

## 【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】	2019年9月10日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	F Wりそな国内債券インデックスファンド F Wりそな国内株式インデックスファンド F W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） F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） F Wりそな新興国債券インデックスファンド F Wりそな先進国株式インデックスファンド F Wりそな新興国株式インデックスファンド F Wりそな国内リートインデックスファンド F Wりそな先進国リートインデックスファンド
【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】	F Wりそな国内債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F W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） 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国リートインデックスファンド 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】

F Wりそな国内債券インデックスファンド  
 F Wりそな国内株式インデックスファンド  
 F W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）  
 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）  
 F Wりそな新興国債券インデックスファンド  
 F Wりそな先進国株式インデックスファンド  
 F Wりそな新興国株式インデックスファンド  
 F Wりそな国内リートインデックスファンド  
 F Wりそな先進国リートインデックスファンド

- ・以下、上記を総称して「りそなファンドラップ（スタンダードコース）」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称
F Wりそな国内債券インデックスファンド	国内債券インデックス
F Wりそな国内株式インデックスファンド	国内株インデックス
F W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）	先進国債券インデックス（ヘッジなし）
F Wりそな先進国債券インデックスファンド （為替ヘッジあり）	先進国債券インデックス（ヘッジあり）
F Wりそな新興国債券インデックスファンド	新興国債券インデックス
F Wりそな先進国株式インデックスファンド	先進国株インデックス
F Wりそな新興国株式インデックスファンド	新興国株インデックス
F Wりそな国内リートインデックスファンド	国内リートインデックス
F Wりそな先進国リートインデックスファンド	先進国リートインデックス

### （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】

各ファンド、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

F Wりそな国内債券インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。  
 F Wりそな国内株式インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。  
 F W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）：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。  
 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：取得申込受付日の翌営業日の基準

価額とします。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：取得申込受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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】

販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2019年9月11日から2020年3月10日までとします。

・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

当ファンドは、投資者と株式会社りそな銀行が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。受益権の取得申込者は、原則として、株式会社りそな銀行と投資一任契約を締結し、投資一任契約の資産を管理する口座を開設した者に限るものとします。

投資一任業者である株式会社りそな銀行が、投資者との投資一任契約に基づく運用財産の効率的な運営および維持のため、ファンドを買付ける場合があります。

## 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

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

東証株価指数（T O P I X、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F W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） >

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指して運用を行います。

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

M S C I - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券	(毎月)	中南米		
クレジット属性 ( )	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (NOMURA-BPI 総合)
不動産投信	その他 ( )	中近東 (中東)		
その他資産 (投資信託証券(債券 一般))		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。

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(債券 一般)))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(債券)とが異なります。

## &lt; FWRりそな国内株式インデックスファンド &gt;

## 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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
		不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ( )	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		東証株価指数
社債		オセアニア		(TOPIX、配当込み)
その他債券	年12回			
クレジット属性	(毎月)	中南米		
( )	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他
不動産投信	その他	中近東		( )
( )	( )	(中東)		
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		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。

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(株式一般)))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(株式)とが異なります。

< FWR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) >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年5回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(債券 公債))	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東)			その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円換算 ベース))
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
		債 券	
	海外	不動産投信	特殊型
追加型投信	内外	その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	日経225
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			TOPIX
	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 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円ヘッ ジ・円ベー ス))
その他資産 (投資信託証券(債 券 公債))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

#### < F W りそな新興国債券インデックスファンド >

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株 式 債 券	インデックス型
	海外	不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ( ) 資産複合	特殊型

(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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
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	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(債券 公債))	その他 ( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (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))
資産複合 ( )		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(債券 公債)))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(債券)とが異なります。

#### <FWりそな先進国株式インデックスファンド>

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
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			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ( )	アフリカ			その他 (MSCI-KOKUSAI 指数(配当込 み、円換算ベー ス))
資産複合 ( )		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式 一般)))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(株式)とが異なります。

#### < F W I りそな新興国株式インデックスファンド >

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年5回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI エマージング・マーケット 指数(配当込み、円換算ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(株式 一般)))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(株式)とが異なります。

#### < FWRりそな国内リートインデックスファンド >

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
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	ファミリーファンド	
	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		
その他資産 (投資信託証券(不動産投信))	その他 ( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他 (東証 REIT 指数 (配当込み))
		中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(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。

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(不動産投信)))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(不動産投信)とが異なります。

#### <FWりそな先進国リートインデックスファンド>

##### 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)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ( ) 資産複合	特殊型

(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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経 225
	年2回	日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (S&P 先進国 REIT 指数 (除く日 本、配当込み、 円換算ペー ス))
その他資産 (投資信託証券(不 動産投信))	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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(不動産投信)))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(不動産投信)とが異なります。

#### < 商品分類の定義 >

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### 4. 独立した区分

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

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

###### (2)債券

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

###### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

###### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

###### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

##### 2. 決算頻度による属性区分

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

##### 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があ

るものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4. 投資形態による属性区分

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

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

#### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

#### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

1

「りそなファンドラップ(スタンダードコース)」は、原則として、投資者と株式会社りそな銀行が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するための専用ファンドです。

- 「りそなファンドラップ(スタンダードコース)」の受益権の取得申込者は、株式会社りそな銀行と投資一任契約を締結する必要があります。

※投資一任業者である株式会社りそな銀行は、投資者との投資一任契約に基づく運用財産の効率的な運営および維持のため、ファンドを買い付ける場合があります。

2

「りそなファンドラップ(スタンダードコース)」を構成する各ファンドは、各マザーファンドを通じて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。

### ■ ファンドの仕組み





### 3 各ファンドの運用方針は以下の通りです。

#### FWりそな国内債券インデックスファンド

1. 国内の債券を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[NOMURA-BPI総合]は、野村證券株式会社が公表する、日本の公債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。

2. RAM国内債券マザーファンドを通じて、国内の債券への投資を行います。
  - NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。

#### FWりそな国内株式インデックスファンド

1. 国内の株式を実質的な主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX、配当込み)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[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。

2. RAM国内株式マザーファンドを通じて、国内の株式への投資を行います。
  - 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。

#### 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)

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、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指します。

\*[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指数です。

2. RAM先進国債券マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
  - 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。
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。

**FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)**

1. 日本を除く先進国の債券を実質的な主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数で、為替ヘッジを考慮したものです。

2. RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)を通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
  - FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)または海外の債券先物取引を活用することがあります。
3. 為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

**FWりそな新興国債券インデックスファンド**

1. 新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、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指して運用を行います。

\*[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)]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す。

2. RAM新興国債券マザーファンドを通じて、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)への投資を行います。
  - 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)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。
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。

**FWりそな先進国株式インデックスファンド**

1. 日本を除く先進国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)]は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。

2. RAM先進国株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式\*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)への投資を行います。
  - MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。
    - \*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券等を含みます。
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。



**FWりそな新興国株式インデックスファンド**

1. 新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[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。

2. RAM新興国株式マザーファンドを通じて、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）への投資を行います。

- MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

\*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。

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。

**FWりそな国内リートインデックスファンド**

1. 国内の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）\*の動きに連動する投資成果を目指します。

\*[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。

2. RAM国内リートマザーファンドを通じて、国内の不動産投資信託証券\*への投資を行います。

- 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。

\*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。

**FWりそな先進国リートインデックスファンド**

1. 日本を除く先進国の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、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。

\*[S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）]は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（REIT）および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。

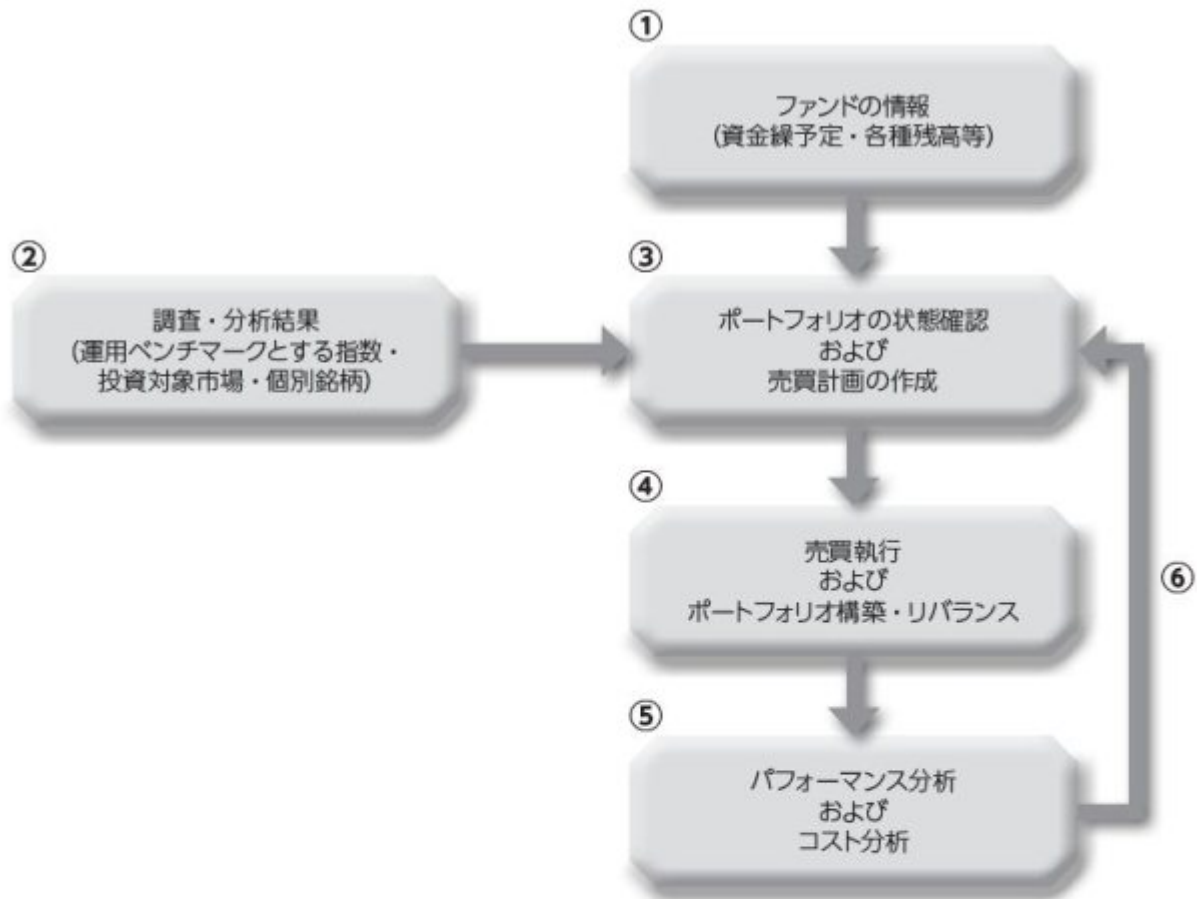
2. RAM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券\*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）への投資を行います。

- 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。

\*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。

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。

## ■ 運用プロセスのイメージ



- ① 設定・解約による資金繰予定のほか、個別銘柄・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
- ② 運用ベンチマークとする指数および投資対象となる市場・個別銘柄に関する調査・分析を行います。
- ③ 各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じて個別銘柄の売買計画を作成します。
- ④ 売買執行（市場での個別銘柄等の売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
- ⑤ 運用パフォーマンスや運用ベンチマークとの連動性、売買執行に要したコストの分析等を行います。
- ⑥ 上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## ■ 主な投資制限

### ● FWりそな国内債券インデックスファンド

- 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、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 投資信託証券（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。

### ● FWりそな国内株式インデックスファンド

- 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。

### ● 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)

### ● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

### ● FWりそな新興国債券インデックスファンド

- 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、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 投資信託証券（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。

### ● FWりそな先進国株式インデックスファンド

### ● FWりそな新興国株式インデックスファンド

- 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。

### ● FWりそな国内リートインデックスファンド

- 不動産投資信託証券および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。

### ● FWりそな先進国リートインデックスファンド

- 不動産投資信託証券および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12月10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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ 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先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ● 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とした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

### ● RAM先進国株式マザーファンド

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

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

### 信託金限度額

- ・ F Wりそな国内債券インデックスファンド：5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F W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）：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな新興国債券インデックスファンド：2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

す。

- ・ F Wりそな先進国株式インデックスファンド：3,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな新興国株式インデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな国内リートインデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ F Wりそな先進国リートインデックスファンド：1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

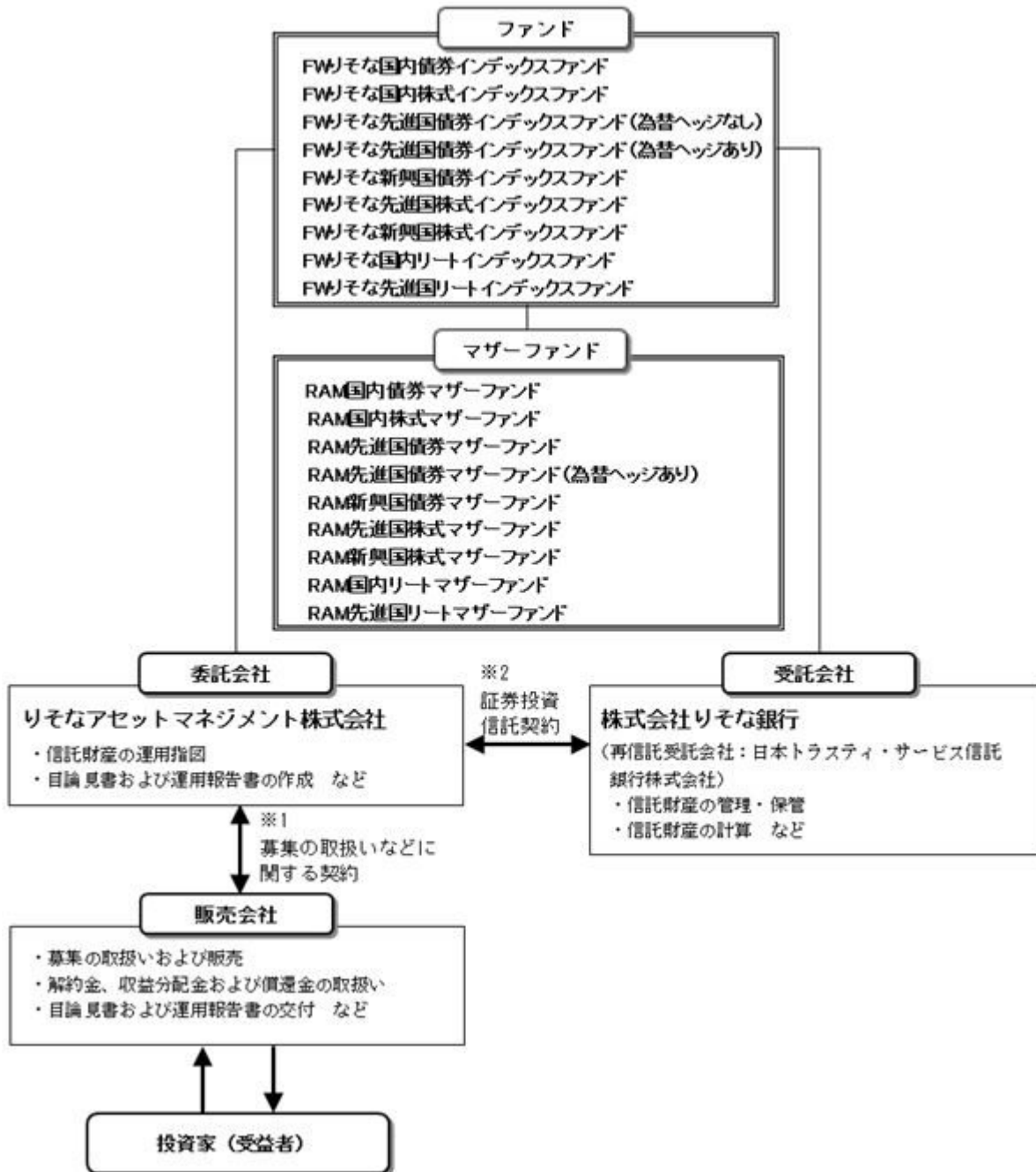
## （ 2 ）【ファンドの沿革】

2017年1月5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



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。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。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。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（2019年6月末現在）

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

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

## 2【投資方針】



## （１）【投資方針】

### < F W りそな国内債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

### < F W りそな国内株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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。

### < F W 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） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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。

### < F W りそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。

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。

### < F W りそな新興国債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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。

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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-KOUSA 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目指して運用を行います。なお、MSCI-KOUSA 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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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。

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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。

#### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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目指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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、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。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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。

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。

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、前述の「運用プロセスの

イメージ」をご参照ください。

## （２）【投資対象】

### < F Wりそな国内債券インデックスファンド >

R A M国内債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の債券に直接投資することがあります。

#### 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（本邦通貨表示のものに限ります。）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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ) 為替手形

#### 有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R A M国内債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) 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。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。）
- 16) 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。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) 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8) および13) 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10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) 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、9)の証券および10)の証券(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、上記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

先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

R A M国内株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の株式に直接投資することがあります。

#### 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(本邦通貨表示のものに限ります。)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条および第23条に定めるものに限ります。)
- ハ) 約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- ニ) 金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ) 為替手形

#### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)

## 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、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

## &lt; F W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） &gt;

R A M先進国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

## 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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ) 為替手形

## 有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「RAM先進国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限ります。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7)までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。)
- 10) 投資証券、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。)
- 11) 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。)
- 12) 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。)
- 13) 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。)
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。)
- 16) 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。)
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)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8)および13)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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券(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

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、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。

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の債券に直接投資することがあります。

#### 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20条、第21条および第22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、親投資信託「RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)」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) 転換社債の転換、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、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7)までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。)
- 10) 投資証券、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。)
- 11) 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。)
- 12) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
- 13) 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。)
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。)
- 16) 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。)
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)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8)および13)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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券(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

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、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。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

R A M新興国債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の債券に直接投資することがあります。

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20条、第21条、第22条および第23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、親投資信託「R A M新興国債券マザーファンド」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) 転換社債の転換、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、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 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。）
- 10) 投資証券、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。）
- 11) 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。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
- 13) 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。）



14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15) 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。）

16) 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。）

17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)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8)および13)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10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)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、9)の証券および10)の証券（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

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。

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

R A M先進国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式（D R（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。）および先進国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に直接投資することがあります。

#### 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条および第23条に定めるものに限ります。）

ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

#### 有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R A M先進国株式マザーファンド」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、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。

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

R A M新興国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式（D R（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。）および新興国株式の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に直接投資することがあります。

## 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す。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 二) 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、親投資信託「RAM新興国株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

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

#### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

R A M国内リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の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。)に直接投資することがあります。

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(本邦通貨表示のものに限ります。)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条および第23条に定めるものに限ります。)
- ハ) 約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- ニ) 金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
- 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、金利先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

R A M先進国リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の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。）、不動産関連株式および不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に直接投資することがあります。

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条および第23条に定めるものに限ります。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 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、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 高位に維持することを基本とします。資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は、行いません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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（T O P I X、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（T O P I X、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（T O P I X、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（T O P I X、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（T O P I X、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E T F（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、E T F（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先進国債券マザーファンド &gt;

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

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	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12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R A M新興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、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）
投資方針	主として、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に投資し、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 債券またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCI-KOUSA I指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li> <li>（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</li> <li>先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li> </ul>

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

< RAM新興国株式マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

## &lt; R A M国内リートマザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証 R E I T 指数（配当込み）を対象指数とした E T F（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 E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。
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先進国リートマザーファンド &gt;

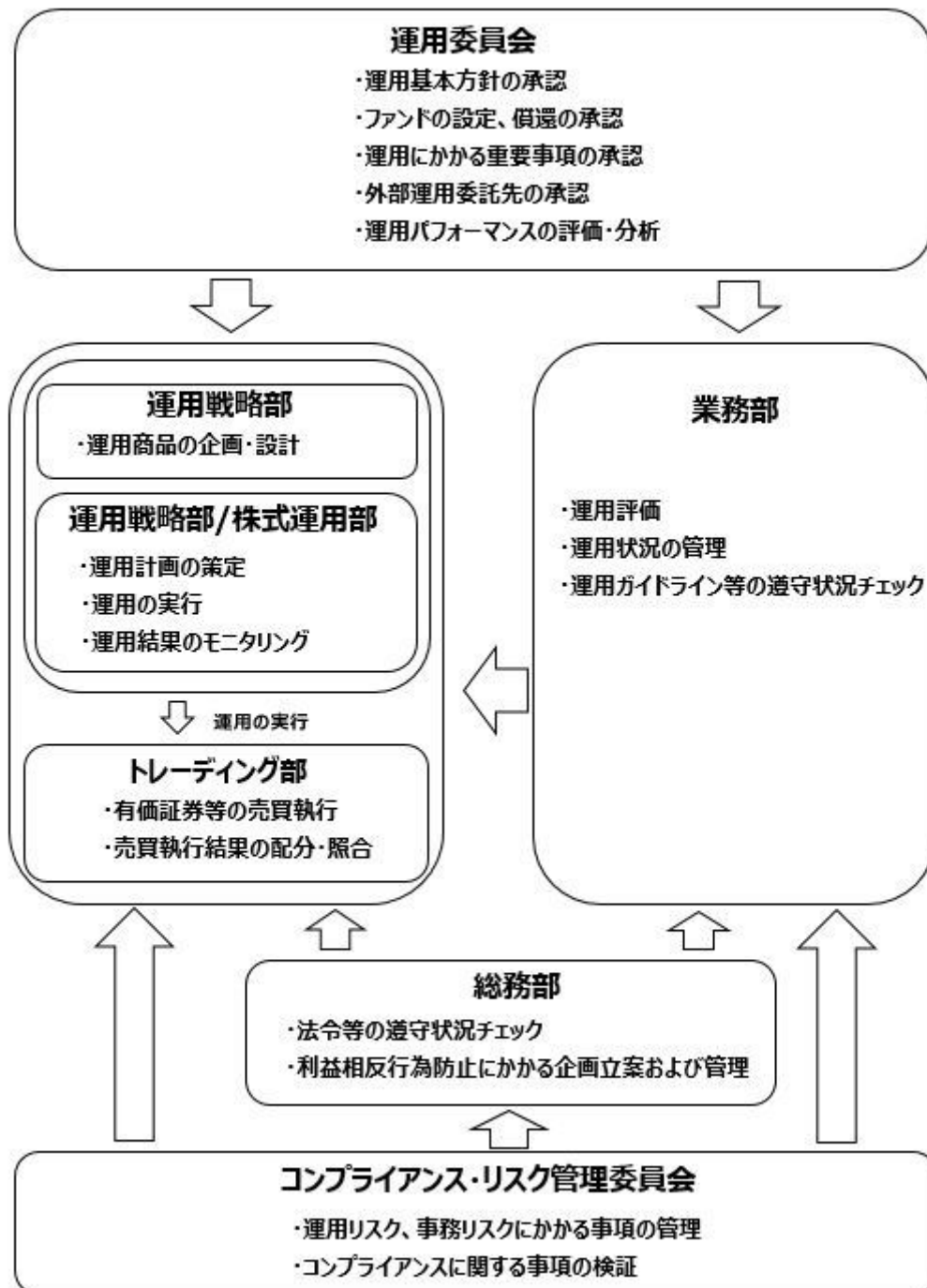
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）</li> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）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



その他の費用など	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

### （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7名程度、運用委員会は7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、2019年6月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

#### （４）【分配方針】

##### 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価額を含みます。）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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

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

##### 収益分配金の支払い

###### <分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>

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

###### <分配金受取りコース（一般コース）>

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

#### （５）【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

###### <FWりそな国内債券インデックスファンド>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。
- 8) 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、8)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わが国の金利にかか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8)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。
- 9) 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を回避するため、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。

#### 10) 金利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を回避するため、金利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. 前記3.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。
5. 金利先渡取引の評価は、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、金利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。

#### 11) 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。

#### 12) 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。

#### < F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

#### 13) 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、
  - 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、
  - 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、
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、
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、

#### 14) 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、
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。

#### < F W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） >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限



ります。)の行使等により取得したものに限りです。

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

- 2) 投資信託証券(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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。
- 8) 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、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)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。
- 9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 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。
- 13) 外国為替予約取引の指図および範囲
- 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

## 14) 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。

## &lt; F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）&gt;

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（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。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一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。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、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。
- 8) 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、8）で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8）で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8）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。

9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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。

八) 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。

#### 12) 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。

#### 13) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

#### 14) 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。

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

2) 投資信託証券（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。

3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のもの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ものとします。

#### 7) 投資する株式の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式は、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。

## 8) 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、8) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8) 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し引いた額。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8)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。

9) 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。

10) 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。

#### 11) 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。

#### 12) 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。

#### 13) 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。

#### 14) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

## 15) 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。

## &lt; F Wりそな先進国株式インデックスファンド &gt;

- 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受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受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) 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。

#### 14) 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。

#### 15) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

#### 16) 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。

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合



は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えるこ

ととなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

#### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総

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

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

#### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

#### 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

#### 17) 資金の借入れ

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

#### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

#### 14) 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。

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。



- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券

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

ヘ) 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受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の

総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

#### 13) 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。

14) 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。

15) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

16) 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

##### <FWりそな国内債券インデックスファンド>

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

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

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

##### 市場リスク

##### ・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。

##### 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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてNOMURA - B P I総合（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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

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

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

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。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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。

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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX、配当込み）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

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

#### < F W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） >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・ 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。

###### ・ 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。

##### 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)

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)(以下、当項目において「指数」といいます。)に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用(信託報酬)、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

<FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)>

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

・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。

・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。当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることをしていますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替変動の影響を受け、基準価額が下落する場合があります。また為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

- ・ 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の場合は、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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて「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）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

当ファンドの基準価額は、実質的に組み入れている有価証券等の値動きにより影響を受けますが、運用

により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・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。

#### 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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに

相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかつた場合も同様です。

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。

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・株価変動リスク

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

###### ・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。

##### 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)

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIEマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)(以下、当項目において「指数」といいます。)に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用(信託報酬)、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

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

#### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・ リートの価格変動リスク

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

##### 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。

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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証REIT指数（配当込み）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・ リートの価格変動リスク

リーートの価格は、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。リーートの価格および分配金がその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

###### ・ 為替変動リスク

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

##### 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）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

- ・ 指数を構成する全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、指数を構成する銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
- ・ 有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
- ・ 外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。

・運用管理費用(信託報酬)、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

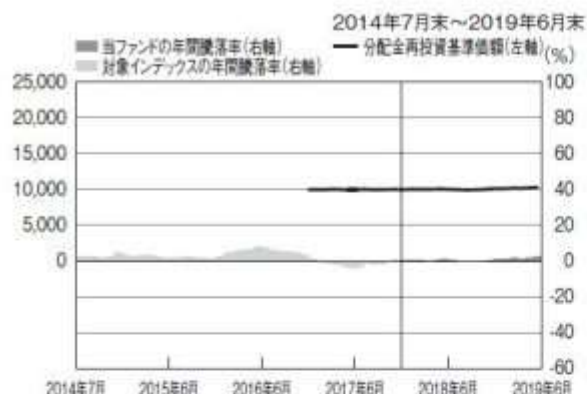
上記体制は2019年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## 【参考情報】

## FWりそな国内債券インデックスファンド

## 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

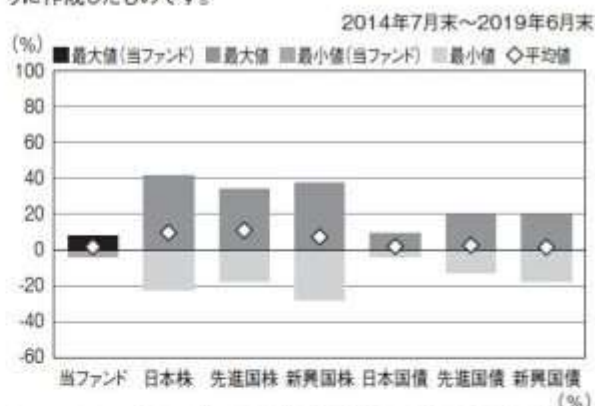


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	8.2	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△3.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.8	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## FWりそな国内株式インデックスファンド

## 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

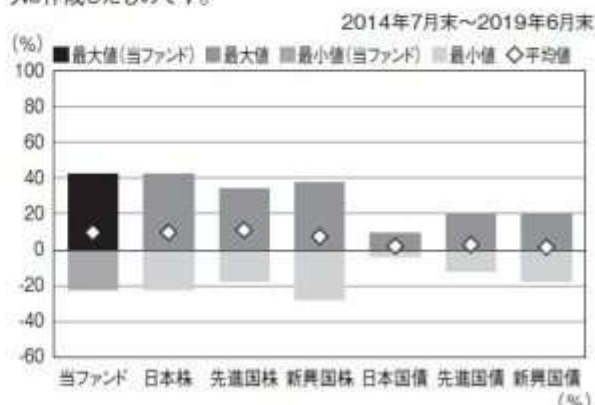


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	41.9	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△22.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	9.6	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## 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)

## 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

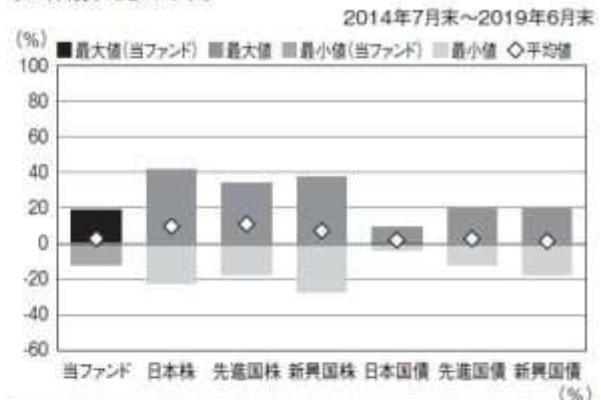


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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。



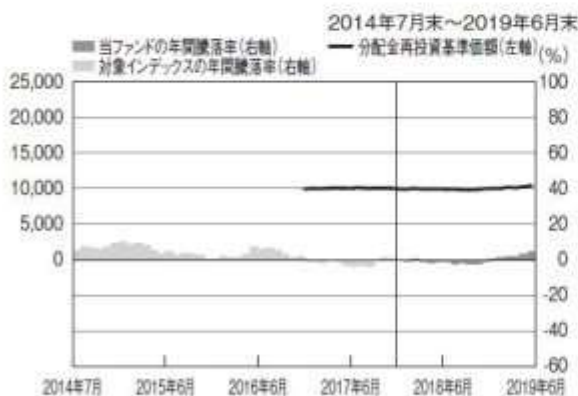
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.9	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△11.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.7	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

## 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、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	10.1	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△3.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.0	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

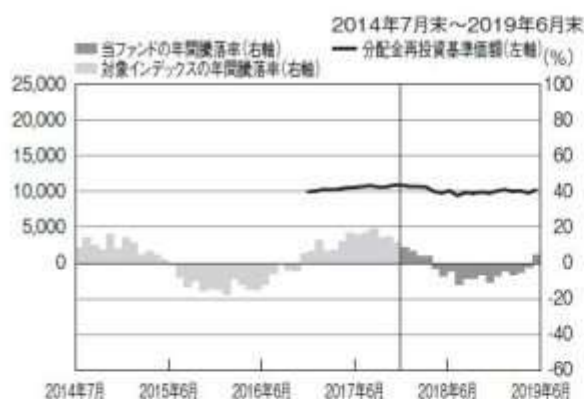
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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



## FWりそな新興国債券インデックスファンド

## 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

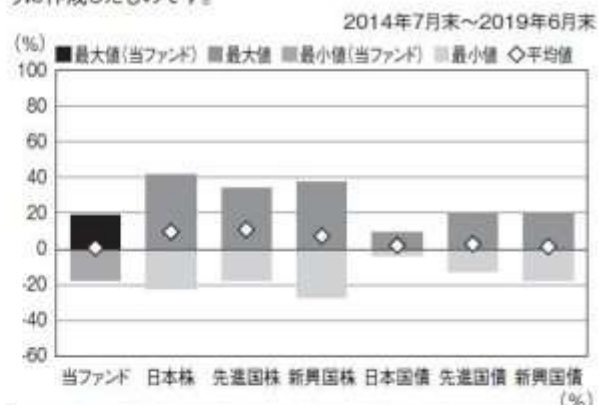


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	19.0	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△17.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.7	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## FWりそな先進国株式インデックスファンド

## 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

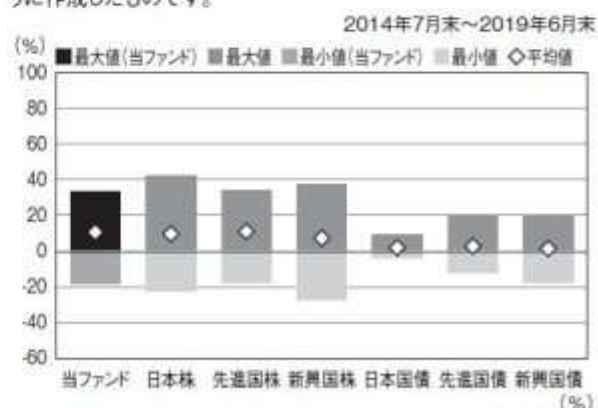


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	33.5	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△18.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	10.6	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## FWりそな新興国株式インデックスファンド

## 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

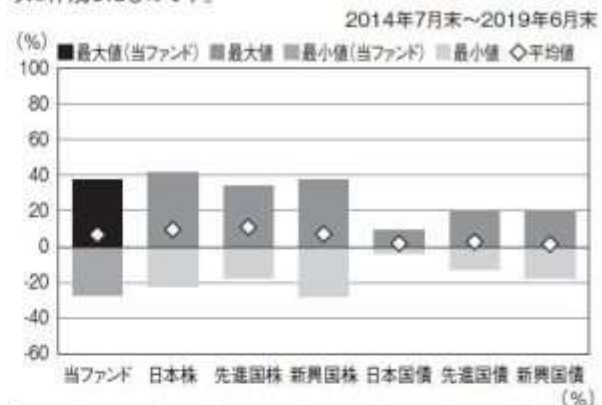


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
  - \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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。

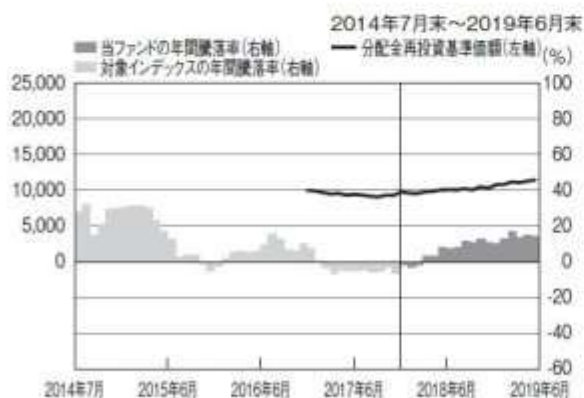


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	37.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△27.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	6.8	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
  - \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## FWりそな国内リートインデックスファンド

## 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

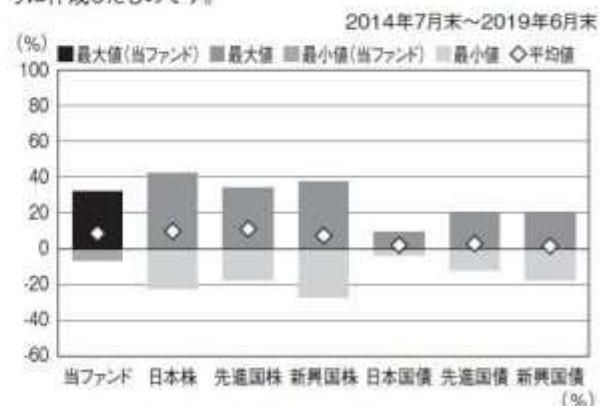


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
  - \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※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	31.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△6.8	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	8.7	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 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。
  - \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。



## FWりそな先進国リートインデックスファンド

## 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

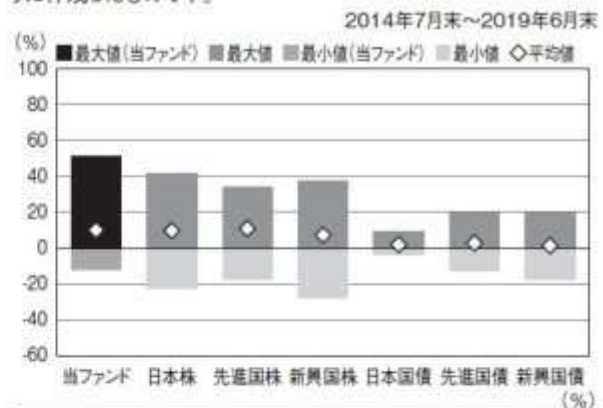


\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定前日目を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。  
\* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

