG-REG	87	520.40	45,274.80	
	スイスフラン 小計	44,388		3,153,030.46 (364,963,275)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	151	206.30	31,151.30	
	BOLIDEN AB	792	287.70	227,858.40	
	ALFA LAVAL AB	659	207.50	136,742.50	
	ASSA ABLOY AB-B	2,811	177.35	498,530.85	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,958	375.30	734,837.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	760	331.80	252,168.00	
	SANDVIK AB	3,314	157.75	522,783.50	
	SKANSKA AB-B SHS	566	161.05	91,154.30	
	SKF AB-B SHARES	1,113	197.45	219,761.85	
	VOLVO AB-B SHS	4,181	164.55	687,983.55	
	SECURITAS AB-B SHS	933	149.60	139,576.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	732	267.00	195,444.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	337	81.64	27,512.68	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,567	157.68	404,764.56	
	ICA GRUPPEN AB	65	311.80	20,267.00	
	SWEDISH MATCH AB	558	335.50	187,209.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,663	234.20	389,474.60	
	GETINGE AB-B SHS	163	115.95	18,899.85	
	NORDEA BANK AB	8,237	100.75	829,877.75	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,730	100.85	477,020.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,155	117.00	486,135.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,457	203.90	500,982.30	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	133	217.70	28,954.10	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	481	294.60	141,702.60	
	INVESTOR AB-B SHS	1,249	400.30	499,974.70	
	LUNDBERGS AB-B SHS	45	650.50	29,272.50	
	ERICSSON LM-B SHS	8,301	56.48	468,840.48	
	HEXAGON AB-B SHS	721	467.10	336,779.10	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	280	591.00	165,480.00	
	TELE2 AB-B SHS	965	96.54	93,161.10	
	TELIA CO AB	5,963	37.42	223,135.46	
	スウェーデンクローナ 小計	61,040		9,067,435.73 (125,221,287)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	3,201	187.30	599,547.30	
	NORSK HYDRO ASA	3,829	58.22	222,924.38	
	YARA INTERNATIONAL ASA	339	378.60	128,345.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	71	241.00	17,111.00	
	MARINE HARVEST	996	134.80	134,260.80	
	ORKLA ASA	2,391	81.80	195,583.80	
	DNB ASA	2,804	161.40	452,565.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	160.20	106,052.40	
	TELENOR ASA	2,080	184.00	382,720.00	
	ノルウェークローネ 小計	16,373		2,239,110.68 (31,616,242)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	211	544.60	114,910.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	515	335.90	172,988.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	622	423.70	263,541.40	
	ISS A/S	284	242.30	68,813.20	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	10	11,050.00	110,500.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	14	11,600.00	162,400.00	
	DSV A/S	434	492.80	213,875.20	
	PANDORA A/S	337	596.40	200,986.80	
	CARLSBERG AS-B	198	763.40	151,153.20	
	COLOPLAST-B	357	531.20	189,638.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	100	184.70	18,470.00	
	GENMAB A/S	207	1,114.50	230,701.50	
H LUNDBECK A/S	120	319.70	38,364.00		



	NOVO NORDISK A/S-B	5,149	347.65	1,790,049.85
	DANSKE BANK A/S	2,073	245.50	508,921.50
	TRYG A/S	94	151.60	14,250.40
	TDC A/S	2,471	39.70	98,098.70
	ORSTED A/S	431	350.40	151,022.40
	デンマーククローネ 小計	13,627		4,498,685.65 (82,011,039)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	829	35.28	29,247.12
	OIL SEARCH LTD	3,517	7.90	27,784.30
	ORIGIN ENERGY LTD	4,126	9.27	38,248.02
	SANTOS LTD	6,493	5.24	34,023.32
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,581	33.90	87,495.90
	ALUMINA LTD	7,748	2.45	18,982.60
	AMCOR LIMITED	2,572	14.64	37,654.08
	BHP BILLITON LIMITED	8,507	30.68	260,994.76
	BLUESCOPE STEEL LTD	2,175	15.10	32,842.50
	BORAL LTD	3,791	7.76	29,418.16
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,154	5.02	15,833.08
	INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.76	20,085.92
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,651	21.44	35,397.44
	NEWCREST MINING LTD	2,137	22.85	48,830.45
	ORICA LTD	747	19.01	14,200.47
	RIO TINTO LTD	1,118	78.20	87,427.60
	SOUTH32 LTD	14,348	3.82	54,809.36
	CIMIC GROUP LTD	82	48.41	3,969.62
	BRAMBLES LTD	4,330	9.89	42,823.70
	SEEK LTD	909	19.42	17,652.78
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,129	4.60	23,593.40
	SYDNEY AIRPORT	2,292	7.03	16,112.76
	TRANSURBAN GROUP	6,006	12.19	73,213.14
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,336	24.01	32,077.36	
CROWN RESORTS LTD	773	13.09	10,118.57	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	49	46.78	2,292.22	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	50.09	2,203.96	
TABCORP HOLDINGS LTD	5,825	5.11	29,765.75	

HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	4.40	1,944.80	
WESFARMERS LTD	3,074	43.72	134,395.28	
WOOLWORTHS GROUP LTD	3,542	27.19	96,306.98	
COCA-COLA AMATIL LTD	469	8.25	3,869.25	
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,522	16.90	25,721.80	
COCHLEAR LTD	117	171.00	20,007.00	
HEALTHSCOPE LTD	1,394	1.94	2,711.33	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	511	69.23	35,376.53	
SONIC HEALTHCARE LTD	1,331	23.10	30,746.10	
CSL LTD	1,242	147.83	183,604.86	
AUST AND NZ BANKING GROUP	7,442	28.80	214,329.60	
BANK OF QUEENSLAND LTD	304	12.33	3,748.32	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	368	11.40	4,195.20	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,777	78.65	375,711.05	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,947	29.23	203,060.81	
WESTPAC BANKING CORP	8,715	31.01	270,252.15	
AMP LTD	5,656	5.20	29,411.20	
ASX LTD	342	54.70	18,707.40	
CHALLENGER LTD	1,796	14.01	25,161.96	
MACQUARIE GROUP LTD	903	104.40	94,273.20	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	5,369	7.16	38,442.04	
MEDIBANK PRIVATE LTD	5,841	3.29	19,216.89	
QBE INSURANCE GROUP LTD	3,777	10.99	41,509.23	
SUNCORP GROUP LTD	3,548	13.66	48,465.68	
LENDLEASE GROUP	1,068	15.99	17,077.32	
COMPUTERSHARE LTD	1,073	16.79	18,015.67	
REA GROUP LTD	43	74.80	3,216.40	
TELSTRA CORP LTD	9,588	3.57	34,229.16	
TPG TELECOM LTD	287	6.37	1,828.19	
AGL ENERGY LTD	2,185	23.85	52,112.25	
APA GROUP	3,668	8.06	29,564.08	
AUSNET SERVICES	1,437	1.71	2,464.45	
オーストラリアドル 小計	186,389		3,206,774.52 (283,158,190)	
ニュージーラン	FLETCHER BUILDING LTD	914	7.51	6,864.14

ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,787	6.69	25,353.96
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,400	13.10	18,340.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	10.97	17,519.09
	SPARK NEW ZEALAND LTD	3,528	3.50	12,348.00
	MERCURY NZ LTD	567	3.37	1,913.62
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,074	2.83	3,039.42
	ニュージーランドドル 小計	12,867		85,378.23 (6,872,947)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,500	104.60	784,500.00
	NWS HOLDINGS LTD	1,000	15.20	15,200.00
	MTR CORP	4,500	44.80	201,600.00
	MINTH GROUP LTD	2,000	45.35	90,700.00
	LI & FUNG LTD	4,000	4.09	16,360.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	3,500	49.50	173,250.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	35.15	17,575.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,000	66.35	398,100.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	800	25.10	20,080.00
	SANDS CHINA LTD	8,200	48.15	394,830.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	2,000	18.96	37,920.00
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.54	17,080.00
	WYNN MACAU LTD	5,200	29.50	153,400.00
	WH GROUP LTD	33,000	9.14	301,620.00
	BANK OF EAST ASIA	3,600	34.20	123,120.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,000	41.90	419,000.00
	HANG SENG BANK LTD	1,600	186.90	299,040.00
	FIRST PACIFIC CO	2,000	5.74	11,480.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,300	301.40	994,620.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	10,000	9.09	90,900.00
	AIA GROUP LTD	31,600	66.90	2,114,040.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	7,500	74.60	559,500.00
	HANG LUNG GROUP LTD	1,200	31.00	37,200.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	21.05	63,150.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	3,650	52.30	190,895.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	2,300	46.00	105,800.00	
KERRY PROPERTIES LTD	500	35.30	17,650.00	

	NEW WORLD DEVELOPMENT	20,000	12.48	249,600.00	
	SINO LAND CO	6,000	14.70	88,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,700	134.00	495,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	700	79.65	55,755.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	27.00	135,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	31.55	63,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	52.35	209,400.00	
	WHEELOCK & CO LTD	3,400	61.25	208,250.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	6,000	9.73	58,380.00	
	PCCW LTD	4,000	4.50	18,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,400	67.05	93,870.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,500	78.20	351,900.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.21	3,605.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	24,000	15.36	368,640.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	4,500	66.50	299,250.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	200	112.90	22,580.00	
	香港ドル 小計	250,350		10,369,940.00	(145,282,859)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	4,600	8.63	39,698.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	800	3.47	2,776.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	3.46	10,380.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	1.60	2,400.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	6,700	2.12	14,204.00	
	SATS LTD	1,200	5.73	6,876.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,300	11.46	26,358.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	10,800	1.39	15,012.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,600	2.69	4,304.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	40.95	4,095.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,700	0.38	2,194.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,600	3.21	11,556.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,900	27.17	133,133.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	8,600	13.29	114,294.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,700	28.38	105,006.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,300	8.40	10,920.00	
	CAPITALAND LTD	5,200	3.85	20,020.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,600	13.28	21,248.00	
	UOL GROUP LTD	2,300	9.33	21,459.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	22,400	3.64	81,536.00	
	STARHUB LTD	600	2.99	1,794.00	
	シンガポールドル 小計	92,500		649,263.50 (54,343,354)	
イスラエルシ ケル	FRUTAROM	166	328.50	54,531.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	407	15.05	6,125.35	
	ELBIT SYSTEMS LTD	52	476.50	24,778.00	
	BANK HAPOALIM BM	2,520	25.47	64,184.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,096	21.26	87,080.96	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	110	64.80	7,128.00	
	AZRIELI GROUP	34	181.90	6,184.60	
	NICE SYSTEMS LTD	153	315.70	48,302.10	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,770	5.65	10,000.50	
	イスラエルシケル 小計	9,308		308,314.91 (9,887,659)	
	合 計	2,895,972		10,935,609,945 (10,935,609,945)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	654	12,896.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	229	28,995.98	
		AMERICAN TOWER CORP	1,134	160,755.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3,062	34,018.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	369	63,394.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	409	50,405.16	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	521	8,846.58	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	192	16,598.40	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	820	8,118.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,091	119,562.69	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	548	60,745.80	
	DUKE REALTY CORP	601	15,638.02	
	EQUINIX INC	204	90,025.20	
	EQUITY RESIDENTIAL	967	59,412.48	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	181	41,910.55	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	436	37,295.44	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	126	15,525.72	
	GGP INC	1,697	40,134.05	
	HCP INC	1,316	31,860.36	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1,995	42,473.55	
	INVITATION HOMES INC	800	18,072.00	
	IRON MOUNTAIN INC	625	22,356.25	
	KIMCO REALTY CORP	1,097	17,914.01	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	348	14,581.20	
	MACERICH CO/THE	178	11,981.18	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	309	29,234.49	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	210	8,586.90	
	PROLOGIS INC	1,378	88,853.44	
	PUBLIC STORAGE	412	80,307.04	
	REALTY INCOME CORP	935	50,499.35	
	REGENCY CENTERS CORP	259	16,653.70	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	387	65,383.65	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	812	134,873.20	
	SL GREEN REALTY CORP	174	16,874.52	
	UDR INC	643	23,675.26	
	VENTAS INC	953	53,263.17	
	VEREIT INC	1,599	11,896.56	
	VORNADO REALTY TRUST	453	32,951.22	
	WELLTOWER INC	998	60,418.92	
	WEYERHAEUSER CO	2,009	75,518.31	
	米ドル 小計	31,131	1,772,508.09 (194,089,635)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,412.24	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	130	3,182.40	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,647.77	