※ 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	51.1	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△12.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	10.0	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

\* 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。  
\* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。  
\* 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、弊社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.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

## JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、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、各ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

年率0.270%（税抜0.250%）

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

年率0.324%（税抜0.300%）

< F W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） >

年率0.378%（税抜0.350%）

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

年率0.378%（税抜0.350%）

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

年率0.594%（税抜0.550%）

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

年率0.432%（税抜0.400%）

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

年率0.648%（税抜0.600%）

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

年率0.324%（税抜0.300%）

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

年率0.432%（税抜0.400%）

#### 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。

ファンド	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
F Wりそな国内債券インデックスファンド	0.250%	0.190%	0.030%	0.030%
F Wりそな国内株式インデックスファンド	0.300%	0.240%		
F W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）	0.350%	0.290%		
F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	0.350%	0.290%		
F Wりそな新興国債券インデックスファンド	0.550%	0.490%		
F Wりそな先進国株式インデックスファンド	0.400%	0.340%		
F Wりそな新興国株式インデックスファンド	0.600%	0.540%		
F Wりそな国内リートインデックスファンド	0.300%	0.240%		
F Wりそな先進国リートインデックスファンド	0.400%	0.340%		

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

#### 支払時期

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

消費税率が10%となった場合は、「(3) 信託報酬等 信託報酬」は以下の通りになります。

#### 信託報酬

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

- < F Wりそな国内債券インデックスファンド >  
年率0.275%（税抜0.250%）
- < F Wりそな国内株式インデックスファンド >  
年率0.330%（税抜0.300%）
- < F W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） >  
年率0.385%（税抜0.350%）
- < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >  
年率0.385%（税抜0.350%）
- < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >  
年率0.605%（税抜0.550%）
- < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >  
年率0.440%（税抜0.400%）
- < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >  
年率0.660%（税抜0.600%）
- < F Wりそな国内リートインデックスファンド >  
年率0.330%（税抜0.300%）
- < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >  
年率0.440%（税抜0.400%）

#### (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す。



す(現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。)

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

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

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

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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(「国内株インデックス」のみ配当控除の適用があります。その他のファンドは、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

原則として、益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

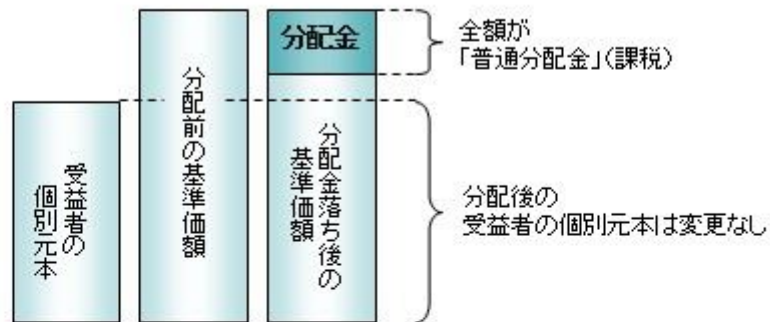
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

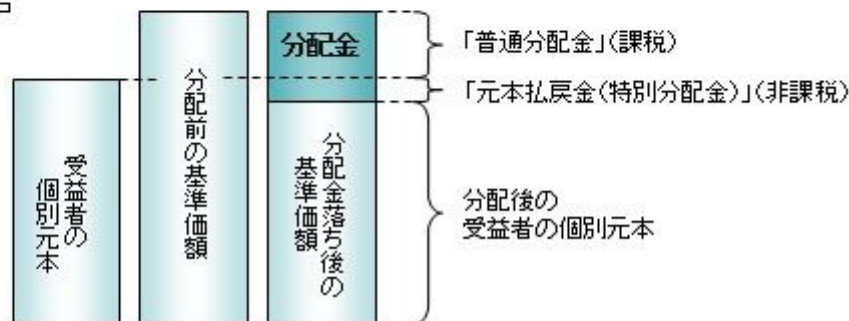
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年6月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	46,139,220,498	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		27,268,541	0.06
合計(純資産総額)		46,166,489,039	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	43,205,562,785	1.0407	44,964,416,457	1.0679	46,139,220,498	99.94

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

#### 【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12月11日)	28,958	28,958	0.9997	0.9997
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,611	47,611	1.0020	1.0020
2018年 6月末日	43,930		1.0043	
7月末日	46,147		1.0023	
8月末日	47,780		0.9966	
9月末日	48,847		0.9939	
10月末日	46,682		0.9954	
11月末日	47,419		0.9993	
12月末日	47,340		1.0064	
2019年 1月末日	46,485		1.0103	
2月末日	46,555		1.0121	
3月末日	47,460		1.0190	
4月末日	44,185		1.0155	
5月末日	45,383		1.0216	
6月末日	46,166		1.0275	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.03
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.23
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	2.40

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,909,645,686	1,943,062,889
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	26,877,211,328	8,328,798,276
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	6,705,885,651	9,626,026,299

(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。

## 【FWりそな国内株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	18,256,542,048	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		8,867,177	0.05
合計（純資産総額）		18,265,409,225	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M国内株式マザーファンド	17,011,313,873	1.0807	18,385,754,299	1.0732	18,256,542,048	99.95

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

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12月11日)	8,186	8,186	1.1849	1.1849
第2計算期間末 (2018年12月10日)	16,834	16,834	1.0571	1.0571
2018年 6月末日	14,099		1.1431	
7月末日	15,502		1.1575	
8月末日	16,004		1.1455	
9月末日	17,298		1.2088	
10月末日	16,673		1.0948	
11月末日	17,626		1.1090	
12月末日	17,225		0.9952	
2019年 1月末日	17,736		1.0438	
2月末日	18,168		1.0704	
3月末日	18,341		1.0711	
4月末日	18,397		1.0885	
5月末日	17,560		1.0175	
6月末日	18,265		1.0451	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	18.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10.79
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	1.15

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	8,464,438,150	1,555,516,946
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10,773,198,886	1,757,205,923
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	3,959,134,450	2,552,621,158

(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。

## 【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)】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	19,473,515,933	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,176,372	0.06
合計(純資産総額)		19,484,692,305	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド	19,712,031,515	0.9717	19,155,679,379	0.9879	19,473,515,933	99.94

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

#### 【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12月11日)	8,788	8,788	1.0508	1.0508
第2計算期間末 (2018年12月10日)	19,813	19,813	1.0139	1.0139
2018年 6月末日	9,847		1.0016	
7月末日	8,494		1.0087	
8月末日	8,825		1.0077	
9月末日	9,186		1.0242	
10月末日	19,396		1.0053	
11月末日	19,789		1.0140	
12月末日	19,582		1.0074	
2019年 1月末日	18,051		1.0006	
2月末日	18,296		1.0144	
3月末日	18,707		1.0276	
4月末日	18,762		1.0244	
5月末日	19,017		1.0158	
6月末日	19,484		1.0287	

#### 【分配の推移】



期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	5.08
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	3.51
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	1.33

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	9,816,051,299	1,452,754,871
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	16,644,523,180	5,465,983,147
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	3,095,928,884	3,849,742,349

(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。

## 【FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	57,246,793,423	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		33,062,247	0.06
合計(純資産総額)		57,279,855,670	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	56,434,141,782	0.9672	54,588,487,649	1.0144	57,246,793,423	99.94

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.94
合 計	99.94

#### 【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12月11日)	28,986	28,986	1.0090	1.0090
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,560	47,560	0.9899	0.9899
2018年 6月末日	43,458		0.9931	
7月末日	45,909		0.9880	
8月末日	47,864		0.9891	
9月末日	48,741		0.9824	
10月末日	46,697		0.9796	
11月末日	47,133		0.9822	
12月末日	47,290		0.9956	
2019年 1月末日	46,419		0.9994	
2月末日	46,346		0.9980	
3月末日	47,633		1.0161	
4月末日	53,802		1.0090	
5月末日	55,740		1.0229	
6月末日	57,279		1.0399	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1.89
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	4.41

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,662,448,431	1,934,517,343
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	27,497,514,870	8,180,419,930
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	12,734,592,152	6,114,874,701

(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。

## 【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,470,691,024	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		830,084	0.06
合計(純資産総額)		1,471,521,108	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	1,331,665,180	1.0576	1,408,424,158	1.1044	1,470,691,024	99.94

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合 計	99.94

#### 【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12月11日)	742	742	1.0790	1.0790
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,769	1,769	0.9796	0.9796
2018年 6月末日	1,080		0.9778	
7月末日	1,258		1.0107	
8月末日	1,212		0.9409	
9月末日	1,297		0.9866	
10月末日	1,738		0.9709	
11月末日	1,795		0.9938	
12月末日	1,743		0.9747	
2019年 1月末日	1,341		1.0067	
2月末日	1,363		1.0231	
3月末日	1,347		1.0016	
4月末日	1,401		1.0098	
5月末日	1,390		0.9780	
6月末日	1,471		1.0214	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	9.21
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	1.13

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	735,295,511	47,003,360
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,230,517,990	112,441,673
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	205,930,241	583,213,620

(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。

## 【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	13,503,036,669	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		6,500,253	0.05
合計（純資産総額）		13,509,536,922	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国株式マザーファンド	10,777,425,708	1.1464	12,355,370,522	1.2529	13,503,036,669	99.95

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合 計	99.95

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

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12月11日)	5,912	5,912	1.1507	1.1507
第2計算期間末 (2018年12月10日)	6,033	6,033	1.1001	1.1001
2018年 6月末日	9,892		1.1344	
7月末日	10,925		1.1788	
8月末日	11,671		1.2042	
9月末日	12,251		1.2344	
10月末日	5,965		1.1250	
11月末日	6,283		1.1502	
12月末日	6,009		1.0299	
2019年 1月末日	12,427		1.0949	
2月末日	13,167		1.1599	
3月末日	13,311		1.1677	
4月末日	13,494		1.2196	
5月末日	12,899		1.1420	
6月末日	13,509		1.1826	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	15.07
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	4.40
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	6.14

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	6,405,695,993	1,267,334,524
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	6,421,790,557	6,075,525,169
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	7,415,015,648	1,563,125,638

(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。

## 【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## （１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,788,769,743	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		797,768	0.04
合計（純資産総額）		1,789,567,511	100.00

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細



国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国株式マザーファンド	1,392,363,776	1.2299	1,712,591,369	1.2847	1,788,769,743	99.96

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

#### 【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12月11日)	873	873	1.2449	1.2449
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,999	1,999	1.0986	1.0986
2018年 6月末日	1,293		1.1456	
7月末日	1,566		1.2018	
8月末日	1,575		1.1676	
9月末日	1,636		1.1881	
10月末日	1,906		1.0592	
11月末日	2,055		1.1297	
12月末日	2,011		1.0557	
2019年 1月末日	1,743		1.1289	
2月末日	1,811		1.1730	
3月末日	1,801		1.1577	
4月末日	1,806		1.2022	
5月末日	1,675		1.0880	
6月末日	1,789		1.1452	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	24.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.75
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	0.24

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	814,658,599	112,792,530
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,273,924,653	155,611,382
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	291,845,487	563,034,212

(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。

## 【FWりそな国内リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,221,688,224	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,125,262	0.05
合計（純資産総額）		2,222,813,486	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国内リートマザーファンド	1,724,110,061	1.1715	2,019,943,900	1.2886	2,221,688,224	99.95

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

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12月11日)	1,168	1,168	0.9275	0.9275
第2計算期間末 (2018年12月10日)	2,602	2,602	1.0343	1.0343
2018年 6月末日	1,789		1.0022	
7月末日	1,770		1.0072	
8月末日	1,831		1.0036	
9月末日	1,904		1.0194	
10月末日	2,488		1.0031	
11月末日	2,626		1.0463	
12月末日	2,533		1.0267	
2019年 1月末日	2,022		1.0742	
2月末日	2,031		1.0794	
3月末日	2,120		1.1147	
4月末日	2,078		1.1062	
5月末日	2,162		1.1252	
6月末日	2,222		1.1416	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.25
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.51
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	8.96

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,436,731,064	176,969,258
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,606,741,957	350,251,304
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	294,612,751	877,827,752

(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。

## 【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## （１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,662,839,769	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,250,847	0.05
合計（純資産総額）		2,664,090,616	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先進国リートマザーファンド	2,419,443,730	1.0572	2,558,054,494	1.1006	2,662,839,769	99.95

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

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12月11日)	1,518	1,518	1.0266	1.0266
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,887	1,887	1.0271	1.0271
2018年 6月末日	1,878		1.0003	
7月末日	2,149		1.0032	
8月末日	2,304		1.0343	
9月末日	2,329		1.0205	
10月末日	1,821		1.0039	
11月末日	1,883		1.0270	
12月末日	1,698		0.9354	
2019年 1月末日	2,583		1.0212	
2月末日	2,643		1.0451	
3月末日	2,758		1.0830	
4月末日	2,634		1.0792	
5月末日	2,623		1.0486	
6月末日	2,664		1.0507	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	2.66
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.05
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	4.22

(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	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,618,331,745	138,782,803
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,601,705,660	1,243,412,814
当中間期	2018年12月11日～2019年 6月10日	1,038,842,304	360,121,274

(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2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	61,123,551,100	84.99
地方債証券	日本	3,637,548,400	5.06
特殊債券	日本	4,300,789,655	5.98
社債券	日本	2,439,245,000	3.39
	フランス	100,878,000	0.14
	オーストラリア	100,555,000	0.14
	小計	2,640,678,000	3.67
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		219,311,803	0.30

合計（純資産総額）	71,921,878,958	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	102.60	790,027,700	102.08	786,077,600	1.200	2020/12/20	1.09
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	721,000,000	103.53	746,502,700	103.83	748,614,300	0.400	2025/3/20	1.04
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	740,000,000	100.98	747,316,600	101.08	748,043,800	0.100	2022/9/20	1.04
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	730,000,000	101.53	741,238,300	101.71	742,548,700	0.100	2024/3/20	1.03
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	670,000,000	101.32	678,881,900	101.62	680,907,600	0.100	2023/12/20	0.95
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	634,000,000	103.73	657,676,800	104.17	660,456,820	0.400	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	640,000,000	101.84	651,794,400	102.79	657,881,600	0.100	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	610,000,000	101.08	616,612,300	101.19	617,259,000	0.100	2022/12/20	0.86
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	590,000,000	101.61	599,507,700	102.79	606,508,200	0.100	2028/3/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	581,000,000	104.08	604,756,400	104.33	606,157,300	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	600,000,000	100.94	605,650,900	100.98	605,916,000	0.100	2022/6/20	0.84
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	590,000,000	101.51	598,915,700	102.64	605,623,200	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	550,000,000	101.37	557,576,000	102.67	564,701,500	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	550,000,000	101.12	556,184,600	101.29	557,117,000	0.100	2023/3/20	0.77
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	540,000,000	102.08	551,242,400	102.55	553,797,000	0.100	2026/6/20	0.77
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	530,000,000	100.68	533,647,000	100.72	533,842,500	0.100	2021/9/20	0.74
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	490,000,000	103.69	508,090,800	103.27	506,067,100	1.100	2021/12/20	0.70
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	477,000,000	104.26	497,320,200	104.21	497,081,700	0.800	2023/6/20	0.69
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	490,000,000	101.22	495,998,200	101.42	496,972,700	0.100	2023/6/20	0.69
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	470,000,000	103.53	486,623,900	103.34	485,712,100	0.800	2022/9/20	0.68
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	470,000,000	101.86	478,767,400	102.74	482,887,400	0.100	2026/12/20	0.67
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	461,000,000	103.18	475,696,680	103.15	475,526,110	0.600	2023/3/20	0.66
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	385,000,000	121.57	468,070,700	123.48	475,432,650	1.700	2033/6/20	0.66
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	470,000,000	100.85	473,995,000	100.90	474,239,400	0.100	2022/3/20	0.66
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	470,000,000	100.64	473,045,600	100.63	472,975,100	0.100	2021/6/20	0.66



日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	445,000,000	103.93	462,524,100	104.10	463,276,150	0.600	2024/3/20	0.64
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	450,000,000	101.71	457,738,200	102.85	462,829,500	0.100	2027/12/20	0.64
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	450,000,000	102.23	460,038,500	102.64	461,920,500	0.100	2026/9/20	0.64
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	450,000,000	101.21	455,459,800	101.53	456,912,000	0.100	2023/9/20	0.64
日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	365,000,000	118.58	432,817,000	121.27	442,646,450	1.500	2034/3/20	0.62

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.99
地方債証券	5.06
特殊債券	5.98
社債券	3.67
合計	99.70

### 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

該当事項はありません。

### RAM国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	26,837,729,380	96.74
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		903,633,487	3.26
合計(純資産総額)		27,741,362,867	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	876,315,000	3.16

(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	134,600	6,726.02	905,323,007	6,688.00	900,204,800	3.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	99,000	4,305.57	426,251,934	5,165.00	511,335,000	1.84
日本	株式	ソニー	電気機器	81,000	5,281.18	427,775,657	5,648.00	457,488,000	1.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	819,900	576.58	472,743,022	512.00	419,788,800	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	81,000	4,714.82	381,901,229	5,017.00	406,377,000	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	105,400	4,450.71	469,105,282	3,823.00	402,944,200	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,900	55,983.15	330,300,621	66,130.00	390,167,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	83,900	3,983.61	334,225,328	3,806.00	319,323,400	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	82,700	2,851.16	235,790,951	3,594.00	297,223,800	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	101,900	3,208.06	326,902,289	2,785.00	283,791,500	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	6,900	33,783.20	233,104,140	39,490.00	272,481,000	0.98
日本	株式	KDDI	情報・通信業	97,100	2,690.14	261,212,594	2,743.50	266,393,850	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,618,400	176.52	285,680,664	156.10	252,632,240	0.91
日本	株式	花王	化学	29,300	7,739.16	226,757,635	8,210.00	240,553,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	83,500	3,102.98	259,099,520	2,840.00	237,140,000	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,800	23,323.90	251,898,135	21,580.00	233,064,000	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,500	12,097.65	199,611,263	14,065.00	232,072,500	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	42,600	5,370.48	228,782,486	5,399.00	229,997,400	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	11,500	18,706.58	215,125,766	19,930.00	229,195,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	21,500	10,048.93	216,052,094	10,080.00	216,720,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	54,400	3,425.50	186,347,474	3,949.00	214,825,600	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	14,500	13,161.99	190,848,957	14,725.00	213,512,500	0.77
日本	株式	信越化学工業	化学	20,800	9,104.39	189,371,442	10,035.00	208,728,000	0.75
日本	株式	キヤノン	電気機器	65,000	3,134.57	203,747,523	3,146.00	204,490,000	0.74
日本	株式	HOYA	精密機器	24,300	6,410.06	155,764,695	8,254.00	200,572,200	0.72
日本	株式	第一三共	医薬品	34,600	3,960.37	137,028,853	5,635.00	194,971,000	0.70
日本	株式	資生堂	化学	24,000	6,597.65	158,343,795	8,121.00	194,904,000	0.70
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	75,000	2,583.27	193,745,689	2,512.50	188,437,500	0.68
日本	株式	村田製作所	電気機器	38,000	5,064.00	192,432,163	4,840.00	183,920,000	0.66
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	49,900	4,646.17	231,844,248	3,648.00	182,035,200	0.66

## 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	0.27
		建設業	2.71
		食料品	3.99
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.16
		医薬品	5.32
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.88
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.54
		機械	5.00
		電気機器	13.15
		輸送用機器	7.59
		精密機器	2.07
		その他製品	2.10
		電気・ガス業	1.61
		陸運業	4.57
		海運業	0.16
		空運業	0.53
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.61
		卸売業	4.80
		小売業	4.40
		銀行業	5.67
		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	2.21
その他金融業	1.09		
不動産業	2.35		
サービス業	5.11		
合 計		96.74	

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）

株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	56	日本円	870,265,240	868,560,000	3.13
	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	5	日本円	7,779,490	7,755,000	0.03

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

### R A M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	16,479,180,934	46.62
	カナダ	685,194,973	1.94
	メキシコ	282,741,620	0.80
	ドイツ	2,350,264,298	6.65
	イタリア	3,087,477,536	8.73
	フランス	3,509,404,005	9.93
	オランダ	709,670,506	2.01
	スペイン	2,045,748,397	5.79
	ベルギー	887,788,648	2.51
	オーストリア	524,328,724	1.48
	フィンランド	202,289,919	0.57
	アイルランド	262,722,720	0.74
	イギリス	2,232,927,325	6.32
	スウェーデン	119,956,046	0.34
	ノルウェー	85,298,681	0.24
	デンマーク	182,185,868	0.52
	ポーランド	203,149,333	0.57
	オーストラリア	708,988,589	2.01
	シンガポール	140,343,662	0.40
	マレーシア	154,905,413	0.44
南アフリカ	202,956,589	0.57	
	小計	35,057,523,786	99.18
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		290,647,755	0.82
合計(純資産総額)		35,348,171,541	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		135,662,862	0.38

(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	1,740,000	10,625.94	184,891,453	10,742.57	186,920,853	1.625	2020/7/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,660,000	10,575.78	175,558,053	10,711.63	177,813,079	1.375	2020/8/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,601.73	169,627,760	10,729.31	171,669,044	1.500	2020/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	10,476.07	161,331,585	11,040.05	170,016,821	2.250	2027/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,490,000	10,632.98	158,431,491	10,895.00	162,335,506	2.000	2024/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	10,518.92	152,524,363	10,677.10	154,818,007	1.250	2021/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	11,206.33	146,802,940	11,816.05	154,790,350	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	10,503.92	141,803,011	10,884.68	146,943,230	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,446.32	138,936,157	11,027.63	146,667,515	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	10,863.76	140,142,575	11,359.42	146,536,558	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,566.47	140,534,104	10,710.15	142,445,083	1.375	2020/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	10,832.26	139,736,196	11,002.79	141,935,995	2.750	2021/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	10,394.99	137,213,975	10,635.41	140,387,536	1.125	2021/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	10,756.68	135,534,207	11,104.89	139,921,683	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,928.68	131,144,213	11,576.05	138,912,677	2.875	2028/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	10,557.10	134,075,238	10,780.89	136,917,351	1.750	2021/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,927.42	128,943,573	11,567.21	136,493,130	2.875	2028/5/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	19,875.47	123,227,929	21,980.38	136,278,415	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,821.03	127,688,250	11,453.10	135,146,673	2.750	2028/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	10,203.27	128,561,273	10,615.41	133,754,291	1.625	2026/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,555.80	126,669,707	11,137.31	133,647,799	2.375	2027/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,210,000	10,518.87	127,278,331	10,956.05	132,568,236	2.125	2025/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	10,592.31	126,048,575	11,033.52	131,298,967	2.250	2025/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,633.14	125,471,112	11,011.42	129,934,782	2.250	2024/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,614.88	125,255,675	10,903.84	128,665,340	2.000	2024/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,428.49	123,056,224	10,722.57	126,526,424	1.625	2023/10/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	10,482.36	122,643,684	10,785.94	126,195,580	1.750	2022/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	10,282.15	119,272,997	10,853.73	125,903,340	2.000	2026/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	10,444.95	121,161,519	10,656.68	123,617,524	1.250	2021/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,120,000	10,466.30	117,222,667	11,031.84	123,556,642	2.250	2027/8/15	0.35

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.18
合計	99.18

## 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	663,700.00	71,547,442	71,507,838	0.20
	ユーロ	買建	523,800.00	64,192,910	64,155,024	0.18

(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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	43,054,546,463	46.39
	カナダ	1,793,294,581	1.93
	メキシコ	761,519,704	0.82
	ドイツ	6,117,801,599	6.59
	イタリア	8,060,590,008	8.69
	フランス	9,167,191,742	9.88
	オランダ	1,845,565,082	1.99
	スペイン	5,352,806,537	5.77
	ベルギー	2,313,661,606	2.49
	オーストリア	1,360,221,229	1.47
	フィンランド	547,888,816	0.59
	アイルランド	684,036,009	0.74
	イギリス	5,849,831,071	6.30
	スウェーデン	321,123,455	0.35
	ノルウェー	238,216,897	0.26
	デンマーク	480,026,062	0.52
	ポーランド	562,187,712	0.61
	オーストラリア	1,844,280,095	1.99
	シンガポール	377,754,053	0.41
	マレーシア	430,356,412	0.46
南アフリカ	521,981,037	0.56	
	小計	91,684,880,170	98.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,123,113,430	1.21
合計（純資産総額）		92,807,993,600	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		73,003,215	0.08
	売建		90,992,528,320	98.04

(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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,210,000	11,062.23	465,720,278	11,359.42	478,231,721	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,220,000	10,715.09	452,177,110	11,033.52	465,614,826	2.250	2025/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,240,000	10,886.53	461,589,290	10,946.57	464,134,948	2.625	2021/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,300,000	10,597.36	455,686,552	10,698.15	460,020,772	1.375	2021/5/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,220,000	10,796.53	455,613,592	10,868.47	458,649,570	2.250	2021/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,820,000	10,950.11	418,294,340	11,453.10	437,508,720	2.750	2028/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,840,000	10,724.99	411,839,903	10,848.68	416,589,468	2.000	2021/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,730,000	10,858.80	405,033,288	11,148.47	415,838,117	2.500	2024/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,480,000	11,251.56	391,554,469	11,816.05	411,198,793	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,730,000	10,715.84	399,700,993	10,850.78	404,734,437	2.000	2021/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,750,000	10,670.05	400,127,054	10,745.52	402,957,217	1.625	2020/11/30	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	2,580,000	15,314.08	395,103,473	15,518.03	400,365,371	3.500	2026/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	10,618.63	380,147,197	11,040.05	395,233,910	2.250	2027/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,340,000	11,020.99	368,101,176	11,576.05	386,640,281	2.875	2028/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,490,000	10,574.79	369,060,466	11,027.21	384,849,672	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,560,000	10,538.33	375,164,649	10,703.41	381,041,745	1.375	2021/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,490,000	10,318.28	360,108,303	10,615.42	370,478,159	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,195.11	358,243,815	11,420.68	365,461,978	2.875	2025/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,310,000	10,826.53	358,358,312	11,011.42	364,478,073	2.250	2024/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,350,000	10,633.65	356,227,353	10,764.05	360,595,731	1.750	2020/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,220,000	10,868.07	349,951,962	10,900.89	351,008,797	2.500	2021/2/28	0.38
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	2,470,000	13,368.74	330,208,108	14,185.92	350,392,277	1.500	2031/5/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,270,000	10,569.95	345,637,561	10,677.10	349,141,299	1.250	2021/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,645.71	340,662,931	10,784.26	345,096,394	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	10,976.33	318,313,605	11,828.68	343,031,987	3.000	2048/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,130,000	10,668.47	333,923,366	10,880.05	340,545,663	2.000	2023/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,560,000	12,500.47	320,012,043	13,276.69	339,883,413	3.750	2043/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,930,000	10,894.54	319,210,222	11,567.21	338,919,381	2.875	2028/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,080,000	10,751.98	331,161,215	10,959.00	337,537,220	2.125	2024/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,050,000	10,697.59	326,276,557	10,956.05	334,159,604	2.125	2025/5/15	0.36

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.79
合計	98.79

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	379,500.00	40,744,789	40,891,125	0.04
	ノルウェークローネ	買建	2,536,500.00	31,883,805	32,112,090	0.03
	米ドル	売建	398,857,000.00	42,863,135,838	42,837,241,800	46.16
	カナダドル	売建	21,914,000.00	1,799,441,813	1,799,139,400	1.94
	メキシコペソ	売建	137,204,000.00	763,924,431	761,482,200	0.82
	ユーロ	売建	285,643,000.00	34,998,322,882	34,976,985,350	37.69
	英ポンド	売建	42,944,000.00	5,858,403,302	5,855,414,400	6.31
	スウェーデンクローナ	売建	27,749,000.00	322,368,457	322,165,890	0.35
	ノルウェークローネ	売建	18,852,000.00	238,117,027	238,100,760	0.26
	デンマーククローネ	売建	29,042,000.00	476,686,675	476,579,220	0.51
	ポーランドズロチ	売建	19,700,000.00	566,595,640	566,178,000	0.61
	オーストラリアドル	売建	24,334,000.00	1,832,982,884	1,832,350,200	1.97
	シンガポールドル	売建	4,755,000.00	377,718,180	377,689,650	0.41
	マレーシアリングギット	売建	16,100,000.00	418,746,048	418,600,000	0.45
	南アフリカランド	売建	70,465,000.00	531,214,495	530,601,450	0.57

(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2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	3,190,380,639	99.97
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,007,147	0.03
合計（純資産総額）		3,191,387,786	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		2,855,375	0.09

(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 E	854,449	3,641.32	3,111,322,871	3,733.84	3,190,380,639	99.97

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	26,500.00	2,858,528	2,855,375	0.09

(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先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	14,808,537,434	57.30
	カナダ	900,806,858	3.49
	モーリシャス	140,794	0.00
	パナマ	13,631,520	0.05

	ドイツ	749,394,360	2.90
	イタリア	163,094,207	0.63
	フランス	881,762,011	3.41
	オランダ	421,067,402	1.63
	スペイン	258,129,912	1.00
	ベルギー	81,932,416	0.32
	オーストリア	17,318,266	0.07
	ルクセンブルク	22,196,514	0.09
	フィンランド	95,916,062	0.37
	アイルランド	422,117,244	1.63
	ポルトガル	14,858,377	0.06
	イギリス	1,420,402,557	5.50
	スイス	877,565,721	3.40
	スウェーデン	214,003,763	0.83
	ノルウェー	57,044,720	0.22
	デンマーク	147,980,023	0.57
	ケイマン	59,455,156	0.23
	リベリア	14,878,642	0.06
	オーストラリア	570,879,143	2.21
	バミューダ	86,696,578	0.34
	ニュージーランド	18,479,962	0.07
	パプアニューギニア	3,642,725	0.01
	香港	243,666,768	0.94
	シンガポール	103,984,152	0.40
	イスラエル	49,849,328	0.19
	キュラソー	35,466,406	0.14
	ジャージー	88,176,458	0.34
	英ヴァージン諸島	3,001,520	0.01
	マン島	1,309,843	0.01
	小計	22,847,386,842	88.41
投資証券	アメリカ	506,522,449	1.96
	カナダ	639,235	0.00
	フランス	24,964,980	0.10
	イギリス	12,667,099	0.05
	オーストラリア	45,829,347	0.18
	香港	18,842,656	0.07
	シンガポール	14,902,231	0.06
	小計	624,367,997	2.42
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,372,165,232	9.18
合計（純資産総額）		25,843,920,071	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	1,848,142,008	7.15
	買建	ドイツ	551,717,617	2.13

(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		51,051,980	0.20

(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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	42,135	11,945.35	503,317,725	14,460.02	609,273,301	2.36
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	27,271	17,163.84	468,075,100	21,529.97	587,143,937	2.27
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2,417	182,209.13	440,399,480	205,262.34	496,119,079	1.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	13,864	16,428.70	227,767,563	20,426.20	283,188,906	1.10
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	15,446	13,943.42	215,370,159	15,164.97	234,238,205	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	18,999	11,186.09	212,524,693	11,731.86	222,893,677	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,831	116,479.97	213,274,833	115,983.11	212,365,089	0.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1,744	117,449.84	204,832,533	116,049.94	202,391,109	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	24,655	7,789.80	192,057,758	8,172.63	201,496,385	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	17,808	9,672.42	172,246,556	11,106.85	197,790,820	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	10,162	15,456.38	157,067,812	18,456.88	187,558,832	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	7,607	21,734.42	165,333,765	22,853.63	173,847,608	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	14,514	10,445.66	151,608,437	11,833.18	171,746,864	0.66
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	53,361	3,113.67	166,148,630	3,040.75	162,257,776	0.63
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	10,518	12,377.09	130,182,284	15,015.14	157,929,316	0.61
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	25,623	5,092.69	130,490,062	6,007.13	153,920,864	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	42,552	3,332.25	141,793,977	3,554.91	151,268,709	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	32,293	4,451.81	143,762,613	4,681.31	151,173,857	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	5,308	22,736.16	120,683,577	28,143.96	149,388,187	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	24,137	6,166.20	148,833,580	6,170.97	148,948,884	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	5,578	28,314.98	157,941,001	26,552.98	148,112,570	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	11,091	12,409.04	137,628,669	13,270.02	147,177,868	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	6,585	19,569.28	128,863,749	22,314.68	146,942,206	0.57
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	15,027	8,064.68	121,188,052	9,036.03	135,784,508	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	26,136	5,296.91	138,440,053	5,115.71	133,704,285	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	23,657	5,193.43	122,860,991	5,505.91	130,253,389	0.50
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	25,194	5,330.36	134,293,093	4,989.59	125,707,960	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	12,659	8,649.47	109,493,658	9,853.24	124,732,222	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,102	28,626.13	117,424,397	30,213.59	123,936,177	0.48
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	3,140	38,695.90	121,505,137	39,237.71	123,206,428	0.48

## 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	5.49
		素材	4.09
		資本財	6.42
		商業・専門サービス	1.14
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.03
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	5.33
		小売	4.42
		食品・生活必需品小売り	1.36
		食品・飲料・タバコ	4.49
		家庭用品・パーソナル用品	1.93
		ヘルスケア機器・サービス	4.36
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.38		

	銀行	7.10
	各種金融	3.87
	保険	3.64
	不動産	0.53
	ソフトウェア・サービス	8.76
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
	電気通信サービス	2.17
	公益事業	3.16
	半導体・半導体製造装置	2.61
投資証券		2.42
合計		90.82

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	SP500MIN1909	買建	117	米ドル	16,957,662.5	1,827,866,442	17,145,765	1,848,142,008	7.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6001909	買建	237	ユーロ	4,524,185	554,167,421	4,504,185	551,717,617	2.13

(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	280,000.00	30,153,216	30,164,800	0.12
	カナダドル	買建	20,000.00	1,645,336	1,645,800	0.01
	ユーロ	買建	80,000.00	9,796,437	9,798,400	0.04
	英ポンド	買建	52,000.00	7,105,450	7,099,880	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	30,000.00	348,456	348,300	0.00
	オーストラリアドル	買建	10,000.00	754,196	754,600	0.00
	香港ドル	買建	90,000.00	1,240,200	1,240,200	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。

## RAM新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	21,847,880	0.31
	アルゼンチン	16,843,426	0.24
	メキシコ	147,681,246	2.07
	ブラジル	453,363,002	6.35
	チリ	54,651,100	0.77
	コロンビア	25,446,575	0.36
	ペルー	4,261,003	0.06
	オランダ	4,362,100	0.06
	ルクセンブルク	6,105,392	0.09
	ギリシャ	18,701,097	0.26
	トルコ	28,646,373	0.40
	チェコ	8,975,043	0.13
	ハンガリー	17,705,433	0.25
	ポーランド	67,010,697	0.94
	ロシア	221,318,087	3.10
	ケイマン	967,054,054	13.54
	バミューダ	55,358,147	0.78
	香港	193,522,240	2.71
	シンガポール	1,976,521	0.03
	マレーシア	127,078,307	1.78
	タイ	176,927,975	2.48
	フィリピン	66,706,556	0.93
	インドネシア	127,466,000	1.78
	韓国	734,080,582	10.28
	台湾	638,891,060	8.95
	中国	666,586,470	9.33
	インド	538,143,154	7.54
	カタール	59,102,423	0.83
	エジプト	5,735,341	0.08
	南アフリカ	333,850,507	4.68
	アラブ首長国連邦	42,045,679	0.59
	マン島	3,546,920	0.05
小計		5,834,990,390	81.71
投資証券	メキシコ	4,523,330	0.06
	南アフリカ	11,371,970	0.16
	小計		15,895,300
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,290,238,118	18.07
合計（純資産総額）		7,141,123,808	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	1,286,358,309	18.01

(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		10,954,740	0.15
	売建		118,004	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	メディア・ 娯楽	56,500	4,554.14	257,309,396	4,865.11	274,878,828	3.85
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	14,030	16,870.03	236,686,627	18,421.31	258,450,993	3.62
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	49,170	4,019.59	197,643,692	4,338.44	213,321,586	2.99
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	244,000	776.05	189,358,424	834.53	203,626,540	2.85
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,332	22,362.30	96,873,496	25,609.34	110,939,661	1.55
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	959,000	92.02	88,247,853	92.11	88,340,395	1.24
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	55,500	1,027.22	57,010,825	1,296.94	71,980,697	1.01
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	61,500	1,122.95	69,061,818	984.60	60,553,269	0.85
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,400	1,967.53	55,877,969	2,000.41	56,811,800	0.80
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	73,200	724.22	53,013,575	767.61	56,189,323	0.79
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	16,297	3,101.45	50,544,344	3,446.85	56,173,420	0.79
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	50,000	1,014.73	50,736,502	1,068.40	53,420,050	0.75
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	639,000	80.67	51,549,380	78.32	50,051,081	0.70
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	銀行	48,800	1,047.47	51,116,844	1,021.88	49,868,110	0.70
ブラジル	株式	VALE SA	素材	32,000	1,559.92	49,917,698	1,457.42	46,637,536	0.65
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	26,697	1,428.75	38,143,359	1,668.58	44,546,326	0.62
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	51,229	525.63	26,927,938	790.10	40,476,069	0.57
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	34,862	1,149.59	40,077,124	1,146.96	39,985,442	0.56
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	4,012	8,530.50	34,224,368	9,211.73	36,957,474	0.52
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	801,000	48.11	38,541,391	45.36	36,340,649	0.51

韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	5,355	6,594.49	35,313,543	6,549.65	35,073,429	0.49
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,750	17,155.34	47,177,205	12,507.95	34,396,867	0.48
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	123,800	243.55	30,152,384	268.57	33,249,956	0.47
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	179,000	177.33	31,742,729	185.61	33,224,799	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	9,012	3,014.53	27,166,984	3,536.50	31,870,970	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	343,100	83.00	28,480,349	79.07	27,130,084	0.38
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	46,300	577.15	26,722,445	560.05	25,930,449	0.36
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	7,420	2,424.64	17,990,853	3,264.95	24,225,996	0.34
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	19,208	1,060.72	20,374,436	1,256.70	24,138,818	0.34
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	46,400	484.06	22,460,464	508.82	23,609,689	0.33

## 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	6.53
		素材	6.00
		資本財	2.68
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.95
		耐久消費財・アパレル	1.05
		消費者サービス	1.10
		メディア・娯楽	5.85
		小売	6.95
		食品・生活必需品小売り	1.45
		食品・飲料・タバコ	3.08
		家庭用品・パーソナル用品	0.89
		ヘルスケア機器・サービス	0.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.58
		銀行	15.24
		各種金融	2.21
		保険	3.29
		不動産	2.23
		ソフトウェア・サービス	1.60
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.65		
電気通信サービス	3.77		
公益事業	2.19		
半導体・半導体製造装置	4.13		
投資証券			0.22



合 計	81.93
-----	-------

## 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 1909	買建	226	米ドル	11,703,370	1,261,506,250	11,933,930	1,286,358,309	18.01

(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	76,094.03	8,179,909	8,198,740	0.11
	香港ドル	買建	200,000.00	2,756,000	2,756,000	0.04
	ブラジルレアル	売建	1,442.13	40,379	40,652	0.00
	オフショア人民元	売建	4,936.47	77,204	77,352	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2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	15,565,278,400	97.75
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		358,714,519	2.25
合計(純資産総額)		15,923,992,919	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	334,254,000	2.10

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

## 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	1,554	713,416.13	1,108,648,674	738,000	1,146,852,000	7.20
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,605	638,901.01	1,025,436,137	656,000	1,052,880,000	6.61
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,993	156,302.88	780,420,322	165,700	827,340,100	5.20
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,033	219,367.06	665,340,322	218,000	661,194,000	4.15
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,603	172,269.39	620,686,618	180,600	650,701,800	4.09
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,197	187,410.64	599,151,823	196,600	628,530,200	3.95
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,305	233,616.71	538,486,521	248,900	573,714,500	3.60
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,153	251,510.95	541,503,090	260,100	559,995,300	3.52
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,564	318,181.98	497,636,630	320,500	501,262,000	3.15
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,976	114,008.92	453,299,483	122,800	488,252,800	3.07
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,016	441,649.46	448,715,852	467,000	474,472,000	2.98
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,165	83,536.32	431,465,119	86,800	448,322,000	2.82
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	843	466,630.69	393,369,674	469,000	395,367,000	2.48
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	496	746,698.2	370,362,308	771,000	382,416,000	2.40
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,692	76,597.51	359,395,518	80,600	378,175,200	2.37
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	533	563,611.79	300,405,086	604,000	321,932,000	2.02
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	5,536	49,890.24	276,192,388	55,800	308,908,800	1.94
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	370	734,251.51	271,673,059	773,000	286,010,000	1.80
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,840	145,781.16	268,237,344	152,600	280,784,000	1.76
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,969	120,639.65	237,539,475	134,000	263,846,000	1.66
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,048	232,951.51	244,133,187	246,700	258,541,600	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	546	453,163.57	247,427,310	460,000	251,160,000	1.58
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,297	178,333.39	231,298,418	187,100	242,668,700	1.52
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,437	155,528.17	223,493,986	158,200	227,333,400	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,647	131,789.19	217,056,812	138,000	227,286,000	1.43
日本	投資証券	日本リート投資法人	518	390,289.2	202,169,809	419,000	217,042,000	1.36
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,526	134,370.08	205,048,755	141,800	216,386,800	1.36
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	665	293,960.55	195,483,767	309,500	205,817,500	1.29
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	1,076	170,584.65	183,549,092	187,200	201,427,200	1.26
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	1,147	170,746.13	195,845,815	175,200	200,954,400	1.26

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.75
合計	97.75

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	174	日本円	330,832,692	334,254,000	2.10

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

## RAM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	9,753,924,116	71.96
	カナダ	261,556,271	1.93
	ドイツ	36,618,757	0.27
	イタリア	3,436,138	0.03
	フランス	514,623,797	3.80
	オランダ	38,405,237	0.28
	スペイン	93,165,406	0.69
	ベルギー	125,580,544	0.93
	アイルランド	36,248,855	0.27
	イギリス	637,026,885	4.70
	オーストラリア	976,111,298	7.20
	ニュージーランド	67,377,018	0.50
	香港	335,462,987	2.48
	シンガポール	537,964,669	3.97
	韓国	2,570,601	0.02
	イスラエル	10,022,447	0.07
	ガーンジー	24,667,595	0.18
マン島	3,739,352	0.03	
	小計	13,458,501,973	99.30
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		95,290,927	0.70
合計（純資産総額）		13,553,792,900	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		38,590,384	0.28
	売建		40,877	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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	64,886	7,164.10	464,849,958	8,554.21	555,048,756	4.10
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,784	18,837.57	598,733,400	17,238.85	547,919,758	4.04
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	15,455	22,284.83	344,412,123	25,550.54	394,883,620	2.91
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	41,699	8,144.97	339,637,450	8,798.89	366,905,235	2.71
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,365	20,262.93	291,076,991	21,713.21	311,910,371	2.30
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	38,170	7,682.69	293,248,568	8,150.00	311,085,573	2.30
香港	投資証券	LINK REIT	217,400	1,148.67	249,721,444	1,345.90	292,599,530	2.16
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	38,088	6,753.01	257,208,926	7,482.78	285,004,193	2.10
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,471	11,470.47	246,282,665	12,676.10	272,168,629	2.01
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	32,532	7,080.00	230,326,829	7,482.78	243,429,858	1.80
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,211	18,242.99	259,251,183	15,586.85	221,504,761	1.63
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	15,985	13,326.48	213,023,901	13,800.35	220,598,654	1.63
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,796	28,680.55	194,913,062	31,083.40	211,242,802	1.56
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	165,950	906.69	150,466,010	1,151.22	191,045,374	1.41
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,701	13,706.17	160,375,977	15,097.06	176,650,786	1.30
アメリカ	投資証券	HCP INC	49,510	3,244.81	160,650,581	3,427.72	169,706,516	1.25
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	551,752	294.11	162,278,296	299.69	165,357,481	1.22
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	17,451	7,850.84	137,005,158	8,776.26	153,154,545	1.13
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,223	10,183.76	134,659,936	11,383.70	150,526,690	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	76,867	1,883.20	144,756,631	1,941.29	149,221,746	1.10
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,822	11,024.49	130,331,578	12,538.13	148,225,806	1.09
アメリカ	投資証券	UDR INC	28,853	4,579.95	132,145,561	4,805.27	138,646,692	1.02
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	9,235	11,668.05	107,754,478	13,646.21	126,022,786	0.93
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	36,805	3,102.44	114,185,560	3,364.12	123,816,654	0.91
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	17,115	6,726.06	115,116,675	7,211.15	123,418,849	0.91
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	17,776	7,125.83	126,668,890	6,864.06	122,015,659	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,210	11,170.35	102,878,998	12,900.30	118,811,829	0.88
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	39,251	2,446.67	96,034,625	2,859.66	112,244,856	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	9,902	10,145.53	100,461,090	11,172.43	110,629,437	0.82
オーストラリア	投資証券	DEXUS	110,972	886.65	98,394,244	990.42	109,909,865	0.81

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.30
合計	99.30

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	170,378.42	18,376,832	18,358,074	0.14
	カナダドル	買建	30,000.00	2,468,004	2,468,700	0.02
	英ポンド	買建	40,000.00	5,476,200	5,462,000	0.04
	オーストラリアドル	買建	163,000.00	12,303,566	12,301,610	0.09
	韓国ウォン	売建	438,130.00	40,877	40,877	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。

## 参考情報

## 運用実績

## FWりそな国内債券インデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.7%
先物	0.0%
現金等	0.3%
合計	100.0%

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第312回利付国債(10年)	1.20%	2020/12/20	1.1%
2	第338回利付国債(10年)	0.40%	2025/03/20	1.0%
3	第133回利付国債(5年)	0.10%	2022/09/20	1.0%
4	第139回利付国債(5年)	0.10%	2024/03/20	1.0%
5	第138回利付国債(5年)	0.10%	2023/12/20	0.9%
6	第340回利付国債(10年)	0.40%	2025/09/20	0.9%
7	第346回利付国債(10年)	0.10%	2027/03/20	0.9%
8	第134回利付国債(5年)	0.10%	2022/12/20	0.9%
9	第350回利付国債(10年)	0.10%	2028/03/20	0.8%
10	第334回利付国債(10年)	0.60%	2024/06/20	0.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(NOMJRA-BPI総合)の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。

## FWりそな国内株式インデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	96.7%
先物	3.2%
現金等	0.1%
合計	100.0%

## ■ 組入上位業種

業種	組入比率
1 電気機器	13.1%
2 情報・通信業	8.6%
3 輸送用機器	7.6%
4 化学	7.2%
5 銀行業	5.7%

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	業種	組入比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.2%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.8%
3	ソニー	電気機器	1.6%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.5%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
6	武田薬品工業	医薬品	1.5%
7	キーエンス	電気機器	1.4%
8	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.2%
9	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
10	本田技研工業	輸送用機器	1.0%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※業種は東証33業種の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(東証株価指数(TOPIX、配当込み))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。



## 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)

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.2%
先物	0.0%
現金等	0.8%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	46.6%
ユーロ	38.4%
英ポンド	6.3%
豪ドル	2.0%
カナダドル	1.9%
その他	4.7%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	米国	1.625%	2020/7/31	0.5%
2	US TREASURY N/B	米国	1.375%	2020/8/31	0.5%
3	US TREASURY N/B	米国	1.500%	2020/8/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2027/2/15	0.5%
5	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2024/4/30	0.5%
6	US TREASURY N/B	米国	1.250%	2021/3/31	0.4%
7	US TREASURY N/B	米国	3.125%	2028/11/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2025/2/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2027/11/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	米国	2.625%	2029/2/15	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(FI TSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。



## FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	98.8%
先物	0.0%
現金等	1.2%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	46.4%
ユーロ	38.2%
英ポンド	6.3%
豪ドル	2.0%
カナダドル	1.9%
その他	5.2%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	米国	2.625%	2029/2/15	0.5%
2	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2025/11/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	米国	2.625%	2021/5/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	米国	1.375%	2021/5/31	0.5%
5	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2021/4/30	0.5%
6	US TREASURY N/B	米国	2.750%	2028/2/15	0.5%
7	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2021/11/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	米国	2.500%	2024/5/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	米国	3.125%	2028/11/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2021/12/31	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月未までの騰落率です。2019年は6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。

## FWりそな新興国債券インデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
投資信託証券	100.0%
先物	0.0%
現金等	0.0%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

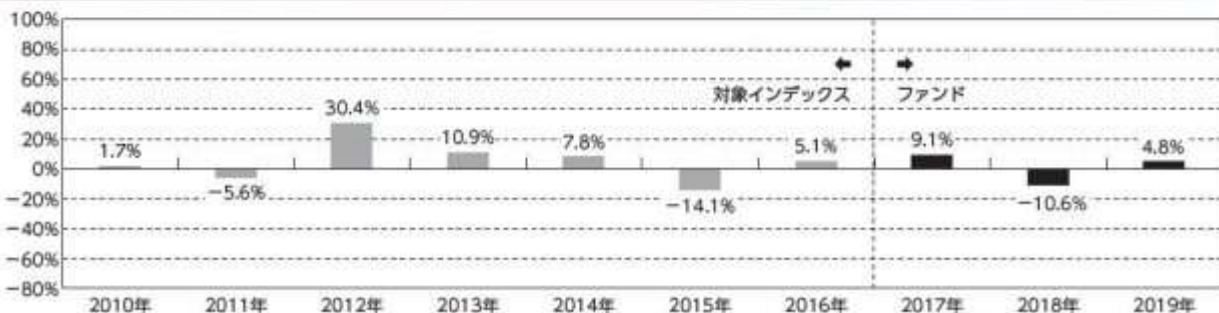
通貨	組入比率
インドネシアルピア	10.1%
メキシコペソ	10.0%
ブラジルレアル	10.0%
ポーランドズロチ	8.3%
南アフリカランド	8.3%
その他	53.4%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	米国	—	—	100.0%
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※通貨別資産配分は、マザーファンドが実質的に保有している債券の通貨を基準に算出しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(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))の年間騰落率です。  
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。

## FWりそな先進国株式インデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	90.8%
先物	9.3%
現金等	-0.1%
合計	100.0%

## ■ 国・地域別配分

国・地域	組入比率
米国	61.9%
英国	5.6%
フランス	3.8%
カナダ	3.4%
スイス	3.1%
その他	22.2%
合計	100.0%

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	MICROSOFT CORP	米国	情報技術	2.4%
2	APPLE INC	米国	情報技術	2.3%
3	AMAZON.COM INC	米国	一般消費財・サービス	1.9%
4	FACEBOOK INC-A	米国	コミュニケーション・サービス	1.1%
5	JOHNSON & JOHNSON	米国	ヘルスクエア	0.9%
6	JPMORGAN CHASE & CO	米国	金融	0.9%
7	ALPHABET INC-CL C	米国	コミュニケーション・サービス	0.8%
8	ALPHABET INC-CL A	米国	コミュニケーション・サービス	0.8%
9	EXXON MOBIL CORP	米国	エネルギー	0.8%
10	NESTLE SA-REG	スイス	生活必需品	0.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。  
 ※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。  
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。



## FWりそな新興国株式インデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	81.9%
先物	18.0%
現金等	0.1%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
中国	26.3%
韓国	10.3%
台湾	9.1%
インド	7.5%
ブラジル	6.3%
その他	40.5%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	コミュニケーション・サービス	3.8%
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	一般消費財・サービス	3.6%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	情報技術	3.0%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	情報技術	2.9%
5	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	一般消費財・サービス	1.6%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	金融	1.2%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	金融	1.0%
8	CHINA MOBILE LTD	中国	コミュニケーション・サービス	0.8%
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	0.8%
10	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	エネルギー	0.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。

## FWりそな国内リートインデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	97.7%
先物	2.1%
現金等	0.2%
合計	100.0%

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.2%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.6%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.2%
4	日本リテールファンド投資法人	4.2%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.1%
6	オリックス不動産投資法人	3.9%
7	日本プロロジスリート投資法人	3.6%
8	大和ハウスリート投資法人	3.5%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	3.1%
10	GLP投資法人	3.1%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(東証REIT指数(配当込み))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6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。

## FWりそな先進国リートインデックスファンド

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	99.3%
先物	0.0%
現金等	0.7%
合計	100.0%

## ■ 国・地域別配分

国・地域	組入比率
米国	72.0%
オーストラリア	7.2%
英国	4.8%
シンガポール	3.8%
フランス	3.8%
その他	8.5%
合計	100.0%

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	米国	4.1%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	4.0%
3	PUBLIC STORAGE	米国	2.9%
4	WELLTOWER INC	米国	2.7%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米国	2.3%
6	EQUITY RESIDENTIAL	米国	2.3%
7	LINK REIT	香港	2.2%
8	VENTAS INC	米国	2.1%
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	2.0%
10	REALTY INCOME CORP	米国	1.8%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



・2010年から2016年までは、対象インデックス(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2019年は6月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択



収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)＞と＜分配金受取りコース(一般コース)＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース(一般コース)＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

＜F W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)＞

＜F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)＞

＜F Wりそな新興国債券インデックスファンド＞

＜F Wりそな先進国株式インデックスファンド＞

・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

＜F Wりそな新興国株式インデックスファンド＞

・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

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

＜F Wりそな先進国リートインデックスファンド＞

・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

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(6) 申込金額

F Wりそな国内債券インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F W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)：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。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)：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。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：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。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：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。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：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。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た

額です。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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。

( 7 ) 申込単位

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

( 8 ) 申込代金の支払い

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

( 9 ) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所<sup>\*</sup>における取引の停止、外国為替取引の停止（「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。）、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

## 2【換金（解約）手続等】

( 1 ) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

( 2 ) 取扱時間

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

( 3 ) 解約請求不可日

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

< F W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） >

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

- ・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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

- ・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

- ・香港の銀行の休業日

- ・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

- ・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

- ・シドニーの銀行の休業日

- ・オーストラリア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

F Wりそな国内債券インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F W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）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：解約請求受付日の基準価額とします。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

#### (6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

#### (7) 解約単位

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

#### (8) 解約代金の支払い

F Wりそな国内債券インデックスファンド：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。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：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。

F W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）：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。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：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。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：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。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

F Wりそな国内リートインデックスファンド：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。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：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（「国内債券インデックス」、「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」を除きます。）、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回で

きます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

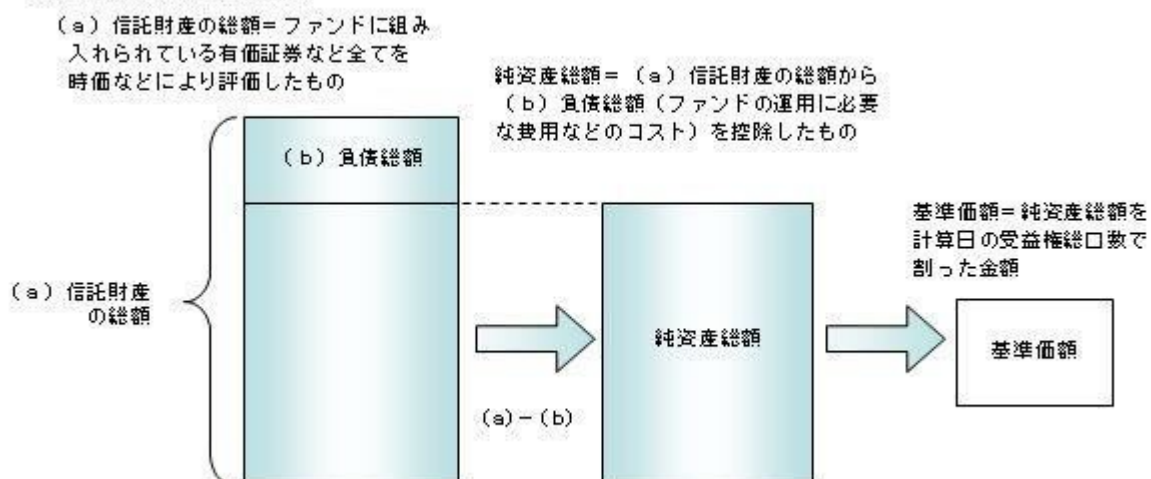
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<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（2017年1月5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12月11日から翌年12月10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各ファンドの純資産総額が20億円を下回ることとなった場合
  - 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。）
  - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

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

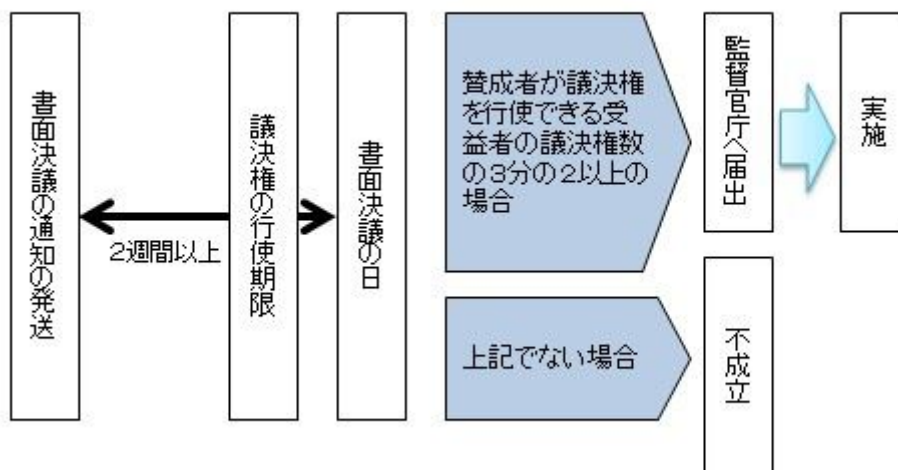
除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)

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

#### 書面決議

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

#### <書面決議の主な流れ>



#### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

#### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、每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】

FWりそな国内債券インデックスファンド  
FWりそな国内株式インデックスファンド  
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)  
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)  
FWりそな新興国債券インデックスファンド  
FWりそな先進国株式インデックスファンド  
FWりそな新興国株式インデックスファンド  
FWりそな国内リートインデックスファンド  
FWりそな先進国リートインデックスファンド

- (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(2017年12月12日から2018年12月10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】

## 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	113,358,019	151,809,503
親投資信託受益証券	28,941,038,662	47,582,711,764
未収入金	-	30,000,000
流動資産合計	29,054,396,681	47,764,521,267
<b>資産合計</b>	29,054,396,681	47,764,521,267
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	68,271,601	87,553,692
未払受託者報酬	3,163,314	7,509,891
未払委託者報酬	23,197,585	55,072,458
未払利息	307	411
その他未払費用	1,054,358	2,504,733
流動負債合計	95,687,165	152,641,185
<b>負債合計</b>	95,687,165	152,641,185
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	28,966,582,797	47,514,995,849
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,873,281	96,884,233
（分配準備積立金）	80,681,100	309,036,484
元本等合計	28,958,709,516	47,611,880,082
<b>純資産合計</b>	28,958,709,516	47,611,880,082
<b>負債純資産合計</b>	29,054,396,681	47,764,521,267

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		98,939,162		184,973,102
営業収益合計		98,939,162		184,973,102
営業費用				
支払利息		47,284		101,699
受託者報酬		4,334,667		13,242,624
委託者報酬		31,787,484		97,112,395
その他費用		1,444,777		4,418,376
営業費用合計		37,614,212		114,875,094
営業利益又は営業損失( )		61,324,950		70,098,008
経常利益又は経常損失( )		61,324,950		70,098,008
当期純利益又は当期純損失( )		61,324,950		70,098,008
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( )		2,917,481		22,700,321
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		7,873,281
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,418,862		13,500,787
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,418,862		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,500,787
剰余金減少額又は欠損金増加額		71,699,612		1,541,602
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,541,602
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		71,699,612		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,873,281		96,884,233



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	28,966,582,797円
期中追加設定元本額	30,909,545,686円	期中追加設定元本額	26,877,211,328円
期中一部解約元本額	1,943,062,889円	期中一部解約元本額	8,328,798,276円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	28,966,582,797口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	47,514,995,849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	7,873,281円		
7,873,281円			
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9997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	1.0020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)	(9,997円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,020円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	80,681,100円	A 費用控除後の配当等収益額	242,731,308円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	20,520,336円	C 収益調整金額	116,020,947円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	66,305,176円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	101,201,436円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	425,057,431円
F 当ファンドの期末残存口数	28,966,582,797口	F 当ファンドの期末残存口数	47,514,995,849口

G	10,000口当たり収益分配対象額 ( $G=E/F \times 10,000$ )	34円	G	10,000口当たり収益分配対象額 ( $G=E/F \times 10,000$ )	89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( $I=F \times H/10,000$ )	0円	I	収益分配金金額( $I=F \times H/10,000$ )	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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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>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>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>
---	--

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第1期</p> <p>自 2017年 1月 5日</p> <p>至 2017年12月11日</p>	<p>第2期</p> <p>自 2017年12月12日</p> <p>至 2018年12月10日</p>
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	<p>第1期</p> <p>自 2017年 1月 5日</p> <p>至 2017年12月11日</p>	<p>第2期</p> <p>自 2017年12月12日</p> <p>至 2018年12月10日</p>
	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	98,822,073	214,866,433
合計	98,822,073	214,866,433

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	45,761,407,737	47,582,711,764	
合計		45,761,407,737	47,582,711,764	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M国内債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	33,241,320	62,252,717
親投資信託受益証券	8,181,157,860	16,821,725,624
未収入金	-	10,800,000
流動資産合計	8,214,399,180	16,894,778,341
<b>資産合計</b>	8,214,399,180	16,894,778,341
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	19,314,568	33,221,016
未払受託者報酬	861,317	2,584,525
未払委託者報酬	7,751,781	23,260,669
未払利息	90	168
その他未払費用	287,033	861,979
流動負債合計	28,214,789	59,928,357
<b>負債合計</b>	28,214,789	59,928,357
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	6,908,921,204	15,924,914,167
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,277,263,187	909,935,817
( 分配準備積立金 )	968,388,243	1,035,492,938
元本等合計	8,186,184,391	16,834,849,984
<b>純資産合計</b>	8,186,184,391	16,834,849,984
<b>負債純資産合計</b>	8,214,399,180	16,894,778,341

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,068,058,160		1,643,589,236
<b>営業収益合計</b>		<b>1,068,058,160</b>		<b>1,643,589,236</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		16,797		35,670
受託者報酬		1,257,972		4,242,332
委託者報酬		11,321,591		38,180,880
その他費用		419,220		1,415,535
<b>営業費用合計</b>		<b>13,015,580</b>		<b>43,874,417</b>
営業利益又は営業損失 ( )		1,055,042,580		1,687,463,653
経常利益又は経常損失 ( )		1,055,042,580		1,687,463,653
当期純利益又は当期純損失 ( )		1,055,042,580		1,687,463,653
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 ( )		86,654,337		8,572,866
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		-		1,277,263,187
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>319,657,816</b>		<b>1,618,598,644</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		319,657,816		1,618,598,644
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>10,782,872</b>		<b>307,035,227</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,782,872		307,035,227
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		1,277,263,187		909,935,817

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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 100,000円	期首元本額 6,908,921,204円
期中追加設定元本額 8,464,338,150円	期中追加設定元本額 10,773,198,886円
期中一部解約元本額 1,555,516,946円	期中一部解約元本額 1,757,205,923円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 6,908,921,204口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 15,924,914,167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 1.1849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 1.0571円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,849円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,571円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 80,856,744円	A 費用控除後の配当等収益額 222,639,644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 887,531,499円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 308,874,944円	C 収益調整金額 1,484,889,112円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 812,853,294円
E 当ファンドの分配対象収益額 1,277,263,187円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 2,520,382,050円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 6,908,921,204口	F 当ファンドの期末残存口数 15,924,914,167口
G 10,000口当たり収益分配対象額 1,848円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 1,582円 (G=E/F×10,000)
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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>（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</p> <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> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>



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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	1,019,035,541	1,656,134,427
合計	1,019,035,541	1,656,134,427

## 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国内株式マザーファンド	15,523,925,456	16,821,725,624	
合 計		15,523,925,456	16,821,725,624	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M国内株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【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)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	33,056,561	66,897,259
親投資信託受益証券	8,782,505,894	19,801,804,178
<b>流動資産合計</b>	<b>8,815,562,455</b>	<b>19,868,701,437</b>
<b>資産合計</b>	<b>8,815,562,455</b>	<b>19,868,701,437</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	15,609,154	30,794,215
未払受託者報酬	956,092	2,000,137
未払委託者報酬	10,198,297	21,334,805
未払利息	89	181
その他未払費用	318,615	667,097
<b>流動負債合計</b>	<b>27,082,247</b>	<b>54,796,435</b>
<b>負債合計</b>	<b>27,082,247</b>	<b>54,796,435</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	8,363,296,428	19,541,836,461
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	425,183,780	272,068,541
(分配準備積立金)	406,052,664	441,299,750
<b>元本等合計</b>	<b>8,788,480,208</b>	<b>19,813,905,002</b>
<b>純資産合計</b>	<b>8,788,480,208</b>	<b>19,813,905,002</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>8,815,562,455</b>	<b>19,868,701,437</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		475,906,394		165,101,716
営業収益合計		475,906,394		165,101,716
営業費用				
支払利息		17,431		26,299
受託者報酬		1,388,579		3,525,420
委託者報酬		14,811,531		37,604,449
その他費用		462,758		1,176,111
営業費用合計		16,680,299		42,332,279
営業利益又は営業損失( )		459,226,095		207,433,995
経常利益又は経常損失( )		459,226,095		207,433,995
当期純利益又は当期純損失( )		459,226,095		207,433,995
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( )		53,173,431		169,034,799
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		425,183,780
剰余金増加額又は欠損金減少額		25,691,944		94,915,577
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		25,691,944		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		94,915,577
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,560,828		209,631,620
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		209,631,620
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,560,828		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		425,183,780		272,068,541

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	8,363,296,428円
期中追加設定元本額	9,815,951,299円	期中追加設定元本額	16,644,523,180円
期中一部解約元本額	1,452,754,871円	期中一部解約元本額	5,465,983,147円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	8,363,296,428口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	19,541,836,461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	1.0508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	1.0139円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,508円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,139円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	92,385,191円	A 費用控除後の配当等収益額	212,778,610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	313,667,473円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	19,131,116円	C 収益調整金額	784,347,335円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	228,521,140円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	425,183,780円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	1,225,647,085円
F 当ファンドの期末残存口数	8,363,296,428口	F 当ファンドの期末残存口数	19,541,836,461口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	508円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	627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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	445,836,900	25,874,556
合計	445,836,900	25,874,556

## 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先進国債券マザーファンド	20,380,613,605	19,801,804,178	
合計		20,380,613,605	19,801,804,178	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「R A M先進国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。



## 【F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	109,473,132	192,311,792
親投資信託受益証券	28,968,298,282	47,533,577,926
<b>流動資産合計</b>	<b>29,077,771,414</b>	<b>47,725,889,718</b>
<b>資産合計</b>	<b>29,077,771,414</b>	<b>47,725,889,718</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	53,397,603	75,732,020
未払受託者報酬	3,145,353	7,477,619
未払委託者報酬	33,550,403	79,761,274
未払利息	296	521
その他未払費用	1,048,368	2,493,978
<b>流動負債合計</b>	<b>91,142,023</b>	<b>165,465,412</b>
<b>負債合計</b>	<b>91,142,023</b>	<b>165,465,412</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	28,727,931,088	48,045,026,028
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	258,698,303	484,601,722
(分配準備積立金)	242,919,590	996,408,055
<b>元本等合計</b>	<b>28,986,629,391</b>	<b>47,560,424,306</b>
<b>純資産合計</b>	<b>28,986,629,391</b>	<b>47,560,424,306</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>29,077,771,414</b>	<b>47,725,889,718</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		286,198,782		466,820,356
営業収益合計		286,198,782		466,820,356
営業費用				
支払利息		45,607		99,550
受託者報酬		4,299,516		13,147,543
委託者報酬		45,861,459		140,240,331
その他費用		1,433,059		4,386,772
営業費用合計		51,639,641		157,874,196
営業利益又は営業損失 ( )		234,559,141		624,694,552
経常利益又は経常損失 ( )		234,559,141		624,694,552
当期純利益又は当期純損失 ( )		234,559,141		624,694,552
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 ( )		11,461,263		137,428,167
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		-		258,698,303
剰余金増加額又は欠損金減少額		35,600,425		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,337,220		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		34,263,205		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		256,033,640
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		24,117,317
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		231,916,323
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		258,698,303		484,601,722

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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 100,000円	期首元本額 28,727,931,088円
期中追加設定元本額 30,662,348,431円	期中追加設定元本額 27,497,514,870円
期中一部解約元本額 1,934,517,343円	期中一部解約元本額 8,180,419,930円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 28,727,931,088口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 48,045,026,028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 1.0090円	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 484,601,722円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,090円)	4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9899円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,899円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 242,919,590円	A 費用控除後の配当等収益額 795,642,410円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 43,842,173円	C 収益調整金額 326,017,027円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 200,765,645円
E 当ファンドの分配対象収益額 286,761,763円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 1,322,425,082円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 28,727,931,088口	F 当ファンドの期末残存口数 48,045,026,028口
G 10,000口当たり収益分配対象額 99円 (G=E/F × 10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 275円 (G=E/F × 10,000)

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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>(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</p> <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> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	286,198,782	394,823,794
合計	286,198,782	394,823,794

## 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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	49,329,159,326	47,533,577,926	
合計		49,329,159,326	47,533,577,926	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,784,089	7,731,019
親投資信託受益証券	741,996,402	1,768,599,488
流動資産合計	744,780,491	1,776,330,507
資産合計	744,780,491	1,776,330,507
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	646,497	2,595,505
未払受託者報酬	78,607	223,430
未払委託者報酬	1,362,456	3,872,657
未払利息	7	20
その他未払費用	26,122	74,456
流動負債合計	2,113,689	6,766,068
負債合計	2,113,689	6,766,068
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	688,292,151	1,806,368,468
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,374,651	36,804,029
（分配準備積立金）	22,828,921	79,281,730
元本等合計	742,666,802	1,769,564,439
純資産合計	742,666,802	1,769,564,439
負債純資産合計	744,780,491	1,776,330,507

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		26,396,902		85,730,914
<b>営業収益合計</b>		<b>26,396,902</b>		<b>85,730,914</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,648		3,335
受託者報酬		107,765		372,814
委託者報酬		1,867,785		6,461,900
その他費用		35,806		124,257
<b>営業費用合計</b>		<b>2,013,004</b>		<b>6,962,306</b>
営業利益又は営業損失（ ）		24,383,898		92,693,220
経常利益又は経常損失（ ）		24,383,898		92,693,220
当期純利益又は当期純損失（ ）		24,383,898		92,693,220
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,554,977		5,307,617
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		54,374,651
剰余金増加額又は欠損金減少額		32,967,252		3,154,355
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		32,967,252		3,154,355
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,421,522		6,947,432
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,421,522		6,947,432
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,374,651		36,804,029



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	688,292,151円
期中追加設定元本額	735,195,511円	期中追加設定元本額	1,230,517,990円
期中一部解約元本額	47,003,360円	期中一部解約元本額	112,441,673円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	688,292,151口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,806,368,468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	1.0790円	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	36,804,029円
1口当たり純資産額		4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9796円
(10,000口当たり純資産額)	(10,790円)	1口当たり純資産額	
		(10,000口当たり純資産額)	(9,796円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	17,646,634円	A 費用控除後の配当等収益額	58,687,263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	5,182,287円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	31,545,730円	C 収益調整金額	52,374,326円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	20,594,467円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	54,374,651円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	131,656,056円
F 当ファンドの期末残存口数	688,292,151口	F 当ファンドの期末残存口数	1,806,368,468口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	789円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	728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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>(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</p> <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> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	26,333,014	85,424,222
合計	26,333,014	85,424,222

## 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新興国債券マザーファンド	1,675,286,055	1,768,599,488	
合計		1,675,286,055	1,768,599,488	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M新興国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	24,871,972	33,520,443
親投資信託受益証券	5,908,106,045	6,029,475,373
<b>流動資産合計</b>	<b>5,932,978,017</b>	<b>6,062,995,816</b>
<b>資産合計</b>	<b>5,932,978,017</b>	<b>6,062,995,816</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	11,545,338	9,236,771
未払受託者報酬	624,640	1,484,700
未払委託者報酬	7,703,853	18,311,196
未払利息	67	90
その他未払費用	208,135	495,105
<b>流動負債合計</b>	<b>20,082,033</b>	<b>29,527,862</b>
<b>負債合計</b>	<b>20,082,033</b>	<b>29,527,862</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	5,138,361,469	5,484,626,857
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	774,534,515	548,841,097
(分配準備積立金)	519,346,148	316,280,514
<b>元本等合計</b>	<b>5,912,895,984</b>	<b>6,033,467,954</b>
<b>純資産合計</b>	<b>5,912,895,984</b>	<b>6,033,467,954</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>5,932,978,017</b>	<b>6,062,995,816</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日	自	2017年12月12日
	至	2017年12月11日	至	2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		594,506,345		236,829,328
<b>営業収益合計</b>		<b>594,506,345</b>		<b>236,829,328</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		11,896		23,095
受託者報酬		919,364		2,670,462
委託者報酬		11,338,794		32,935,536
その他費用		306,355		891,087
<b>営業費用合計</b>		<b>12,576,409</b>		<b>36,520,180</b>
営業利益又は営業損失（ ）		581,929,936		200,309,148
経常利益又は経常損失（ ）		581,929,936		200,309,148
当期純利益又は当期純損失（ ）		581,929,936		200,309,148
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（ ）		62,583,788		455,728,103
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		774,534,515
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>277,880,885</b>		<b>912,326,827</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		277,880,885		912,326,827
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>22,692,518</b>		<b>882,601,290</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,692,518		882,601,290
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		774,534,515		548,841,097

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	5,138,361,469円
期中追加設定元本額	6,405,595,993円	期中追加設定元本額	6,421,790,557円
期中一部解約元本額	1,267,334,524円	期中一部解約元本額	6,075,525,169円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,138,361,469口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,484,626,857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	1.1507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	1.1001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)	(11,507円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,001円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	59,643,645円	A 費用控除後の配当等収益額	92,303,068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	459,702,503円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	255,188,367円	C 収益調整金額	352,702,182円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	223,977,446円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	774,534,515円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	668,982,696円
F 当ファンドの期末残存口数	5,138,361,469口	F 当ファンドの期末残存口数	5,484,626,857口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,507円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,219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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>（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</p> <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> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>



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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	555,710,165	228,340,997
合計	555,710,165	228,340,997

## 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先進国株式マザーファンド	5,186,199,358	6,029,475,373	
合計		5,186,199,358	6,029,475,373	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M先進国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	3,750,950	9,880,403
親投資信託受益証券	872,794,346	1,998,217,451
未収入金	-	120,000
流動資産合計	876,545,296	2,008,217,854
<b>資産合計</b>	876,545,296	2,008,217,854
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	910,879	3,151,445
未払受託者報酬	92,539	268,200
未払委託者報酬	1,758,146	5,095,703
未払利息	10	26
その他未払費用	30,773	89,395
流動負債合計	2,792,347	8,604,769
<b>負債合計</b>	2,792,347	8,604,769
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	701,866,069	1,820,179,340
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	171,886,880	179,433,745
( 分配準備積立金 )	79,216,581	89,052,823
元本等合計	873,752,949	1,999,613,085
<b>純資産合計</b>	873,752,949	1,999,613,085
<b>負債純資産合計</b>	876,545,296	2,008,217,854

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日	自	2017年12月12日
	至	2017年12月11日	至	2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		90,994,646		178,498,895
<b>営業収益合計</b>		<b>90,994,646</b>		<b>178,498,895</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,204		4,457
受託者報酬		129,170		445,181
委託者報酬		2,454,133		8,458,169
その他費用		42,958		148,421
<b>営業費用合計</b>		<b>2,628,465</b>		<b>9,056,228</b>
営業利益又は営業損失（ ）		88,366,181		187,555,123
経常利益又は経常損失（ ）		88,366,181		187,555,123
当期純利益又は当期純損失（ ）		88,366,181		187,555,123
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（ ）		9,149,600		2,491,645
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		171,886,880
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>100,983,514</b>		<b>229,973,937</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		100,983,514		229,973,937
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>8,313,215</b>		<b>37,363,594</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,313,215		37,363,594
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		171,886,880		179,433,745

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	701,866,069円
期中追加設定元本額	814,558,599円	期中追加設定元本額	1,273,924,653円
期中一部解約元本額	112,792,530円	期中一部解約元本額	155,611,382円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	701,866,069口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,820,179,340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	1.2449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	1.0986円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(12,449円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,986円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	5,047,583円	A 費用控除後の配当等収益額	21,355,033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	74,168,998円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	92,670,299円	C 収益調整金額	142,313,383円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	67,697,790円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	171,886,880円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	231,366,206円
F 当ファンドの期末残存口数	701,866,069口	F 当ファンドの期末残存口数	1,820,179,340口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	2,448円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,271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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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>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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	86,767,278	180,635,343
合計	86,767,278	180,635,343

## 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新興国株式マザーファンド	1,627,345,428	1,998,217,451	
合 計		1,627,345,428	1,998,217,451	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「R A M新興国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。



## 【F Wりそな国内リートインデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	4,797,430	8,106,106
親投資信託受益証券	1,167,364,918	2,600,564,748
<b>流動資産合計</b>	<b>1,172,162,348</b>	<b>2,608,670,854</b>
<b>資産合計</b>	<b>1,172,162,348</b>	<b>2,608,670,854</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	2,402,648	2,762,928
未払受託者報酬	134,123	330,344
未払委託者報酬	1,207,082	2,973,033
未払利息	13	21
その他未払費用	44,623	110,089
<b>流動負債合計</b>	<b>3,788,489</b>	<b>6,176,415</b>
<b>負債合計</b>	<b>3,788,489</b>	<b>6,176,415</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,259,761,806	2,516,252,459
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	91,387,947	86,241,980
（分配準備積立金）	20,117,809	159,085,643
<b>元本等合計</b>	<b>1,168,373,859</b>	<b>2,602,494,439</b>
<b>純資産合計</b>	<b>1,168,373,859</b>	<b>2,602,494,439</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,172,162,348</b>	<b>2,608,670,854</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日	自	2017年12月12日
	至	2017年12月11日	至	2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		22,434,782		194,155,830
<b>営業収益合計</b>		<b>22,434,782</b>		<b>194,155,830</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,512		4,485
受託者報酬		192,860		560,953
委託者報酬		1,735,693		5,048,484
その他費用		64,175		186,966
<b>営業費用合計</b>		<b>1,995,240</b>		<b>5,800,888</b>
営業利益又は営業損失（ ）		24,430,022		188,354,942
経常利益又は経常損失（ ）		24,430,022		188,354,942
当期純利益又は当期純損失（ ）		24,430,022		188,354,942
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（ ）		6,076,630		14,437,786
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		91,387,947
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>8,231,499</b>		<b>21,669,482</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,231,499		21,669,482
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>81,266,054</b>		<b>17,956,711</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		81,266,054		17,956,711
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		91,387,947		86,241,980

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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 100,000円	期首元本額 1,259,761,806円
期中追加設定元本額 1,436,631,064円	期中追加設定元本額 1,606,741,957円
期中一部解約元本額 176,969,258円	期中一部解約元本額 350,251,304円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,259,761,806口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,516,252,459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 91,387,947円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9275円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,275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 1.0343円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,343円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 20,117,809円	A 費用控除後の配当等収益額 63,357,675円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	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 79,470,629円
C 収益調整金額 2,935,344円	C 収益調整金額 31,791,307円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 16,257,339円
E 当ファンドの分配対象収益額 23,053,153円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 190,876,950円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 1,259,761,806口	F 当ファンドの期末残存口数 2,516,252,459口
G 10,000口当たり収益分配対象額 182円 (G=E/F × 10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 758円 (G=E/F × 10,000)

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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>(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</p> <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> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	18,905,446	187,544,853
合計	18,905,446	187,544,853

## 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国内リートマザーファンド	2,231,861,267	2,600,564,748	
合計		2,231,861,267	2,600,564,748	

(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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	6,127,600	7,081,239
親投資信託受益証券	1,517,068,515	1,886,710,077
<b>流動資産合計</b>	<b>1,523,196,115</b>	<b>1,893,791,316</b>
<b>資産合計</b>	<b>1,523,196,115</b>	<b>1,893,791,316</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	2,032,374	1,647,403
未払受託者報酬	164,908	327,335
未払委託者報酬	2,033,803	4,037,028
未払利息	16	19
その他未払費用	54,888	109,095
<b>流動負債合計</b>	<b>4,285,989</b>	<b>6,120,880</b>
<b>負債合計</b>	<b>4,285,989</b>	<b>6,120,880</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1,479,548,942	1,837,841,788
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	39,361,184	49,828,648
( 分配準備積立金 )	71,146,872	99,774,968
<b>元本等合計</b>	<b>1,518,910,126</b>	<b>1,887,670,436</b>
<b>純資産合計</b>	<b>1,518,910,126</b>	<b>1,887,670,436</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,523,196,115</b>	<b>1,893,791,316</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年1月5日	自	2017年12月12日
	至	2017年12月11日	至	2018年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		78,068,815		30,943,562
<b>営業収益合計</b>		<b>78,068,815</b>		<b>30,943,562</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,923		4,835
受託者報酬		234,170		589,225
委託者報酬		2,888,125		7,266,965
その他費用		77,943		196,427
<b>営業費用合計</b>		<b>3,203,161</b>		<b>8,057,452</b>
営業利益又は営業損失（ ）		74,865,654		22,886,110
経常利益又は経常損失（ ）		74,865,654		22,886,110
当期純利益又は当期純損失（ ）		74,865,654		22,886,110
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（ ）		3,718,782		31,432,159
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		39,361,184
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>4,374,092</b>		<b>3,521,367</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,374,092		3,521,367
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>36,159,780</b>		<b>47,372,172</b>
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		36,159,780		47,372,172
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		39,361,184		49,828,648



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在		第2期 2018年12月10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	100,000円	期首元本額	1,479,548,942円
期中追加設定元本額	1,618,231,745円	期中追加設定元本額	1,601,705,660円
期中一部解約元本額	138,782,803円	期中一部解約元本額	1,243,412,814円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,479,548,942口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,837,841,788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	1.0266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	1.0271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)	(10,266円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,271円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日		第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	26,454,030円	A 費用控除後の配当等収益額	62,819,893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	44,692,842円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	4,406,339円	C 収益調整金額	60,986,488円
D 分配準備積立金額	0円	D 分配準備積立金額	36,955,075円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	75,553,211円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	160,761,456円
F 当ファンドの期末残存口数	1,479,548,942口	F 当ファンドの期末残存口数	1,837,841,788口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	510円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	874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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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、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。</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>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、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。</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 2017年12月11日現在	第2期 2018年12月10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</p> <p>（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</p> <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> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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 2017年 1月 5日 至 2017年12月11日	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	76,150,000	57,662,433
合計	76,150,000	57,662,433

## 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先進国リートマザーファンド	1,758,022,808	1,886,710,077	
合 計		1,758,022,808	1,886,710,077	

(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。

「RAM国内債券マザーファンド」「RAM国内株式マザーファンド」「RAM先進国債券マザーファンド」「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」「RAM新興国債券マザーファンド」「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」及び「RAM先進国リートマザーファンド」の状況は次の通りです。

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)

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	436,023
コール・ローン	142,794,962
国債証券	53,946,487,420
地方債証券	3,608,477,600
特殊債券	4,226,702,433
社債券	2,623,923,000
未収入金	149,066,200
未収利息	177,109,723
前払費用	12,785,359
流動資産合計	64,887,782,720
資産合計	64,887,782,720
負債の部	
流動負債	
未払解約金	250,065,000
未払利息	387
その他未払費用	2,375
流動負債合計	250,067,762
負債合計	250,067,762
純資産の部	
元本等	
元本	62,165,264,291
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,472,450,667
元本等合計	64,637,714,958
純資産合計	64,637,714,958
負債純資産合計	64,887,782,720

## 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	42,755,412,735円
期中追加設定元本額	33,025,578,915円
期中一部解約元本額	13,615,727,359円
期末元本額	62,165,264,291円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	15,269,601,836円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	295,853,528円

りそなラップ型ファンド（成長型）	137,987,417円
DCりそな グローバルバランス	158,662,311円
つみたてバランスファンド	261,235,355円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	54,831,555円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	6,934,474円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	2,391,554円
FWりそな国内債券インデックスファンド	45,761,407,737円
Smart-i 国内債券インデックス	43,573,318円
Smart-i 8資産バランス 安定型	12,660,589円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	19,206,953円
Smart-i 8資産バランス 成長型	11,922,624円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	3,214,431円
りそなFT 国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	125,780,609円
2. 計算日における受益権の総数	62,165,264,291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	1.0398円
(10,000口当たり純資産額)	(10,398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

2018年12月10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

2018年12月10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 )

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		60,223,780
地方債証券		12,780,400
特殊債券		5,678,311
社債券		4,574,000
合計		37,191,069

(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384回利付国債(2年)	290,000,000	290,858,400	
	第385回利付国債(2年)	290,000,000	290,925,100	
	第386回利付国債(2年)	200,000,000	200,680,000	
	第387回利付国債(2年)	300,000,000	301,068,000	
	第388回利付国債(2年)	400,000,000	401,512,000	
	第389回利付国債(2年)	320,000,000	321,248,000	
	第390回利付国債(2年)	350,000,000	351,442,000	
	第391回利付国債(2年)	200,000,000	200,886,000	
	第392回利付国債(2年)	300,000,000	301,398,000	
	第393回利付国債(2年)	150,000,000	150,705,000	
	第394回利付国債(2年)	160,000,000	160,772,800	
	第123回利付国債(5年)	395,000,000	396,307,450	
	第124回利付国債(5年)	305,000,000	306,186,450	
	第125回利付国債(5年)	271,000,000	272,227,630	
	第126回利付国債(5年)	380,000,000	381,964,600	
	第127回利付国債(5年)	350,000,000	351,991,500	
	第128回利付国債(5年)	400,000,000	402,532,000	
	第129回利付国債(5年)	310,000,000	312,157,600	
	第130回利付国債(5年)	120,000,000	120,910,800	
	第131回利付国債(5年)	540,000,000	544,525,200	
	第132回利付国債(5年)	360,000,000	363,186,000	
	第133回利付国債(5年)	460,000,000	464,365,400	
	第134回利付国債(5年)	530,000,000	535,363,600	
	第135回利付国債(5年)	480,000,000	485,155,200	
	第136回利付国債(5年)	520,000,000	525,917,600	
	第137回利付国債(5年)	400,000,000	404,612,000	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	56,795,200	
	第2回利付国債(40年)	70,000,000	96,226,900	
	第3回利付国債(40年)	80,000,000	110,502,400	
	第4回利付国債(40年)	130,000,000	180,382,800	
	第5回利付国債(40年)	130,000,000	173,499,300	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	143,899,800	



第7回利付国債（40年）	150,000,000	187,393,500
第8回利付国債（40年）	150,000,000	173,593,500
第9回利付国債（40年）	230,000,000	193,317,300
第10回利付国債（40年）	220,000,000	219,062,800
第11回利付国債（40年）	100,000,000	95,846,000
第306回利付国債（10年）	480,000,000	489,504,000
第307回利付国債（10年）	250,000,000	254,632,500
第308回利付国債（10年）	180,000,000	183,983,400
第309回利付国債（10年）	120,000,000	122,289,600
第310回利付国債（10年）	130,000,000	132,661,100
第311回利付国債（10年）	200,000,000	203,382,000
第312回利付国債（10年）	770,000,000	791,028,700
第313回利付国債（10年）	520,000,000	537,118,400
第314回利付国債（10年）	130,000,000	133,688,100
第315回利付国債（10年）	375,000,000	387,772,500
第316回利付国債（10年）	300,000,000	309,459,000
第317回利付国債（10年）	180,000,000	186,244,200
第318回利付国債（10年）	366,000,000	377,675,400
第319回利付国債（10年）	490,000,000	508,531,800
第320回利付国債（10年）	352,000,000	364,242,560
第321回利付国債（10年）	291,000,000	301,950,330
第322回利付国債（10年）	120,000,000	124,120,800
第323回利付国債（10年）	340,000,000	352,580,000
第324回利付国債（10年）	183,000,000	189,123,180
第325回利付国債（10年）	470,000,000	486,858,900
第326回利付国債（10年）	280,000,000	289,576,000
第327回利付国債（10年）	387,000,000	401,802,750
第328回利付国債（10年）	461,000,000	475,756,610
第329回利付国債（10年）	557,000,000	580,962,140
第330回利付国債（10年）	257,000,000	268,613,830
第331回利付国債（10年）	90,000,000	93,201,300
第332回利付国債（10年）	312,000,000	323,681,280
第333回利付国債（10年）	445,000,000	462,363,900
第334回利付国債（10年）	671,000,000	698,443,900
第335回利付国債（10年）	135,000,000	139,989,600
第336回利付国債（10年）	230,000,000	238,797,500
第337回利付国債（10年）	150,000,000	153,916,500
第338回利付国債（10年）	661,000,000	682,931,980
第339回利付国債（10年）	205,000,000	212,076,600
第340回利付国債（10年）	534,000,000	552,967,680
第341回利付国債（10年）	240,000,000	247,051,200
第342回利付国債（10年）	240,000,000	243,693,600

第343回利付国債(10年)	220,000,000	223,249,400
第344回利付国債(10年)	340,000,000	344,923,200
第345回利付国債(10年)	550,000,000	557,540,500
第346回利付国債(10年)	430,000,000	435,534,100
第347回利付国債(10年)	310,000,000	313,844,000
第348回利付国債(10年)	290,000,000	293,314,700
第349回利付国債(10年)	370,000,000	373,844,300
第350回利付国債(10年)	340,000,000	343,151,800
第351回利付国債(10年)	380,000,000	382,888,000
第352回利付国債(10年)	410,000,000	412,595,300
第1回利付国債(30年)	10,000,000	12,878,300
第11回利付国債(30年)	10,000,000	11,990,000
第12回利付国債(30年)	40,000,000	50,328,800
第13回利付国債(30年)	90,000,000	112,076,100
第14回利付国債(30年)	20,000,000	26,132,800
第15回利付国債(30年)	100,000,000	132,337,000
第16回利付国債(30年)	20,000,000	26,527,600
第17回利付国債(30年)	110,000,000	144,545,500
第18回利付国債(30年)	120,000,000	156,022,800
第19回利付国債(30年)	100,000,000	130,255,000
第20回利付国債(30年)	60,000,000	80,185,800
第21回利付国債(30年)	90,000,000	117,536,400
第22回利付国債(30年)	50,000,000	67,017,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	214,844,800
第24回利付国債(30年)	100,000,000	134,515,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	131,281,000
第26回利付国債(30年)	225,000,000	299,578,500
第27回利付国債(30年)	105,000,000	142,018,800
第28回利付国債(30年)	150,000,000	203,446,500
第29回利付国債(30年)	140,000,000	187,868,800
第30回利付国債(30年)	190,000,000	252,017,900
第31回利付国債(30年)	150,000,000	196,695,000
第32回利付国債(30年)	215,000,000	286,921,800
第33回利付国債(30年)	240,000,000	306,480,000
第34回利付国債(30年)	195,000,000	257,559,900
第35回利付国債(30年)	226,000,000	289,978,340
第36回利付国債(30年)	235,000,000	302,181,800
第37回利付国債(30年)	280,000,000	354,631,200
第38回利付国債(30年)	160,000,000	199,619,200
第39回利付国債(30年)	70,000,000	88,977,700
第40回利付国債(30年)	195,000,000	243,631,050
第41回利付国債(30年)	145,000,000	177,959,950
第42回利付国債(30年)	130,000,000	159,628,300

第43回利付国債(30年)	160,000,000	196,561,600	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	184,363,500	
第45回利付国債(30年)	150,000,000	177,393,000	
第46回利付国債(30年)	150,000,000	177,415,500	
第47回利付国債(30年)	220,000,000	265,478,400	
第48回利付国債(30年)	183,000,000	212,124,450	
第49回利付国債(30年)	170,000,000	197,041,900	
第50回利付国債(30年)	230,000,000	232,603,600	
第51回利付国債(30年)	180,000,000	159,517,800	
第52回利付国債(30年)	160,000,000	149,430,400	
第53回利付国債(30年)	190,000,000	181,925,000	
第54回利付国債(30年)	210,000,000	211,461,600	
第55回利付国債(30年)	80,000,000	80,466,400	
第56回利付国債(30年)	150,000,000	150,705,000	
第57回利付国債(30年)	170,000,000	170,601,800	
第58回利付国債(30年)	220,000,000	220,521,400	
第59回利付国債(30年)	180,000,000	175,491,000	
第60回利付国債(30年)	110,000,000	112,916,100	
第46回利付国債(20年)	10,000,000	10,360,000	
第47回利付国債(20年)	210,000,000	218,796,900	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	63,232,800	
第49回利付国債(20年)	30,000,000	31,538,400	
第50回利付国債(20年)	150,000,000	157,006,500	
第51回利付国債(20年)	90,000,000	94,894,200	
第52回利付国債(20年)	190,000,000	201,897,800	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	21,364,000	
第54回利付国債(20年)	180,000,000	192,823,200	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	107,056,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,757,700	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	117,945,300	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	107,742,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	42,978,800	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,869,900	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	52,449,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	83,422,400	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	65,298,600	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	131,736,000	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	419,121,000	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	22,154,800	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	101,129,400	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	67,101,000	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	125,481,400	

第7 1 回利付国債(20年)	100,000,000	112,962,000
第7 2 回利付国債(20年)	150,000,000	169,464,000
第7 3 回利付国債(20年)	180,000,000	203,218,200
第7 5 回利付国債(20年)	100,000,000	114,027,000
第7 6 回利付国債(20年)	100,000,000	112,763,000
第7 7 回利付国債(20年)	20,000,000	22,679,000
第7 8 回利付国債(20年)	50,000,000	56,640,500
第7 9 回利付国債(20年)	20,000,000	22,787,600
第8 0 回利付国債(20年)	180,000,000	206,271,000
第8 1 回利付国債(20年)	30,000,000	34,332,600
第8 2 回利付国債(20年)	170,000,000	195,712,500
第8 3 回利付国債(20年)	10,000,000	11,564,500
第8 4 回利付国債(20年)	120,000,000	137,924,400
第8 5 回利付国債(20年)	150,000,000	174,234,000
第8 6 回利付国債(20年)	100,000,000	117,621,000
第8 7 回利付国債(20年)	90,000,000	105,200,100
第8 8 回利付国債(20年)	185,000,000	218,490,550
第8 9 回利付国債(20年)	70,000,000	82,141,500
第9 0 回利付国債(20年)	90,000,000	106,054,200
第9 1 回利付国債(20年)	10,000,000	11,862,100
第9 2 回利付国債(20年)	105,000,000	123,337,200
第9 3 回利付国債(20年)	20,000,000	23,405,200
第9 4 回利付国債(20年)	90,000,000	106,071,300
第9 5 回利付国債(20年)	35,000,000	42,004,200
第9 6 回利付国債(20年)	70,000,000	82,811,400
第9 7 回利付国債(20年)	130,000,000	155,506,000
第9 8 回利付国債(20年)	70,000,000	83,118,000
第9 9 回利付国債(20年)	205,000,000	244,181,650
第1 0 0 回利付国債(20年)	151,000,000	181,797,960
第1 0 1 回利付国債(20年)	20,000,000	24,450,000
第1 0 2 回利付国債(20年)	145,000,000	177,801,900
第1 0 3 回利付国債(20年)	20,000,000	24,334,200
第1 0 4 回利付国債(20年)	10,000,000	11,977,000
第1 0 5 回利付国債(20年)	132,000,000	158,631,000
第1 0 6 回利付国債(20年)	40,000,000	48,460,000
第1 0 7 回利付国債(20年)	130,000,000	156,738,400
第1 0 8 回利付国債(20年)	130,000,000	154,142,300
第1 0 9 回利付国債(20年)	130,000,000	154,495,900
第1 1 0 回利付国債(20年)	115,000,000	139,018,900
第1 1 1 回利付国債(20年)	200,000,000	244,628,000
第1 1 2 回利付国債(20年)	55,000,000	66,697,950
第1 1 3 回利付国債(20年)	275,000,000	334,345,000
第1 1 4 回利付国債(20年)	210,000,000	255,937,500

第115回利付国債(20年)	100,000,000	122,966,000	
第116回利付国債(20年)	90,000,000	111,003,300	
第117回利付国債(20年)	205,000,000	250,557,150	
第118回利付国債(20年)	261,000,000	316,770,480	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	71,457,000	
第120回利付国債(20年)	40,000,000	46,728,400	
第121回利付国債(20年)	245,000,000	295,122,100	
第122回利付国債(20年)	20,000,000	23,859,800	
第123回利付国債(20年)	275,000,000	338,538,750	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	60,961,500	
第125回利付国債(20年)	60,000,000	74,775,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	122,144,000	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	60,470,000	
第128回利付国債(20年)	285,000,000	345,457,050	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	23,997,400	
第130回利付国債(20年)	250,000,000	300,387,500	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	35,672,100	
第132回利付国債(20年)	190,000,000	226,176,000	
第133回利付国債(20年)	125,000,000	150,387,500	
第134回利付国債(20年)	85,000,000	102,449,650	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,694,800	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,356,800	
第137回利付国債(20年)	260,000,000	310,328,200	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	58,366,500	
第139回利付国債(20年)	30,000,000	35,413,500	
第140回利付国債(20年)	290,000,000	346,689,200	
第141回利付国債(20年)	155,000,000	185,451,300	
第142回利付国債(20年)	120,000,000	145,201,200	
第143回利付国債(20年)	405,000,000	479,345,850	
第145回利付国債(20年)	345,000,000	413,655,000	
第146回利付国債(20年)	280,000,000	336,173,600	
第147回利付国債(20年)	235,000,000	278,919,150	
第148回利付国債(20年)	365,000,000	428,017,250	
第149回利付国債(20年)	260,000,000	304,920,200	
第150回利付国債(20年)	340,000,000	393,662,200	
第151回利付国債(20年)	205,000,000	231,088,300	
第152回利付国債(20年)	260,000,000	293,118,800	
第153回利付国債(20年)	200,000,000	228,606,000	
第154回利付国債(20年)	308,000,000	347,005,120	
第155回利付国債(20年)	250,000,000	273,255,000	
第156回利付国債(20年)	290,000,000	287,674,200	
第157回利付国債(20年)	160,000,000	153,004,800	

	第158回利付国債(20年)	240,000,000	241,180,800
	第159回利付国債(20年)	210,000,000	214,179,000
	第160回利付国債(20年)	120,000,000	124,225,200
	第161回利付国債(20年)	250,000,000	254,022,500
	第162回利付国債(20年)	270,000,000	273,693,600
	第163回利付国債(20年)	280,000,000	283,385,200
	第164回利付国債(20年)	230,000,000	227,994,400
	第165回利付国債(20年)	300,000,000	296,832,000
	第166回利付国債(20年)	180,000,000	184,485,600
	国債証券合計	49,489,000,000	53,946,487,420
地方債証券	第680回東京都公募公債	100,000,000	101,741,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	103,397,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	103,583,000
	第729回東京都公募公債	100,000,000	103,581,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	103,269,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,310,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,804,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,981,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	102,611,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,399,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	114,274,600
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,846,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,686,000
	平成27年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	100,208,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	103,088,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,115,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,883,000
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,357,000
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,467,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,185,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,711,000
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,037,000
	第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,869,000
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,897,000
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,645,000
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,508,000
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,996,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,202,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,253,000
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,143,000
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,982,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,156,000

	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,858,000	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,018,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,417,000	
	地方債証券合計	3,530,000,000	3,608,477,600	
特殊債券	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,908,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,249,000	
	第27回道路債券	100,000,000	112,581,000	
	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	104,219,880	
	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	118,369,620	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	131,396,740	
	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	103,130,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,474,000	
	第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	136,376,870	
	第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,771,000	
	第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,006,000	
	第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,186,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	113,791,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	131,584,700	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,927,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,986,000	
	F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,155,000	
	第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,967,000	
	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,485,000	
	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,246,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	118,428,000	
	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,189,000	
	第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,198,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,752,000	95,550,759	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,358,000	95,855,768	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,119,000	96,432,347	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,049,000	96,515,798	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,874,000	99,002,536	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,374,000	100,114,336	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	92,864,000	93,095,231	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	95,659,000	95,970,848	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,178,000	

	第52回日本学生支援債券	100,000,000	99,984,000	
	第310回信中金債	100,000,000	100,350,000	
	第327回信中金債	100,000,000	99,903,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	103,239,000	
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,075,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,909,000	
	第61回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,371,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,531,000	
	特殊債券合計	4,071,049,000	4,226,702,433	
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	100,084,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,410,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,286,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,056,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,762,000	
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,209,000	
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	99,651,000	
	第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,399,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,584,000	
	第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,585,000	
	第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	
	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	100,553,000	
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,057,000	
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,958,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,570,000	
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,267,000	
	第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,413,000	
	第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,990,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,532,000	
	第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,010,000	
	第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,681,000	
	第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,955,000	
	第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,884,000	
	第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,113,000	



	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,376,000	
	社債券合計	2,600,000,000	2,623,923,000	
	合計		64,405,590,453	

## 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国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	836,483,135
株式	22,316,880,680
未収配当金	11,753,763
前払金	46,974,500
差入委託証拠金	23,760,000
流動資産合計	23,235,852,078
資産合計	
23,235,852,078	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,321,500
未払金	110,183,195
未払解約金	34,800,000
未払利息	2,268
その他未払費用	8,207
流動負債合計	208,315,170
負債合計	
208,315,170	
純資産の部	
元本等	
元本	21,251,159,523
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,776,377,385
元本等合計	23,027,536,908
純資産合計	
23,027,536,908	
負債純資産合計	
23,235,852,078	

### 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	10,646,785,404円
期中追加設定元本額	18,789,660,107円
期中一部解約元本額	8,185,285,988円
期末元本額	21,251,159,523円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,000,895,973円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	946,063,157円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,861,681,687円
DCりそな グローバルバランス	20,506,430円
つみたてバランスファンド	363,423,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	41,152,350円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	12,917,411円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	11,554,103円
FWりそな国内株式インデックスファンド	15,523,925,456円
Smart-i TOPIXインデックス	119,205,017円
Smart-i 8資産バランス 安定型	3,283,337円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	21,925,848円
Smart-i 8資産バランス 成長型	40,386,428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)	1,631,226円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	257,782,642円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	24,825,083円
2. 計算日における受益権の総数	21,251,159,523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	1.0836円
(10,000口当たり純資産額)	(10,836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

2018年12月10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

2018年12月10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）

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,740,052,316
合計		2,740,052,316

(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）

（2018年12月10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	822,921,500	-	759,600,000	63,321,500
合計		822,921,500	-	759,600,000	63,321,500

## （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

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	400	3,105.00	1,242,000	
日本水産	13,500	666.00	8,991,000	
マルハニチロ	1,900	3,905.00	7,419,500	
カネコ種苗	400	1,378.00	551,200	
サカタのタネ	1,600	3,855.00	6,168,000	
ホクト	1,100	2,014.00	2,215,400	
ホクリヨウ	200	701.00	140,200	
住石ホールディングス	2,900	108.00	313,200	
日鉄鉱業	300	4,920.00	1,476,000	
三井松島ホールディングス	600	1,549.00	929,400	
国際石油開発帝石	54,000	1,193.50	64,449,000	
石油資源開発	1,900	2,412.00	4,582,800	
K&Oエナジーグループ	600	1,567.00	940,200	
ヒノキヤグループ	300	2,093.00	627,900	
ショーボンドホールディングス	1,000	8,520.00	8,520,000	
ミライト・ホールディングス	3,500	1,537.00	5,379,500	
タマホーム	1,000	1,074.00	1,074,000	
サンヨーホームズ	200	835.00	167,000	
日本アクア	500	385.00	192,500	
ファーストコーポレーション	500	933.00	466,500	
ベステラ	300	1,608.00	482,400	
TATERU	1,600	368.00	588,800	
スペースバリューホールディングス	1,700	1,025.00	1,742,500	
ダイセキ環境ソリューション	300	793.00	237,900	
第一カッター興業	100	1,965.00	196,500	
安藤・間	8,600	681.00	5,856,600	
東急建設	4,000	1,018.00	4,072,000	
コムシスホールディングス	4,800	2,656.00	12,748,800	
ミサワホーム	1,200	814.00	976,800	
ピーアールホールディングス	1,300	387.00	503,100	
高松コンストラクショングループ	800	2,680.00	2,144,000	
東建コーポレーション	400	7,390.00	2,956,000	

ソネック	100	754.00	75,400	
ヤマウラ	500	956.00	478,000	
大成建設	11,100	4,835.00	53,668,500	
大林組	33,300	1,070.00	35,631,000	
清水建設	34,000	889.00	30,226,000	
飛鳥建設	1,000	1,482.00	1,482,000	
長谷工コーポレーション	13,900	1,290.00	17,931,000	
松井建設	1,200	786.00	943,200	
銭高組	100	5,220.00	522,000	
鹿島建設	26,000	1,475.00	38,350,000	
不動テトラ	800	1,812.00	1,449,600	
大末建設	400	1,139.00	455,600	
鉄建建設	700	2,748.00	1,923,600	
西松建設	2,400	2,447.00	5,872,800	
三井住友建設	8,000	647.00	5,176,000	
大豊建設	800	3,595.00	2,876,000	
前田建設工業	7,900	1,103.00	8,713,700	
佐田建設	700	407.00	284,900	
ナカノフドー建設	1,000	560.00	560,000	
奥村組	1,800	3,525.00	6,345,000	
東鉄工業	1,300	3,130.00	4,069,000	
イチケン	200	2,002.00	400,400	
富士ピー・エス	300	445.00	133,500	
浅沼組	400	3,120.00	1,248,000	
戸田建設	12,900	686.00	8,849,400	
熊谷組	1,600	3,415.00	5,464,000	
青木あすなろ建設	500	998.00	499,000	
北野建設	200	3,995.00	799,000	
植木組	100	2,384.00	238,400	
矢作建設工業	1,700	725.00	1,232,500	
ピーエス三菱	1,300	669.00	869,700	
日本ハウスホールディングス	2,200	477.00	1,049,400	
大東建託	3,900	15,070.00	58,773,000	
新日本建設	1,300	1,062.00	1,380,600	
N I P P O	2,900	1,938.00	5,620,200	
東亜道路工業	200	3,090.00	618,000	

前田道路	3,500	2,123.00	7,430,500	
日本道路	300	6,060.00	1,818,000	
東亜建設工業	1,000	1,444.00	1,444,000	
若築建設	600	1,642.00	985,200	
東洋建設	4,100	404.00	1,656,400	
五洋建設	13,200	675.00	8,910,000	
世紀東急工業	1,600	641.00	1,025,600	
福田組	400	4,655.00	1,862,000	
住友林業	7,900	1,497.00	11,826,300	
日本基礎技術	1,100	324.00	356,400	
巴コーポレーション	1,400	399.00	558,600	
大和ハウス工業	30,800	3,417.00	105,243,600	
ライト工業	2,100	1,491.00	3,131,100	
積水ハウス	34,000	1,638.00	55,692,000	
日特建設	900	676.00	608,400	
北陸電気工事	500	966.00	483,000	
ユアテック	1,800	889.00	1,600,200	
四電工	200	2,632.00	526,400	
中電工	1,400	2,347.00	3,285,800	
関電工	5,100	1,105.00	5,635,500	
きんでん	7,400	1,858.00	13,749,200	
東京エネシス	1,100	953.00	1,048,300	
トーエネック	300	3,165.00	949,500	
住友電設	800	1,823.00	1,458,400	
日本電設工業	1,900	2,320.00	4,408,000	
協和エクシオ	4,400	2,588.00	11,387,200	
新日本空調	900	1,921.00	1,728,900	
九電工	2,200	4,015.00	8,833,000	
三機工業	2,500	1,114.00	2,785,000	
日揮	9,600	1,641.00	15,753,600	
中外炉工業	300	2,240.00	672,000	
ヤマト	1,000	569.00	569,000	
太平電業	800	2,667.00	2,133,600	
高砂熱学工業	2,800	1,892.00	5,297,600	
三晃金属工業	100	2,856.00	285,600	
朝日工業社	200	3,150.00	630,000	

明星工業	2,000	787.00	1,574,000	
大気社	1,500	2,950.00	4,425,000	
ダイダン	700	2,604.00	1,822,800	
日比谷総合設備	1,100	1,811.00	1,992,100	
東芝プラントシステム	2,400	2,231.00	5,354,400	
O S J Bホールディングス	4,900	321.00	1,572,900	
東洋エンジニアリング	1,300	745.00	968,500	
千代田化工建設	8,000	318.00	2,544,000	
新興プランテック	2,000	1,159.00	2,318,000	
日本製粉	3,300	1,885.00	6,220,500	
日清製粉グループ本社	11,200	2,320.00	25,984,000	
日東富士製粉	100	5,550.00	555,000	
昭和産業	900	2,893.00	2,603,700	
鳥越製粉	900	904.00	813,600	
中部飼料	1,200	1,289.00	1,546,800	
フィード・ワン	6,700	191.00	1,279,700	
東洋精糖	200	1,134.00	226,800	
日本甜菜製糖	600	1,878.00	1,126,800	
三井製糖	800	2,967.00	2,373,600	
塩水港精糖	1,100	240.00	264,000	
日新製糖	500	2,260.00	1,130,000	
森永製菓	2,500	4,795.00	11,987,500	
中村屋	300	4,340.00	1,302,000	
江崎グリコ	3,000	5,570.00	16,710,000	
名糖産業	500	1,414.00	707,000	
井村屋グループ	400	2,839.00	1,135,600	
不二家	600	2,444.00	1,466,400	
山崎製パン	8,100	2,354.00	19,067,400	
第一屋製パン	200	1,129.00	225,800	
モロゾフ	200	5,300.00	1,060,000	
亀田製菓	600	5,320.00	3,192,000	
寿スピリッツ	1,100	4,560.00	5,016,000	
カルビー	4,500	3,560.00	16,020,000	
森永乳業	2,000	3,190.00	6,380,000	
六甲バター	700	2,279.00	1,595,300	
ヤクルト本社	7,400	8,340.00	61,716,000	