	カナダドル 小計	297	7,242.41 (642,546)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	27	2,403.00
	GECINA SA	93	14,768.40
	ICADE	30	2,601.00
	KLEPIERRE	683	24,635.81
	UNIBAIL-RODAMCO SE	276	57,076.80
	ユーロ 小計	1,109	101,485.01 (13,777,604)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	3,094	21,002.07
	HAMMERSON PLC	1,987	9,899.23
	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,295	23,018.85
	SEGRO PLC	1,601	9,144.91
	英ポンド 小計	8,977	63,065.06 (9,826,166)
オーストラリアドル	DEXUS	3,337	32,202.05
	GOODMAN GROUP	5,498	44,753.72
	GPT GROUP	3,440	17,268.80
	MIRVAC GROUP	7,208	16,001.76
	SCENTRE GROUP	15,297	62,564.73
	STOCKLAND	7,747	33,389.57
	VICINITY CENTRES	8,539	22,542.96
	WESTFIELD CORP	5,925	54,450.75
	オーストラリアドル 小計	56,991	283,174.34 (25,004,294)
香港ドル	LINK REIT	6,500	461,500.00
	香港ドル 小計	6,500	461,500.00 (6,465,615)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	8,600	23,822.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,600	14,516.00
	CAPITALAND MALL TRUST	8,100	16,848.00
	SUNTEC REIT	8,500	18,275.00
	シンガポールドル 小計	32,800	73,461.00 (6,148,685)
	合計		255,954,545 (255,954,545)

(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 602銘柄	97.4%		63.7%
	投資証券 40銘柄		2.6%	1.7%
カナダドル	株式 88銘柄	99.8%		3.8%
	投資証券 3銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	99.1%		13.2%
	投資証券 5銘柄		0.9%	0.1%
英ポンド	株式 98銘柄	98.8%		7.1%
	投資証券 4銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%		3.3%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
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 60銘柄	91.9%		2.5%
	投資証券 8銘柄		8.1%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 43銘柄	95.7%		1.3%
	投資証券 1銘柄		4.3%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	89.8%		0.5%
	投資証券 4銘柄		10.2%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%		0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



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

## R A M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	107,624,025
コール・ローン	4,338,085
株式	2,924,142,908
投資証券	12,238,849
派生商品評価勘定	18,678,510
未収入金	29,136
未収配当金	1,845,339
差入委託証拠金	76,386,105
流動資産合計	3,145,282,957
資産合計	
3,145,282,957	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	548
未払解約金	26,000
未払利息	11
流動負債合計	26,559
負債合計	
26,559	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,079,461,070
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,065,795,328
元本等合計	3,145,256,398
純資産合計	
3,145,256,398	
負債純資産合計	
3,145,282,957	

### 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。</p> <p>投資証券</p>
-------------------	---

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	1,201,490,791円
期中追加設定元本額	1,574,058,655円
期中一部解約元本額	696,088,376円
期末元本額	2,079,461,070円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	305,243,401円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	922,358,299円
りそなラップ型ファンド(成長型)	169,382,629円
DCりそな グローバルバランス	1,537,182円
つみたてバランスファンド	757,217円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	676,389,950円
Smart-i 新興国株式インデックス	3,639,383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)	153,009円
2. 計算日における受益権の総数	2,079,461,070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	1.5125円

(10,000口当たり純資産額)

(15,125円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

これらは、株価変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、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、運用委員会に報告します。

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

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		404,802,247
投資証券		170,255
合計		404,631,992

(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）

（平成30年 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	189,656,738	-	208,334,700	18,677,962
合計		189,656,738	-	208,334,700	18,677,962

## （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。

## 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	25,200	5.25	132,350.40	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,970	68.24	134,432.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	400	133.00	53,200.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	5,800	6.10	35,380.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	7,000	5.31	37,205.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	1,300	60.44	78,572.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	800	15.82	12,656.00	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	1,150	10.20	11,730.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3,180	20.18	64,172.40	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	450	26.90	12,105.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	600	16.50	9,900.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	330	40.70	13,431.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	1,250	16.41	20,512.50	
	SOUTHERN COPPER CORP	360	49.99	17,996.40	
	DP WORLD LTD	950	26.86	25,517.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	650	90.02	58,513.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,200	28.51	34,212.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,650	47.41	78,226.50	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	1,820	44.84	81,608.80	
	JD.COM INC-ADR	3,020	46.74	141,154.80	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1,500	16.44	24,660.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,850	26.65	49,302.50	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	5,000	4.48	22,425.00	
	CREDICORP LTD	325	236.53	76,872.25	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	11,500	18.97	218,212.50	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	14,500	1.90	27,608.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	4,000	1.51	6,040.00		
58.COM INC-ADR	360	83.62	30,103.20		

	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	5,230	195.53	1,022,621.90	
	AUTOHOME INC-ADR	220	84.06	18,493.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,252	257.96	322,965.92	
	MOMO INC-SPON ADR	350	29.00	10,150.00	
	NETEASE INC-ADR	356	324.63	115,568.28	
	SINA CORP	230	118.02	27,144.60	
	WEIBO CORP-SPON ADR	230	128.58	29,573.40	
	YY INC-ADR	220	138.92	30,562.40	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	2,600	11.59	30,134.00	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	11,700	1.34	15,748.20	
	米ドル 小計	120,503		3,131,060.95 (342,851,174)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	71,000	15.58	1,106,180.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	18,000	65.55	1,179,900.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	590	438.80	258,892.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	4,500	53.98	242,910.00	
	ALFA S.A.B.-A	15,400	23.75	365,750.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,000	67.05	134,100.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,300	201.57	262,041.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,150	364.72	419,428.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	800	188.30	150,640.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	12,100	77.70	940,170.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	800	135.30	108,240.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	25,400	47.30	1,201,420.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	138.36	249,048.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	1,800	145.33	261,594.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	8,700	184.09	1,601,583.00	
	GRUMA S.A.B.-B	860	230.13	197,911.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	6,400	46.56	297,984.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	2,600	29.48	76,648.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	6,600	34.21	225,786.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	7,300	28.75	209,875.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	11,200	116.84	1,308,608.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	9,000	34.51	310,590.00	
	GENTERA SAB DE CV	4,200	16.79	70,518.00	

	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	157,500	17.47	2,751,525.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	2,300	95.62	219,926.00	
	メキシコペソ 小計	373,300		14,151,267.80	(83,633,992)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	700	44.20	30,940.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	30,900	19.34	597,606.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,800	81.01	145,818.00	
	BRASKEM SA-PREF A	800	50.86	40,688.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	1,100	53.23	58,553.00	
	GERDAU SA-PREF	4,000	14.14	56,560.00	
	KLABIN SA - UNIT	2,600	17.92	46,592.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,800	20.89	37,602.00	
	VALE SA	13,600	41.78	568,208.00	
	EMBRAER SA	2,400	19.80	47,520.00	
	WEG SA	2,500	24.90	62,250.00	
	CCR SA	5,800	15.95	92,510.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	1,800	24.17	43,506.00	
	RUMO SA	5,600	13.23	74,088.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	6,000	16.57	99,420.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	3,500	16.50	57,750.00	
	LOJAS RENNER S.A.	3,300	37.25	122,925.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	2,300	15.52	35,696.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	700	76.00	53,200.00	
	RAIA DROGASIL SA	1,200	84.49	101,388.00	
	AMBEV SA	21,900	21.89	479,391.00	
	BRF SA	2,300	36.41	83,743.00	
	JBS SA	4,200	9.89	41,538.00	
	M DIAS BRANCO SA	500	54.74	27,370.00	
	NATURA COSMETICOS SA	800	37.10	29,680.00	
	ODONTOPREV S.A.	1,600	16.78	26,848.00	
	QUALICORP SA	900	33.50	30,150.00	
	HYPERMARCAS SA	1,400	36.48	51,072.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	17,400	39.80	692,520.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	4,300	37.99	163,357.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,700	35.15	59,755.00	

	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	15,000	50.37	755,550.00	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	17,800	12.91	229,798.00	
	BM&FBOVESPA SA	9,400	25.87	243,178.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	3,400	31.81	108,154.00	
	PORTO SEGURO SA	700	43.38	30,366.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	1,300	21.00	27,300.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	3,500	12.53	43,855.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	400	72.60	29,040.00	
	CIELO SA	6,000	27.00	162,000.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	2,100	52.30	109,830.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	3,400	12.95	44,030.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	1,700	22.65	38,505.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,200	6.75	21,600.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1,200	35.89	43,068.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	1,300	13.68	17,784.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	700	36.70	25,690.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,000	67.79	67,790.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	800	20.58	16,464.00	
	ブラジルリアル 小計	222,300		6,072,246.00	(211,557,050)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,350	10,005.00	23,511,750.00	
	EMPRESAS CMPC SA	4,500	2,325.50	10,464,750.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	470	33,553.00	15,769,910.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	1,580	10,133.00	16,010,140.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	3,700	6,369.10	23,565,670.00	
	CENCOSUD SA	5,200	1,901.50	9,887,800.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	650	8,888.20	5,777,330.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,250	2,923.10	3,653,875.00	
	BANCO DE CHILE	108,000	103.94	11,225,520.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	167	44,478.00	7,427,826.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	350,000	51.82	18,137,000.00	
	ITAU CORPBANCA	680,000	5.96	4,054,840.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	680	7,240.50	4,923,540.00	
	AES GENER SA	14,000	193.45	2,708,300.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	12,000	401.44	4,817,280.00	



	COLBUN SA	35,000	144.94	5,072,900.00	
	ENEL AMERICAS SA	144,000	144.82	20,854,080.00	
	ENEL CHILE SA	87,000	77.07	6,705,090.00	
	ENEL GENERACION CHILE SA	11,500	568.34	6,535,910.00	
	チリペソ 小計	1,462,047		201,103,511.00 (36,500,287)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	28,000	2,800.00	78,400,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	2,000	11,760.00	23,520,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	1,300	21,320.00	27,716,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	950	31,300.00	29,735,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	2,250	31,700.00	71,325,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	15,000	1,315.00	19,725,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	850	41,280.00	35,088,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	480	39,340.00	18,883,200.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,700	14,420.00	24,514,000.00	
	コロンビアペソ 小計	52,530		328,906,200.00 (12,794,451)	
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	280	24.45	6,846.00	
	OPAP SA	1,100	11.07	12,177.00	
	FF GROUP	250	19.14	4,785.00	
	JUMBO SA	560	15.70	8,792.00	
	ALPHA BANK AE	6,800	2.03	13,804.00	
	EUROBANK ERGASIAS SA	10,000	0.91	9,100.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	28,000	0.35	9,884.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,150	12.70	14,605.00	
	ユーロ 小計	48,140		79,993.00 (10,859,849)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	650	116.50	75,725.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	5,000	10.07	50,350.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	3,100	7.92	24,552.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	900	34.20	30,780.00	
	KOC HOLDING AS	3,960	18.60	73,656.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	3,500	5.02	17,570.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	800	22.34	17,872.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	2,500	15.51	38,775.00	

	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	62.75	28,237.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	600	32.06	19,236.00	
	ARCELIK AS	1,000	20.12	20,120.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,100	76.40	84,040.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	920	28.40	26,128.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	500	36.90	18,450.00	
	ULKER BISKUVI SANAYI	950	23.98	22,781.00	
	AKBANK T.A.S.	9,900	10.77	106,623.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	10,200	11.86	120,972.00	
	TURKIYE HALK BANKASI	2,600	10.22	26,572.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	6,000	7.68	46,080.00	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	3,300	7.20	23,760.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	4,000	4.57	18,280.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	3,300	11.46	37,818.00	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	3,200	6.79	21,728.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	5,700	16.57	94,449.00	
	トルコリラ 小計	74,130		1,044,554.50	(30,521,882)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	400	926.00	370,400.00	
	MONETA MONEY BANK AS	2,400	84.50	202,800.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	420	288.00	120,960.00	
	CEZ AS	850	519.50	441,575.00	
	チェココルナ 小計	4,070		1,135,735.00	(6,076,182)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,880	3,170.00	5,959,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	710	6,670.00	4,735,700.00	
	OTP BANK PLC	1,050	11,530.00	12,106,500.00	
	ハンガリーフォリント 小計	3,640		22,801,800.00	(10,000,869)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	420	60.70	25,494.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,320	111.30	146,916.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	6,200	6.79	42,098.00	
	GRUPA AZOTY SA	320	74.50	23,840.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	250	99.50	24,875.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	730	112.95	82,453.50	