明治ホールディングス	7,000	8,720.00	61,040,000	
雪印メグミルク	2,400	2,999.00	7,197,600	
プリマハム	1,400	2,026.00	2,836,400	
日本ハム	4,300	4,065.00	17,479,500	
林兼産業	300	636.00	190,800	
丸大食品	1,100	1,906.00	2,096,600	
S Foods	900	4,410.00	3,969,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	6,400	705.00	4,512,000	
サッポロホールディングス	3,600	2,397.00	8,629,200	
アサヒグループホールディングス	20,800	4,373.00	90,958,400	
キリンホールディングス	45,000	2,427.00	109,215,000	
宝ホールディングス	7,400	1,381.00	10,219,400	
オエノンホールディングス	2,800	376.00	1,052,800	
養命酒製造	300	2,248.00	674,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	7,600	3,225.00	24,510,000	
サントリー食品インターナショナル	6,700	4,730.00	31,691,000	
ダイドーグループホールディングス	600	6,010.00	3,606,000	
伊藤園	3,300	5,010.00	16,533,000	
キーコーヒー	1,000	2,112.00	2,112,000	
ユニカフェ	300	1,195.00	358,500	
ジャパンフーズ	100	1,215.00	121,500	
日清オイリオグループ	1,300	3,375.00	4,387,500	
不二製油グループ本社	2,400	3,620.00	8,688,000	
かどや製油	100	5,670.00	567,000	
J - オイルミルズ	500	3,965.00	1,982,500	
キッコーマン	6,600	6,280.00	41,448,000	
味の素	22,000	1,881.00	41,382,000	
キューピー	5,500	2,657.00	14,613,500	
ハウス食品グループ本社	3,800	3,920.00	14,896,000	
カゴメ	4,000	3,095.00	12,380,000	
焼津水産化学工業	500	1,030.00	515,000	
アリアケジャパン	900	9,300.00	8,370,000	
ピエトロ	100	1,649.00	164,900	
エバラ食品工業	200	2,116.00	423,200	
ニチレイ	5,200	3,160.00	16,432,000	

東洋水産	5,100	4,010.00	20,451,000	
イトアンド	300	1,646.00	493,800	
大冷	100	1,810.00	181,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	605.00	181,500	
日清食品ホールディングス	4,200	7,120.00	29,904,000	
永谷園ホールディングス	500	2,684.00	1,342,000	
一正蒲鉾	400	1,033.00	413,200	
フジッコ	1,100	2,453.00	2,698,300	
ロック・フィールド	1,100	1,729.00	1,901,900	
日本たばこ産業	57,500	2,803.50	161,201,250	
ケンコーマヨネーズ	600	2,216.00	1,329,600	
わらべや日洋ホールディングス	700	1,926.00	1,348,200	
なとり	600	1,788.00	1,072,800	
イフジ産業	200	704.00	140,800	
ピクルスコーポレーション	200	2,220.00	444,000	
北の達人コーポレーション	3,900	451.00	1,758,900	
ユーグレナ	4,100	665.00	2,726,500	
ミヨシ油脂	400	1,208.00	483,200	
理研ビタミン	500	3,635.00	1,817,500	
片倉工業	1,200	1,173.00	1,407,600	
ゲンゼ	700	4,260.00	2,982,000	
東洋紡	4,100	1,558.00	6,387,800	
ユニチカ	2,800	509.00	1,425,200	
富士紡ホールディングス	500	2,854.00	1,427,000	
倉敷紡績	900	2,820.00	2,538,000	
シキボウ	500	1,117.00	558,500	
日本毛織	3,200	885.00	2,832,000	
ダイトウボウ	1,600	92.00	147,200	
トーア紡コーポレーション	400	534.00	213,600	
ダイドーリミテッド	1,200	360.00	432,000	
帝国繊維	1,100	2,284.00	2,512,400	
帝人	7,900	1,873.00	14,796,700	
東レ	75,300	827.00	62,273,100	
サカイオーベックス	200	2,368.00	473,600	
住江織物	300	2,615.00	784,500	
日本フェルト	500	474.00	237,000	

イチカワ	100	1,470.00	147,000	
日東製網	100	1,435.00	143,500	
アツギ	800	1,011.00	808,800	
ダイニック	400	761.00	304,400	
セーレン	2,400	1,768.00	4,243,200	
ソトー	400	961.00	384,400	
東海染工	100	1,095.00	109,500	
小松マテーレ	1,600	843.00	1,348,800	
ワコールホールディングス	2,800	2,943.00	8,240,400	
ホギメディカル	1,200	3,185.00	3,822,000	
レナウン	2,800	111.00	310,800	
クラウディアホールディングス	200	488.00	97,600	
T S Iホールディングス	3,600	687.00	2,473,200	
マツオカコーポレーション	300	3,345.00	1,003,500	
ワールド	1,000	1,724.00	1,724,000	
三陽商会	600	1,991.00	1,194,600	
ナイガイ	400	541.00	216,400	
オンワードホールディングス	5,800	619.00	3,590,200	
ルックホールディングス	400	1,016.00	406,400	
キムラタン	4,800	27.00	129,600	
ゴールドウイン	900	11,130.00	10,017,000	
デサント	2,400	2,025.00	4,860,000	
キング	500	502.00	251,000	
ヤマトインターナショナル	600	437.00	262,200	
特種東海製紙	600	4,350.00	2,610,000	
王子ホールディングス	43,700	629.00	27,487,300	
日本製紙	4,700	2,036.00	9,569,200	
三菱製紙	1,600	545.00	872,000	
北越コーポレーション	6,400	555.00	3,552,000	
中越パルプ工業	400	1,513.00	605,200	
巴川製紙所	300	1,049.00	314,700	
大王製紙	4,700	1,321.00	6,208,700	
阿波製紙	200	530.00	106,000	
レンゴー	10,000	893.00	8,930,000	
トーモク	600	1,783.00	1,069,800	
ザ・バック	700	3,070.00	2,149,000	

クラレ	16,400	1,691.00	27,732,400
旭化成	69,100	1,145.50	79,154,050
共和レザー	600	825.00	495,000
昭和電工	6,500	3,740.00	24,310,000
住友化学	76,400	580.00	44,312,000
住友精化	500	4,445.00	2,222,500
日産化学	6,000	6,060.00	36,360,000
ラサ工業	400	1,449.00	579,600
クレハ	900	7,310.00	6,579,000
多木化学	100	8,710.00	871,000
テイカ	800	1,839.00	1,471,200
石原産業	1,900	1,100.00	2,090,000
片倉コープアグリ	300	1,160.00	348,000
日東エフシー	600	765.00	459,000
日本曹達	1,500	2,729.00	4,093,500
東ソー	15,000	1,443.00	21,645,000
トクヤマ	2,800	2,714.00	7,599,200
セントラル硝子	2,100	2,432.00	5,107,200
東亜合成	6,100	1,206.00	7,356,600
大阪ソーダ	1,000	2,583.00	2,583,000
関東電化工業	2,300	864.00	1,987,200
デンカ	3,800	3,430.00	13,034,000
信越化学工業	17,100	9,318.00	159,337,800
日本カーバイド工業	300	1,891.00	567,300
堺化学工業	700	2,570.00	1,799,000
第一稀元素化学工業	900	972.00	874,800
エア・ウォーター	8,000	1,733.00	13,864,000
大陽日酸	8,000	1,870.00	14,960,000
日本化学工業	300	2,445.00	733,500
東邦アセチレン	100	1,402.00	140,200
日本パーカライジング	5,300	1,305.00	6,916,500
高圧ガス工業	1,500	831.00	1,246,500
チタン工業	100	2,341.00	234,100
四国化成工業	1,700	1,154.00	1,961,800
戸田工業	200	2,309.00	461,800
ステラ ケミファ	600	2,856.00	1,713,600

保土谷化学工業	400	2,242.00	896,800	
日本触媒	1,600	7,190.00	11,504,000	
大日精化工業	800	2,960.00	2,368,000	
カネカ	2,600	4,050.00	10,530,000	
三菱瓦斯化学	10,000	1,670.00	16,700,000	
三井化学	8,800	2,636.00	23,196,800	
J S R	9,700	1,712.00	16,606,400	
東京応化工業	1,700	3,185.00	5,414,500	
大阪有機化学工業	900	1,273.00	1,145,700	
三菱ケミカルホールディングス	64,900	853.30	55,379,170	
K Hネオケム	1,500	2,486.00	3,729,000	
ダイセル	15,100	1,223.00	18,467,300	
住友ベークライト	1,700	3,810.00	6,477,000	
積水化学工業	21,200	1,768.00	37,481,600	
日本ゼオン	8,800	1,048.00	9,222,400	
アイカ工業	2,900	3,540.00	10,266,000	
宇部興産	4,900	2,391.00	11,715,900	
積水樹脂	1,600	1,984.00	3,174,400	
タキロンシーアイ	2,100	609.00	1,278,900	
旭有機材	700	1,622.00	1,135,400	
日立化成	4,500	1,619.00	7,285,500	
ニチバン	500	2,034.00	1,017,000	
リケンテクノス	2,600	487.00	1,266,200	
大倉工業	500	2,024.00	1,012,000	
積水化成品工業	1,400	992.00	1,388,800	
群栄化学工業	200	2,957.00	591,400	
タイガースポリマー	500	669.00	334,500	
ミライアル	300	1,060.00	318,000	
ダイキアクシス	300	1,014.00	304,200	
ダイキョーニシカワ	2,000	1,106.00	2,212,000	
竹本容器	200	2,937.00	587,400	
森六ホールディングス	500	2,808.00	1,404,000	
日本化薬	6,200	1,407.00	8,723,400	
カーリットホールディングス	1,000	814.00	814,000	
日本精化	800	1,048.00	838,400	
扶桑化学工業	1,000	2,170.00	2,170,000	

トリケミカル研究所	200	4,785.00	957,000	
A D E K A	4,800	1,661.00	7,972,800	
日油	3,700	3,690.00	13,653,000	
新日本理化	1,800	172.00	309,600	
ハリマ化成グループ	800	1,060.00	848,000	
花王	24,100	8,175.00	197,017,500	
第一工業製薬	400	2,943.00	1,177,200	
石原ケミカル	200	1,864.00	372,800	
日華化学	300	1,171.00	351,300	
ニイタカ	100	1,736.00	173,600	
三洋化成工業	600	5,460.00	3,276,000	
有機合成薬品工業	700	228.00	159,600	
大日本塗料	1,100	1,064.00	1,170,400	
日本ペイントホールディングス	8,000	3,740.00	29,920,000	
関西ペイント	10,900	2,012.00	21,930,800	
神東塗料	800	180.00	144,000	
中国塗料	3,200	951.00	3,043,200	
日本特殊塗料	700	1,537.00	1,075,900	
藤倉化成	1,300	618.00	803,400	
太陽ホールディングス	800	3,355.00	2,684,000	
D I C	4,400	3,360.00	14,784,000	
サカタインクス	2,100	1,235.00	2,593,500	
東洋インキ S C ホールディングス	2,100	2,627.00	5,516,700	
T & K T O K A	700	1,084.00	758,800	
富士フイルムホールディングス	20,600	4,525.00	93,215,000	
資生堂	19,700	7,034.00	138,569,800	
ライオン	13,800	2,228.00	30,746,400	
高砂香料工業	700	3,540.00	2,478,000	
マンダム	2,200	3,110.00	6,842,000	
ミルボン	1,200	4,875.00	5,850,000	
ファンケル	4,400	2,824.00	12,425,600	
コーセー	1,700	16,420.00	27,914,000	
コタ	500	1,478.00	739,000	
シーズ・ホールディングス	1,100	5,870.00	6,457,000	
シーボン	100	2,714.00	271,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	4,200	2,984.00	12,532,800	

ノエビアホールディングス	600	4,980.00	2,988,000	
アジュバンコスメジャパン	200	963.00	192,600	
エステー	700	2,174.00	1,521,800	
アグロ カネショウ	400	2,140.00	856,000	
コニシ	1,800	1,637.00	2,946,600	
長谷川香料	1,200	1,497.00	1,796,400	
星光PMC	700	851.00	595,700	
小林製薬	2,800	7,370.00	20,636,000	
荒川化学工業	900	1,475.00	1,327,500	
メック	700	1,200.00	840,000	
日本高純度化学	300	2,332.00	699,600	
タカラバイオ	2,600	2,726.00	7,087,600	
JCU	1,300	1,650.00	2,145,000	
新田ゼラチン	600	727.00	436,200	
OATアグリオ	100	2,170.00	217,000	
デクセリアルズ	2,600	878.00	2,282,800	
アース製薬	800	5,400.00	4,320,000	
北興化学工業	1,000	494.00	494,000	
大成ラミック	300	3,020.00	906,000	
クミアイ化学工業	4,100	666.00	2,730,600	
日本農薬	2,400	517.00	1,240,800	
アキレス	700	2,113.00	1,479,100	
有沢製作所	1,600	789.00	1,262,400	
日東電工	7,500	5,689.00	42,667,500	
レック	1,100	1,881.00	2,069,100	
三光合成	800	368.00	294,400	
きもと	1,700	202.00	343,400	
藤森工業	900	3,165.00	2,848,500	
前澤化成工業	700	1,089.00	762,300	
ウェーブロックホールディングス	200	804.00	160,800	
JSP	600	2,303.00	1,381,800	
エフピコ	800	6,590.00	5,272,000	
天馬	700	1,904.00	1,332,800	
信越ポリマー	1,800	734.00	1,321,200	
東リ	2,500	276.00	690,000	
ニフコ	4,000	2,762.00	11,048,000	

バルカー	800	2,499.00	1,999,200	
ユニ・チャーム	21,000	3,525.00	74,025,000	
協和発酵キリン	12,400	2,249.00	27,887,600	
武田薬品工業	39,100	3,771.00	147,446,100	
アステラス製薬	91,400	1,647.50	150,581,500	
大日本住友製薬	7,300	3,755.00	27,411,500	
塩野義製薬	13,000	6,920.00	89,960,000	
田辺三菱製薬	10,400	1,645.00	17,108,000	
わかもと製薬	1,200	285.00	342,000	
あすか製薬	1,200	1,168.00	1,401,600	
日本新薬	2,600	7,400.00	19,240,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,730.00	546,000	
中外製薬	10,300	7,200.00	74,160,000	
科研製薬	1,800	5,330.00	9,594,000	
エーザイ	11,900	9,634.00	114,644,600	
ロート製薬	5,100	3,370.00	17,187,000	
小野薬品工業	23,400	2,615.50	61,202,700	
久光製薬	2,900	7,100.00	20,590,000	
持田製薬	800	10,300.00	8,240,000	
参天製薬	18,800	1,817.00	34,159,600	
扶桑薬品工業	300	2,680.00	804,000	
日本ケミファ	100	3,840.00	384,000	
ツムラ	3,100	3,420.00	10,602,000	
日医工	2,500	1,799.00	4,497,500	
キッセイ薬品工業	1,800	3,325.00	5,985,000	
生化学工業	1,900	1,428.00	2,713,200	
栄研化学	1,700	2,475.00	4,207,500	
日水製薬	400	1,201.00	480,400	
鳥居薬品	500	2,419.00	1,209,500	
JCRファーマ	700	5,350.00	3,745,000	
東和薬品	500	8,430.00	4,215,000	
富士製薬工業	700	1,845.00	1,291,500	
沢井製薬	2,000	6,120.00	12,240,000	
ゼリア新薬工業	2,000	2,009.00	4,018,000	
第一三共	28,400	4,164.00	118,257,600	
キョーリン製薬ホールディングス	2,500	2,656.00	6,640,000	



大幸薬品	400	1,860.00	744,000	
ダイト	600	3,280.00	1,968,000	
大塚ホールディングス	18,900	5,342.00	100,963,800	
大正製薬ホールディングス	2,200	12,830.00	28,226,000	
ペプチドリーム	4,600	4,815.00	22,149,000	
日本コークス工業	8,400	101.00	848,400	
昭和シェル石油	9,300	1,650.00	15,345,000	
ニチレキ	1,300	1,092.00	1,419,600	
ユシロ化学工業	500	1,299.00	649,500	
ビーピー・カストロール	400	1,481.00	592,400	
富士石油	2,400	320.00	768,000	
MORESCO	400	1,595.00	638,000	
出光興産	7,700	3,905.00	30,068,500	
JXTGホールディングス	168,800	645.70	108,994,160	
コスモエネルギーホールディングス	2,900	2,637.00	7,647,300	
横浜ゴム	5,700	2,289.00	13,047,300	
東洋ゴム工業	5,100	1,611.00	8,216,100	
ブリヂストン	30,500	4,475.00	136,487,500	
住友ゴム工業	8,900	1,439.00	12,807,100	
藤倉ゴム工業	900	478.00	430,200	
オカモト	700	5,950.00	4,165,000	
フコク	400	927.00	370,800	
ニッタ	1,100	3,645.00	4,009,500	
住友理工	1,900	1,006.00	1,911,400	
三ツ星ベルト	1,300	2,225.00	2,892,500	
バンドー化学	1,900	1,194.00	2,268,600	
日東紡績	1,500	1,961.00	2,941,500	
A G C	10,000	3,665.00	36,650,000	
日本板硝子	4,700	899.00	4,225,300	
石塚硝子	100	2,069.00	206,900	
日本山村硝子	400	1,695.00	678,000	
日本電気硝子	4,300	2,895.00	12,448,500	
オハラ	400	2,124.00	849,600	
住友大阪セメント	2,000	4,705.00	9,410,000	
太平洋セメント	6,300	3,565.00	22,459,500	
日本ヒューム	1,000	900.00	900,000	

日本コンクリート工業	2,100	281.00	590,100	
三谷セキサン	500	2,800.00	1,400,000	
アジアパイルホールディングス	1,400	645.00	903,000	
東海カーボン	9,000	1,434.00	12,906,000	
日本カーボン	500	4,620.00	2,310,000	
東洋炭素	600	2,500.00	1,500,000	
ノリタケカンパニーリミテド	600	4,795.00	2,877,000	
TOTO	7,600	3,855.00	29,298,000	
日本碍子	12,100	1,593.00	19,275,300	
日本特殊陶業	8,400	2,179.00	18,303,600	
ダントーホールディングス	800	118.00	94,400	
MARUWA	300	6,320.00	1,896,000	
品川リフラクトリーズ	300	3,995.00	1,198,500	
黒崎播磨	200	6,740.00	1,348,000	
ヨータイ	900	652.00	586,800	
イソライト工業	500	485.00	242,500	
東京窯業	1,300	420.00	546,000	
ニッカトー	400	930.00	372,000	
フジインコーポレーテッド	900	2,177.00	1,959,300	
クニミネ工業	300	956.00	286,800	
エーアンドエーマテリアル	200	1,022.00	204,400	
ニチアス	2,700	2,026.00	5,470,200	
ニチハ	1,400	2,871.00	4,019,400	
新日鐵住金	43,900	1,962.50	86,153,750	
神戸製鋼所	17,900	864.00	15,465,600	
中山製鋼所	1,400	537.00	751,800	
合同製鐵	500	1,787.00	893,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	26,500	1,898.50	50,310,250	
日新製鋼	2,400	1,385.00	3,324,000	
東京製鐵	5,300	940.00	4,982,000	
共英製鋼	1,100	1,956.00	2,151,600	
大和工業	2,100	2,728.00	5,728,800	
東京鐵鋼	400	1,365.00	546,000	
大阪製鐵	600	1,929.00	1,157,400	
淀川製鋼所	1,300	2,366.00	3,075,800	
丸一鋼管	3,500	3,420.00	11,970,000	

モリ工業	300	2,487.00	746,100	
大同特殊鋼	1,600	4,345.00	6,952,000	
日本高周波鋼業	400	648.00	259,200	
日本冶金工業	8,100	255.00	2,065,500	
山陽特殊製鋼	1,200	2,538.00	3,045,600	
愛知製鋼	500	3,845.00	1,922,500	
日立金属	10,600	1,217.00	12,900,200	
日本金属	200	1,271.00	254,200	
大平洋金属	700	3,065.00	2,145,500	
新日本電工	5,900	239.00	1,410,100	
栗本鐵工所	500	1,502.00	751,000	
虹技	100	1,545.00	154,500	
日本鑄鉄管	100	1,256.00	125,600	
三菱製鋼	700	1,834.00	1,283,800	
日亜鋼業	1,400	320.00	448,000	
日本精線	100	3,315.00	331,500	
エンビプロ・ホールディングス	200	515.00	103,000	
シンニッタン	1,500	396.00	594,000	
新家工業	200	1,669.00	333,800	
大紀アルミニウム工業所	1,600	603.00	964,800	
日本軽金属ホールディングス	26,700	236.00	6,301,200	
三井金属鉱業	2,600	2,423.00	6,299,800	
東邦亜鉛	500	3,485.00	1,742,500	
三菱マテリアル	6,500	3,155.00	20,507,500	
住友金属鉱山	13,600	3,149.00	42,826,400	
D O W Aホールディングス	2,300	3,535.00	8,130,500	
古河機械金属	1,600	1,278.00	2,044,800	
エス・サイエンス	4,300	68.00	292,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,100	2,047.00	2,251,700	
東邦チタニウム	1,800	1,254.00	2,257,200	
U A C J	1,500	2,373.00	3,559,500	
C Kサンエツ	200	2,774.00	554,800	
古河電気工業	2,800	2,856.00	7,996,800	
住友電気工業	36,800	1,510.50	55,586,400	
フジクラ	11,800	452.00	5,333,600	
昭和電線ホールディングス	1,100	637.00	700,700	

東京特殊電線	100	1,944.00	194,400
タツタ電線	1,900	513.00	974,700
カナレ電気	200	1,936.00	387,200
平河ヒューテック	400	1,210.00	484,000
リヨービ	1,200	2,807.00	3,368,400
アーレスティ	1,200	673.00	807,600
アサヒホールディングス	1,800	2,351.00	4,231,800
稲葉製作所	500	1,315.00	657,500
宮地エンジニアリンググループ	300	2,037.00	611,100
トーカロ	2,500	908.00	2,270,000
アルファC o	300	1,361.00	408,300
SUMCO	10,800	1,447.00	15,627,600
川田テクノロジーズ	200	8,410.00	1,682,000
RS Technologies	200	4,165.00	833,000
東洋製罐グループホールディングス	6,200	2,588.00	16,045,600
ホッカンホールディングス	500	1,733.00	866,500
コロナ	500	1,114.00	557,000
横河ブリッジホールディングス	1,800	1,837.00	3,306,600
駒井ハルテック	200	2,056.00	411,200
高田機工	100	2,727.00	272,700
三和ホールディングス	10,100	1,275.00	12,877,500
文化シャッター	2,900	744.00	2,157,600
三協立山	1,400	1,213.00	1,698,200
アルインコ	800	1,055.00	844,000
東洋シャッター	200	647.00	129,400
LIXILグループ	14,500	1,439.00	20,865,500
日本フィルコン	800	550.00	440,000
ノーリツ	2,200	1,545.00	3,399,000
長府製作所	1,000	2,294.00	2,294,000
リンナイ	1,700	7,300.00	12,410,000
ダイニチ工業	500	722.00	361,000
日東精工	1,400	658.00	921,200
三洋工業	100	2,001.00	200,100
岡部	2,000	958.00	1,916,000
ジーテクト	1,100	1,560.00	1,716,000
中国工業	100	563.00	56,300

東プレ	1,800	2,240.00	4,032,000
高周波熱錬	1,900	955.00	1,814,500
東京製綱	600	1,076.00	645,600
サンコール	600	714.00	428,400
モリテック スチール	800	440.00	352,000
パイオラックス	1,600	2,464.00	3,942,400
エイチワン	1,000	1,007.00	1,007,000
日本発條	9,800	1,007.00	9,868,600
中央発條	100	3,405.00	340,500
アドバネクス	100	1,363.00	136,300
立川ブラインド工業	400	1,175.00	470,000
三益半導体工業	800	1,351.00	1,080,800
日本ドライケミカル	300	1,267.00	380,100
日本製鋼所	3,000	1,977.00	5,931,000
三浦工業	4,200	2,934.00	12,322,800
タクマ	3,600	1,486.00	5,349,600
ツガミ	2,200	738.00	1,623,600
オークマ	1,200	5,330.00	6,396,000
東芝機械	1,100	1,919.00	2,110,900
アマダホールディングス	15,100	1,051.00	15,870,100
アイダエンジニアリング	2,700	823.00	2,222,100
滝澤鉄工所	300	1,480.00	444,000
F U J I	2,900	1,380.00	4,002,000
牧野フライス製作所	1,100	4,175.00	4,592,500
オーエスジー	4,800	2,200.00	10,560,000
ダイジェット工業	100	1,802.00	180,200
旭ダイヤモンド工業	2,600	647.00	1,682,200
D M G 森精機	6,200	1,436.00	8,903,200
ソディック	2,100	756.00	1,587,600
ディスコ	1,300	14,240.00	18,512,000
日東工器	500	2,344.00	1,172,000
日進工具	300	2,448.00	734,400
パンチ工業	700	546.00	382,200
富士ダイス	400	697.00	278,800
豊和工業	500	800.00	400,000
O K K	400	847.00	338,800

石川製作所	200	1,387.00	277,400
東洋機械金属	700	565.00	395,500
津田駒工業	200	1,935.00	387,000
エンシュウ	300	1,182.00	354,600
島精機製作所	1,400	3,270.00	4,578,000
オプトラン	1,000	1,879.00	1,879,000
N C ホールディングス	300	531.00	159,300
フリー	800	1,002.00	801,600
ヤマシンフィルタ	1,700	725.00	1,232,500
日阪製作所	1,200	915.00	1,098,000
やまびこ	1,900	1,160.00	2,204,000
平田機工	500	5,770.00	2,885,000
ペガサスミシン製造	900	753.00	677,700
タツモ	300	821.00	246,300
ナブテスコ	5,400	2,650.00	14,310,000
三井海洋開発	1,000	2,656.00	2,656,000
レオン自動機	1,000	1,631.00	1,631,000
S M C	2,900	34,720.00	100,688,000
新川	700	453.00	317,100
ホソカワミクロン	300	4,485.00	1,345,500
ユニオンツール	400	3,270.00	1,308,000
オイレス工業	1,400	1,925.00	2,695,000
日精エー・エス・ビー機械	300	3,815.00	1,144,500
サトーホールディングス	1,200	2,861.00	3,433,200
技研製作所	700	3,835.00	2,684,500
日本エアータック	300	680.00	204,000
カワタ	200	1,585.00	317,000
日精樹脂工業	800	968.00	774,400
オカダアイヨン	300	1,642.00	492,600
ワイエイシイホールディングス	400	681.00	272,400
小松製作所	44,900	2,615.00	117,413,500
住友重機械工業	5,700	3,700.00	21,090,000
日立建機	4,000	2,706.00	10,824,000
日工	300	2,451.00	735,300
巴工業	400	2,308.00	923,200
井関農機	1,000	1,688.00	1,688,000

T O W A	800	687.00	549,600	
丸山製作所	200	1,497.00	299,400	
北川鉄工所	400	2,462.00	984,800	
ローツェ	400	1,611.00	644,400	
タカキタ	300	630.00	189,000	
クボタ	53,200	1,802.50	95,893,000	
荏原実業	300	1,978.00	593,400	
三菱化工機	300	1,558.00	467,400	
月島機械	2,000	1,266.00	2,532,000	
帝国電機製作所	700	1,450.00	1,015,000	
東京機械製作所	400	416.00	166,400	
新東工業	2,400	887.00	2,128,800	
澁谷工業	900	3,735.00	3,361,500	
アイチ コーポレーション	1,700	640.00	1,088,000	
小森コーポレーション	2,700	1,126.00	3,040,200	
鶴見製作所	800	1,900.00	1,520,000	
住友精密工業	200	3,345.00	669,000	
酒井重工業	200	2,516.00	503,200	
荏原製作所	4,400	2,797.00	12,306,800	
石井鐵工所	200	1,844.00	368,800	
西島製作所	1,000	1,033.00	1,033,000	
北越工業	1,000	1,120.00	1,120,000	
ダイキン工業	13,500	12,205.00	164,767,500	
オルガノ	400	2,931.00	1,172,400	
トーヨーカネツ	400	2,269.00	907,600	
栗田工業	5,400	2,787.00	15,049,800	
椿本チエイン	1,300	4,180.00	5,434,000	
大同工業	500	964.00	482,000	
木村化工機	800	400.00	320,000	
アネスト岩田	1,500	1,064.00	1,596,000	
ダイフク	5,500	5,600.00	30,800,000	
サムコ	300	1,274.00	382,200	
加藤製作所	500	2,876.00	1,438,000	
油研工業	200	1,932.00	386,400	
タダノ	4,800	1,116.00	5,356,800	
フジテック	3,600	1,284.00	4,622,400	

C K D	2,800	1,071.00	2,998,800
キトー	700	1,635.00	1,144,500
平和	2,800	2,387.00	6,683,600
理想科学工業	900	1,773.00	1,595,700
S A N K Y O	2,500	4,430.00	11,075,000
日本金銭機械	1,100	1,080.00	1,188,000
マースグループホールディングス	600	2,203.00	1,321,800
福島工業	600	3,965.00	2,379,000
オーイズミ	400	463.00	185,200
ダイコク電機	500	1,612.00	806,000
竹内製作所	1,700	1,926.00	3,274,200
アマノ	2,800	2,312.00	6,473,600
J U K I	1,400	1,320.00	1,848,000
サンデンホールディングス	1,200	788.00	945,600
蛇の目マシン工業	900	529.00	476,100
マックス	1,500	1,421.00	2,131,500
グローリー	2,700	2,686.00	7,252,200
新晃工業	900	1,622.00	1,459,800
大和冷機工業	1,400	1,145.00	1,603,000
セガサミーホールディングス	9,800	1,567.00	15,356,600
日本ピストンリング	400	1,962.00	784,800
リケン	500	5,130.00	2,565,000
T P R	1,300	2,433.00	3,162,900
ツバキ・ナカシマ	1,500	1,802.00	2,703,000
ホシザキ	2,900	8,990.00	26,071,000
大豊工業	800	1,031.00	824,800
日本精工	20,400	1,007.00	20,542,800
N T N	21,300	358.00	7,625,400
ジェイテクト	9,500	1,354.00	12,863,000
不二越	900	4,380.00	3,942,000
日本トムソン	2,900	560.00	1,624,000
T H K	6,200	2,400.00	14,880,000
ユーシン精機	800	1,081.00	864,800
前澤給装工業	400	1,951.00	780,400
イーグル工業	1,200	1,308.00	1,569,600
前澤工業	700	374.00	261,800



日本ピラー工業	1,000	1,443.00	1,443,000	
キット	4,000	911.00	3,644,000	
マキタ	12,100	4,200.00	50,820,000	
日立造船	7,900	362.00	2,859,800	
三菱重工業	16,600	4,229.00	70,201,400	
I H I	7,600	3,410.00	25,916,000	
スター精密	1,700	1,597.00	2,714,900	
日清紡ホールディングス	5,500	953.00	5,241,500	
イビデン	6,100	1,562.00	9,528,200	
コニカミノルタ	21,700	1,036.00	22,481,200	
ブラザー工業	12,900	1,700.00	21,930,000	
ミネベアミツミ	18,400	1,601.00	29,458,400	
日立製作所	44,700	3,254.00	145,453,800	
三菱電機	99,100	1,343.50	133,140,850	
富士電機	6,400	3,405.00	21,792,000	
東洋電機製造	400	1,387.00	554,800	
安川電機	11,500	3,180.00	36,570,000	
シンフォニアテクノロジー	1,400	1,463.00	2,048,200	
明電舎	2,000	1,543.00	3,086,000	
オリジン電気	300	1,870.00	561,000	
山洋電気	500	3,895.00	1,947,500	
デンヨー	900	1,556.00	1,400,400	
東芝テック	1,200	2,716.00	3,259,200	
芝浦メカトロニクス	200	3,750.00	750,000	
マブチモーター	2,700	3,640.00	9,828,000	
日本電産	11,900	13,760.00	163,744,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	500	2,245.00	1,122,500	
トレックス・セミコンダクター	300	1,399.00	419,700	
東光高岳	500	1,537.00	768,500	
ダブル・スコープ	1,400	1,214.00	1,699,600	
宮越ホールディングス	400	1,066.00	426,400	
ダイヘン	1,100	2,510.00	2,761,000	
田淵電機	1,400	164.00	229,600	
ヤーマン	1,400	1,700.00	2,380,000	
JVCケンウッド	7,400	275.00	2,035,000	
ミマキエンジニアリング	900	858.00	772,200	

第一精工	400	1,212.00	484,800
日新電機	2,300	926.00	2,129,800
大崎電気工業	2,000	763.00	1,526,000
オムロン	10,500	4,455.00	46,777,500
日東工業	1,600	2,068.00	3,308,800
I D E C	1,300	2,224.00	2,891,200
不二電機工業	100	1,322.00	132,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,600	2,531.00	9,111,600
サクサホールディングス	200	1,878.00	375,600
メルコホールディングス	400	3,720.00	1,488,000
テクノメディカ	200	2,065.00	413,000
日本電気	12,800	3,565.00	45,632,000
富士通	9,600	6,930.00	66,528,000
沖電気工業	4,300	1,462.00	6,286,600
岩崎通信機	500	746.00	373,000
電気興業	500	2,646.00	1,323,000
サンケン電気	1,200	2,223.00	2,667,600
ナカヨ	200	1,484.00	296,800
アイホン	600	1,697.00	1,018,200
ルネサスエレクトロニクス	10,300	518.00	5,335,400
セイコーエプソン	12,300	1,627.00	20,012,100
ワコム	7,200	531.00	3,823,200
アルバック	2,300	3,540.00	8,142,000
アクセル	400	540.00	216,000
E I Z O	900	4,130.00	3,717,000
ジャパンディスプレイ	23,400	59.00	1,380,600
日本信号	2,500	938.00	2,345,000
京三製作所	2,100	441.00	926,100
能美防災	1,300	2,062.00	2,680,600
ホーチキ	600	1,226.00	735,600
星和電機	400	423.00	169,200
エレコム	900	2,935.00	2,641,500
パナソニック	113,200	1,086.00	122,935,200
シャープ	9,800	1,377.00	13,494,600
アンリツ	6,400	1,638.00	10,483,200
富士通ゼネラル	3,000	1,542.00	4,626,000

ソニー	66,300	5,694.00	377,512,200
T D K	5,200	7,920.00	41,184,000
帝国通信工業	400	1,203.00	481,200
タムラ製作所	3,800	584.00	2,219,200
アルプス電気	9,200	2,428.00	22,337,600
池上通信機	300	1,252.00	375,600
パイオニア	16,500	64.00	1,056,000
日本電波工業	900	455.00	409,500
鈴木	500	651.00	325,500
日本トリム	200	5,890.00	1,178,000
ローランド ディー . ジー .	500	2,310.00	1,155,000
フォスター電機	1,200	1,451.00	1,741,200
クラリオン	800	2,481.00	1,984,800
S M K	300	2,226.00	667,800
ヨコオ	700	1,452.00	1,016,400
ティアック	700	246.00	172,200
ホシデン	2,900	813.00	2,357,700
ヒロセ電機	1,400	10,760.00	15,064,000
日本航空電子工業	2,300	1,298.00	2,985,400
T O A	1,100	1,133.00	1,246,300
マクセルホールディングス	2,100	1,511.00	3,173,100
古野電気	1,300	1,189.00	1,545,700
ユニデンホールディングス	300	2,279.00	683,700
アルパイン	1,700	1,660.00	2,822,000
スミダコーポレーション	800	1,360.00	1,088,000
アイコム	500	2,220.00	1,110,000
リオン	500	1,988.00	994,000
本多通信工業	800	550.00	440,000
船井電機	1,000	690.00	690,000
横河電機	9,900	2,028.00	20,077,200
新電元工業	400	3,935.00	1,574,000
アズビル	6,400	2,234.00	14,297,600
東亜ディーケーケー	500	887.00	443,500
日本光電工業	4,400	3,570.00	15,708,000
チノー	300	1,406.00	421,800
共和電業	1,000	401.00	401,000