	CCC SA	120	286.00	34,320.00	
	LPP SA	5	9,850.00	49,250.00	
	CYFROWY POLSAT SA	1,000	24.56	24,560.00	
	DINO POLSKA SA	350	83.70	29,295.00	
	ALIOR BANK SA	420	87.20	36,624.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	250	82.90	20,725.00	
	BANK MILLENNIUM SA	2,800	9.75	27,300.00	
	BANK PEKAO SA	810	140.50	113,805.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	185	442.00	81,770.00	
	MBANK SA	65	527.50	34,287.50	
	PKO BANK POLSKI SA	4,100	47.59	195,119.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,800	46.08	129,024.00	
	CD PROJEKT SA	380	116.50	44,270.00	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	6.26	26,292.00	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	750	33.20	24,900.00	
	PGE SA	3,000	12.16	36,480.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	5,000	3.14	15,700.00	
	ポーランドズロチ 小計	35,475		1,269,398.00	(41,471,232)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	8,000	10.32	82,560.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	112,000	6.85	767,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	15,500	23.55	365,025.00	
	CNOOC LTD	78,000	12.82	999,960.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	12,000	7.85	94,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	96,000	6.21	596,160.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	8,000	13.16	105,280.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	18,000	5.76	103,680.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,500	41.30	185,850.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	21,000	5.97	125,370.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	8.06	96,720.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	6,000	12.90	77,400.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	8,000	9.17	73,360.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	7,000	12.20	85,400.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	14,000	4.84	67,760.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	24,000	3.48	83,520.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	10,000	4.31	43,100.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	2,000	50.00	100,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	22,000	9.54	209,880.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	7,000	20.85	145,950.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	8,500	9.67	82,195.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	21,000	6.15	129,150.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	8,000	11.80	94,400.00	
CITIC LTD	26,000	12.62	328,120.00	
CRRC CORP LTD - H	21,000	8.32	174,720.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	13,000	19.70	256,100.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	3,000	24.95	74,850.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	14,000	3.26	45,640.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	23.70	47,400.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	9,000	10.42	93,780.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	2,400	47.05	112,920.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	13,000	12.36	160,680.00	
AIR CHINA LTD-H	8,000	10.28	82,240.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	6,000	12.06	72,360.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	6,000	21.20	127,200.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	8.65	69,200.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	8,000	8.42	67,360.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	6,000	12.78	76,680.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	6,000	9.81	58,860.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	14,000	19.04	266,560.00	
BYD CO LTD-H	3,000	75.40	226,200.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	12,000	9.77	117,240.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,000	33.45	66,900.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	23,000	25.85	594,550.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	11,500	9.57	110,055.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	10,000	17.10	171,000.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	5,000	17.10	85,500.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	5,000	38.85	194,250.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	27.05	135,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,000	80.00	240,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	60,000	1.08	64,800.00	

GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	43,000	1.00	43,000.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	10,000	10.56	105,600.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	13,000	26.85	349,050.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	8,000	31.55	252,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	8,000	17.14	137,120.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	45.45	90,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	26,000	7.11	184,860.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	3,500	76.35	267,225.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	14,000	4.15	58,100.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	6.10	48,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,800	21.00	58,800.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	6,000	33.55	201,300.00	
3SBIO INC	4,500	15.80	71,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	6,000	18.08	108,480.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	9,500	10.50	99,750.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	20,000	18.14	362,800.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2,500	51.90	129,750.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	17,000	3.06	52,020.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	22,000	15.46	340,120.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	121,000	4.80	580,800.00	
BANK OF CHINA LTD-H	369,000	4.70	1,734,300.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	41,000	6.78	277,980.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	46,000	6.58	302,680.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	386,000	8.73	3,369,780.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	11,000	4.54	49,940.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	18,000	38.60	694,800.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	28,500	8.76	249,660.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	10,000	6.98	69,800.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	339,000	7.28	2,467,920.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	32,000	3.38	108,160.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	4,000	20.25	81,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	14,000	6.95	97,300.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	50,000	4.09	204,500.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	11,500	22.90	263,350.00	
FAR EAST HORIZON LTD	8,000	8.42	67,360.00	

GF SECURITIES CO LTD-H	5,200	18.24	94,848.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	16,000	13.50	216,000.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6,200	19.40	120,280.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	33,000	26.95	889,350.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	11,800	41.45	489,110.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	8,400	34.30	288,120.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	3,000	52.85	158,550.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	27,000	4.66	125,820.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	22,000	17.22	378,840.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	24,000	94.00	2,256,000.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	8,000	14.28	114,240.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	17,000	28.50	484,500.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	16,000	4.85	77,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	18,000	30.55	549,900.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	14,000	31.05	434,700.00
CHINA VANKE CO LTD-H	5,100	41.20	210,120.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	25,000	16.78	419,500.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	30,000	4.36	130,800.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	4,400	22.70	99,880.00
LONGFOR PROPERTIES	5,500	24.65	135,575.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	5,000	24.10	120,500.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	13,000	6.53	84,890.00
SOHO CHINA LTD	12,000	4.77	57,240.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	10,000	35.90	359,000.00
KINGSOFT CORP LTD	3,000	27.65	82,950.00
TENCENT HOLDINGS LTD	25,900	469.00	12,147,100.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	4,000	25.40	101,600.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	135.00	472,500.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,500	17.26	60,410.00
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	3,000	45.45	136,350.00
LENOVO GROUP LTD	26,000	4.67	121,420.00
MEITU INC	7,000	11.48	80,360.00
SUNNY OPTICAL TECH	3,000	116.10	348,300.00
ZTE CORP-H	3,200	31.50	100,800.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	5.18	62,160.00

	CHINA MOBILE LTD	28,000	82.80	2,318,400.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	58,000	3.88	225,040.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	28,000	11.34	317,520.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	18,000	6.26	112,680.00	
	CGN POWER CO LTD-H	45,000	2.21	99,450.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	10,000	22.00	220,000.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	14,000	5.46	76,440.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	4,000	25.65	102,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	8,000	14.38	115,040.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,000	57.40	172,200.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	16,000	11.40	182,400.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	16,000	5.13	82,080.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	22,000	2.60	57,200.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	52,000	1.33	69,160.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	11,000	11.86	130,460.00	
	香港ドル 小計	3,308,900		48,705,023.00 (682,357,372)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	13,500	2.66	35,910.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,100	24.80	27,280.00	
	SAPURA ENERGY BHD	17,000	0.79	13,430.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	12,600	8.00	100,800.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	7,500	5.62	42,150.00	
	GAMUDA BHD	7,400	5.20	38,480.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,800	9.70	27,160.00	
	IJM CORP BHD	12,600	3.16	39,816.00	
	SIME DARBY BERHAD	11,900	2.89	34,391.00	
	AIRASIA BHD	7,500	4.11	30,825.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	3,700	9.16	33,892.00	
	MISC BHD	5,000	7.49	37,450.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.54	24,072.00	
	GENTING BHD	12,200	9.66	117,852.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	10,600	5.58	59,148.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	10,000	2.60	26,000.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	700	33.16	23,212.00	
	IOI CORP BHD	8,500	4.66	39,610.00	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,800	25.24	45,432.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	300	106.50	31,950.00	
	PPB GROUP BERHAD	2,100	17.40	36,540.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	11,900	5.54	65,926.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	3,100	11.50	35,650.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	7,500	6.00	45,000.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	6,500	4.22	27,430.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	7,500	4.75	35,625.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	20,700	6.95	143,865.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	2,900	18.00	52,200.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,500	17.80	26,700.00	
	MALAYAN BANKING BHD	20,900	9.91	207,119.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	12,500	20.96	262,000.00	
	RHB BANK BHD	5,500	5.34	29,370.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	11,000	2.01	22,110.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	11,900	1.56	18,564.00	
	SP SETIA BHD	7,000	3.25	22,750.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	9,800	5.56	54,488.00	
	DIGI.COM BHD	16,500	4.91	81,015.00	
	MAXIS BHD	8,000	6.05	48,400.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	5,000	6.01	30,050.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,500	17.70	44,250.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	14,600	15.84	231,264.00	
	YTL CORP BHD	19,380	1.54	29,845.20	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	15,300	1.30	19,890.00	
	マレーシアリングット 小計	377,080		2,398,911.20	(67,313,448)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	13,000	21.30	276,900.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	5,000	68.00	340,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	42,500	7.40	314,500.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	5,000	117.50	587,500.00	
	PTT PCL-NVDR	4,500	492.00	2,214,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	6,000	101.00	606,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	6,200	57.50	356,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	11,500	98.25	1,129,875.00	



	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	1,900	502.00	953,800.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	5,400	58.50	315,900.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	20,500	70.25	1,440,125.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	33,000	7.70	254,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	26,000	8.15	211,900.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	11,500	44.00	506,000.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	18,000	15.00	270,000.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	75.50	249,150.00	
	CP ALL PCL-NVDR	21,000	80.25	1,685,250.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	12,000	24.10	289,200.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	9,000	21.00	189,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	14,300	21.20	303,160.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	1,600	198.50	317,600.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	1,100	237.00	260,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	9,000	226.00	2,034,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	15,200	20.30	308,560.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,100	156.50	1,424,150.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	85,000	3.02	256,700.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	4,800	84.50	405,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,200	76.50	168,300.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	4,600	198.00	910,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	43,000	6.75	290,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	900	219.00	197,100.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	2,300	85.75	197,225.00	
	タイパーツ 小計	448,400		19,263,845.00	(66,845,542)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	7,000	75.25	526,750.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	18,000	16.00	288,000.00	
	DMCI HOLDINGS INC	18,000	14.52	261,360.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	14,700	78.00	1,146,600.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,240	1,088.00	1,349,120.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,500	110.10	275,250.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,900	282.00	535,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	3,200	170.00	544,000.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	3,200	118.10	377,920.00	

	BDO UNIBANK INC	9,800	157.90	1,547,420.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	2,700	102.00	275,400.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	251.80	352,520.00	
	AYALA CORPORATION	1,250	1,035.00	1,293,750.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	380	1,338.00	508,440.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	60,000	6.65	399,000.00	
	AYALA LAND INC	35,500	46.25	1,641,875.00	
	MEGAWORLD CORP	68,000	5.04	342,720.00	
	ROBINSONS LAND CO	12,000	20.80	249,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	42,000	38.90	1,633,800.00	
	GLOBE TELECOM INC	150	1,730.00	259,500.00	
	PLDT INC	320	1,507.00	482,240.00	
	ABOITIZ POWER CORP	6,500	41.75	271,375.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,400	333.80	467,320.00	
	フィリピンベソ 小計	311,140		15,029,760.00	(32,313,984)
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	62,000	2,440.00	151,280,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	8,700	40,000.00	348,000,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	7,900	21,375.00	168,862,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	13,000	10,725.00	139,425,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	9,500	6,300.00	59,850,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	34,000	2,790.00	94,860,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	11,500	5,950.00	68,425,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	87,000	8,725.00	759,075,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	36,000	2,530.00	91,080,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	9,500	11,225.00	106,637,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	32,000	3,600.00	115,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	2,100	85,275.00	179,077,500.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	34,000	5,250.00	178,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	10,000	8,850.00	88,500,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	16,000	8,075.00	129,200,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,800	55,600.00	433,680,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	90,000	1,725.00	155,250,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	47,500	22,575.00	1,072,312,500.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	15,000	7,050.00	105,750,000.00		

	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	80,000	8,250.00	660,000,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	39,500	9,725.00	384,137,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	240,000	3,830.00	919,200,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	3,680.00	95,680,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	36,000	1,735.00	62,460,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	705.00	68,385,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	239,000	3,980.00	951,220,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	13,000	6,375.00	82,875,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	22,000	3,090.00	67,980,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	40,000	2,690.00	107,600,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,366,000		7,844,502,500.00	(65,109,370)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	200	66,500.00	13,300,000.00	
	S-OIL CORP	180	118,000.00	21,240,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	311	199,500.00	62,044,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	470	34,650.00	16,285,500.00	
	HYOSUNG CORPORATION	90	127,500.00	11,475,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	430	60,000.00	25,800,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	31	519,000.00	16,089,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	110	104,500.00	11,495,000.00	
	LG CHEM LTD	238	438,000.00	104,244,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	81	403,000.00	32,643,000.00	
	OCI CO LTD	80	157,000.00	12,560,000.00	
	POSCO	330	387,000.00	127,710,000.00	
	CJ CORP	65	186,000.00	12,090,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	125	87,000.00	10,875,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	220	35,050.00	7,711,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	220	31,000.00	6,820,000.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	160	33,400.00	5,344,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	260	43,400.00	11,284,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	280	40,850.00	11,438,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	170	141,000.00	23,970,000.00	
	KCC CORP	26	404,000.00	10,504,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	242	54,800.00	13,261,600.00	
	LG CORP	465	93,300.00	43,384,500.00	

LOTTE CORP	112	67,500.00	7,560,000.00
SAMSUNG C&T CORP	330	135,500.00	44,715,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,450	8,980.00	13,021,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	157	305,000.00	47,885,000.00
SK NETWORKS CO LTD	900	6,390.00	5,751,000.00
S-1 CORPORATION	85	101,000.00	8,585,000.00
CJ LOGISTICS	36	134,000.00	4,824,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	68	139,000.00	9,452,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	200	37,850.00	7,570,000.00
PAN OCEAN CO LTD	950	5,660.00	5,377,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	270	55,500.00	14,985,000.00
HANON SYSTEMS	800	13,200.00	10,560,000.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	305	270,000.00	82,350,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	710	156,500.00	111,115,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	103,500.00	24,840,000.00
HYUNDAI WIA CORP	100	65,600.00	6,560,000.00
KIA MOTORS CORP	1,320	33,900.00	44,748,000.00
COWAY CO LTD	265	98,800.00	26,182,000.00
HANSSEM CO LTD	45	170,500.00	7,672,500.00
LG ELECTRONICS INC	495	102,500.00	50,737,500.00
KANGWON LAND INC	520	32,850.00	17,082,000.00
CHEIL WORLDWIDE INC	320	20,450.00	6,544,000.00
CJ E&M CORP	85	92,100.00	7,828,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	130	96,700.00	12,571,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	60	105,500.00	6,330,000.00
LOTTE SHOPPING CO	41	231,000.00	9,471,000.00
SHINSEGAE INC	33	317,500.00	10,477,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	33	219,000.00	7,227,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	230	28,950.00	6,658,500.00
E-MART INC	90	259,500.00	23,355,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	35	362,000.00	12,670,000.00
KT&G CORP	570	111,000.00	63,270,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	105	112,500.00	11,812,500.00
AMOREPACIFIC CORP	160	305,500.00	48,880,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	125	147,000.00	18,375,000.00

LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	48	1,150,000.00	55,200,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	183	120,100.00	21,978,300.00	
CELLTRION INC	387	293,500.00	113,584,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	27	584,000.00	15,768,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	76	104,500.00	7,942,000.00	
MEDY-TOX INC	19	608,600.00	11,563,400.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	85	406,500.00	34,552,500.00	
SILLAJEN INC	270	110,500.00	29,835,000.00	
YUHAN CORP	42	218,000.00	9,156,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	1,100	10,500.00	11,550,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	750	12,250.00	9,187,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	1,450	52,700.00	76,415,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,100	16,900.00	18,590,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	1,790	67,500.00	120,825,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,900	52,700.00	100,130,000.00	
WOORI BANK	1,800	17,000.00	30,600,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	170	87,100.00	14,807,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,050	10,600.00	21,730,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	620	16,750.00	10,385,000.00	
SAMSUNG CARD CO	180	39,850.00	7,173,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	280	42,300.00	11,844,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	215	72,200.00	15,523,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	910	7,290.00	6,633,900.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	270	45,850.00	12,379,500.00	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	200	53,100.00	10,620,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	130	284,500.00	36,985,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	305	130,000.00	39,650,000.00	
KAKAO CORP	145	135,000.00	19,575,000.00	
NAVER CORP	124	878,000.00	108,872,000.00	
NCSOFT CORP	83	435,500.00	36,146,500.00	
NETMARBLE GAMES CORP	75	167,500.00	12,562,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	180	258,500.00	46,530,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,120	33,250.00	37,240,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	63	127,000.00	8,001,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	220	100,500.00	22,110,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	443	2,467,000.00	1,092,881,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	81	2,012,000.00	162,972,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	237	208,000.00	49,296,000.00	
	SK TELECOM	88	274,000.00	24,112,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,110	35,400.00	39,294,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	125	51,100.00	6,387,500.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	49	450,500.00	22,074,500.00	
	SK HYNIX INC	2,690	72,400.00	194,756,000.00	
	韓国ウォン 小計	39,349		4,146,027,700.00 (427,455,455)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	5,000	121.50	607,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	10,000	30.00	300,000.00	
	CHINA STEEL CORP	60,000	25.00	1,500,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	14,000	107.50	1,505,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	18,000	99.20	1,785,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	20,000	80.30	1,606,000.00	
	TAIWAN CEMENT	12,000	37.30	447,600.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	474.50	474,500.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	12,000	26.55	318,600.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,020	365.00	372,300.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	9,000	28.95	260,550.00	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	12.50	212,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	9,270	15.70	145,539.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,000	17.60	193,600.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	8,000	23.85	190,800.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	7,000	51.60	361,200.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,020	308.50	314,670.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,000	142.50	285,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	2,000	168.00	336,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	311.50	311,500.00	
	POU CHEN	8,000	39.45	315,600.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	4,000	52.30	209,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	366.50	366,500.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	3,000	287.00	861,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	3,120	75.00	234,000.00	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	21,000	68.40	1,436,400.00	
TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	201.50	201,500.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,950	17.10	341,145.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	56,000	10.75	602,000.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	74,000	21.05	1,557,700.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	47,222	19.45	918,467.90	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	38,760	20.00	775,200.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	30,450	17.25	525,262.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	45,000	25.30	1,138,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	44,505	10.05	447,275.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	39,632	14.70	582,590.40	
TAIWAN BUSINESS BANK	16,480	8.77	144,529.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	41,810	17.25	721,222.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	6,000	97.20	583,200.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	29,000	52.80	1,531,200.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	51,000	14.15	721,650.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	39,000	55.70	2,172,300.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,170	30.65	434,310.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	34,000	10.75	365,500.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	4,000	45.00	180,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	7,200	33.50	241,200.00	
ACER INC	14,000	30.15	422,100.00	
ADVANTECH CO LTD	2,000	235.00	470,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	3,000	280.50	841,500.00	
AU OPTRONICS CORP	32,000	13.80	441,600.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	3,000	331.00	993,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	3,000	77.10	231,300.00	
COMPAL ELECTRONICS	17,000	20.90	355,300.00	
DELTA ELECTRONICS INC	10,000	148.00	1,480,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	4,000	86.50	346,000.00	
GENERAL INTERFACE SOLUTION	1,000	204.00	204,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	71,000	95.90	6,808,900.00	
HTC CORP	3,000	69.20	207,600.00	
INNOLUX CORP	32,000	14.40	460,800.00	
INVENTEC CORP	11,000	24.10	265,100.00	

	LARGAN PRECISION CO LTD	500	3,790.00	1,895,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	10,000	41.90	419,000.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	3,000	92.40	277,200.00	
	PEGATRON CORP	10,000	77.60	776,000.00	
	QUANTA COMPUTER INC	14,000	64.20	898,800.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	6,000	41.50	249,000.00	
	WISTRON CORP	11,325	25.10	284,257.50	
	WPG HOLDINGS LTD	7,000	39.70	277,900.00	
	YAGEO CORPORATION	1,000	397.00	397,000.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	2,000	69.00	138,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	16,000	108.50	1,736,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	7,000	75.00	525,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	8,000	110.00	880,000.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	27,000	42.05	1,135,350.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	468.50	468,500.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	9,000	43.40	390,600.00	
	MEDIATEK INC	7,000	307.50	2,152,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	3,000	80.50	241,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3,000	124.50	373,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	314.50	314,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	3,000	89.70	269,100.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	122.00	244,000.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	7,000	50.20	351,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	112,000	258.00	28,896,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	52,000	14.40	748,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	4,000	66.00	264,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	249.50	499,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	14,000	23.45	328,300.00	
	新台湾ドル 小計	1,448,434		88,093,320.15 (330,349,950)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,600	480.50	1,729,800.00	
	COAL INDIA LTD	2,900	294.55	854,195.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	2,600	389.15	1,011,790.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	2,300	390.30	897,690.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	5,500	210.85	1,159,675.00	



PETRONET LNG LTD	2,300	247.25	568,675.00
RELIANCE INDUSTRIES LTD	11,870	966.35	11,470,574.50
ACC LTD	200	1,737.50	347,500.00
AMBUJA CEMENTS LTD	2,600	260.15	676,390.00
ASIAN PAINTS LTD	1,460	1,151.05	1,680,533.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	1,400	1,200.05	1,680,070.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	6,100	258.70	1,578,070.00
JSW STEEL LTD	3,600	288.65	1,039,140.00
SHREE CEMENT LTD	36	18,234.60	656,445.60
TATA STEEL LTD	1,300	762.10	990,730.00
ULTRATECH CEMENT LTD	415	4,283.00	1,777,445.00
UPL LTD	1,770	824.25	1,458,922.50
VEDANTA LTD	6,900	340.00	2,346,000.00
ASHOK LEYLAND LTD	4,900	123.30	604,170.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	3,900	104.15	406,185.00
EICHER MOTORS LTD	64	26,404.05	1,689,859.20
HAVELLS INDIA LTD	1,100	576.25	633,875.00
LARSEN & TOUBRO LTD	2,250	1,401.20	3,152,700.00
SIEMENS LTD	300	1,304.05	391,215.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,650	448.75	1,637,937.50
BAJAJ AUTO LTD	360	3,341.55	1,202,958.00
BHARAT FORGE LTD	900	746.35	671,715.00
BOSCH LTD	31	19,730.30	611,639.30
HERO MOTOCORP LTD	220	3,645.50	802,010.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	3,200	755.40	2,417,280.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	480	9,434.95	4,528,776.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,700	384.45	1,038,015.00
TATA MOTORS LTD	7,300	403.60	2,946,280.00
TATA MOTORS LTD-A-DVR	1,600	231.00	369,600.00
TITAN CO LTD	1,100	886.90	975,590.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	2,600	603.20	1,568,320.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	155	4,719.25	731,483.75
ITC LTD	15,300	281.45	4,306,185.00
NESTLE INDIA LTD	85	7,592.90	645,396.50
UNITED SPIRITS LTD	250	3,487.85	871,962.50

DABUR INDIA LTD	2,300	359.20	826,160.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,040	1,117.60	1,162,304.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,800	1,365.90	3,824,520.00	
MARICO LTD	2,000	312.65	625,300.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	1,150	658.45	757,217.50	
CADILA HEALTHCARE LTD	870	424.75	369,532.50	
CIPLA LTD	1,500	618.30	927,450.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	580	2,559.40	1,484,452.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	600	640.10	384,060.00	
LUPIN LTD	780	959.05	748,059.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	280	2,811.25	787,150.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	4,400	586.55	2,580,820.00	
AXIS BANK LTD	7,550	607.95	4,590,022.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	7,040	1,911.20	13,454,848.00	
ICICI BANK LTD	10,800	352.75	3,809,700.00	
IDFC BANK LTD	6,000	59.15	354,900.00	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,700	1,362.00	2,315,400.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,300	570.05	741,065.00	
STATE BANK OF INDIA	8,800	329.90	2,903,120.00	
YES BANK LTD	8,050	364.80	2,936,640.00	
BAJAJ FINANCE LTD	850	1,739.15	1,478,277.50	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	1,200	490.35	588,420.00	
POWER FINANCE CORPORATION	2,800	121.50	340,200.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	3,000	160.25	480,750.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	630	1,437.90	905,877.00	
BAJAJ FINSERV LTD	165	5,014.45	827,384.25	
HCL TECHNOLOGIES LTD	2,680	1,018.45	2,729,446.00	
INFOSYS LTD	8,040	1,185.80	9,533,832.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2,060	3,174.60	6,539,676.00	
TECH MAHINDRA LTD	2,000	603.15	1,206,300.00	
VAKRANGEE LTD	2,200	503.20	1,107,040.00	
WIPRO LTD	6,100	313.95	1,915,095.00	
BHARTI AIRTEL LTD	5,200	459.50	2,389,400.00	
BHARTI INFRATEL LTD	2,400	342.30	821,520.00	
IDEA CELLULAR LTD	6,000	93.90	563,400.00	