日本電子材料	400	673.00	269,200
堀場製作所	2,000	4,880.00	9,760,000
アドバンテスト	6,800	2,071.00	14,082,800
小野測器	500	666.00	333,000
エスベック	900	1,932.00	1,738,800
キーエンス	4,900	57,860.00	283,514,000
日置電機	500	4,030.00	2,015,000
シスメックス	7,700	5,607.00	43,173,900
日本マイクロニクス	1,600	814.00	1,302,400
メガチップス	800	2,645.00	2,116,000
OBARA GROUP	600	4,295.00	2,577,000
澤藤電機	100	1,790.00	179,000
原田工業	300	882.00	264,600
コーセル	1,400	1,075.00	1,505,000
イリソ電子工業	900	4,145.00	3,730,500
オブテックスグループ	1,700	2,040.00	3,468,000
千代田インテグレ	400	2,302.00	920,800
アイ・オー・データ機器	400	1,090.00	436,000
レーザーテック	2,000	3,245.00	6,490,000
スタンレー電気	7,000	3,100.00	21,700,000
岩崎電気	400	1,445.00	578,000
ウシオ電機	6,000	1,197.00	7,182,000
岡谷電機産業	700	407.00	284,900
ヘリオス テクノ ホールディング	900	700.00	630,000
日本セラミック	1,000	2,623.00	2,623,000
遠藤照明	500	773.00	386,500
古河電池	700	762.00	533,400
双信電機	500	384.00	192,000
山一電機	700	1,249.00	874,300
図研	600	1,607.00	964,200
日本電子	2,000	1,868.00	3,736,000
カシオ計算機	8,800	1,497.00	13,173,600
ファナック	9,400	17,390.00	163,466,000
日本シイエムケイ	2,500	815.00	2,037,500
エンプラス	400	3,000.00	1,200,000
大真空	400	960.00	384,000

ローム	4,800	7,280.00	34,944,000
浜松ホトニクス	7,100	3,715.00	26,376,500
三井ハイテック	1,100	1,086.00	1,194,600
新光電気工業	3,300	753.00	2,484,900
京セラ	15,100	5,696.00	86,009,600
太陽誘電	4,400	1,930.00	8,492,000
村田製作所	10,400	16,045.00	166,868,000
ユーシン	1,500	983.00	1,474,500
双葉電子工業	1,600	1,635.00	2,616,000
北陸電気工業	400	991.00	396,400
ニチコン	3,100	789.00	2,445,900
日本ケミコン	700	1,990.00	1,393,000
K O A	1,500	1,363.00	2,044,500
市光工業	1,500	637.00	955,500
小糸製作所	5,900	5,720.00	33,748,000
ミツバ	1,800	669.00	1,204,200
S C R E E Nホールディングス	1,700	5,060.00	8,602,000
キャノン電子	900	1,982.00	1,783,800
キャノン	53,400	3,120.00	166,608,000
リコー	29,800	1,063.00	31,677,400
象印マホービン	1,800	1,089.00	1,960,200
M U T O Hホールディングス	100	2,160.00	216,000
東京エレクトロン	6,600	14,065.00	92,829,000
トヨタ紡織	3,500	1,697.00	5,939,500
芦森工業	200	1,558.00	311,600
ユニプレス	1,900	1,999.00	3,798,100
豊田自動織機	8,000	5,540.00	44,320,000
モリタホールディングス	1,700	1,991.00	3,384,700
三櫻工業	1,300	601.00	781,300
デンソー	22,000	5,093.00	112,046,000
東海理化電機製作所	2,600	1,945.00	5,057,000
三井E & Sホールディングス	3,600	1,164.00	4,190,400
川崎重工業	7,700	2,528.00	19,465,600
名村造船所	3,000	473.00	1,419,000
サノヤスホールディングス	1,300	195.00	253,500
日本車輛製造	400	2,501.00	1,000,400

三菱ロジスネクスト	1,200	1,171.00	1,405,200	
近畿車輛	100	2,102.00	210,200	
日産自動車	116,900	945.00	110,470,500	
いすゞ自動車	31,300	1,590.00	49,767,000	
トヨタ自動車	110,500	6,820.00	753,610,000	
日野自動車	12,400	1,101.00	13,652,400	
三菱自動車工業	36,700	665.00	24,405,500	
エフテック	700	972.00	680,400	
レシップホールディングス	400	708.00	283,200	
G M B	200	1,107.00	221,400	
ファルテック	200	911.00	182,200	
武蔵精密工業	2,300	1,662.00	3,822,600	
日産車体	1,900	867.00	1,647,300	
新明和工業	4,600	1,423.00	6,545,800	
極東開発工業	2,000	1,578.00	3,156,000	
日信工業	1,800	1,450.00	2,610,000	
トピー工業	800	2,531.00	2,024,800	
ティラド	400	2,427.00	970,800	
曙ブレーキ工業	5,400	216.00	1,166,400	
タチエス	1,700	1,483.00	2,521,100	
N O K	5,300	1,634.00	8,660,200	
フタバ産業	2,800	572.00	1,601,600	
K Y B	1,000	2,685.00	2,685,000	
大同メタル工業	1,600	852.00	1,363,200	
プレス工業	4,900	579.00	2,837,100	
ミクニ	1,300	534.00	694,200	
太平洋工業	2,100	1,493.00	3,135,300	
ケーヒン	2,300	1,841.00	4,234,300	
河西工業	1,200	933.00	1,119,600	
アイシン精機	8,200	4,185.00	34,317,000	
マツダ	31,100	1,220.50	37,957,550	
今仙電機製作所	900	1,031.00	927,900	
本田技研工業	83,600	3,033.00	253,558,800	
スズキ	18,100	5,420.00	98,102,000	
S U B A R U	30,800	2,462.00	75,829,600	
安永	500	1,672.00	836,000	

ヤマハ発動機	14,000	2,249.00	31,486,000
ショーワ	2,300	1,405.00	3,231,500
T B K	1,200	423.00	507,600
エクセディ	1,300	2,715.00	3,529,500
豊田合成	3,200	2,213.00	7,081,600
愛三工業	1,600	786.00	1,257,600
盟和産業	100	1,050.00	105,000
日本プラスト	800	844.00	675,200
ヨロズ	900	1,419.00	1,277,100
エフ・シー・シー	1,800	2,621.00	4,717,800
シマノ	4,000	16,000.00	64,000,000
テイ・エス テック	2,300	3,225.00	7,417,500
ジャムコ	500	2,747.00	1,373,500
テルモ	14,000	6,105.00	85,470,000
クリエートメディック	300	1,115.00	334,500
日機装	3,200	1,005.00	3,216,000
島津製作所	12,800	2,389.00	30,579,200
J M S	900	571.00	513,900
クボテック	200	305.00	61,000
長野計器	800	874.00	699,200
ブイ・テクノロジー	200	14,940.00	2,988,000
東京計器	600	1,029.00	617,400
愛知時計電機	100	3,865.00	386,500
インターアクション	500	2,053.00	1,026,500
オーバル	1,000	258.00	258,000
東京精密	1,800	3,015.00	5,427,000
マニー	1,200	5,000.00	6,000,000
ニコン	17,300	1,725.00	29,842,500
トプコン	5,300	1,670.00	8,851,000
オリンパス	14,800	3,120.00	46,176,000
理研計器	900	2,172.00	1,954,800
タムロン	900	1,742.00	1,567,800
H O Y A	20,000	6,739.00	134,780,000
シード	400	1,410.00	564,000
ノーリツ鋼機	800	1,758.00	1,406,400
エー・アンド・デイ	900	733.00	659,700

朝日インテック	3,600	5,450.00	19,620,000	
シチズン時計	10,800	582.00	6,285,600	
リズム時計工業	300	2,000.00	600,000	
大研医器	800	706.00	564,800	
メニコン	1,400	2,813.00	3,938,200	
シンシア	100	612.00	61,200	
松風	500	1,166.00	583,000	
セイコーホールディングス	1,500	2,375.00	3,562,500	
ニプロ	6,900	1,430.00	9,867,000	
中本パックス	300	1,754.00	526,200	
スノーピーク	500	1,335.00	667,500	
パラマウントベッドホールディングス	1,100	4,570.00	5,027,000	
トランザクション	600	748.00	448,800	
S H O - B I	300	395.00	118,500	
ニホンフラッシュ	400	1,847.00	738,800	
前田工織	1,100	2,693.00	2,962,300	
永大産業	1,300	419.00	544,700	
アートネイチャー	1,100	657.00	722,700	
バンダイナムコホールディングス	10,200	4,670.00	47,634,000	
アイフィスジャパン	300	671.00	201,300	
共立印刷	1,700	229.00	389,300	
S H O E I	500	4,145.00	2,072,500	
フランスベッドホールディングス	1,500	935.00	1,402,500	
パイロットコーポレーション	1,700	5,730.00	9,741,000	
萩原工業	500	1,551.00	775,500	
トッパン・フォームズ	2,100	984.00	2,066,400	
フジシールインターナショナル	2,200	3,710.00	8,162,000	
タカラトミー	4,100	1,337.00	5,481,700	
廣済堂	1,000	422.00	422,000	
エステールホールディングス	300	675.00	202,500	
アーク	3,900	92.00	358,800	
タカノ	400	854.00	341,600	
プロネクサス	800	1,061.00	848,800	
ホクシン	700	155.00	108,500	
ウッドワン	300	1,104.00	331,200	
大建工業	700	2,000.00	1,400,000	



凸版印刷	14,000	1,788.00	25,032,000	
大日本印刷	14,000	2,472.00	34,608,000	
図書印刷	1,000	773.00	773,000	
共同印刷	300	2,627.00	788,100	
N I S S H A	2,000	1,572.00	3,144,000	
光村印刷	100	2,161.00	216,100	
宝印刷	500	1,794.00	897,000	
アシックス	9,800	1,618.00	15,856,400	
ツツミ	300	1,996.00	598,800	
小松ウオール工業	300	1,990.00	597,000	
ヤマハ	5,900	4,840.00	28,556,000	
河合楽器製作所	300	3,475.00	1,042,500	
クリナップ	900	695.00	625,500	
ピジョン	6,000	4,550.00	27,300,000	
兼松サステック	100	1,662.00	166,200	
キングジム	800	881.00	704,800	
リンテック	2,400	2,378.00	5,707,200	
イトーキ	1,900	580.00	1,102,000	
任天堂	6,100	32,830.00	200,263,000	
三菱鉛筆	1,600	2,084.00	3,334,400	
タカラスタANDARD	2,000	1,700.00	3,400,000	
コクヨ	4,800	1,701.00	8,164,800	
ナカバヤシ	1,000	550.00	550,000	
グローブライド	500	2,661.00	1,330,500	
オカムラ	3,500	1,519.00	5,316,500	
美津濃	1,000	2,416.00	2,416,000	
東京電力ホールディングス	79,100	688.00	54,420,800	
中部電力	30,300	1,698.00	51,449,400	
関西電力	40,500	1,715.50	69,477,750	
中国電力	13,700	1,433.00	19,632,100	
北陸電力	9,700	1,023.00	9,923,100	
東北電力	23,200	1,488.00	34,521,600	
四国電力	8,900	1,383.00	12,308,700	
九州電力	20,400	1,343.00	27,397,200	
北海道電力	9,300	794.00	7,384,200	
沖縄電力	1,800	2,144.00	3,859,200	

電源開発	7,900	2,857.00	22,570,300	
エフオン	600	937.00	562,200	
イーレックス	1,700	671.00	1,140,700	
レノバ	1,000	974.00	974,000	
東京瓦斯	19,400	2,851.00	55,309,400	
大阪瓦斯	19,200	2,064.00	39,628,800	
東邦瓦斯	4,900	4,710.00	23,079,000	
北海道瓦斯	500	1,474.00	737,000	
広島ガス	2,000	351.00	702,000	
西部瓦斯	1,100	2,478.00	2,725,800	
静岡ガス	3,000	932.00	2,796,000	
メタウォーター	500	3,160.00	1,580,000	
SBSホールディングス	1,200	1,382.00	1,658,400	
東武鉄道	10,500	3,090.00	32,445,000	
相鉄ホールディングス	3,400	3,360.00	11,424,000	
東京急行電鉄	26,900	1,921.00	51,674,900	
京浜急行電鉄	13,600	1,743.00	23,704,800	
小田急電鉄	15,900	2,415.00	38,398,500	
京王電鉄	5,500	6,250.00	34,375,000	
京成電鉄	7,400	3,535.00	26,159,000	
富士急行	1,400	2,999.00	4,198,600	
新京成電鉄	300	2,121.00	636,300	
東日本旅客鉄道	17,600	10,230.00	180,048,000	
西日本旅客鉄道	8,900	7,717.00	68,681,300	
東海旅客鉄道	8,900	23,035.00	205,011,500	
西武ホールディングス	12,600	2,064.00	26,006,400	
鴻池運輸	1,600	1,712.00	2,739,200	
西日本鉄道	2,700	2,822.00	7,619,400	
ハマキョウレックス	800	3,785.00	3,028,000	
サカイ引越センター	500	5,780.00	2,890,000	
近鉄グループホールディングス	9,400	4,850.00	45,590,000	
阪急阪神ホールディングス	12,500	3,730.00	46,625,000	
南海電気鉄道	4,200	2,955.00	12,411,000	
京阪ホールディングス	4,200	4,730.00	19,866,000	
神戸電鉄	200	3,990.00	798,000	
名古屋鉄道	7,500	2,786.00	20,895,000	

山陽電気鉄道	700	2,272.00	1,590,400	
日本通運	3,700	6,590.00	24,383,000	
ヤマトホールディングス	16,500	2,948.00	48,642,000	
山九	2,600	5,270.00	13,702,000	
丸運	500	312.00	156,000	
丸全昭和運輸	800	3,020.00	2,416,000	
センコーグループホールディングス	5,200	869.00	4,518,800	
トナミホールディングス	200	5,850.00	1,170,000	
ニッコンホールディングス	3,600	2,735.00	9,846,000	
日本石油輸送	100	2,868.00	286,800	
福山通運	1,200	4,710.00	5,652,000	
セイノーホールディングス	7,000	1,588.00	11,116,000	
エスライン	300	1,150.00	345,000	
神奈川中央交通	200	3,730.00	746,000	
日立物流	2,100	3,005.00	6,310,500	
丸和運輸機関	500	3,070.00	1,535,000	
C & F ロジホールディングス	900	1,226.00	1,103,400	
九州旅客鉄道	7,900	3,595.00	28,400,500	
S Gホールディングス	8,900	2,753.00	24,501,700	
日本郵船	7,900	1,875.00	14,812,500	
商船三井	5,600	2,547.00	14,263,200	
川崎汽船	2,900	1,548.00	4,489,200	
N S ユナイテッド海運	500	3,020.00	1,510,000	
明治海運	1,000	365.00	365,000	
飯野海運	4,400	428.00	1,883,200	
共栄タンカー	100	1,836.00	183,600	
乾汽船	800	943.00	754,400	
日本航空	17,200	3,865.00	66,478,000	
A N A ホールディングス	17,200	3,889.00	66,890,800	
パスコ	200	946.00	189,200	
トランコム	300	6,240.00	1,872,000	
日新	800	1,907.00	1,525,600	
三菱倉庫	3,200	2,639.00	8,444,800	
三井倉庫ホールディングス	1,100	1,932.00	2,125,200	
住友倉庫	3,500	1,397.00	4,889,500	
澁澤倉庫	500	1,568.00	784,000	

東陽倉庫	1,700	290.00	493,000
日本トランスシティ	2,100	454.00	953,400
ケイヒン	200	1,364.00	272,800
中央倉庫	600	1,032.00	619,200
川西倉庫	200	1,528.00	305,600
安田倉庫	800	806.00	644,800
東洋埠頭	300	1,497.00	449,100
宇徳	800	509.00	407,200
上組	5,800	2,460.00	14,268,000
サンリツ	200	655.00	131,000
キムラユニティー	200	1,071.00	214,200
キューソー流通システム	200	2,383.00	476,600
近鉄エクスプレス	1,800	1,774.00	3,193,200
東海運	500	360.00	180,000
エーアイティー	600	971.00	582,600
内外トランスライン	300	1,552.00	465,600
日本コンセプト	300	1,116.00	334,800
NEC ネットエスアイ	1,100	2,459.00	2,704,900
システナ	3,600	1,525.00	5,490,000
デジタルアーツ	500	6,850.00	3,425,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,500	2,945.00	4,417,500
キューブシステム	500	717.00	358,500
エイジア	200	1,237.00	247,400
コア	400	1,314.00	525,600
ソリトンシステムズ	500	811.00	405,500
ソフトクリエイティブホールディングス	400	1,710.00	684,000
T I S	3,200	4,920.00	15,744,000
ネオス	400	1,219.00	487,600
電算システム	400	2,268.00	907,200
グリー	5,300	460.00	2,438,000
コーエーテクモホールディングス	2,100	1,853.00	3,891,300
三菱総合研究所	400	3,480.00	1,392,000
ボルテージ	200	646.00	129,200
電算	100	2,152.00	215,200
A G S	500	743.00	371,500
ファインデックス	800	698.00	558,400

ヒト・コミュニケーションズ	200	1,720.00	344,000	
ブレインパッド	200	6,480.00	1,296,000	
K L a b	1,800	1,100.00	1,980,000	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	600	2,134.00	1,280,400	
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,809.00	361,800	
ネクソン	24,800	1,391.00	34,496,800	
アイスタイル	2,500	1,005.00	2,512,500	
エムアップ	300	2,103.00	630,900	
エイチーム	600	1,521.00	912,600	
テクノスジャパン	800	903.00	722,400	
e n i s h	300	518.00	155,400	
コロブラ	2,800	821.00	2,298,800	
オルトプラス	600	375.00	225,000	
ブロードリーフ	4,800	611.00	2,932,800	
クロス・マーケティンググループ	300	388.00	116,400	
デジタルハーツホールディングス	400	1,648.00	659,200	
メディアドゥホールディングス	300	2,643.00	792,900	
じげん	1,000	577.00	577,000	
ブイキューブ	500	440.00	220,000	
サイバーリンクス	100	1,036.00	103,600	
ディー・エル・イー	600	214.00	128,400	
フィックスターズ	900	1,172.00	1,054,800	
VOYAGE GROUP	500	1,127.00	563,500	
オブティム	200	4,745.00	949,000	
セレス	300	1,803.00	540,900	
ベリサーブ	100	5,280.00	528,000	
ティーガイア	1,000	2,230.00	2,230,000	
セック	200	4,020.00	804,000	
日本アジアグループ	1,000	344.00	344,000	
豆蔵ホールディングス	700	1,080.00	756,000	
テクマトリックス	700	1,868.00	1,307,600	
プロシップ	100	2,452.00	245,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23,400	230.00	5,382,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,600	6,660.00	10,656,000	
ザッパラス	500	391.00	195,500	

システムリサーチ	100	3,255.00	325,500
インターネットイニシアティブ	1,600	2,618.00	4,188,800
さくらインターネット	1,200	542.00	650,400
ヴィンクス	300	1,650.00	495,000
GMOクラウド	200	3,790.00	758,000
SRAホールディングス	500	2,812.00	1,406,000
Minorityソリューションズ	200	1,700.00	340,000
システムインテグレータ	300	900.00	270,000
朝日ネット	800	524.00	419,200
eBASE	300	1,705.00	511,500
アバント	300	1,182.00	354,600
アドソル日進	300	1,805.00	541,500
フリービット	600	993.00	595,800
コムチュア	600	3,220.00	1,932,000
サイバーコム	200	1,645.00	329,000
アステリア	500	811.00	405,500
マークライnz	300	1,394.00	418,200
メディカル・データ・ビジョン	900	985.00	886,500
gumi	1,100	610.00	671,000
ショーケース・ティービー	200	772.00	154,400
モバイルファクトリー	300	1,252.00	375,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	400	1,851.00	740,400
PCIホールディングス	200	2,525.00	505,000
パイプドHD	100	1,010.00	101,000
アイピーシー	200	1,186.00	237,200
ネオジャパン	200	792.00	158,400
PR TIMES	100	2,244.00	224,400
ランドコンピュータ	100	1,031.00	103,100
オープンドア	500	3,015.00	1,507,500
マイネット	300	2,028.00	608,400
アカツキ	400	5,560.00	2,224,000
ベネフィットジャパン	100	808.00	80,800
Ubicomホールディングス	200	1,065.00	213,000
LINE	3,000	3,630.00	10,890,000
カナミックネットワーク	100	1,862.00	186,200

ノムラシステムコーポレーション	100	976.00	97,600	
チェンジ	100	6,710.00	671,000	
シンクロ・フード	400	565.00	226,000	
オークネット	500	1,089.00	544,500	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,100	949.00	1,043,900	
マクロミル	1,200	1,660.00	1,992,000	
ビーグリー	200	993.00	198,600	
オロ	100	4,400.00	440,000	
ソルクシーズ	400	727.00	290,800	
フェイス	400	1,130.00	452,000	
ハイマックス	100	1,754.00	175,400	
野村総合研究所	6,200	4,745.00	29,419,000	
サイバネットシステム	800	707.00	565,600	
C E ホールディングス	300	700.00	210,000	
日本システム技術	200	1,893.00	378,600	
インテージホールディングス	1,200	987.00	1,184,400	
東邦システムサイエンス	300	859.00	257,700	
ソースネクスト	3,800	620.00	2,356,000	
F I G	900	383.00	344,700	
フォーカスシステムズ	700	1,054.00	737,800	
クレスコ	300	3,600.00	1,080,000	
フジ・メディア・ホールディングス	10,100	1,702.00	17,190,200	
オービック	3,400	9,160.00	31,144,000	
ジャストシステム	1,400	2,492.00	3,488,800	
T D C ソフト	900	918.00	826,200	
ヤフー	63,400	317.00	20,097,800	
トレンドマイクロ	5,200	6,210.00	32,292,000	
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,328.00	398,400	
日本オラクル	1,600	7,090.00	11,344,000	
アルファシステムズ	300	2,606.00	781,800	
フューチャー	1,300	1,654.00	2,150,200	
C A C H o l d i n g s	700	1,016.00	711,200	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,851.00	740,400	
トーセ	300	895.00	268,500	
オービックビジネスコンサルタント	500	9,600.00	4,800,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	4,400	2,115.00	9,306,000	

アイティフォー	1,200	797.00	956,400	
東計電算	100	3,245.00	324,500	
エクスネット	200	906.00	181,200	
大塚商会	5,300	3,515.00	18,629,500	
サイボウズ	1,100	658.00	723,800	
ソフトブレン	800	484.00	387,200	
電通国際情報サービス	600	3,385.00	2,031,000	
デジタルガレージ	1,900	2,762.00	5,247,800	
E Mシステムズ	800	1,087.00	869,600	
ウェザーニューズ	300	3,185.00	955,500	
C I J	800	718.00	574,400	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,175.00	217,500	
日本エンタープライズ	1,000	221.00	221,000	
WOWOW	500	3,265.00	1,632,500	
スカラ	800	792.00	633,600	
I M A G I C A G R O U P	800	557.00	445,600	
ネットワンシステムズ	3,400	2,221.00	7,551,400	
システムソフト	2,300	106.00	243,800	
アルゴグラフィックス	400	4,225.00	1,690,000	
マーベラス	1,500	859.00	1,288,500	
エイベックス	1,700	1,552.00	2,638,400	
日本ユニシス	3,000	2,870.00	8,610,000	
兼松エレクトロニクス	500	3,415.00	1,707,500	
東京放送ホールディングス	6,500	1,924.00	12,506,000	
日本テレビホールディングス	8,900	1,782.00	15,859,800	
朝日放送グループホールディングス	1,000	754.00	754,000	
テレビ朝日ホールディングス	2,700	2,178.00	5,880,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	7,400	522.00	3,862,800	
テレビ東京ホールディングス	800	2,575.00	2,060,000	
日本BS放送	300	1,220.00	366,000	
ビジョン	300	4,630.00	1,389,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	400	1,021.00	408,400	
ワイヤレスゲート	400	497.00	198,800	
コネクシオ	700	1,399.00	979,300	
日本通信	8,300	120.00	996,000	
クロップス	200	700.00	140,000	



日本電信電話	66,500	4,595.00	305,567,500	
K D D I	85,700	2,619.50	224,491,150	
光通信	1,100	18,020.00	19,822,000	
N T T ドコモ	69,800	2,551.50	178,094,700	
エムティーアイ	1,100	570.00	627,000	
G M O インターネット	3,500	1,385.00	4,847,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	200	497.00	99,400	
カドカワ	2,800	1,260.00	3,528,000	
学研ホールディングス	300	4,355.00	1,306,500	
ゼンリン	1,900	2,687.00	5,105,300	
昭文社	400	523.00	209,200	
インプレスホールディングス	800	159.00	127,200	
アイネット	500	1,529.00	764,500	
松竹	600	11,380.00	6,828,000	
東宝	6,400	3,815.00	24,416,000	
東映	400	13,530.00	5,412,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	25,900	1,292.00	33,462,800	
ピー・シー・エー	100	2,095.00	209,500	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,956.00	391,200	
D T S	1,100	3,880.00	4,268,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,500	3,310.00	14,895,000	
シーイーシー	1,000	2,409.00	2,409,000	
カブコン	4,200	2,106.00	8,845,200	
アイ・エス・ピー	200	2,159.00	431,800	
ジャステック	600	1,045.00	627,000	
S C S K	2,600	4,110.00	10,686,000	
日本システムウエア	300	2,164.00	649,200	
アイネス	1,200	1,195.00	1,434,000	
T K C	800	4,020.00	3,216,000	
富士ソフト	1,500	4,655.00	6,982,500	
N S D	1,600	2,328.00	3,724,800	
コナミホールディングス	4,000	4,885.00	19,540,000	
福井コンピュータホールディングス	300	1,601.00	480,300	
J B C C ホールディングス	800	1,691.00	1,352,800	
ミロク情報サービス	1,000	2,504.00	2,504,000	
ソフトバンクグループ	40,700	8,616.00	350,671,200	

ハウスイ	100	927.00	92,700	
高千穂交易	400	999.00	399,600	
伊藤忠食品	200	5,030.00	1,006,000	
エレマテック	500	2,016.00	1,008,000	
JALUX	300	2,713.00	813,900	
あらた	500	4,920.00	2,460,000	
トーメンデバイス	100	2,359.00	235,900	
東京エレクトロン デバイス	400	1,793.00	717,200	
フィールズ	900	934.00	840,600	
双日	53,900	403.00	21,721,700	
アルフレッサ ホールディングス	10,900	2,928.00	31,915,200	
横浜冷凍	2,600	930.00	2,418,000	
神栄	100	1,017.00	101,700	
ラサ商事	500	934.00	467,000	
ラクーンホールディングス	600	622.00	373,200	
アルコニックス	1,000	1,198.00	1,198,000	
神戸物産	1,500	3,190.00	4,785,000	
あい ホールディングス	1,600	2,025.00	3,240,000	
ディーブイエックス	400	1,214.00	485,600	
ダイワボウホールディングス	900	5,420.00	4,878,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,700	1,590.00	4,293,000	
ラクト・ジャパン	200	8,240.00	1,648,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,800	1,115.00	2,007,000	
八洲電機	700	802.00	561,400	
メディアスホールディングス	500	776.00	388,000	
UKCホールディングス	600	2,346.00	1,407,600	
ジューテックホールディングス	200	1,013.00	202,600	
大光	200	639.00	127,800	
OCHIホールディングス	300	1,225.00	367,500	
TOKAIホールディングス	5,200	943.00	4,903,600	
黒谷	200	480.00	96,000	
Cominix	200	815.00	163,000	
三洋貿易	500	1,862.00	931,000	
ビューティガレージ	100	1,709.00	170,900	
ウイン・パートナーズ	600	1,052.00	631,200	
ミタチ産業	200	741.00	148,200	

シップヘルスケアホールディングス	2,000	4,280.00	8,560,000	
明治電機工業	300	1,882.00	564,600	
デリカフーズホールディングス	200	1,421.00	284,200	
スターティアホールディングス	200	713.00	142,600	
コメダホールディングス	2,300	2,332.00	5,363,600	
富士興産	400	622.00	248,800	
協栄産業	100	1,727.00	172,700	
小野建	900	1,592.00	1,432,800	
佐島電機	700	955.00	668,500	
エコートレーディング	200	629.00	125,800	
伯東	700	1,275.00	892,500	
コンドーテック	700	996.00	697,200	
中山福	600	543.00	325,800	
ナガイレーベン	1,400	2,632.00	3,684,800	
三菱食品	1,100	2,965.00	3,261,500	
松田産業	700	1,459.00	1,021,300	
第一興商	1,500	5,100.00	7,650,000	
メディバルホールディングス	10,500	2,505.00	26,302,500	
S P K	200	2,360.00	472,000	
萩原電気ホールディングス	400	2,950.00	1,180,000	
アズワン	700	8,070.00	5,649,000	
スズデン	300	1,267.00	380,100	
尾家産業	300	1,298.00	389,400	
シモジマ	600	1,070.00	642,000	
ドウシシャ	900	1,986.00	1,787,400	
小津産業	200	1,925.00	385,000	
高速	600	1,074.00	644,400	
たけびし	300	1,394.00	418,200	
リックス	200	1,510.00	302,000	
丸文	900	803.00	722,700	
ハピネット	800	1,532.00	1,225,600	
橋本総業ホールディングス	200	1,540.00	308,000	
日本ライフライン	3,100	1,578.00	4,891,800	
タカショー	500	469.00	234,500	
エクセル	400	1,891.00	756,400	
マルカキカイ	300	2,086.00	625,800	

I D O M	3,300	428.00	1,412,400	
日本エム・ディ・エム	600	1,239.00	743,400	
進和	600	2,205.00	1,323,000	
エスケイジャパン	200	811.00	162,200	
ダイトロン	400	1,373.00	549,200	
シークス	1,200	1,695.00	2,034,000	
田中商事	300	611.00	183,300	
オーハシテクニカ	500	1,361.00	680,500	
白銅	300	1,660.00	498,000	
伊藤忠商事	68,300	1,988.50	135,814,550	
丸紅	96,300	807.50	77,762,250	
高島	200	1,978.00	395,600	
長瀬産業	5,500	1,608.00	8,844,000	
蝶理	600	1,804.00	1,082,400	
豊田通商	10,900	3,660.00	39,894,000	
三共生興	1,700	429.00	729,300	
兼松	3,900	1,361.00	5,307,900	
ツカモトコーポレーション	200	1,160.00	232,000	
三井物産	80,400	1,699.00	136,599,600	
日本紙パルプ商事	600	4,320.00	2,592,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,000	3,725.00	11,175,000	
カメイ	1,300	1,216.00	1,580,800	
東都水産	100	1,926.00	192,600	
O U Gホールディングス	200	2,577.00	515,400	
スターゼン	400	4,085.00	1,634,000	
山善	3,800	1,137.00	4,320,600	
椿本興業	200	3,080.00	616,000	
住友商事	57,700	1,658.50	95,695,450	
内田洋行	400	2,612.00	1,044,800	
三菱商事	68,400	3,034.00	207,525,600	
第一実業	400	3,875.00	1,550,000	
キヤノンマーケティングジャパン	2,800	2,036.00	5,700,800	
西華産業	500	1,530.00	765,000	
佐藤商事	900	915.00	823,500	
菱洋エレクトロ	1,000	1,668.00	1,668,000	
東京産業	1,000	541.00	541,000	

ユアサ商事	1,000	3,630.00	3,630,000	
神鋼商事	200	2,673.00	534,600	
小林産業	600	295.00	177,000	
阪和興業	1,700	3,095.00	5,261,500	
正栄食品工業	500	4,525.00	2,262,500	
カナデン	900	1,300.00	1,170,000	
菱電商事	800	1,560.00	1,248,000	
フルサト工業	500	1,717.00	858,500	
岩谷産業	2,200	3,805.00	8,371,000	
すてきナイスグループ	400	1,066.00	426,400	
昭光通商	300	735.00	220,500	
ニチモウ	200	1,707.00	341,400	
極東貿易	300	1,540.00	462,000	
イワキ	1,200	485.00	582,000	
三愛石油	2,600	1,211.00	3,148,600	
稲畑産業	2,300	1,510.00	3,473,000	
G S Iクレオス	300	1,391.00	417,300	
明和産業	900	403.00	362,700	
ワキタ	2,100	1,224.00	2,570,400	
東邦ホールディングス	2,900	2,919.00	8,465,100	
サンゲツ	2,900	2,141.00	6,208,900	
ミツウロコグループホールディングス	1,400	658.00	921,200	
シナネンホールディングス	400	2,520.00	1,008,000	
伊藤忠エネクス	2,200	1,060.00	2,332,000	
サンリオ	3,000	2,379.00	7,137,000	
サンワテクノス	600	1,144.00	686,400	
リョーサン	1,100	2,966.00	3,262,600	
新光商事	900	1,704.00	1,533,600	
トーヨー	400	2,250.00	900,000	
三信電気	800	1,792.00	1,433,600	
東陽テクニカ	1,100	851.00	936,100	
モスフードサービス	1,300	2,999.00	3,898,700	
加賀電子	1,000	2,062.00	2,062,000	
ソーダニッカ	1,000	586.00	586,000	
立花エレテック	700	1,630.00	1,141,000	
フォーバル	400	911.00	364,400	

PAL TAC	1,800	5,740.00	10,332,000	
三谷産業	1,100	298.00	327,800	
太平洋興発	400	831.00	332,400	
西本Wismettacホールディングス	200	4,965.00	993,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,224.00	122,400	
国際紙パルプ商事	1,700	296.00	503,200	
ヤマタネ	500	1,748.00	874,000	
丸紅建材リース	100	2,009.00	200,900	
日鉄住金物産	700	4,815.00	3,370,500	
泉州電業	300	2,613.00	783,900	
トラスコ中山	2,000	3,090.00	6,180,000	
オートバックスセブン	3,900	1,746.00	6,809,400	
モリト	700	796.00	557,200	
加藤産業	1,500	3,375.00	5,062,500	
北恵	200	1,162.00	232,400	
イノテック	700	1,013.00	709,100	
イエローハット	900	2,793.00	2,513,700	
J Kホールディングス	900	619.00	557,100	
日伝	800	1,671.00	1,336,800	
北沢産業	700	233.00	163,100	
杉本商事	500	1,751.00	875,500	
因幡電機産業	1,400	4,585.00	6,419,000	
バイテックホールディングス	400	2,339.00	935,600	
東テク	300	2,561.00	768,300	
ミスミグループ本社	12,200	2,455.00	29,951,000	
アルテック	700	252.00	176,400	
タキヒヨー	300	1,907.00	572,100	
葺王産業	200	1,350.00	270,000	
スズケン	4,500	6,060.00	27,270,000	
ジェコス	700	1,108.00	775,600	
ルネサスイーストン	900	425.00	382,500	
ローソン	2,500	7,350.00	18,375,000	
サンエー	700	4,695.00	3,286,500	
カワチ薬品	800	2,024.00	1,619,200	
エービーシー・マート	1,500	6,270.00	9,405,000	
ハードオフコーポレーション	400	876.00	350,400	

アスクル	900	2,949.00	2,654,100
ゲオホールディングス	1,500	1,767.00	2,650,500
アダストリア	1,400	2,025.00	2,835,000
ジーフット	600	744.00	446,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	100	727.00	72,700
くらコーポレーション	600	6,560.00	3,936,000
キャンドウ	500	1,678.00	839,000
パルグループホールディングス	500	2,884.00	1,442,000
エディオン	4,100	1,218.00	4,993,800
サーラコーポレーション	2,000	629.00	1,258,000
ワッツ	300	793.00	237,900
ハローズ	400	2,508.00	1,003,200
あみやき亭	200	3,905.00	781,000
ひらまつ	1,900	355.00	674,500
大黒天物産	200	4,415.00	883,000
ハニーズホールディングス	900	868.00	781,200
ファーマライズホールディングス	200	593.00	118,600
アルペン	700	1,872.00	1,310,400
ハブ	300	1,067.00	320,100
クオールホールディングス	1,400	1,979.00	2,770,600
ジーンズ	700	6,680.00	4,676,000
ビックカメラ	5,200	1,669.00	8,678,800
D C Mホールディングス	5,300	1,103.00	5,845,900
ペッパーフードサービス	800	3,955.00	3,164,000
Monotaro	6,200	3,150.00	19,530,000
東京一番フーズ	200	628.00	125,600
DDホールディングス	200	2,357.00	471,400
きちり	300	802.00	240,600
アークランドサービスホールディングス	700	2,429.00	1,700,300
J . フロント リテイリング	12,500	1,478.00	18,475,000
ドトール・日レスホールディングス	1,700	2,225.00	3,782,500
マツモトキヨシホールディングス	4,000	3,995.00	15,980,000
ブロンコビリー	500	3,005.00	1,502,500
Z O Z O	10,600	2,391.00	25,344,600
トレジャー・ファクトリー	300	737.00	221,100
物語コーポレーション	300	10,170.00	3,051,000

ココカラファイン	1,100	6,080.00	6,688,000	
三越伊勢丹ホールディングス	18,300	1,279.00	23,405,700	
H a m e e	200	1,886.00	377,200	
ウエルシアホールディングス	2,600	5,780.00	15,028,000	
クリエイトSDホールディングス	1,400	3,025.00	4,235,000	
丸善CHIホールディングス	1,100	348.00	382,800	
ミサワ	200	490.00	98,000	
ティーライフ	100	1,074.00	107,400	
エー・ピーカンパニー	200	524.00	104,800	
チムニー	300	2,733.00	819,900	
シュッピン	700	1,011.00	707,700	
ネクステージ	1,500	1,193.00	1,789,500	
ジョイフル本田	2,900	1,593.00	4,619,700	
鳥貴族	300	1,983.00	594,900	
キリン堂ホールディングス	400	1,582.00	632,800	
ホットランド	500	1,402.00	701,000	
すかいらーくホールディングス	9,100	1,949.00	17,735,900	
綿半ホールディングス	400	2,570.00	1,028,000	
ヨシックス	200	2,907.00	581,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,800	1,264.00	3,539,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	769.00	307,600	
B E E N O S	200	1,463.00	292,600	
あさひ	800	1,451.00	1,160,800	
日本調剤	300	3,490.00	1,047,000	
コスモス薬品	500	21,620.00	10,810,000	
トーエル	500	752.00	376,000	
一六堂	200	512.00	102,400	
オンリー	200	1,046.00	209,200	
セブン&アイ・ホールディングス	40,900	4,867.00	199,060,300	
薬王堂	400	3,140.00	1,256,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,600	1,284.00	3,338,400	
ツルハホールディングス	2,100	10,990.00	23,079,000	
サンマルクホールディングス	800	2,712.00	2,169,600	
フェリシモ	200	1,194.00	238,800	
トリドールホールディングス	1,200	2,147.00	2,576,400	



T O K Y O B A S E	900	697.00	627,300	
ウイルプラスホールディングス	100	933.00	93,300	
ジャパンミート	400	2,044.00	817,600	
サツドラホールディングス	200	1,899.00	379,800	
デファクトスタンダード	100	571.00	57,100	
ダイユー・リックホールディングス	500	1,095.00	547,500	
パロックジャパンリミテッド	800	980.00	784,000	
クスリのアオキホールディングス	800	8,090.00	6,472,000	
力の源ホールディングス	300	861.00	258,300	
スシログローバルホールディングス	1,100	6,660.00	7,326,000	
L I X I L ビバ	800	1,742.00	1,393,600	
メディカルシステムネットワーク	1,000	427.00	427,000	
はるやまホールディングス	500	867.00	433,500	
ノジマ	1,700	2,357.00	4,006,900	
カップ・クリエイト	1,400	1,445.00	2,023,000	
ライトオン	800	915.00	732,000	
ジーンズメイト	300	419.00	125,700	
良品計画	1,400	29,290.00	41,006,000	
三城ホールディングス	1,200	463.00	555,600	
アドヴァン	1,500	1,012.00	1,518,000	
アルビス	400	2,736.00	1,094,400	
コナカ	1,200	481.00	577,200	
ハウス オブ ローゼ	100	1,877.00	187,700	
G - 7ホールディングス	300	2,470.00	741,000	
イオン北海道	1,000	801.00	801,000	
コジマ	1,400	539.00	754,600	
ヒマラヤ	300	970.00	291,000	
コーナン商事	1,300	2,790.00	3,627,000	
エコス	400	2,256.00	902,400	
ワタミ	1,300	1,350.00	1,755,000	
マルシェ	300	793.00	237,900	
ドンキホーテホールディングス	6,300	6,980.00	43,974,000	
西松屋チェーン	2,100	985.00	2,068,500	
ゼンショーホールディングス	4,600	2,797.00	12,866,200	
幸楽苑ホールディングス	600	2,263.00	1,357,800	
ハークスレイ	200	1,061.00	212,200	

サイゼリヤ	1,600	2,019.00	3,230,400	
V Tホールディングス	3,300	453.00	1,494,900	
魚力	300	1,445.00	433,500	
ポブラ	300	610.00	183,000	
フジ・コーポレーション	200	1,959.00	391,800	
ユナイテッドアローズ	1,100	4,015.00	4,416,500	
ハイデイ日高	1,300	2,273.00	2,954,900	
京都きもの友禅	600	410.00	246,000	
コロワイド	3,200	2,592.00	8,294,400	
ピーシーデポコーポレーション	1,300	520.00	676,000	
壱番屋	700	4,540.00	3,178,000	
トップカルチャー	300	359.00	107,700	
P L A N T	200	1,022.00	204,400	
スギホールディングス	2,100	4,895.00	10,279,500	
ヴィア・ホールディングス	1,200	702.00	842,400	
スクロール	1,500	411.00	616,500	
ヨンドシーホールディングス	1,100	2,362.00	2,598,200	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,700	16,570.00	44,739,000	
木曽路	1,200	2,558.00	3,069,600	
S R Sホールディングス	1,100	1,005.00	1,105,500	
千趣会	1,800	289.00	520,200	
タカキュー	800	192.00	153,600	
ケーヨー	1,800	548.00	986,400	
上新電機	1,100	2,621.00	2,883,100	
日本瓦斯	1,800	4,155.00	7,479,000	
ロイヤルホールディングス	1,700	2,883.00	4,901,100	
東天紅	100	1,425.00	142,500	
いなげや	1,100	1,513.00	1,664,300	
島忠	2,200	2,985.00	6,567,000	
チヨダ	1,000	1,928.00	1,928,000	
ライフコーポレーション	700	2,545.00	1,781,500	
リンガーハット	1,200	2,392.00	2,870,400	
M r M a x H D	1,300	522.00	678,600	
テンアライド	900	410.00	369,000	
A O K Iホールディングス	2,000	1,353.00	2,706,000	
オークワ	1,400	1,138.00	1,593,200	

コメリ	1,500	2,634.00	3,951,000	
青山商事	1,900	2,820.00	5,358,000	
しまむら	1,100	9,330.00	10,263,000	
はせがわ	500	449.00	224,500	
高島屋	7,700	1,551.00	11,942,700	
松屋	2,000	1,233.00	2,466,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,000	1,780.00	8,900,000	
近鉄百貨店	400	3,655.00	1,462,000	
パルコ	900	1,242.00	1,117,800	
丸井グループ	8,300	2,292.00	19,023,600	
アクシアル リテイリング	800	3,900.00	3,120,000	
井筒屋	500	222.00	111,000	
イオン	37,600	2,641.50	99,320,400	
イズミ	2,000	5,880.00	11,760,000	
平和堂	2,000	2,948.00	5,896,000	
フジ	1,200	1,993.00	2,391,600	
ヤオコー	1,100	6,320.00	6,952,000	
ゼビオホールディングス	1,200	1,398.00	1,677,600	
ケーズホールディングス	10,100	1,136.00	11,473,600	
Olympicグループ	600	769.00	461,400	
日産東京販売ホールディングス	1,400	323.00	452,200	
Genky DrugStores	400	3,600.00	1,440,000	
総合メディカルホールディングス	800	2,408.00	1,926,400	
ブックオフグループホールディングス	500	790.00	395,000	
アインホールディングス	1,300	8,320.00	10,816,000	
元気寿司	300	4,770.00	1,431,000	
ヤマダ電機	29,700	533.00	15,830,100	
アークランドサカモト	1,700	1,404.00	2,386,800	
ニトリホールディングス	4,200	14,490.00	60,858,000	
グルメ杵屋	700	1,185.00	829,500	
愛眼	800	312.00	249,600	
ケーユーホールディングス	500	854.00	427,000	
吉野家ホールディングス	3,400	1,903.00	6,470,200	
松屋フーズホールディングス	500	3,760.00	1,880,000	
サガミホールディングス	1,300	1,347.00	1,751,100	
関西スーパーマーケット	700	1,021.00	714,700	

王将フードサービス	700	7,570.00	5,299,000	
プレナス	1,100	1,894.00	2,083,400	
ミニストップ	700	2,030.00	1,421,000	
アークス	1,800	2,644.00	4,759,200	
パローホールディングス	2,100	2,756.00	5,787,600	
藤久	100	822.00	82,200	
ベルク	500	5,780.00	2,890,000	
大庄	500	1,642.00	821,000	
ファーストリテイリング	1,300	57,550.00	74,815,000	
サンドラッグ	3,700	3,740.00	13,838,000	
サックスパー ホールディングス	800	1,156.00	924,800	
ヤマザワ	200	1,754.00	350,800	
やまや	200	2,459.00	491,800	
ベルーナ	2,400	1,073.00	2,575,200	
島根銀行	200	820.00	164,000	
じもとホールディングス	6,600	139.00	917,400	
めぶきフィナンシャルグループ	50,800	322.00	16,357,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,300	1,826.00	2,373,800	
九州フィナンシャルグループ	16,000	484.00	7,744,000	
ゆうちょ銀行	27,700	1,261.00	34,929,700	
富山第一銀行	2,300	413.00	949,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	62,300	475.00	29,592,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	6,300	1,100.00	6,930,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	4,700	818.00	3,844,600	
三十三フィナンシャルグループ	800	1,883.00	1,506,400	
第四北越フィナンシャルグループ	1,700	3,375.00	5,737,500	
新生銀行	7,200	1,496.00	10,771,200	
あおぞら銀行	5,500	3,565.00	19,607,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	680,500	596.50	405,918,250	
りそなホールディングス	107,700	561.20	60,441,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	19,200	4,233.00	81,273,600	
三井住友フィナンシャルグループ	68,900	3,962.00	272,981,800	
千葉銀行	34,600	647.00	22,386,200	
群馬銀行	19,600	487.00	9,545,200	
武蔵野銀行	1,500	2,783.00	4,174,500	
千葉興業銀行	2,700	414.00	1,117,800	

筑波銀行	4,100	222.00	910,200	
七十七銀行	3,100	2,090.00	6,479,000	
青森銀行	800	2,933.00	2,346,400	
秋田銀行	600	2,247.00	1,348,200	
山形銀行	1,100	2,219.00	2,440,900	
岩手銀行	700	3,915.00	2,740,500	
東邦銀行	8,700	342.00	2,975,400	
東北銀行	500	1,236.00	618,000	
みちのく銀行	600	1,774.00	1,064,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	7,900	2,447.00	19,331,300	
静岡銀行	24,600	942.00	23,173,200	
十六銀行	1,300	2,515.00	3,269,500	
スルガ銀行	9,900	495.00	4,900,500	
八十二銀行	17,700	484.00	8,566,800	
山梨中央銀行	1,200	1,543.00	1,851,600	
大垣共立銀行	1,500	2,374.00	3,561,000	
福井銀行	800	1,795.00	1,436,000	
北國銀行	1,000	3,915.00	3,915,000	
清水銀行	400	1,774.00	709,600	
富山銀行	200	3,575.00	715,000	
滋賀銀行	2,000	2,717.00	5,434,000	
南都銀行	1,100	2,383.00	2,621,300	
百五銀行	8,800	413.00	3,634,400	
京都銀行	3,500	5,040.00	17,640,000	
紀陽銀行	3,500	1,614.00	5,649,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	6,500	1,362.00	8,853,000	
広島銀行	14,400	637.00	9,172,800	
山陰合同銀行	5,800	837.00	4,854,600	
中国銀行	6,300	1,010.00	6,363,000	
鳥取銀行	300	1,504.00	451,200	
伊予銀行	13,000	631.00	8,203,000	
百十四銀行	1,000	2,692.00	2,692,000	
四国銀行	1,400	1,339.00	1,874,600	
阿波銀行	1,600	2,941.00	4,705,600	
大分銀行	600	3,540.00	2,124,000	
宮崎銀行	600	3,005.00	1,803,000	

佐賀銀行	600	1,944.00	1,166,400	
十八銀行	600	2,694.00	1,616,400	
沖縄銀行	900	3,485.00	3,136,500	
琉球銀行	2,300	1,177.00	2,707,100	
セブン銀行	33,000	338.00	11,154,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,328,700	181.00	240,494,700	
高知銀行	400	866.00	346,400	
山口フィナンシャルグループ	12,200	1,136.00	13,859,200	
長野銀行	300	1,673.00	501,900	
名古屋銀行	800	3,495.00	2,796,000	
北洋銀行	14,700	306.00	4,498,200	
愛知銀行	400	4,195.00	1,678,000	
中京銀行	400	2,285.00	914,000	
大光銀行	300	1,992.00	597,600	
愛媛銀行	1,400	1,104.00	1,545,600	
トマト銀行	400	1,227.00	490,800	
京葉銀行	4,300	737.00	3,169,100	
栃木銀行	5,100	270.00	1,377,000	
北日本銀行	300	2,322.00	696,600	
東和銀行	1,700	837.00	1,422,900	
福島銀行	800	495.00	396,000	
大東銀行	500	765.00	382,500	
トモニホールディングス	7,600	452.00	3,435,200	
フィデアホールディングス	9,500	146.00	1,387,000	
池田泉州ホールディングス	10,400	324.00	3,369,600	
F P G	3,100	1,120.00	3,472,000	
マーキュリアインベストメント	400	813.00	325,200	
S B Iホールディングス	11,600	2,466.00	28,605,600	
日本アジア投資	800	243.00	194,400	
ジャフコ	1,600	3,910.00	6,256,000	
大和証券グループ本社	78,500	601.80	47,241,300	
野村ホールディングス	179,400	455.40	81,698,760	
岡三証券グループ	8,300	522.00	4,332,600	
丸三証券	2,900	853.00	2,473,700	
東洋証券	3,500	192.00	672,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11,700	519.00	6,072,300	

光世証券	200	916.00	183,200	
水戸証券	2,800	299.00	837,200	
いちよし証券	2,100	903.00	1,896,300	
松井証券	4,800	1,248.00	5,990,400	
だいこう証券ビジネス	400	476.00	190,400	
マネックスグループ	9,100	384.00	3,494,400	
カブドットコム証券	7,300	397.00	2,898,100	
極東証券	1,300	1,264.00	1,643,200	
岩井コスモホールディングス	1,000	1,306.00	1,306,000	
藍澤証券	1,800	746.00	1,342,800	
マネーパートナーズグループ	1,100	310.00	341,000	
小林洋行	300	267.00	80,100	
かんぽ生命保険	3,700	2,673.00	9,890,100	
S O M P Oホールディングス	19,200	4,136.00	79,411,200	
アニコム ホールディングス	800	3,430.00	2,744,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	25,600	3,307.00	84,659,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,000	2,244.00	17,952,000	
第一生命ホールディングス	55,300	1,868.00	103,300,400	
東京海上ホールディングス	35,400	5,475.00	193,815,000	
T & Dホールディングス	30,200	1,494.00	45,118,800	
アドバンスクリエイト	200	2,003.00	400,600	
全国保証	2,800	3,840.00	10,752,000	
ジェイリース	200	464.00	92,800	
イントラスト	300	390.00	117,000	
日本モーゲージサービス	100	876.00	87,600	
C a s a	300	1,159.00	347,700	
アルヒ	900	1,952.00	1,756,800	
クレディセゾン	6,800	1,368.00	9,302,400	
アクリーティブ	100	412.00	41,200	
芙蓉総合リース	1,100	5,880.00	6,468,000	
興銀リース	1,800	2,606.00	4,690,800	
東京センチュリー	2,000	4,975.00	9,950,000	
日本証券金融	4,300	643.00	2,764,900	
アイフル	14,900	304.00	4,529,600	
リコーリース	800	3,440.00	2,752,000	

イオンフィナンシャルサービス	6,200	2,099.00	13,013,800	
アコム	19,700	402.00	7,919,400	
ジャックス	1,100	1,908.00	2,098,800	
オリエントコーポレーション	26,400	159.00	4,197,600	
日立キャピタル	2,300	2,525.00	5,807,500	
アプラスフィナンシャル	4,700	98.00	460,600	
オリックス	65,200	1,739.50	113,415,400	
三菱UFJリース	22,100	579.00	12,795,900	
九州リースサービス	500	658.00	329,000	
日本取引所グループ	26,400	1,893.00	49,975,200	
イー・ギャランティ	900	1,041.00	936,900	
アサックス	400	577.00	230,800	
NECキャピタルソリューション	400	1,601.00	640,400	
いちご	12,400	357.00	4,426,800	
日本駐車場開発	11,800	153.00	1,805,400	
ヒューリック	20,400	1,035.00	21,114,000	
三栄建築設計	400	1,555.00	622,000	
スター・マイカ	400	1,666.00	666,400	
野村不動産ホールディングス	6,500	2,167.00	14,085,500	
三重交通グループホールディングス	2,000	592.00	1,184,000	
サムティ	1,300	1,328.00	1,726,400	
ディア・ライフ	1,300	482.00	626,600	
コーセーアールイー	300	872.00	261,600	
エー・ディー・ワークス	14,200	38.00	539,600	
日本商業開発	600	1,679.00	1,007,400	
プレサンスコーポレーション	1,500	1,486.00	2,229,000	
ユニゾホールディングス	1,500	2,189.00	3,283,500	
THEグローバル社	500	575.00	287,500	
日本管理センター	600	986.00	591,600	
サンセイランディック	300	967.00	290,100	
エストラスト	100	772.00	77,200	
フージャースホールディングス	2,200	639.00	1,405,800	
オープンハウス	1,600	4,030.00	6,448,000	
東急不動産ホールディングス	26,300	603.00	15,858,900	
飯田グループホールディングス	8,200	2,022.00	16,580,400	
イーランド	100	715.00	71,500	



ムゲンエステート	700	689.00	482,300
ビーロット	100	1,261.00	126,100
ファーストブラザーズ	300	1,205.00	361,500
ハウストゥ	400	1,194.00	477,600
シーアールイー	300	1,010.00	303,000
プロパティエージェント	100	917.00	91,700
ケイアイスター不動産	300	1,702.00	510,600
アグレ都市デザイン	100	618.00	61,800
グッドコムアセット	200	1,514.00	302,800
ジェイ・エス・ビー	100	4,405.00	440,500
テンポイノベーション	100	1,480.00	148,000
パーク24	5,700	2,981.00	16,991,700
バラカ	200	1,849.00	369,800
三井不動産	51,900	2,673.00	138,728,700
三菱地所	68,500	1,803.50	123,539,750
平和不動産	1,800	1,852.00	3,333,600
東京建物	10,700	1,261.00	13,492,700
ダイビル	2,900	1,199.00	3,477,100
京阪神ビルディング	1,700	827.00	1,405,900
住友不動産	22,000	4,189.00	92,158,000
大京	1,500	2,958.00	4,437,000
テオーシー	2,200	790.00	1,738,000
東京楽天地	100	4,775.00	477,500
レオパレス21	12,100	454.00	5,493,400
スターツコーポレーション	1,300	2,524.00	3,281,200
フジ住宅	1,200	867.00	1,040,400
空港施設	1,100	569.00	625,900
明和地所	500	607.00	303,500
ゴールドクレスト	800	1,643.00	1,314,400
日本エスリード	400	1,589.00	635,600
日神不動産	1,400	489.00	684,600
日本エスコン	1,800	667.00	1,200,600
タカラレーベン	4,600	330.00	1,518,000
サンヨーハウジング名古屋	500	1,000.00	500,000
イオンモール	4,900	1,903.00	9,324,700
ファースト住建	400	1,207.00	482,800

ランド	39,900	10.00	399,000	
カチタス	1,100	2,978.00	3,275,800	
トーセイ	1,300	959.00	1,246,700	
穴吹興産	100	2,961.00	296,100	
エヌ・ティ・ティ都市開発	6,100	1,679.00	10,241,900	
サンフロンティア不動産	1,400	1,129.00	1,580,600	
エフ・ジェー・ネクスト	900	880.00	792,000	
インテリックス	300	722.00	216,600	
ランドビジネス	500	599.00	299,500	
グランディハウス	900	403.00	362,700	
日本空港ビルデング	3,100	3,940.00	12,214,000	
日本工営	600	2,591.00	1,554,600	
L I F U L L	3,300	825.00	2,722,500	
ジェイエイシーリクルートメント	800	2,245.00	1,796,000	
日本M&Aセンター	7,100	2,693.00	19,120,300	
メンバーズ	300	998.00	299,400	
中広	100	648.00	64,800	
タケエイ	1,000	790.00	790,000	
E・Jホールディングス	100	1,144.00	114,400	
トラスト・テック	500	3,180.00	1,590,000	
コシダカホールディングス	2,500	1,438.00	3,595,000	
アルトナー	200	778.00	155,600	
パソナグループ	900	1,275.00	1,147,500	
C D S	200	1,334.00	266,800	
リンクアンドモチベーション	1,700	949.00	1,613,300	
G C A	1,000	771.00	771,000	
エス・エム・エス	3,500	1,757.00	6,149,500	
パーソルホールディングス	9,500	1,916.00	18,202,000	
リニカル	500	1,575.00	787,500	
クックパッド	3,000	381.00	1,143,000	
エスクリ	300	632.00	189,600	
アイ・ケイ・ケイ	500	715.00	357,500	
学情	400	1,503.00	601,200	
スタジオアリス	500	2,486.00	1,243,000	
シミックホールディングス	500	2,019.00	1,009,500	
N J S	200	1,689.00	337,800	

総合警備保障	3,800	5,210.00	19,798,000
カカクコム	7,100	2,182.00	15,492,200
アイロムグループ	400	1,945.00	778,000
セントケア・ホールディング	500	556.00	278,000
サイネックス	200	710.00	142,000
ルネサンス	500	2,299.00	1,149,500
ディップ	1,500	2,206.00	3,309,000
オプトホールディング	600	1,693.00	1,015,800
新日本科学	1,300	710.00	923,000
ツクイ	2,200	950.00	2,090,000
キャリアデザインセンター	200	1,161.00	232,200
エムスリー	19,900	1,646.00	32,755,400
ツカダ・グローバルホールディング	600	612.00	367,200
プラス	100	599.00	59,900
アウトソーシング	5,000	1,318.00	6,590,000
ウェルネット	1,000	1,079.00	1,079,000
ワールドホールディングス	300	2,608.00	782,400
ディー・エヌ・エー	5,100	2,041.00	10,409,100
博報堂D Yホールディングス	13,200	1,676.00	22,123,200
ぐるなび	1,300	792.00	1,029,600
エスアールジータカミヤ	1,000	741.00	741,000
ジャパンベストレスキューシステム	700	1,488.00	1,041,600
ファンコミュニケーションズ	2,600	698.00	1,814,800
ライク	400	1,551.00	620,400
ビジネス・ブレークスルー	400	350.00	140,000
WDBホールディングス	400	2,728.00	1,091,200
ティア	400	665.00	266,000
C D G	100	1,453.00	145,300
バリューコマース	600	1,524.00	914,400
インフォマート	5,200	1,135.00	5,902,000
J Pホールディングス	2,700	289.00	780,300
エコナックホールディングス	1,700	111.00	188,700
E P Sホールディングス	1,400	1,990.00	2,786,000
レグス	200	1,051.00	210,200
プレステージ・インターナショナル	1,800	1,337.00	2,406,600
アミューズ	600	2,553.00	1,531,800

ドリームインキュベータ	300	1,640.00	492,000
クイック	600	1,440.00	864,000
T A C	500	235.00	117,500
ケネディクス	8,800	537.00	4,725,600
電通	11,500	5,000.00	57,500,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	1,748.00	699,200
ぴあ	300	4,535.00	1,360,500
イオンファンタジー	300	3,080.00	924,000
シーティーエス	1,100	645.00	709,500
ネクシィーズグループ	300	1,827.00	548,100
みらかホールディングス	2,600	2,557.00	6,648,200
アルプス技研	800	1,889.00	1,511,200
サニックス	1,700	209.00	355,300
ダイオーズ	200	1,385.00	277,000
日本空調サービス	1,100	757.00	832,700
オリエンタルランド	11,200	10,860.00	121,632,000
ダスキン	2,500	2,500.00	6,250,000
明光ネットワークジャパン	1,200	978.00	1,173,600
ファルコホールディングス	500	1,608.00	804,000
秀英予備校	200	486.00	97,200
田谷	200	646.00	129,200
ラウンドワン	2,900	1,147.00	3,326,300
リゾートトラスト	4,000	1,682.00	6,728,000
ピー・エム・エル	1,200	2,914.00	3,496,800
ワタベウェディング	200	925.00	185,000
りらいあコミュニケーションズ	1,700	998.00	1,696,600
リソー教育	4,800	382.00	1,833,600
早稲田アカデミー	100	2,121.00	212,100
ユー・エス・エス	11,600	1,895.00	21,982,000
東京個別指導学院	300	1,291.00	387,300
サイバーエージェント	5,800	4,695.00	27,231,000
楽天	44,200	859.00	37,967,800
クリーク・アンド・リバー社	600	1,145.00	687,000
テー・オー・ダブリュー	900	785.00	706,500
セントラルスポーツ	400	3,620.00	1,448,000
フルキャストホールディングス	900	2,071.00	1,863,900

エン・ジャパン	1,000	4,210.00	4,210,000	
リソルホールディングス	100	4,005.00	400,500	
テクノプロ・ホールディングス	1,800	5,150.00	9,270,000	
アトラ	200	490.00	98,000	
インターワークス	200	737.00	147,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	300	1,417.00	425,100	
K e e P e r 技研	300	1,086.00	325,800	
ファーストロジック	200	724.00	144,800	
三機サービス	100	1,839.00	183,900	
G u n o s y	600	3,300.00	1,980,000	
デザインワン・ジャパン	200	388.00	77,600	
イー・ガーディアン	400	2,391.00	956,400	
リブセンス	500	310.00	155,000	
ジャパンマテリアル	2,600	1,108.00	2,880,800	
ベクトル	1,200	1,679.00	2,014,800	
ウチヤマホールディングス	500	465.00	232,500	
ライクキッズネクスト	200	1,228.00	245,600	
キャリアリンク	300	409.00	122,700	
I B J	600	740.00	444,000	
アサンテ	400	2,129.00	851,600	
N・フィールド	600	1,001.00	600,600	
バリューHR	200	2,033.00	406,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	200	3,915.00	783,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	400	1,502.00	600,800	
E R Iホールディングス	300	872.00	261,600	
アビスト	100	3,330.00	333,000	
シグマクシス	400	918.00	367,200	
ウィルグループ	600	1,065.00	639,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,300	403.00	523,900	
日本ビューホテル	300	1,200.00	360,000	
リクルートホールディングス	67,900	2,995.00	203,360,500	
エラン	300	2,841.00	852,300	
土木管理総合試験所	400	574.00	229,600	
日本郵政	77,600	1,313.00	101,888,800	
ベルシステム24ホールディングス	1,600	1,455.00	2,328,000	
鎌倉新書	700	1,154.00	807,800	

一蔵	100	673.00	67,300	
LITALICO	200	1,924.00	384,800	
グローバルグループ	100	1,079.00	107,900	
エボラブルアジア	300	2,081.00	624,300	
アトラエ	200	2,564.00	512,800	
ストライク	200	2,659.00	531,800	
ソラスト	2,300	1,341.00	3,084,300	
セラク	200	632.00	126,400	
インソース	300	2,301.00	690,300	
アイモパイル	200	767.00	153,400	
キャリアインデックス	300	1,720.00	516,000	
MS - Japan	400	1,440.00	576,000	
船場	200	982.00	196,400	
グレイステクノロジー	300	2,172.00	651,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	600	1,799.00	1,079,400	
フルテック	100	1,135.00	113,500	
グリーンズ	200	1,480.00	296,000	
ツナグ・ソリューションズ	100	660.00	66,000	
日総工産	200	1,830.00	366,000	
キュービーネットホールディングス	500	2,172.00	1,086,000	
スプリックス	300	1,975.00	592,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	1,113.00	445,200	
リログループ	5,200	3,010.00	15,652,000	
東祥	600	4,045.00	2,427,000	
エイチ・アイ・エス	1,700	3,725.00	6,332,500	
ラックランド	200	2,787.00	557,400	
共立メンテナンス	1,400	5,270.00	7,378,000	
イチネンホールディングス	1,000	1,329.00	1,329,000	
建設技術研究所	600	1,440.00	864,000	
スペース	600	1,173.00	703,800	
長大	400	810.00	324,000	
燦ホールディングス	200	2,406.00	481,200	
スバル興業	100	5,500.00	550,000	
東京テアトル	400	1,322.00	528,800	
タナベ経営	200	1,533.00	306,600	

ナガワ	300	5,760.00	1,728,000	
よみうりランド	200	4,065.00	813,000	
東京都競馬	600	3,120.00	1,872,000	
常磐興産	400	1,660.00	664,000	
カナモト	1,400	3,170.00	4,438,000	
東京ドーム	3,500	1,023.00	3,580,500	
西尾レントオール	1,000	3,845.00	3,845,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	5,200	28.00	145,600	
トランス・コスモス	1,100	2,574.00	2,831,400	
乃村工藝社	2,200	3,015.00	6,633,000	
藤田観光	400	3,030.00	1,212,000	
KNT-CTホールディングス	500	1,176.00	588,000	
日本管財	1,000	2,056.00	2,056,000	
トーカイ	900	2,631.00	2,367,900	
白洋舎	100	2,989.00	298,900	
セコム	10,100	9,394.00	94,879,400	
セントラル警備保障	500	5,670.00	2,835,000	
丹青社	1,800	1,218.00	2,192,400	
メイテック	1,200	4,755.00	5,706,000	
応用地質	1,000	1,305.00	1,305,000	
船井総研ホールディングス	2,000	1,826.00	3,652,000	
進学会ホールディングス	400	632.00	252,800	
オオバ	700	700.00	490,000	
いであ	200	1,066.00	213,200	
学究社	300	1,599.00	479,700	
ベネッセホールディングス	3,500	3,240.00	11,340,000	
イオンディライト	1,200	3,975.00	4,770,000	
ナック	600	1,037.00	622,200	
ニチイ学館	1,300	1,096.00	1,424,800	
ダイセキ	1,600	2,393.00	3,828,800	
ステップ	300	1,396.00	418,800	
合 計	11,432,300		22,316,880,680	

## (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。

## RAM先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2018年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	36,791,527
コール・ローン	13,932,407
国債証券	32,811,072,696
未収利息	175,021,603
前払費用	53,626,132
流動資産合計	33,090,444,365
<b>資産合計</b>	<b>33,090,444,365</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	2,000,000
未払利息	37
その他未払費用	865
流動負債合計	2,000,902
<b>負債合計</b>	<b>2,000,902</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	34,054,275,259
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	965,831,796
元本等合計	33,088,443,463
<b>純資産合計</b>	<b>33,088,443,463</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>33,090,444,365</b>

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）



	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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	19,107,771,611円
期中追加設定元本額	22,453,618,843円
期中一部解約元本額	7,507,115,195円
期末元本額	34,054,275,259円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,390,380,241円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	9,941,149,211円
りそなラップ型ファンド(成長型)	146,843,952円
DCりそな グローバルバランス	34,853,415円
つみたてバランスファンド	68,851,237円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	32,185,334円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	4,030,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	1,265,416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)	20,380,613,605円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	12,872,180円
Smart-i 8資産バランス 安定型	7,595,288円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	10,575,547円
Smart-i 8資産バランス 成長型	7,230,887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)	398,784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)	15,429,184円
2. 計算日における受益権の総数	34,054,275,259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	965,831,796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	0.9716円

(10,000口当たり純資産額)

(9,716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

2018年12月10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、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。

## 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

2018年12月10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。

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)

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		886,791
合計		886,791

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	380,000.00	375,539.44	
		US TREASURY N/B	310,000.00	304,908.00	
		US TREASURY N/B	510,000.00	505,328.29	
		US TREASURY N/B	300,000.00	295,986.30	
		US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,543,904.86	

US TREASURY N/B	320,000.00	317,206.24	
US TREASURY N/B	330,000.00	325,211.10	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,150,576.12	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,562.50	
US TREASURY N/B	530,000.00	521,656.63	
US TREASURY N/B	530,000.00	535,320.67	
US TREASURY N/B	550,000.00	541,073.22	
US TREASURY N/B	330,000.00	328,105.07	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,538,671.83	
US TREASURY N/B	590,000.00	577,992.55	
US TREASURY N/B	400,000.00	397,593.72	
US TREASURY N/B	530,000.00	521,480.62	
US TREASURY N/B	600,000.00	589,019.52	
US TREASURY N/B	650,000.00	646,915.03	
US TREASURY N/B	380,000.00	384,104.26	
US TREASURY N/B	370,000.00	363,662.27	
US TREASURY N/B	550,000.00	539,300.74	
US TREASURY N/B	500,000.00	498,349.60	
US TREASURY N/B	330,000.00	324,044.52	
US TREASURY N/B	580,000.00	570,348.37	
US TREASURY N/B	600,000.00	597,902.34	
US TREASURY N/B	250,000.00	245,214.82	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,709,278.01	
US TREASURY N/B	380,000.00	379,339.44	
US TREASURY N/B	450,000.00	449,208.94	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,568,249.92	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,071,968.64	
US TREASURY N/B	410,000.00	400,670.86	
US TREASURY N/B	780,000.00	761,535.91	
US TREASURY N/B	360,000.00	360,140.61	
US TREASURY N/B	400,000.00	392,117.16	
US TREASURY N/B	340,000.00	333,897.23	
US TREASURY N/B	430,000.00	419,317.16	
US TREASURY N/B	510,000.00	511,394.49	
US TREASURY N/B	580,000.00	578,935.12	

US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,443,155.15	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,892.55	
US TREASURY N/B	680,000.00	665,828.86	
US TREASURY N/B	740,000.00	740,578.08	
US TREASURY N/B	400,000.00	393,546.84	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,569,749.92	
US TREASURY N/B	250,000.00	246,362.30	
US TREASURY N/B	640,000.00	622,212.48	
US TREASURY N/B	430,000.00	438,314.43	
US TREASURY N/B	460,000.00	455,400.00	
US TREASURY N/B	650,000.00	627,795.87	
US TREASURY N/B	480,000.00	476,512.45	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,113,096.61	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,941.38	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,703.11	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,260,035.14	
US TREASURY N/B	280,000.00	277,128.88	
US TREASURY N/B	580,000.00	585,664.04	
US TREASURY N/B	490,000.00	488,851.53	
US TREASURY N/B	480,000.00	471,806.20	
US TREASURY N/B	560,000.00	542,084.36	
US TREASURY N/B	420,000.00	419,081.25	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,297,845.58	
US TREASURY N/B	350,000.00	349,159.16	
US TREASURY N/B	680,000.00	652,494.47	
US TREASURY N/B	550,000.00	541,599.57	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,291,032.90	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,265,214.72	
US TREASURY N/B	210,000.00	210,168.14	
US TREASURY N/B	500,000.00	478,691.60	
US TREASURY N/B	600,000.00	590,449.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	502,099.60	
US TREASURY N/B	560,000.00	537,282.76	
US TREASURY N/B	710,000.00	695,938.66	
US TREASURY N/B	340,000.00	341,540.60	

US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,138,076.31	
US TREASURY N/B	360,000.00	351,597.63	
US TREASURY N/B	490,000.00	479,855.43	
US TREASURY N/B	950,000.00	915,247.00	
US TREASURY N/B	490,000.00	477,587.26	
US TREASURY N/B	470,000.00	459,865.62	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,183,852.62	
US TREASURY N/B	400,000.00	389,625.00	
US TREASURY N/B	290,000.00	281,198.03	
US TREASURY N/B	460,000.00	447,933.97	
US TREASURY N/B	370,000.00	358,473.61	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,167,328.08	
US TREASURY N/B	240,000.00	232,467.16	
US TREASURY N/B	510,000.00	495,885.34	
US TREASURY N/B	450,000.00	435,682.57	
US TREASURY N/B	390,000.00	382,253.31	
US TREASURY N/B	410,000.00	396,723.01	
US TREASURY N/B	360,000.00	351,077.32	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,194,229.01	
US TREASURY N/B	280,000.00	269,341.38	
US TREASURY N/B	390,000.00	378,399.02	
US TREASURY N/B	480,000.00	461,521.87	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,129,255.56	
US TREASURY N/B	350,000.00	339,452.12	
US TREASURY N/B	330,000.00	319,777.72	
US TREASURY N/B	410,000.00	399,229.46	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,084,424.72	
US TREASURY N/B	670,000.00	652,124.60	
US TREASURY N/B	720,000.00	703,673.42	
US TREASURY N/B	400,000.00	384,937.48	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,243,462.50	
US TREASURY N/B	650,000.00	631,667.92	
US TREASURY N/B	430,000.00	409,264.23	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,039.04	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,036,543.13	