	GAIL INDIA LTD	2,600	484.95	1,260,870.00	
	NTPC LTD	8,300	174.00	1,444,200.00	
	TATA POWER CO LTD	4,900	91.80	449,820.00	
	インドルピー 小計	239,961		144,291,026.60 (251,066,386)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	850	143.79	122,221.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	320	369.48	118,233.60	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	2,150	139.03	298,914.50	
	GOLD FIELDS LTD	3,500	52.44	183,540.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	400	350.10	140,040.00	
	MONDI LTD	500	323.50	161,750.00	
	SAPPI LIMITED	2,900	87.10	252,590.00	
	SASOL LTD	2,620	439.40	1,151,228.00	
	SIBANYE-STILLWATER	8,000	15.33	122,640.00	
	BIDVEST GROUP LTD	1,690	229.49	387,838.10	
	NASPERS LTD-N SHS	1,992	3,700.00	7,370,400.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	620	281.00	174,220.00	
	MR PRICE GROUP LTD	1,000	277.23	277,230.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	850	201.10	170,935.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	1,800	99.03	178,254.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	5,200	65.67	341,484.00	
	BID CORP LTD	1,450	276.00	400,200.00	
	PICK N PAY STORES LTD	1,600	72.75	116,400.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,930	248.00	478,640.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	850	209.21	177,828.50	
	PIONEER FOODS GROUP LTD	550	141.45	77,797.50	
	TIGER BRANDS LTD	850	465.21	395,428.50	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	4,800	27.35	131,280.00	
	NETCARE LTD	4,400	25.46	112,024.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	1,700	258.51	439,467.00	
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	3,500	185.49	649,215.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	165	1,034.00	170,610.00	
NEDBANK GROUP LTD	900	273.49	246,141.00		
STANDARD BANK GROUP LTD	5,900	201.12	1,186,608.00		
BRAIT SE	1,550	40.36	62,558.00		

	CORONATION FUND MANAGERS LTD	1,000	79.81	79,810.00	
	FIRSTRAND LTD	16,400	70.47	1,155,708.00	
	INVESTEC LTD	1,100	94.87	104,357.00	
	PSG GROUP LTD	380	275.00	104,500.00	
	REMGRO LTD	2,550	241.89	616,819.50	
	RMB HOLDINGS LTD	3,700	81.67	302,179.00	
	DISCOVERY LTD	1,500	180.95	271,425.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	800	136.00	108,800.00	
	MMI HOLDINGS LTD	3,900	23.60	92,040.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	2,800	47.25	132,300.00	
	SANLAM LTD	6,700	92.30	618,410.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	1,950	167.36	326,352.00	
	MTN GROUP LTD	7,550	136.00	1,026,800.00	
	TELKOM SA SOC LTD	1,200	51.20	61,440.00	
	VODACOM GROUP LTD	3,050	151.69	462,654.50	
	南アフリカランド 小計	119,117		21,559,311.20 (198,776,849)	
アラブディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	22,000	0.63	13,926.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	10,500	7.40	77,700.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	5,500	6.45	35,475.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	5,700	11.25	64,125.00	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	11,000	2.53	27,830.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	13,700	2.30	31,510.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	8,000	3.32	26,560.00	
	EMAAR MALLS PJSC	9,000	2.35	21,150.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	16,700	6.87	114,729.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	7,400	17.90	132,460.00	
	アラブディルハム 小計	109,500		545,465.00 (16,287,584)	
	合 計	10,164,016		2,924,142,908 (2,924,142,908)	

(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	15,700	458,126.00	
	メキシコペソ 小計		15,700	458,126.00	(2,707,524)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	8,200	21,894.00	
	トルコリラ 小計		8,200	21,894.00	(639,742)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	4,500	79,425.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	3,400	117,980.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	11,150	313,315.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	1,050	126,000.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	18,000	200,160.00	
		RESILIENT REIT LTD	1,000	127,500.00	
	南アフリカランド 小計		39,100	964,380.00	(8,891,583)
	合計				12,238,849

(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 38銘柄	100.0%		11.7%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.9%		2.8%
	投資証券 1銘柄		3.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	100.0%		7.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%		1.2%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%		0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%		0.4%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.9%		1.0%
	投資証券 1銘柄		2.1%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%		0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%

ポーランドズロチ	株式	23銘柄	100.0%		1.4%
香港ドル	株式	136銘柄	100.0%		23.2%
マレーシアリングット	株式	43銘柄	100.0%		2.3%
タイバーツ	株式	32銘柄	100.0%		2.3%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%		1.1%
インドネシアルピア	株式	29銘柄	100.0%		2.2%
韓国ウォン	株式	101銘柄	100.0%		14.6%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%		11.3%
インドルピー	株式	78銘柄	100.0%		8.6%
南アフリカランド	株式	45銘柄	95.7%		6.8%
	投資証券	6銘柄		4.3%	0.3%
アラブディルハム	株式	10銘柄	100.0%		0.6%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,357,428,771
投資証券	14,120,916,600
派生商品評価勘定	29,792,144
未収入金	41,717,037
未収配当金	90,561,406
差入委託証拠金	7,473,000
流動資産合計	15,647,888,958
資産合計	15,647,888,958
負債の部	
流動負債	
前受金	31,655,600
未払金	1,022,497,980

平成30年 1月25日現在

未払解約金	50,000
未払利息	3,681
流動負債合計	1,054,207,261
負債合計	1,054,207,261
純資産の部	
元本等	
元本	13,219,196,566
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,374,485,131
元本等合計	14,593,681,697
純資産合計	14,593,681,697
負債純資産合計	15,647,888,958

## 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)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	3,484,997,896円
期中追加設定元本額	19,656,355,730円
期中一部解約元本額	9,922,157,060円
期末元本額	13,219,196,566円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	412,915,098円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,150,089,673円
りそなラップ型ファンド(成長型)	861,194,536円
DCりそな グローバルバランス	2,082,440円
つみたてバランスファンド	2,093,810円
FWりそな国内リートインデックスオープン	2,379,328,961円

FWりそな国内リートインデックスファンド	1,235,086,374円
Smart-i リートインデックス	33,414,162円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	7,142,573,887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)	417,625円
2. 計算日における受益権の総数	13,219,196,566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	1.1040円
(10,000口当たり純資産額)	(11,040円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

#### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

#### 金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在

#### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

#### 2. 時価の算定方法

##### 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

##### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

##### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

#### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明



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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		548,733,936
合計		548,733,936

（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）

（平成30年 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	462,156,856	-	491,949,000	29,792,144
	合計	462,156,856	-	491,949,000	29,792,144

## (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	日本アコモデーションファンド投資法人	585	289,867,500	
	MCUBS MidCity投資法人	1,782	142,560,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,892	269,988,400	
	産業ファンド投資法人	478	242,824,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,630	461,290,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	400	129,600,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	797	390,530,000	
	GLP投資法人	3,083	394,624,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	642	160,243,200	
	日本プロロジスリート投資法人	2,215	559,952,000	
	星野リゾート・リート投資法人	267	154,059,000	
	Oneリート投資法人	193	49,562,400	
	イオンリート投資法人	1,672	207,996,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,196	204,516,000	
	日本リート投資法人	473	158,455,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	976	117,998,400	
	日本ヘルスケア投資法人	85	14,586,000	
積水ハウス・リート投資法人	1,105	162,987,500		
トーセイ・リート投資法人	283	31,611,100		

ケネディクス商業リート投資法人	640	157,312,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	217	23,870,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	306	28,978,200	
ジャパン・シニアリビング投資法人	97	15,646,100	
野村不動産マスターファンド投資法人	5,052	772,450,800	
いちごホテルリート投資法人	278	36,001,000	
ラサールロジポート投資法人	1,329	157,486,500	
スターアジア不動産投資法人	366	42,163,200	
マリモ地方創生リート投資法人	141	15,862,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	285	106,590,000	
大江戸温泉リート投資法人	296	25,900,000	
さくら総合リート投資法人	423	42,257,700	
投資法人みらい	225	42,435,000	
森トラスト・ホテルリ-ト投資法人	381	56,807,100	
三菱地所物流リート投資法人	163	45,265,100	
日本ビルファンド投資法人	1,705	1,004,245,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,664	941,824,000	
日本リテールファンド投資法人	3,388	738,922,800	
オリックス不動産投資法人	3,398	585,135,600	
日本プライムリアルティ投資法人	1,112	430,900,000	
プレミア投資法人	1,591	185,351,500	
東急リアル・エステート投資法人	1,181	171,481,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	283	119,001,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,884	666,882,800	
森トラスト総合リート投資法人	1,259	208,994,000	
インヴィンシブル投資法人	4,830	247,296,000	
フロンティア不動産投資法人	599	274,042,500	
平和不動産リート投資法人	1,097	110,687,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,173	251,960,400	
福岡リート投資法人	855	155,353,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	515	361,015,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	1,335	164,739,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,364	112,120,800	
大和証券オフィス投資法人	380	234,460,000	
阪急リート投資法人	722	99,275,000	
スターツプロシード投資法人	277	46,009,700	

大和ハウスリート投資法人	1,811	489,694,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,085	419,004,000	
日本賃貸住宅投資法人	1,981	171,356,500	
ジャパンエクセレント投資法人	1,577	218,887,600	
合計	73,019	14,120,916,600	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国リ - トマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	49,668,030
コール・ローン	17,615,518
投資証券	7,016,085,414
派生商品評価勘定	9,750
未収入金	24,650
未収配当金	12,159,170
流動資産合計	7,095,562,532
資産合計	7,095,562,532
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,000
未払金	61,164,867
未払利息	47
流動負債合計	61,218,914
負債合計	61,218,914
純資産の部	
元本等	
元本	6,893,342,517
剰余金	

平成30年 1月25日現在

剰余金又は欠損金（ ）	141,001,101
元本等合計	7,034,343,618
純資産合計	7,034,343,618
負債純資産合計	7,095,562,532

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

(貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月26日
期首元本額	911,308,026円
期中追加設定元本額	6,843,284,098円
期中一部解約元本額	861,249,607円
期末元本額	6,893,342,517円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	438,172,407円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	254,063,311円
りそなラップ型ファンド(成長型)	523,688,689円
DCりそな グローバルバランス	2,232,435円
つみたてバランスファンド	1,108,451円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	4,094,763,467円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	1,548,604,514円

Smart-i 先進国リートインデックス	30,288,614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）	420,629円
2. 計算日における受益権の総数	6,893,342,517口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0205円
(10,000口当たり純資産額)	(10,205円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスク、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、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成30年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		91,374,620
合計		91,374,620

（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）

（平成30年 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	16,577,050	-	16,532,800	44,250
	米ドル	13,192,800	-	13,138,800	54,000
	ユーロ	3,384,250	-	3,394,000	9,750

合計	16,577,050	-	16,532,800	44,250
----	------------	---	------------	--------

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	4,909	124,934.05	
		AGREE REALTY CORP	1,500	74,940.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,350	68,502.50	
		ALEXANDER'S INC	227	85,976.25	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,611	710,464.82	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,444	88,521.68	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,677	304,776.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	14,262	293,797.20	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	8,637	363,531.33	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	11,986	241,158.32	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2,720	39,902.40	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1,110	11,033.40	



ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,070	35,185.80	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,691	1,321,313.80	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	920	8,326.00	
BOSTON PROPERTIES INC	8,572	1,056,413.28	
BRANDYWINE REALTY TRUST	9,092	163,565.08	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,463	296,521.74	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,084	439,511.80	
CARETRUST REIT INC	4,605	72,160.35	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	10,565	60,114.85	
CEDAR REALTY TRUST INC	4,920	27,109.20	
CHATHAM LODGING TRUST	2,195	51,209.35	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,688	104,333.52	
CITY OFFICE REIT INC	1,200	14,364.00	
CLIPPER REALTY INC	650	6,597.50	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	30,177	298,752.30	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	6,785	148,320.10	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	900	23,742.00	
CORECIVIC INC	6,946	156,771.22	
CORESITE REALTY CORP	1,821	196,576.95	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	5,878	164,113.76	
COUSINS PROPERTIES INC	24,262	222,482.54	
CUBESMART	10,005	275,037.45	
CYRUSONE INC	5,093	289,435.19	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	5,098	300,425.14	
DDR CORP	17,362	148,097.86	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,591	126,880.18	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,445	1,268,678.25	
DOUGLAS EMMETT INC	9,045	354,564.00	
DUKE REALTY CORP	19,460	506,349.20	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	2,525	52,823.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,831	158,509.67	
EDUCATION REALTY TRUST INC	4,111	138,376.26	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,549	126,985.11	
EPR PROPERTIES	3,538	217,940.80	

EQUITY COMMONWEALTH	7,222	218,537.72	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,988	429,716.20	
EQUITY RESIDENTIAL	20,648	1,268,613.12	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,673	850,483.15	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,936	593,305.44	
FARMLAND PARTNERS INC	1,320	11,088.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,017	494,974.74	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	6,911	214,241.00	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	14,972	354,536.96	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,420	82,456.20	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,980	62,251.80	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,459	415,503.34	
GEO GROUP INC/THE	6,604	150,042.88	
GETTY REALTY CORP	2,045	54,253.85	
GGP INC	35,233	833,260.45	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,520	30,156.80	
GLADSTONE LAND CORP	420	5,632.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	800	6,472.00	
GLOBAL NET LEASE INC	4,044	76,795.56	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	5,792	104,893.12	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	9,187	237,667.69	
HCP INC	25,845	625,707.45	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,724	205,619.92	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	11,597	324,484.06	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,258	42,518.14	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,970	288,828.60	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	9,274	274,417.66	
HOST HOTELS & RESORTS INC	41,098	874,976.42	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	8,330	269,059.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	4,150	39,632.50	
INFRAREIT INC	2,160	41,234.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,000	34,680.00	
INVITATION HOMES INC	15,657	353,691.63	
IRON MOUNTAIN INC	15,613	558,477.01	
ISTAR INC	3,340	37,775.40	

JBG SMITH PROPERTIES	4,952	167,823.28	
KILROY REALTY CORP	5,312	376,514.56	
KIMCO REALTY CORP	23,289	380,309.37	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,576	82,551.04	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	6,653	204,646.28	
LEXINGTON REALTY TRUST	13,055	119,453.25	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8,347	349,739.30	
LIFE STORAGE INC	2,701	232,961.25	
LTC PROPERTIES INC	2,288	94,425.76	
MACERICH CO/THE	6,192	416,783.52	
MACK-CALI REALTY CORP	5,207	111,846.36	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	50,000	47,500.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,300	14,547.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,218	266,068.88	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,470	612,126.70	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	4,150	72,334.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,768	358,523.52	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,850	74,613.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,230	158,999.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,930	29,553.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,200	32,784.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	3,640	46,155.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,705	294,173.40	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,050	26,449.50	
PARAMOUNT GROUP INC	11,150	168,811.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	8,940	265,339.20	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,989	156,687.92	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,712	43,727.36	
PHYSICIANS REALTY TRUST	10,507	174,836.48	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	8,196	161,952.96	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,640	28,224.40	
PROLOGIS INC	29,912	1,928,725.76	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,068	128,320.20	
PUBLIC STORAGE	8,370	1,631,480.40	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,806	141,731.06	

QUALITY CARE PROPERTIES	4,621	63,631.17	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,748	51,647.44	
REALTY INCOME CORP	15,669	846,282.69	
REGENCY CENTERS CORP	8,429	541,984.70	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,596	105,820.36	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	12,570	156,119.40	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4,215	124,637.55	
RLJ LODGING TRUST	9,389	221,298.73	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,738	211,072.42	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,181	184,479.72	
SAUL CENTERS INC	500	28,235.00	
SELECT INCOME REIT	3,499	82,821.33	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	13,547	242,355.83	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,597	66,179.68	
SIMON PROPERTY GROUP INC	17,375	2,885,987.50	
SL GREEN REALTY CORP	5,307	514,672.86	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	26,519	224,085.55	
STAG INDUSTRIAL INC	5,204	134,367.28	
STORE CAPITAL CORP	9,035	224,971.50	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6,210	98,304.30	
SUN COMMUNITIES INC	4,512	407,884.80	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	12,359	212,698.39	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	5,239	131,236.95	
TAUBMAN CENTERS INC	3,485	221,785.40	
TERRENO REALTY CORP	3,274	117,143.72	
TIER REIT INC	2,400	47,472.00	
UDR INC	14,741	542,763.62	
UMH PROPERTIES INC	2,280	32,216.40	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	650	44,206.50	
URBAN EDGE PROPERTIES	5,924	142,709.16	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,525	30,195.00	
VENTAS INC	20,085	1,122,550.65	
VEREIT INC	54,634	406,476.96	
VORNADO REALTY TRUST	9,635	700,849.90	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,096	61,307.04	

	WASHINGTON REIT	4,360	126,658.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	6,364	198,238.60	
	WELLTOWER INC	20,619	1,248,274.26	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	150	1,101.00	
	WHITESTONE REIT	2,400	32,016.00	
	WP CAREY INC	5,837	383,199.05	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,727	129,029.31	
	米ドル 小計	1,294,395	44,454,797.24 (4,867,800,297)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	220	2,703.80	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,734	113,461.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,709	52,890.34	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,370	60,896.50	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,889	142,104.06	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	2,079	94,033.17	
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,430	32,148.90	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	5,780	85,717.40	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2,160	29,268.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,120	30,846.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	5,180	63,040.60	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,300	12,155.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,242	51,005.50	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,243	63,455.15	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	8,187	173,236.92	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,480	13,926.80	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,600	21,872.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	720	11,016.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	650	9,080.50	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,475	36,993.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,395	38,974.60	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	6,800	54,944.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,216	225,607.68	
	SLATE OFFICE REIT	1,500	12,270.00	
	SLATE RETAIL REIT - U	720	8,892.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,605	112,079.45	

	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,100	8,910.00
	カナダドル 小計	76,904	1,561,528.37 (138,538,796)
ユーロ	AEDIFICA	1,112	86,180.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,353	98,015.49
	ALTAREA	222	46,620.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	3,582	65,908.80
	BEFIMMO	1,281	69,302.10
	BENI STABILI SPA	46,870	35,527.46
	COFINIMMO	1,124	121,954.00
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	2,819	105,656.12
	FONCIERE DES REGIONS	3,113	277,057.00
	GECINA SA	2,660	422,408.00
	GREEN REIT PLC	42,173	66,633.34
	HAMBORNER REIT AG	4,100	41,082.00
	HIBERNIA REIT PLC	38,321	58,094.63
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,940	99,316.80
	ICADE	2,549	220,998.30
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	23,300	22,321.40
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	17,200	149,382.00
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	934	21,668.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	17,700	26,160.60
	KLEPIERRE	11,703	422,127.21
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,820	44,247.60
	MERCIALYS	2,708	50,693.76
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	18,690	217,271.25
	NSI NV	1,111	38,940.55
	RETAIL ESTATES	241	17,713.50
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,561	1,150,014.80
	VASTNED RETAIL NV	759	30,853.35
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	906	89,875.20
	WERELDHAVE NV	2,272	92,833.92
	ユーロ 小計	271,124	4,188,857.98 (568,679,359)
英ポンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	3,400	3,417.00
	ASSURA PLC	131,213	80,958.42

	BIG YELLOW GROUP PLC	8,213	69,933.69
	BRITISH LAND CO PLC	57,638	391,246.74
	CAPITAL & REGIONAL PLC	19,200	10,848.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	6,200	6,758.00
	DERWENT LONDON PLC	5,920	173,811.20
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	27,400	23,755.80
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	17,568	113,840.64
	HAMMERSON PLC	44,080	219,606.56
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	19,999	28,198.59
	INTU PROPERTIES PLC	48,082	110,444.35
	LAND SECURITIES GROUP PLC	42,426	425,532.78
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	41,022	74,331.86
	LXI REIT PLC	6,200	6,510.00
	NEWRIVER REIT PLC	15,600	49,374.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	29,954	34,147.56
	RDI REIT PLC	85,871	30,183.65
	REGIONAL REIT LTD	21,400	21,785.20
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	11,905	58,810.70
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	39,200	25,244.80
	SEGRO PLC	56,447	322,425.26
	SHAFTESBURY PLC	13,563	136,579.41
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	75,357	112,658.71
	UNITE GROUP PLC	13,550	107,993.50
	WORKSPACE GROUP PLC	7,085	70,141.50
	英債券 小計	848,493	2,708,537.92 (422,017,293)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	15,800	57,828.00
	ARENA REIT	13,900	30,302.00
	BWP TRUST	24,255	73,007.55
	CHARTER HALL GROUP	24,903	150,414.12
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	7,100	27,974.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	15,992	63,008.48
	CROMWELL PROPERTY GROUP	66,923	65,584.54
	DEXUS	57,640	556,226.00
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	9,100	25,207.00

	GDI PROPERTY GROUP	29,000	35,815.00
	GOODMAN GROUP	90,985	740,617.90
	GPT GROUP	100,306	503,536.12
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	16,900	55,432.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6,020	19,264.00
	INDUSTRIA REIT	5,250	13,440.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,400	31,806.00
	INVESTA OFFICE FUND	26,321	117,918.08
	MIRVAC GROUP	203,977	452,828.94
	NATIONAL STORAGE REIT	25,500	39,015.00
	PROPERTYLINK GROUP	22,600	22,148.00
	RURAL FUNDS GROUP	18,000	39,600.00
	SCENTRE GROUP	296,382	1,212,202.38
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	45,627	102,204.48
	STOCKLAND	133,380	574,867.80
	VICINITY CENTRES	179,703	474,415.92
	VIVA ENERGY REIT	27,450	59,566.50
	WESTFIELD CORP	106,718	980,738.42
	オーストラリアドル 小計	1,581,132	6,524,968.23 (576,154,694)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	57,000	60,705.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	49,948	67,679.54
	INVESTORE PROPERTY LTD	8,477	12,291.65
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	83,937	114,574.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	57,373	76,306.09
	STRIDE STAPLED GROUP	22,111	39,136.47
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	20,200	43,935.00
	ニュージーランドドル 小計	299,046	414,627.75 (33,377,533)
香港ドル	CHAMPION REIT	118,000	680,860.00
	FORTUNE REIT	72,000	705,600.00
	LINK REIT	122,000	8,662,000.00
	PROSPERITY REIT	53,000	183,380.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56,000	194,320.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	58,000	320,160.00



	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	75,000	389,250.00
	香港ドル 小計	554,000	11,135,570.00 (156,009,335)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	41,700	57,129.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	34,000	29,920.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	131,600	364,532.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	70,900	88,625.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	55,400	47,921.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	151,800	289,938.00
	CAPITALAND MALL TRUST	154,600	321,568.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	36,500	59,860.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	46,100	83,902.00
	ESR REIT	72,000	40,680.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	53,200	40,432.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	31,000	43,710.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	27,200	62,832.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	39,200	59,192.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	70,000	81,200.00
	KEPPEL DC REIT	38,400	56,064.00
	KEPPEL REIT	96,900	125,970.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	77,000	31,185.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	101,500	168,490.00
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	92,500	117,475.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	69,000	146,280.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	118,500	161,160.00
	OUE HOSPITALITY TRUST	70,300	62,918.50
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	19,500	58,500.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	38,400	15,936.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	25,900	18,259.50
	SPH REIT	32,500	34,450.00
	STARHILL GLOBAL REIT	62,600	48,202.00
	SUNTEC REIT	120,800	259,720.00
	シンガポールドル 小計	1,979,000	2,976,051.00 (249,095,468)
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,900	137,594.00

	イスラエルシェケル 小計	8,900	137,594.00 (4,412,639)
	合計		7,016,085,414 (7,016,085,414)

(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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 158銘柄	100.0%	69.3%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 29銘柄	100.0%	8.1%
英ポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	6.0%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	8.2%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.6%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

**【中間財務諸表】**

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(2018年 1月26日から2018年 7月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCりそな グローバルバランス】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年 1月25日現在	第3期中間計算期間末 2018年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,117,376	2,869,049
親投資信託受益証券	116,257,048	241,504,434
未収入金	-	1,550,000
流動資産合計	117,374,424	245,923,483
資産合計	117,374,424	245,923,483
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,857	2,359,457
未払受託者報酬	18,103	38,385
未払委託者報酬	253,380	537,391
未払利息	3	7
その他未払費用	4,438	9,503
流動負債合計	279,781	2,944,743
負債合計	279,781	2,944,743
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	112,785,606	237,724,544
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,309,037	5,254,196
（分配準備積立金）	2,439,641	2,152,813
元本等合計	117,094,643	242,978,740
純資産合計	117,094,643	242,978,740
負債純資産合計	117,374,424	245,923,483

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	第3期中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	775,740	1,037,614
営業収益合計	775,740	1,037,614
営業費用		
支払利息	69	674
受託者報酬	9,772	38,385
委託者報酬	136,676	537,391
その他費用	2,360	9,519
営業費用合計	148,877	585,969
営業利益又は営業損失( )	626,863	1,623,583
経常利益又は経常損失( )	626,863	1,623,583
中間純利益又は中間純損失( )	626,863	1,623,583
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	10,084	236,544
期首剰余金又は期首欠損金( )	16,300	4,309,037
剰余金増加額又は欠損金減少額	109,003	3,018,814
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	109,003	3,018,814
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,852	686,616
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,852	686,616
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	737,230	5,254,196

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年 1月25日現在	第3期中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 44,058,819円	期首元本額 112,785,606円
期中追加設定元本額 94,737,024円	期中追加設定元本額 146,350,658円
期中一部解約元本額 26,010,237円	期中一部解約元本額 21,411,720円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 112,785,606口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 237,724,544口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0382円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0221円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,382円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,221円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 1月25日現在	第3期中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

<p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	195,775
コール・ローン	797,663,531
国債証券	52,487,870,280
地方債証券	3,180,856,500
特殊債券	3,512,618,568
社債券	2,220,997,000
未収利息	112,911,036
前払費用	10,827,755

2018年 7月25日現在

流動資産合計	62,323,940,445
資産合計	62,323,940,445
負債の部	
流動負債	
未払金	279,040,000
未払解約金	31,400
未払利息	2,163
流動負債合計	279,073,563
負債合計	279,073,563
純資産の部	
元本等	
元本	59,797,723,977
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,247,142,905
元本等合計	62,044,866,882
純資産合計	62,044,866,882
負債純資産合計	62,323,940,445

## 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)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	44,564,485,799円
期中追加設定元本額	17,876,998,932円
期中一部解約元本額	2,643,760,754円
期末元本額	59,797,723,977円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	14,977,554,632円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	268,955,275円
りそなラップ型ファンド(成長型)	126,972,591円
DCりそな グローバルバランス	151,542,092円
つみたてバランスファンド	107,109,481円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	71,646円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	182,471円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	15,882円
FWりそな国内債券インデックスファンド	44,159,063,980円
Smart-i 国内債券インデックス	1,760,578円
Smart-i 8資産バランス 安定型	303,917円



Smart-i 8資産バランス 安定成長型	208,290円
Smart-i 8資産バランス 成長型	129,592円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,894,395円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	959,155円
2. 計算日における受益権の総数	59,797,723,977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	1.0376円
(10,000口当たり純資産額)	(10,376円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	40,828,937
コール・ローン	22,905,496
国債証券	20,489,339,195
派生商品評価勘定	7,256
未収利息	143,281,010
前払費用	21,568,647
流動資産合計	20,717,930,541
資産合計	20,717,930,541
負債の部	
流動負債	
未払解約金	420,000
未払利息	62
流動負債合計	420,062
負債合計	420,062
純資産の部	
元本等	
元本	21,358,648,465
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	641,137,986
元本等合計	20,717,510,479
純資産合計	20,717,510,479
負債純資産合計	20,717,930,541

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	18,306,428,860円
期中追加設定元本額	7,831,954,230円
期中一部解約元本額	4,779,734,625円
期末元本額	21,358,648,465円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	3,267,617,658円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	9,137,566,054円
りそなラップ型ファンド（成長型）	135,583,674円
DCりそな グローバルバランス	32,913,247円
つみたてバランスファンド	28,006,939円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	41,874円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	105,473円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	8,795円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	8,754,349,098円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	674,228円
Smart-i 8資産バランス 安定型	180,871円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	114,261円
Smart-i 8資産バランス 成長型	79,021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）	361,260円
りそなFT 先進国債券インデックス（適格機関投資家専用）	1,046,012円
2. 計算日における受益権の総数	21,358,648,465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	641,137,986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	0.9700円
(10,000口当たり純資産額)	(9,700円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

#### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

#### （通貨関連）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,189,348	-	12,196,604	7,256
	米ドル	4,360,266	-	4,362,176	1,910
	ユーロ	7,829,082	-	7,834,428	5,346
	合計	12,189,348	-	12,196,604	7,256

#### （注）時価の算定方法

##### 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R A M新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,225,866
コール・ローン	2,593,627
投資信託受益証券	2,155,893,593
派生商品評価勘定	869
流動資産合計	2,161,713,955
資産合計	2,161,713,955
負債の部	
流動負債	
未払金	2,333,929
未払解約金	120,000
未払利息	7
流動負債合計	2,453,936
負債合計	2,453,936
純資産の部	
元本等	
元本	2,010,270,496
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	148,989,523
元本等合計	2,159,260,019
純資産合計	2,159,260,019
負債純資産合計	2,161,713,955

## 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本と	外貨建取引等の処理基準

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

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	1,416,556,538円
期中追加設定元本額	602,409,650円
期中一部解約元本額	8,695,692円
期末元本額	2,010,270,496円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	438,713,672円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	265,589,342円
りそなラップ型ファンド(成長型)	123,609,210円
DCりそな グローバルバランス	4,328,850円
つみたてバランスファンド	25,342,988円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	10,665円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	71,401円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	17,174円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,152,183,719円
Smart-i 8資産バランス 安定型	19,602円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	51,632円
Smart-i 8資産バランス 成長型	89,700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)	242,541円
2. 計算日における受益権の総数	2,010,270,496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	1.0741円
(10,000口当たり純資産額)	(10,741円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	

## デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

## （通貨関連）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引 買建	1,857,674	-	1,858,543	869
	米ドル	1,857,674	-	1,858,543	869
合計		1,857,674	-	1,858,543	869

## （注）時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## RAM国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	742,668,071
株式	20,451,310,460
派生商品評価勘定	9,023,660
未収配当金	24,202,633
差入委託証拠金	18,225,000
流動資産合計	21,245,429,824
資産合計	21,245,429,824
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,150,800
前受金	3,870,000
未払金	73,031,405
未払解約金	650,000
未払利息	2,014
流動負債合計	80,704,219
負債合計	80,704,219
純資産の部	
元本等	
元本	17,856,896,314
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,307,829,291
元本等合計	21,164,725,605
純資産合計	21,164,725,605
負債純資産合計	21,245,429,824

## 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）

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	12,835,574,668円
期中追加設定元本額	9,689,418,969円
期中一部解約元本額	4,668,097,323円
期末元本額	17,856,896,314円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,891,918,716円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	851,329,519円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,673,191,281円
DCりそな グローバルバランス	18,940,819円
つみたてバランスファンド	141,829,255円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	51,390円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	323,367円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	75,702円
FWりそな国内株式インデックスファンド	13,003,288,861円
Smart-i TOPIXインデックス	14,851,061円
Smart-i 8資産バランス 安定型	75,249円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	225,814円
Smart-i 8資産バランス 成長型	426,883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）	1,546,048円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	257,977,945円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	844,404円
2. 計算日における受益権の総数	17,856,896,314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	1.1852円
(10,000口当たり純資産額)	(11,852円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

## (株式関連)

(2018年 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	704,497,140	-	710,370,000	5,872,860
	合計	704,497,140	-	710,370,000	5,872,860

## (注) 時価の算定方法

## 先物取引

## 国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R A M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,490,762,434
コール・ローン	20,642,832
株式	13,486,487,369
投資証券	310,093,341

2018年 7月25日現在

派生商品評価勘定	29,460,874
未収配当金	14,169,873
差入委託証拠金	303,141,399
流動資産合計	15,654,758,122
資産合計	15,654,758,122
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	229,371
未払解約金	278,000
未払利息	55
流動負債合計	507,426
負債合計	507,426
純資産の部	
元本等	
元本	12,519,776,313
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,134,474,383
元本等合計	15,654,250,696
純資産合計	15,654,250,696
負債純資産合計	15,654,758,122

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本と	外貨建取引等の処理基準

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

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	9,300,090,859円
期中追加設定元本額	5,473,095,545円
期中一部解約元本額	2,253,410,091円
期末元本額	12,519,776,313円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	901,477,895円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	767,939,083円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,893,679,938円
DCりそな グローバルバランス	8,977,902円
つみたてバランスファンド	88,478,346円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	56,285円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	345,255円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	81,556円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	8,738,285,044円
Smart-i 先進国株式インデックス	116,859,712円
Smart-i 8資産バランス 安定型	88,195円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	234,839円
Smart-i 8資産バランス 成長型	435,265円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,008,988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)	828,010円
2. 計算日における受益権の総数	12,519,776,313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	1.2504円
(10,000口当たり純資産額)	(12,504円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

## 株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

## （株式関連）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,828,659,942	-	1,857,878,005	29,218,063
	合計	1,828,659,942	-	1,857,878,005	29,218,063

## （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）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	19,243,860	-	19,257,300	13,440
	米ドル	13,348,560	-	13,354,800	6,240
	カナダドル	2,533,800	-	2,540,100	6,300
	スイスフラン	3,361,500	-	3,362,400	900
	合計	19,243,860	-	19,257,300	13,440

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## RAM新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	350,724,134
コール・ローン	6,562,885
株式	4,352,565,861
投資証券	16,666,752
派生商品評価勘定	783,755
未収入金	265,349
未収配当金	19,226,870
差入委託証拠金	122,662,063
流動資産合計	4,869,457,669
資産合計	4,869,457,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,450
未払金	281,087,000
未払解約金	120,000
未払利息	17
流動負債合計	281,220,467
負債合計	281,220,467
純資産の部	
元本等	

2018年 7月25日現在

元本	3,443,375,005
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,144,862,197
元本等合計	4,588,237,202
純資産合計	4,588,237,202
負債純資産合計	4,869,457,669

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	2,079,461,070円

期中追加設定元本額	1,563,147,172円
期中一部解約元本額	199,233,237円
期末元本額	3,443,375,005円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	356,513,793円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,417,826,458円
りそなラップ型ファンド(成長型)	416,983,877円
DCりそな グローバルバランス	3,527,354円
つみたてバランスファンド	20,640,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	19,085円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	117,632円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	28,060円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,163,683,277円
Smart-i 新興国株式インデックス	63,417,618円
Smart-i 8資産バランス 安定型	24,486円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	73,891円
Smart-i 8資産バランス 成長型	145,922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)	373,247円
2. 計算日における受益権の総数	3,443,375,005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	1.3325円
(10,000口当たり純資産額)	(13,325円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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



## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

## （株式関連）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	210,179,476	-	210,882,892	703,416
	合計	210,179,476	-	210,882,892	703,416

## （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）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	54,269,979	-	54,334,479	64,500
	米ドル	3,893,330	-	3,895,150	1,820
	メキシコペソ	4,719,600	-	4,712,000	7,600
	香港ドル	7,092,250	-	7,090,000	2,250
	韓国ウォン	34,376,899	-	34,452,329	75,430
	南アフリカランド	4,187,900	-	4,185,000	2,900
	売建	56,634,199	-	56,631,810	2,389
米ドル	56,634,199	-	56,631,810	2,389	

合計	110,904,178	-	110,966,289	66,889
----	-------------	---	-------------	--------

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## RAM国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	608,026,579
投資証券	9,811,701,510
派生商品評価勘定	8,235,860
未収配当金	72,326,404
差入委託証拠金	14,440,000
流動資産合計	10,514,730,353
資産合計	10,514,730,353
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	553,200
前受金	6,013,700
未払金	9,287,055
未払解約金	32,000,000
未払利息	1,649
流動負債合計	47,855,604
負債合計	47,855,604
純資産の部	
元本等	
元本	9,306,461,940
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,160,412,809
元本等合計	10,466,874,749
純資産合計	10,466,874,749
負債純資産合計	10,514,730,353

## 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)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	13,219,196,566円
期中追加設定元本額	7,989,720,645円
期中一部解約元本額	11,902,455,271円
期末元本額	9,306,461,940円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	411,873,246円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	252,107,503円
りそなラップ型ファンド(成長型)	571,937,161円
DCりそな グローバルバランス	4,131,296円
つみたてバランスファンド	49,018,998円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	13,517円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	83,495円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	18,992円
FWりそな国内リートインデックスオープン	2,881,577,304円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,554,468,273円
Smart-i Jリートインデックス	281,712,995円
Smart-i 8資産バランス 安定型	18,525円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,304円
Smart-i 8資産バランス 成長型	102,270円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,298,814,703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)	522,358円
2. 計算日における受益権の総数	9,306,461,940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	1.1247円

(10,000口当たり純資産額)

(11,247円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2018年 7月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	655,227,340	-	662,910,000	7,682,660
	合計	655,227,340	-	662,910,000	7,682,660

(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。

## RAM先進国リ - トマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2018年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	21,901,375
コール・ローン	11,114,237
投資証券	9,677,996,053
派生商品評価勘定	3,640
未収入金	46,979
未収配当金	13,276,332
流動資産合計	9,724,338,616
資産合計	9,724,338,616
負債の部	
流動負債	
未払金	23,636,910
未払解約金	553,000
未払利息	30
流動負債合計	24,189,940
負債合計	24,189,940
純資産の部	
元本等	
元本	9,259,709,141
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	440,439,535
元本等合計	9,700,148,676
純資産合計	9,700,148,676
負債純資産合計	9,724,338,616

## 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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	6,893,342,517円
期中追加設定元本額	5,306,397,490円
期中一部解約元本額	2,940,030,866円
期末元本額	9,259,709,141円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	440,512,334円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	922,024,537円
りそなラップ型ファンド(成長型)	911,693,821円
DCりそな グローバルバランス	4,455,519円
つみたてバランスファンド	25,926,369円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	16,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	96,666円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	23,726円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	4,727,617,535円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,044,768,986円
Smart-i 先進国リートインデックス	181,448,427円
Smart-i 8資産バランス 安定型	20,328円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	65,223円
Smart-i 8資産バランス 成長型	127,369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)	911,417円
2. 計算日における受益権の総数	9,259,709,141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	1.0476円
(10,000口当たり純資産額)	(10,476円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2018年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

## （通貨関連）

（2018年 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	9,062,860	-	9,066,500	3,640
	米ドル	7,786,660	-	7,790,300	3,640
	香港ドル	1,276,200	-	1,276,200	-
合計		9,062,860	-	9,066,500	3,640

（注）時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 7月31日現在です。

## 【DCりそな グローバルバランス】

## 【純資産額計算書】

資産総額	248,509,187円
負債総額	27,197円
純資産総額（ - ）	248,481,990円
発行済口数	243,025,244口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0225円

（参考）

## RAM国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	62,617,844,712円
負債総額	122,365,400円
純資産総額（ - ）	62,495,479,312円
発行済口数	60,152,349,899口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0390円

## RAM先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	20,918,482,854円
負債総額	141,878,284円
純資産総額（ - ）	20,776,604,570円
発行済口数	21,525,345,206口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9652円

## RAM新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	2,193,502,680円
負債総額	3,271,231円
純資産総額（ - ）	2,190,231,449円
発行済口数	2,015,265,400口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0868円

## R A M国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	21,403,803,420円
負債総額	159,546,347円
純資産総額（ - ）	21,244,257,073円
発行済口数	17,926,689,997口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1851円

## R A M先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	16,878,307,565円
負債総額	1,239,995,972円
純資産総額（ - ）	15,638,311,593円
発行済口数	12,572,506,372口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2438円

## R A M新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	4,664,312,259円
負債総額	39,945,483円
純資産総額（ - ）	4,624,366,776円
発行済口数	3,450,440,962口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3402円

## R A M国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	10,641,335,836円
負債総額	573,910,982円
純資産総額（ - ）	10,067,424,854円
発行済口数	8,883,529,018口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1333円

## R A M先進国リ - トマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	9,782,553,354円
負債総額	25,767,648円
純資産総額（ - ）	9,756,785,706円
発行済口数	9,323,634,599口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0465円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 受益権の譲渡

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (4) 受益証券の再発行

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

## (5) 受益権の再分割

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

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2018年7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

###### 過去5年間における主な資本金の増減

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（2018年7月末現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会において選任され、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。

取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。また、取締役会は、取締役社長1名を選定し、必要に応じ、取締役副社長、専務取締役および常務取締役を各若干名定めることができます。

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。

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。

取締役会は、法令、定款等に定められた業務執行の重要事項を決定します。

取締役会の決議は、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。

###### 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

- ・運用部は、運用基本方針や運用ガイドラインなどを策定し、運用委員会がその承認を行います。

###### DO：実行

- ・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、運用部長が承認します。
- ・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。
- ・運用部長は、ファンド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運用部トレーディンググループが、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

- ・法令等や運用ガイドラインの遵守状況等については、運用部門から独立した業務部がモニタリングを行います。その結果は、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告するとともにすみやかに運用部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委員会が統括し、運用部に対する管理・指導を行います。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

「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である委託会社は、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。

2018年7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	57	492,697

### 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- (2) 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期事業年度（自2017年4月1日至2018年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

		（単位：千円）	
		前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）
資産の部			
流動資産			
預金		334,657	1,159,736
前払費用		36,555	45,871
未収入金	2	95,899	19,258
未収委託者報酬		67,272	213,404
未収還付消費税等		11,066	-
繰延税金資産		8,236	22,764
流動資産計		553,688	1,461,036
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	3,992	3,519
器具備品	1	3,866	5,451
有形固定資産計		7,858	8,970
無形固定資産			
ソフトウェア		36,708	30,292
無形固定資産計		36,708	30,292
投資その他の資産			
投資有価証券		2,796	1,716
差入敷金保証金		10,200	15,266
長期前払費用		3,416	2,416
繰延税金資産		873	18,917
投資その他の資産計		17,286	38,317
固定資産計		61,853	77,580
資産合計		615,542	1,538,616

		（単位：千円）	
		前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）

負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	27,694	52,802
その他未払金	55,592	94,427
未払費用	17,511	21,235
未払法人税等	4,868	8,252
未払消費税等	-	12,000
預り金	32	106
賞与引当金	26,272	31,097
流動負債計	131,972	219,921
負債合計	131,972	219,921
純資産の部		
株主資本		
資本金	490,000	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	496,843	171,316
利益剰余金計	496,843	171,316
株主資本計	483,156	1,318,683
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	413	11
評価・換算差額等計	413	11
純資産合計	483,569	1,318,695
負債・純資産合計	615,542	1,538,616

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2016年4月1日	(自	2017年4月1日
	至	2017年3月31日)	至	2018年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		332,491		854,946
営業収益計		332,491		854,946
営業費用				
支払手数料		150,399		213,554
広告宣伝費		20,758		24,143
調査費				
調査費		110,241		155,859
委託調査費		65,285		111,085
委託計算費		52,522		92,905
営業雑経費				
印刷費		12,940		26,910
協会費		1,482		2,097
販売促進費		1,560		1,592
その他		15,978		41,568
営業費用計		431,169		669,717

一般管理費		
給料		
役員報酬	46,399	61,599
給料・手当	150,916	195,821
賞与	10,843	20,138
賞与引当金繰入額	23,811	31,097
旅費交通費	2,575	4,892
租税公課	5,778	7,802
不動産賃借料	16,113	16,648
固定資産減価償却費	8,420	11,306
諸経費	37,244	48,459
一般管理費計	302,103	397,765
営業損失	400,782	212,537
営業外収益		
投資有価証券売却益	419	1,616
雑収入	16	14
営業外収益計	436	1,630
営業外費用		
為替差損	26	-
株式交付費	-	3,630
営業外費用計	26	3,630
経常損失	400,372	214,536
税引前当期純損失	400,372	214,536
法人税、住民税及び事業税	95,241	17,669
法人税等調整額	2,141	32,394
法人税等計	97,383	50,063
当期純損失	302,989	164,472

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	490,000	490,000	490,000	193,854	193,854	786,145
当期変動額						
当期純損失（ ）				302,989	302,989	302,989
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	302,989	302,989	302,989
当期末残高	490,000	490,000	490,000	496,843	496,843	483,156

	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	-	-	786,145
当期変動額			



当期純損失（ ）			302,989
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	413	413	413
当期変動額合計	413	413	302,575
当期末残高	413	413	483,569

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	490,000	490,000	490,000	496,843	496,843	483,156
当期変動額						
欠損填補		490,000	490,000	490,000	490,000	
新株の発行	510,000	490,000	490,000			1,000,000
当期純損失（ ）				164,472	164,472	164,472
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	510,000	0	0	325,527	325,527	835,527
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683

	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	413	413	483,569
当期変動額			
欠損填補			
新株の発行			1,000,000
当期純損失（ ）			164,472
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	401	401	401
当期変動額合計	401	401	835,125
当期末残高	11	11	1,318,695

（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 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。

## (未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30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 平成30年3月30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

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物	800千円	1,273千円
器具備品	1,607千円	3,324千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
流動資産		
未収入金	95,685千円	18,947千円

(注) 当該金額は、連結納税親会社から収受する金額であります。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017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）	1,960,000	-	-	1,960,000

## 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 2017年4月1日 至 2018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）	1,960,000	2,000,000	-	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。

当社の未収入金は、主に連結納税親会社から収受する金額であります。

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。

## 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（2017年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	334,657	334,657	-
未収入金	95,899	95,899	-
未収委託者報酬	67,272	67,272	-
資産計	497,828	497,828	-

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	1,159,736	1,159,736	-
未収委託者報酬	213,404	213,404	-
資産計	1,392,399	1,392,399	-
その他未払金	94,427	94,427	-

負債計	94,427	94,427	-
-----	--------	--------	---

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 資産

## 預金、未収入金、未収委託者報酬

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

## 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 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	8,102千円	9,518千円
未払事業所税	222千円	281千円
未払事業税	1,190千円	1,954千円
未確定債務	1,280千円	1,190千円
減価償却超過額	1,372千円	2,966千円
繰越欠損金	37,126千円	75,767千円
繰延税金資産小計	49,294千円	91,677千円
評価性引当額	40,000千円	49,990千円
繰延税金資産合計	9,294千円	41,687千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	182千円	5千円
繰延税金負債合計	182千円	5千円
繰延税金資産の純額	9,110千円	41,682千円

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

前事業年度及び当事業年度ともに税引前当期純損失のため注記を省略しております。

## (セグメント情報等)

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

内国籍投資信託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。

## 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

顧客情報については、制度上知り得ないため、記載を省略しております。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報  
該当事項はありません。
4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報  
該当事項はありません。
5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報  
該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託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。

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

顧客情報については、制度上知り得ないため、記載を省略しております。

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 2016年4月1日 至 2017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	連結法人税還付請求	95,685	未収入金	95,685

(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)
----	--------	-----	-------------------	-------	------------------------	-----------	-------	--------------	----	--------------

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	支払手数料	121,659	未払手数料	23,073
							委託調査費	62,746	その他 未払金	38,267

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）投資助言の費用については、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3）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 2017年4月1日 至 2018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 資金の調達	連結法人税 還付請求	18,947	未収入金	18,947
							増資の割当	1,000,000	-	-

## （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)
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	支払手数料	177,380	未払手数料	45,605
							委託調査費	63,426	その他 未払金	21,550

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）投資助言の費用については、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3）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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1株当たり純資産額	246円71銭	333円
1株当たり当期純損失金額	154円58銭	47円97銭

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

（注）1株当たり当期純損失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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純損失（千円）	302,989	164,472

普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純損失（千円）	302,989	164,472
普通株式の期中平均株式数（株）	1,960,000	3,428,493

## （重要な後発事象）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 5【その他】

## (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

- 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社  
 資本金の額：51,000百万円（2018年3月末現在）  
 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
 再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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



## 独立監査人の監査報告書

2018年6月8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

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 太田 健司 印

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2017年4月1日から2018年3月31日までの第3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。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 監査意見

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2018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すべ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。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年3月20日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCりそな グローバルバランスの平成29年1月26日から平成30年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCりそな グローバルバランスの平成30年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2018年9月18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

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCりそな グローバルバランスの2018年1月26日から2018年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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ものではないが、監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCりそな グローバルバランスの2018年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年1月26日から2018年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。