US TREASURY N/B	390,000.00	386,709.37
US TREASURY N/B	380,000.00	362,966.76
US TREASURY N/B	450,000.00	450,791.01
US TREASURY N/B	580,000.00	556,777.32
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,212,081.01
US TREASURY N/B	400,000.00	400,906.24
US TREASURY N/B	310,000.00	292,314.25
US TREASURY N/B	450,000.00	448,453.12
US TREASURY N/B	490,000.00	458,877.30
US TREASURY N/B	500,000.00	500,947.25
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,248,088.96
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,128,750.47
US TREASURY N/B	360,000.00	360,836.71
US TREASURY N/B	540,000.00	507,410.35
US TREASURY N/B	480,000.00	483,478.08
US TREASURY N/B	320,000.00	304,068.73
US TREASURY N/B	500,000.00	503,818.35
US TREASURY N/B	710,000.00	711,248.03
US TREASURY N/B	340,000.00	330,616.78
US TREASURY N/B	490,000.00	479,089.80
US TREASURY N/B	680,000.00	664,580.44
US TREASURY N/B	590,000.00	590,760.51
US TREASURY N/B	490,000.00	475,711.49
US TREASURY N/B	290,000.00	281,379.28
US TREASURY N/B	790,000.00	761,331.61
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,354,293.08
US TREASURY N/B	330,000.00	317,850.55
US TREASURY N/B	390,000.00	375,359.75
US TREASURY N/B	380,000.00	367,983.98
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,069,221.87
US TREASURY N/B	400,000.00	382,203.12
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,064,056.62
US TREASURY N/B	340,000.00	330,962.08
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,429,948.23
US TREASURY N/B	300,000.00	289,787.10

US TREASURY N/B	400,000.00	388,992.16
US TREASURY N/B	430,000.00	423,969.89
US TREASURY N/B	590,000.00	564,694.48
US TREASURY N/B	400,000.00	399,968.72
US TREASURY N/B	830,000.00	823,791.18
US TREASURY N/B	320,000.00	322,256.22
US TREASURY N/B	910,000.00	875,946.07
US TREASURY N/B	440,000.00	443,016.37
US TREASURY N/B	890,000.00	889,530.61
US TREASURY N/B	850,000.00	855,910.13
US TREASURY N/B	790,000.00	753,153.84
US TREASURY N/B	910,000.00	909,164.62
US TREASURY N/B	430,000.00	436,483.58
US TREASURY N/B	570,000.00	578,616.74
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,305,624.01
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,415,787.79
US TREASURY N/B	800,000.00	738,124.96
US TREASURY N/B	770,000.00	701,572.56
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,282,835.91
US TREASURY N/B	740,000.00	709,879.63
US TREASURY N/B	780,000.00	754,817.54
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,414,642.90
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,431,181.50
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,220,798.97
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,082,299.21
US TREASURY N/B	120,000.00	146,646.07
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,302,488.20
US TREASURY N/B	500,000.00	511,826.15
US TREASURY N/B	310,000.00	374,779.08
US TREASURY N/B	120,000.00	159,203.90
US TREASURY N/B	170,000.00	213,200.57
US TREASURY N/B	200,000.00	242,375.00
US TREASURY N/B	130,000.00	156,441.79
US TREASURY N/B	230,000.00	281,148.04
US TREASURY N/B	670,000.00	719,111.46



US TREASURY N/B	100,000.00	118,525.39	
US TREASURY N/B	190,000.00	232,490.23	
US TREASURY N/B	200,000.00	240,863.28	
US TREASURY N/B	260,000.00	323,491.79	
US TREASURY N/B	190,000.00	229,090.99	
US TREASURY N/B	550,000.00	619,673.78	
US TREASURY N/B	180,000.00	213,542.56	
US TREASURY N/B	430,000.00	545,310.52	
US TREASURY N/B	190,000.00	229,454.67	
US TREASURY N/B	230,000.00	254,415.02	
US TREASURY N/B	130,000.00	130,449.41	
US TREASURY N/B	180,000.00	180,446.47	
US TREASURY N/B	480,000.00	470,465.61	
US TREASURY N/B	300,000.00	281,027.34	
US TREASURY N/B	670,000.00	626,777.09	
US TREASURY N/B	590,000.00	589,078.12	
US TREASURY N/B	540,000.00	515,889.81	
US TREASURY N/B	380,000.00	411,921.48	
US TREASURY N/B	770,000.00	851,586.89	
US TREASURY N/B	740,000.00	802,480.78	
US TREASURY N/B	640,000.00	666,549.95	
US TREASURY N/B	760,000.00	758,322.60	
US TREASURY N/B	790,000.00	770,620.27	
US TREASURY N/B	680,000.00	601,587.50	
US TREASURY N/B	790,000.00	770,219.11	
US TREASURY N/B	780,000.00	741,822.58	
US TREASURY N/B	460,000.00	448,212.50	
US TREASURY N/B	800,000.00	704,937.44	
US TREASURY N/B	660,000.00	581,031.99	
US TREASURY N/B	730,000.00	608,637.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	664,972.63	
US TREASURY N/B	970,000.00	944,120.68	
US TREASURY N/B	480,000.00	466,903.10	
US TREASURY N/B	500,000.00	462,314.45	
US TREASURY N/B	670,000.00	619,265.79	

	US TREASURY N/B	600,000.00	582,773.40
	US TREASURY N/B	830,000.00	826,157.93
	US TREASURY N/B	800,000.00	777,453.10
	US TREASURY N/B	450,000.00	470,179.66
	米ドル 小計	136,510,000.00	134,182,365.82 (15,098,199,802)
カナダドル	GOV OF CANADA	360,000.00	357,310.80
	GOV OF CANADA	360,000.00	358,113.60
	GOV OF CANADA	300,000.00	299,208.00
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,813.10
	GOV OF CANADA	140,000.00	139,473.60
	GOV OF CANADA	450,000.00	440,671.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	120,006.00
	GOV OF CANADA	500,000.00	486,415.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	113,278.00
	GOV OF CANADA	490,000.00	473,795.70
	GOV OF CANADA	280,000.00	266,912.80
	GOV OF CANADA	150,000.00	153,724.50
	GOV OF CANADA	310,000.00	298,926.80
	GOV OF CANADA	240,000.00	237,566.40
	GOV OF CANADA	270,000.00	264,219.30
	GOV OF CANADA	230,000.00	229,965.50
	GOV OF CANADA	40,000.00	40,455.60
	GOV OF CANADA	260,000.00	266,341.40
	GOV OF CANADA	230,000.00	232,978.50
	GOV OF CANADA	200,000.00	192,382.00
	GOV OF CANADA	310,000.00	284,511.80
	GOV OF CANADA	60,000.00	87,571.80
	GOV OF CANADA	210,000.00	208,666.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	160,917.60
	GOV OF CANADA	210,000.00	213,156.30
	GOV OF CANADA	200,000.00	288,958.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	283,886.00
	GOV OF CANADA	250,000.00	327,145.00
	GOV OF CANADA	270,000.00	338,604.30

	GOV OF CANADA	260,000.00	289,536.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	85,341.60
	GOV OF CANADA	90,000.00	104,477.40
	カナダドル 小計	7,480,000.00	7,818,330.40 (660,805,285)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,270,000.00	3,154,143.90
	UNITED MEXICAN STATE	4,790,000.00	4,740,303.75
	UNITED MEXICAN STATE	4,550,000.00	4,325,685.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,630,000.00	1,563,263.56
	UNITED MEXICAN STATE	4,890,000.00	4,545,010.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,720,000.00	3,585,503.40
	UNITED MEXICAN STATE	4,310,000.00	4,519,789.25
	UNITED MEXICAN STATE	2,600,000.00	2,152,046.00
	UNITED MEXICAN STATE	5,200,000.00	4,724,434.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,733,753.75
	UNITED MEXICAN STATE	2,150,000.00	1,906,996.25
	UNITED MEXICAN STATE	1,460,000.00	1,262,213.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,510,000.00	1,584,322.20
	UNITED MEXICAN STATE	1,900,000.00	1,733,854.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,550,000.00	2,964,853.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,250,000.00	1,064,844.12
	メキシコペソ 小計	48,590,000.00	45,561,017.48 (252,863,647)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	270,000.00	289,484.28
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	244,508.00
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	113,671.18
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	171,902.04
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	218,056.73
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	171,272.45
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	174,896.00
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	208,330.44
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	192,669.84
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	213,545.60
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	196,205.02
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	211,492.89
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	194,458.55

GOV OF AUSTRIA	130,000.00	132,741.70	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	193,037.60	
GOV OF AUSTRIA	230,000.00	348,840.24	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	170,887.15	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	114,504.50	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	105,489.96	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	81,689.30	
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	38,086.96	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	291,066.75	
GOV OF BELGIUM	330,000.00	373,584.75	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	217,565.01	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	375,552.96	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	277,383.25	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	141,682.61	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	330,365.10	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	112,170.11	
GOV OF BELGIUM	300,000.00	310,552.83	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	207,477.92	
GOV OF BELGIUM	300,000.00	312,474.00	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	244,015.20	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	416,669.21	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	291,753.47	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	209,422.50	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	204,919.50	
GOV OF BELGIUM	60,000.00	60,697.26	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	124,696.94	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	526,409.08	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	90,162.09	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	118,069.05	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	438,216.11	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	231,958.40	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	184,490.00	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	96,872.04	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	72,215.50	
GOV OF FINLAND	60,000.00	63,200.88	

GOV OF FINLAND	150,000.00	152,417.63	
GOV OF FINLAND	100,000.00	109,399.37	
GOV OF FINLAND	110,000.00	111,253.45	
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,360.80	
GOV OF FINLAND	90,000.00	96,708.96	
GOV OF FINLAND	120,000.00	120,751.80	
GOV OF FINLAND	90,000.00	99,879.84	
GOV OF FINLAND	80,000.00	100,365.68	
GOV OF FINLAND	110,000.00	115,389.78	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,125.06	
GOV OF FINLAND	110,000.00	110,694.10	
GOV OF FINLAND	90,000.00	108,993.60	
GOV OF FINLAND	20,000.00	19,918.20	
GOV OF FINLAND	70,000.00	70,066.57	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,987.86	
GOV OF FINLAND	80,000.00	106,885.65	
GOV OF FINLAND	50,000.00	52,715.25	
GOV OF FRANCE	630,000.00	634,463.22	
GOV OF FRANCE	400,000.00	422,470.80	
GOV OF FRANCE	310,000.00	312,614.94	
GOV OF FRANCE	770,000.00	814,358.93	
GOV OF FRANCE	600,000.00	609,273.60	
GOV OF FRANCE	520,000.00	525,325.84	
GOV OF FRANCE	420,000.00	462,351.54	
GOV OF FRANCE	680,000.00	687,477.38	
GOV OF FRANCE	680,000.00	752,082.72	
GOV OF FRANCE	650,000.00	723,534.50	
GOV OF FRANCE	720,000.00	727,487.70	
GOV OF FRANCE	430,000.00	471,813.20	
GOV OF FRANCE	600,000.00	603,942.00	
GOV OF FRANCE	830,000.00	900,759.16	
GOV OF FRANCE	640,000.00	776,639.36	
GOV OF FRANCE	390,000.00	389,747.92	
GOV OF FRANCE	560,000.00	629,065.92	
GOV OF FRANCE	640,000.00	703,632.00	

GOV OF FRANCE	920,000.00	940,036.12	
GOV OF FRANCE	340,000.00	474,650.20	
GOV OF FRANCE	460,000.00	484,144.80	
GOV OF FRANCE	530,000.00	655,712.29	
GOV OF FRANCE	700,000.00	709,538.82	
GOV OF FRANCE	520,000.00	513,972.16	
GOV OF FRANCE	690,000.00	719,933.58	
GOV OF FRANCE	520,000.00	621,860.09	
GOV OF FRANCE	570,000.00	576,773.88	
GOV OF FRANCE	380,000.00	382,415.66	
GOV OF FRANCE	560,000.00	831,971.94	
GOV OF FRANCE	620,000.00	734,524.39	
GOV OF FRANCE	850,000.00	908,722.25	
GOV OF FRANCE	550,000.00	894,104.20	
GOV OF FRANCE	200,000.00	204,074.55	
GOV OF FRANCE	450,000.00	697,315.50	
GOV OF FRANCE	510,000.00	511,624.35	
GOV OF FRANCE	430,000.00	637,848.11	
GOV OF FRANCE	270,000.00	290,204.37	
GOV OF FRANCE	620,000.00	995,286.00	
GOV OF FRANCE	410,000.00	565,327.68	
GOV OF FRANCE	440,000.00	480,414.00	
GOV OF FRANCE	250,000.00	405,748.75	
GOV OF FRANCE	190,000.00	316,300.61	
GOV OF FRANCE	210,000.00	205,685.39	
GOV OF GERMANY	200,000.00	201,307.30	
GOV OF GERMANY	150,000.00	156,393.60	
GOV OF GERMANY	220,000.00	221,798.23	
GOV OF GERMANY	470,000.00	474,198.51	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,465.80	
GOV OF GERMANY	430,000.00	454,770.15	
GOV OF GERMANY	190,000.00	199,679.13	
GOV OF GERMANY	490,000.00	495,550.12	
GOV OF GERMANY	310,000.00	315,099.19	
GOV OF GERMANY	40,000.00	40,488.24	

GOV OF GERMANY	520,000.00	554,018.43	
GOV OF GERMANY	340,000.00	344,762.38	
GOV OF GERMANY	230,000.00	252,800.36	
GOV OF GERMANY	200,000.00	215,540.08	
GOV OF GERMANY	310,000.00	314,891.18	
GOV OF GERMANY	420,000.00	452,924.64	
GOV OF GERMANY	350,000.00	355,917.05	
GOV OF GERMANY	290,000.00	313,267.28	
GOV OF GERMANY	250,000.00	268,463.25	
GOV OF GERMANY	470,000.00	477,967.91	
GOV OF GERMANY	270,000.00	291,691.80	
GOV OF GERMANY	300,000.00	304,920.00	
GOV OF GERMANY	220,000.00	238,472.52	
GOV OF GERMANY	460,000.00	511,047.12	
GOV OF GERMANY	170,000.00	172,518.72	
GOV OF GERMANY	600,000.00	663,595.20	
GOV OF GERMANY	290,000.00	317,642.22	
GOV OF GERMANY	230,000.00	245,953.95	
GOV OF GERMANY	350,000.00	364,218.75	
GOV OF GERMANY	420,000.00	451,102.26	
GOV OF GERMANY	460,000.00	478,003.94	
GOV OF GERMANY	470,000.00	469,490.52	
GOV OF GERMANY	520,000.00	527,583.68	
GOV OF GERMANY	140,000.00	216,951.18	
GOV OF GERMANY	420,000.00	433,492.50	
GOV OF GERMANY	170,000.00	254,266.36	
GOV OF GERMANY	490,000.00	503,777.33	
GOV OF GERMANY	130,000.00	186,182.75	
GOV OF GERMANY	400,000.00	399,860.81	
GOV OF GERMANY	210,000.00	346,632.51	
GOV OF GERMANY	250,000.00	402,111.50	
GOV OF GERMANY	360,000.00	586,576.80	
GOV OF GERMANY	380,000.00	598,527.05	
GOV OF GERMANY	230,000.00	386,426.45	
GOV OF GERMANY	280,000.00	506,573.17	

GOV OF GERMANY	240,000.00	368,480.40	
GOV OF GERMANY	450,000.00	623,039.40	
GOV OF GERMANY	460,000.00	646,053.90	
GOV OF GERMANY	200,000.00	218,903.80	
GOV OF IRELAND	170,000.00	181,555.54	
GOV OF IRELAND	120,000.00	132,310.96	
GOV OF IRELAND	120,000.00	123,873.12	
GOV OF IRELAND	80,000.00	80,217.28	
GOV OF IRELAND	110,000.00	128,588.68	
GOV OF IRELAND	150,000.00	175,431.90	
GOV OF IRELAND	170,000.00	222,446.70	
GOV OF IRELAND	240,000.00	247,184.92	
GOV OF IRELAND	100,000.00	100,029.70	
GOV OF IRELAND	190,000.00	216,085.21	
GOV OF IRELAND	20,000.00	20,314.36	
GOV OF IRELAND	60,000.00	59,284.50	
GOV OF IRELAND	90,000.00	92,134.71	
GOV OF IRELAND	150,000.00	158,237.40	
GOV OF ITALY	200,000.00	201,404.40	
GOV OF ITALY	330,000.00	345,136.44	
GOV OF ITALY	370,000.00	386,798.62	
GOV OF ITALY	230,000.00	230,428.26	
GOV OF ITALY	470,000.00	468,378.50	
GOV OF ITALY	550,000.00	580,487.60	
GOV OF ITALY	290,000.00	287,231.37	
GOV OF ITALY	180,000.00	179,595.00	
GOV OF ITALY	490,000.00	518,812.00	
GOV OF ITALY	450,000.00	439,168.27	
GOV OF ITALY	400,000.00	423,635.20	
GOV OF ITALY	230,000.00	226,294.70	
GOV OF ITALY	310,000.00	328,865.29	
GOV OF ITALY	420,000.00	457,140.18	
GOV OF ITALY	290,000.00	281,960.38	
GOV OF ITALY	350,000.00	356,845.05	
GOV OF ITALY	210,000.00	231,974.84	



GOV OF ITALY	420,000.00	413,749.14	
GOV OF ITALY	390,000.00	385,666.90	
GOV OF ITALY	440,000.00	426,100.84	
GOV OF ITALY	230,000.00	260,157.60	
GOV OF ITALY	320,000.00	315,564.48	
GOV OF ITALY	190,000.00	215,152.39	
GOV OF ITALY	380,000.00	363,686.98	
GOV OF ITALY	190,000.00	181,904.10	
GOV OF ITALY	390,000.00	429,652.66	
GOV OF ITALY	280,000.00	312,494.67	
GOV OF ITALY	300,000.00	303,293.10	
GOV OF ITALY	280,000.00	261,206.40	
GOV OF ITALY	460,000.00	507,727.76	
GOV OF ITALY	380,000.00	369,914.04	
GOV OF ITALY	480,000.00	511,945.44	
GOV OF ITALY	280,000.00	263,957.51	
GOV OF ITALY	420,000.00	420,576.28	
GOV OF ITALY	290,000.00	330,191.68	
GOV OF ITALY	210,000.00	195,567.54	
GOV OF ITALY	470,000.00	439,845.50	
GOV OF ITALY	70,000.00	69,008.52	
GOV OF ITALY	370,000.00	354,593.57	
GOV OF ITALY	390,000.00	434,094.96	
GOV OF ITALY	400,000.00	371,072.00	
GOV OF ITALY	530,000.00	474,921.44	
GOV OF ITALY	310,000.00	293,582.09	
GOV OF ITALY	430,000.00	401,286.75	
GOV OF ITALY	290,000.00	368,387.00	
GOV OF ITALY	510,000.00	473,033.16	
GOV OF ITALY	390,000.00	446,927.05	
GOV OF ITALY	180,000.00	175,295.70	
GOV OF ITALY	510,000.00	606,667.95	
GOV OF ITALY	400,000.00	410,484.75	
GOV OF ITALY	410,000.00	521,187.49	
GOV OF ITALY	400,000.00	333,752.00	

GOV OF ITALY	320,000.00	400,986.88	
GOV OF ITALY	400,000.00	358,768.00	
GOV OF ITALY	350,000.00	413,319.55	
GOV OF ITALY	370,000.00	315,405.76	
GOV OF ITALY	490,000.00	523,050.50	
GOV OF ITALY	200,000.00	182,165.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	485,157.10	
GOV OF ITALY	340,000.00	400,746.78	
GOV OF ITALY	340,000.00	393,422.16	
GOV OF ITALY	230,000.00	215,489.07	
GOV OF ITALY	260,000.00	222,399.58	
GOV OF ITALY	240,000.00	229,514.40	
GOV OF ITALY	90,000.00	74,664.00	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	262,714.92	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	277,356.30	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	318,864.57	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	375,317.64	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	186,422.34	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	292,502.25	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	295,232.20	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	302,119.06	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	268,094.30	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	243,219.84	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	246,060.24	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	301,124.11	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	323,209.48	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	196,183.60	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	274,691.34	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	448,728.60	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	451,106.60	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	346,619.04	
GOV OF SPAIN	370,000.00	377,502.44	
GOV OF SPAIN	510,000.00	540,729.58	
GOV OF SPAIN	330,000.00	337,650.06	
GOV OF SPAIN	230,000.00	251,826.49	

GOV OF SPAIN	400,000.00	401,308.80	
GOV OF SPAIN	280,000.00	317,436.78	
GOV OF SPAIN	520,000.00	531,290.76	
GOV OF SPAIN	330,000.00	390,100.26	
GOV OF SPAIN	410,000.00	414,402.58	
GOV OF SPAIN	300,000.00	303,084.90	
GOV OF SPAIN	340,000.00	411,970.00	
GOV OF SPAIN	260,000.00	259,347.40	
GOV OF SPAIN	330,000.00	392,540.33	
GOV OF SPAIN	370,000.00	449,766.03	
GOV OF SPAIN	390,000.00	455,671.78	
GOV OF SPAIN	270,000.00	301,887.83	
GOV OF SPAIN	550,000.00	577,582.50	
GOV OF SPAIN	350,000.00	435,313.22	
GOV OF SPAIN	260,000.00	281,161.92	
GOV OF SPAIN	370,000.00	393,660.94	
GOV OF SPAIN	400,000.00	540,705.63	
GOV OF SPAIN	370,000.00	374,693.08	
GOV OF SPAIN	320,000.00	326,265.60	
GOV OF SPAIN	350,000.00	354,062.10	
GOV OF SPAIN	410,000.00	410,589.99	
GOV OF SPAIN	310,000.00	308,633.94	
GOV OF SPAIN	320,000.00	428,648.00	
GOV OF SPAIN	490,000.00	698,673.36	
GOV OF SPAIN	340,000.00	349,781.80	
GOV OF SPAIN	320,000.00	472,293.28	
GOV OF SPAIN	270,000.00	282,576.49	
GOV OF SPAIN	380,000.00	498,253.01	
GOV OF SPAIN	340,000.00	488,777.83	
GOV OF SPAIN	310,000.00	436,266.72	
GOV OF SPAIN	250,000.00	376,065.25	
GOV OF SPAIN	300,000.00	319,278.90	
GOV OF SPAIN	130,000.00	131,358.56	
GOV OF SPAIN	180,000.00	203,800.14	
ゴロ小計	89,920,000.00	100,527,070.40	

英債券	UK TREASURY	200,000.00	209,880.00
	UK TREASURY	430,000.00	438,746.88
	UK TREASURY	430,000.00	452,363.99
	UK TREASURY	650,000.00	660,384.12
	UK TREASURY	320,000.00	345,989.76
	UK TREASURY	180,000.00	198,545.61
	UK TREASURY	470,000.00	465,252.71
	UK TREASURY	390,000.00	403,508.35
	UK TREASURY	490,000.00	487,232.38
	UK TREASURY	290,000.00	308,560.00
	UK TREASURY	70,000.00	70,225.40
	UK TREASURY	270,000.00	297,383.40
	UK TREASURY	250,000.00	311,100.00
	UK TREASURY	320,000.00	341,136.00
	UK TREASURY	310,000.00	320,006.80
	UK TREASURY	420,000.00	422,877.16
	UK TREASURY	170,000.00	215,228.50
	UK TREASURY	400,000.00	413,228.00
	UK TREASURY	170,000.00	246,054.60
	UK TREASURY	260,000.00	357,084.00
	UK TREASURY	270,000.00	361,843.20
	UK TREASURY	340,000.00	477,588.61
	UK TREASURY	380,000.00	527,084.32
	UK TREASURY	220,000.00	220,459.88
	UK TREASURY	350,000.00	529,937.80
	UK TREASURY	290,000.00	416,445.80
	UK TREASURY	240,000.00	348,572.16
	UK TREASURY	290,000.00	442,716.90
	UK TREASURY	450,000.00	578,011.50
	UK TREASURY	310,000.00	416,512.90
	UK TREASURY	330,000.00	504,504.00
	UK TREASURY	320,000.00	296,768.00
	UK TREASURY	70,000.00	68,796.00
UK TREASURY	240,000.00	378,833.28	
	270,000.00	405,629.10	

	UK TREASURY			
	UK TREASURY	300,000.00	505,692.00	
	UK TREASURY	280,000.00	282,198.00	
	UK TREASURY	240,000.00	402,141.60	
	UK TREASURY	400,000.00	503,868.00	
	UK TREASURY	250,000.00	400,225.00	
	UK TREASURY	190,000.00	185,799.48	
	英ポンド 小計	12,520,000.00	15,218,415.19 (2,178,363,950)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,500,000.00	1,662,208.50	
	GOV OF SWEDEN	1,710,000.00	1,932,539.40	
	GOV OF SWEDEN	1,570,000.00	1,689,945.80	
	GOV OF SWEDEN	840,000.00	966,739.20	
	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	1,139,125.24	
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	954,783.19	
	GOV OF SWEDEN	760,000.00	1,082,838.88	
	スウェーデンクローナ 小計	8,390,000.00	9,428,180.21 (117,380,843)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,410,000.00	1,498,660.80	
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,139,349.51	
	GOV OF NORWAY	610,000.00	656,519.82	
	GOV OF NORWAY	700,000.00	706,869.10	
	GOV OF NORWAY	610,000.00	603,504.72	
	GOV OF NORWAY	630,000.00	630,492.58	
	GOV OF NORWAY	390,000.00	396,396.00	
	ノルウェークローネ 小計	5,460,000.00	5,631,792.53 (74,564,933)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	900,000.00	915,151.50	
	GOV OF DENMARK	1,370,000.00	1,512,252.58	
	GOV OF DENMARK	910,000.00	989,073.54	
	GOV OF DENMARK	1,380,000.00	1,549,502.64	
	GOV OF DENMARK	1,490,000.00	1,526,981.80	
	GOV OF DENMARK	2,230,000.00	3,880,373.94	
	デンマーククローネ 小計	8,280,000.00	10,373,336.00 (178,317,645)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	710,000.00	710,950.82	

	GOV OF POLAND	270,000.00	288,387.00
	GOV OF POLAND	510,000.00	513,876.00
	GOV OF POLAND	620,000.00	620,434.00
	GOV OF POLAND	180,000.00	199,665.00
	GOV OF POLAND	550,000.00	554,565.00
	GOV OF POLAND	310,000.00	350,796.00
	GOV OF POLAND	620,000.00	627,750.00
	GOV OF POLAND	380,000.00	408,595.00
	GOV OF POLAND	190,000.00	190,380.00
	GOV OF POLAND	480,000.00	496,276.80
	GOV OF POLAND	620,000.00	605,895.00
	GOV OF POLAND	530,000.00	512,267.26
	GOV OF POLAND	460,000.00	449,857.00
	GOV OF POLAND	160,000.00	198,198.40
	ポーランドズロチ 小計	6,590,000.00	6,727,893.28 (201,298,566)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	465,326.77
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	488,464.53
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	512,684.55
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	310,670.68
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	463,885.10
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	242,278.27
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	468,937.54
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	453,216.98
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	498,127.57
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	621,748.27
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	589,857.05
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	462,029.22
	GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	472,313.13
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	431,293.29
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	354,125.80
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	277,334.73
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	280,380.68
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	318,670.87
	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	140,371.60
		180,000.00	204,885.37

	GOV OF AUSTRALIA			
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	137,917.44	
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	68,145.97	
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	231,061.55	
	オーストラリアドル 小計	7,980,000.00	8,493,726.96 (688,076,821)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	90,023.85	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,485.80	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	100,590.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	68,558.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	99,160.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,955.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,664.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	133,913.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	83,880.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,050.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	39,912.00	
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	154,000.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,750.75	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,180.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	94,635.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	77,755.30	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	57,744.90	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	92,205.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	81,621.20	
	シンガポールドル 小計	1,500,000.00	1,543,083.80 (126,687,179)	
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	210,077.32	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	130,799.18	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	190,537.90	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	121,439.42	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	222,227.28	
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	299,537.58	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	140,675.17	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	138,221.83	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,044.85	

	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	157,782.06
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	119,622.84
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	119,739.96
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	262,655.69
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,478.41
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	169,030.49
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	249,229.70
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	192,776.75
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	275,300.78
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	95,055.94
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	264,129.84
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	252,844.41
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	252,569.01
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	205,211.17
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	316,599.36
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	121,765.96
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	67,076.57
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	179,607.55
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	173,502.05
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	140,539.21
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	145,472.37
	マレーシアリングット 小計	5,460,000.00	5,414,550.65 (146,192,867)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	480,000.00	485,520.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	940,000.00	931,164.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,290,000.00	1,264,657.95
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,891,240.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,418,266.14
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,584,883.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,040,000.00	1,823,964.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,890,000.00	1,742,202.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,230,000.00	870,717.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,753,133.08
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,443,883.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,290,000.00	892,164.00



	GOV OF SOUTH AFRICA	2,300,000.00	2,029,508.04	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,720,000.00	3,282,528.00	
	南アフリカランド 小計	25,870,000.00	23,413,830.21 (185,671,673)	
	合計		32,811,072,696 (32,811,072,696)	

(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 219銘柄	100.0%	46.1%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 292銘柄	100.0%	39.3%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.4%
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

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（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	41,947,760
コール・ローン	38,302,213
国債証券	57,415,595,590
派生商品評価勘定	450,650,931
未収入金	307,423
未収利息	374,061,074
前払費用	32,229,441
流動資産合計	58,353,094,432
資産合計	58,353,094,432
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,326
未払金	5,724
未払利息	103
その他未払費用	1,520
流動負債合計	10,673
負債合計	10,673
純資産の部	
元本等	
元本	60,557,036,701
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,203,952,942
元本等合計	58,353,083,759
純資産合計	58,353,083,759
負債純資産合計	58,353,094,432

### 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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	原則として、約定日基準で計上しております。 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	40,017,360,273円
期中追加設定元本額	23,842,066,369円
期中一部解約元本額	3,302,389,941円
期末元本額	60,557,036,701円
期末元本の内訳	
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	59,273,245円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	7,511,298円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	2,592,159円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	49,329,159,326円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	49,515,398円
Smart-i 8資産バランス 安定型	13,673,780円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	20,772,843円
Smart-i 8資産バランス 成長型	12,946,002円
先進国債券インデックスファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	11,058,107,861円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	3,484,789円
2. 計算日における受益権の総数	60,557,036,701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	2,203,952,942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	0.9636円
(10,000口当たり純資産額)	(9,636円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

2018年12月10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

2018年12月10日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

#### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		950,205,940
合計		950,205,940

(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)

(2018年12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	57,826,179,035	-	57,375,531,430	450,647,605
	米ドル	26,461,564,776	-	26,275,795,520	185,769,256
	カナダドル	1,162,977,157	-	1,151,947,800	11,029,357
	メキシコペソ	457,931,861	-	453,799,500	4,132,361
	ユーロ	22,822,781,523	-	22,673,759,040	149,022,483
	英ポンド	3,801,135,424	-	3,754,867,650	46,267,774
	スウェーデンクローナ	209,039,237	-	207,865,200	1,174,037
	ノルウェークローネ	145,216,492	-	144,600,360	616,132
	デンマーククローネ	315,119,796	-	312,943,950	2,175,846
	ポーランドズロチ	361,067,473	-	358,168,810	2,898,663
	オーストラリアドル	1,232,003,956	-	1,203,490,620	28,513,336
	シンガポールドル	230,343,113	-	228,664,800	1,678,313
	マレーシアリンギット	274,248,477	-	272,395,700	1,852,777
	南アフリカランド	352,749,750	-	337,232,480	15,517,270
	合計	57,826,179,035	-	57,375,531,430	450,647,605

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,353,918.52	
		US TREASURY N/B	700,000.00	688,501.94	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,020,564.99	
		US TREASURY N/B	760,000.00	749,831.96	
		US TREASURY N/B	770,000.00	757,201.75	
		US TREASURY N/B	970,000.00	961,531.41	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,005,197.95	
		US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,543,935.48	
		US TREASURY N/B	890,000.00	882,768.75	
		US TREASURY N/B	790,000.00	777,563.66	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,313,050.70	
		US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,396,952.69	
		US TREASURY N/B	850,000.00	845,119.13	
		US TREASURY N/B	760,000.00	749,609.35	
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,322,525.34	

US TREASURY N/B	940,000.00	934,345.24
US TREASURY N/B	850,000.00	836,336.84
US TREASURY N/B	1,910,000.00	1,875,045.47
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,492,880.85
US TREASURY N/B	910,000.00	919,828.63
US TREASURY N/B	910,000.00	894,412.61
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,637,513.15
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,395,378.88
US TREASURY N/B	860,000.00	844,479.66
US TREASURY N/B	930,000.00	914,524.14
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,066,259.17
US TREASURY N/B	700,000.00	686,601.51
US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,434,221.80
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,597,218.72
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,147,978.41
US TREASURY N/B	780,000.00	764,521.83
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,358,507.74
US TREASURY N/B	790,000.00	772,024.34
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,396,149.18
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,300,507.78
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,058,716.33
US TREASURY N/B	920,000.00	903,486.64
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,072,671.82
US TREASURY N/B	900,000.00	902,460.87
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,537,172.56
US TREASURY N/B	850,000.00	834,477.47
US TREASURY N/B	980,000.00	966,582.33
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,126,034.11
US TREASURY N/B	900,000.00	900,703.08
US TREASURY N/B	920,000.00	905,157.73
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,314,665.55
US TREASURY N/B	930,000.00	916,467.75
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,030,539.42
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,641,130.79
US TREASURY N/B	850,000.00	841,500.00

US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,168,666.15
US TREASURY N/B	900,000.00	893,460.87
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,132,454.81
US TREASURY N/B	970,000.00	960,110.46
US TREASURY N/B	960,000.00	952,649.95
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,182,494.51
US TREASURY N/B	880,000.00	870,976.48
US TREASURY N/B	760,000.00	767,421.85
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,396,718.68
US TREASURY N/B	910,000.00	894,465.93
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,258,410.14
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,812.50
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,547,801.03
US TREASURY N/B	940,000.00	937,741.74
US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,660,022.71
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,152,130.00
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,501,201.05
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,926,576.96
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,206,302.83
US TREASURY N/B	980,000.00	964,400.36
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,305,458.96
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,419,961.58
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,313,461.70
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,104,984.32
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,031,077.68
US TREASURY N/B	830,000.00	810,627.88
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,400,394.41
US TREASURY N/B	830,000.00	799,636.85
US TREASURY N/B	1,010,000.00	984,414.57
US TREASURY N/B	960,000.00	939,300.00
US TREASURY N/B	800,000.00	776,296.80
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,090,950.00
US TREASURY N/B	900,000.00	872,683.56
US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,528,818.11
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,065,732.36



US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,118,689.41	
US TREASURY N/B	750,000.00	726,459.90	
US TREASURY N/B	990,000.00	962,600.95	
US TREASURY N/B	710,000.00	687,410.28	
US TREASURY N/B	870,000.00	852,718.92	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,209,521.36	
US TREASURY N/B	730,000.00	711,906.80	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,116,555.58	
US TREASURY N/B	630,000.00	606,018.10	
US TREASURY N/B	840,000.00	815,013.27	
US TREASURY N/B	910,000.00	874,968.54	
US TREASURY N/B	880,000.00	849,354.61	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,163,835.84	
US TREASURY N/B	940,000.00	910,881.99	
US TREASURY N/B	900,000.00	876,357.36	
US TREASURY N/B	980,000.00	940,474.54	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,635,178.10	
US TREASURY N/B	2,040,000.00	1,993,741.36	
US TREASURY N/B	860,000.00	827,615.58	
US TREASURY N/B	950,000.00	937,531.25	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,146,720.22	
US TREASURY N/B	850,000.00	809,010.70	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,196,156.16	
US TREASURY N/B	740,000.00	703,708.18	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,090,718.75	
US TREASURY N/B	920,000.00	878,761.64	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,142,003.89	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,535,937.44	
US TREASURY N/B	960,000.00	916,218.72	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,302,945.28	
US TREASURY N/B	990,000.00	933,519.70	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,016,493.74	
US TREASURY N/B	850,000.00	796,011.65	
US TREASURY N/B	990,000.00	991,875.55	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,416,481.92	

US TREASURY N/B	920,000.00	865,375.36	
US TREASURY N/B	800,000.00	801,859.36	
US TREASURY N/B	860,000.00	808,097.96	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,208,695.20	
US TREASURY N/B	930,000.00	883,699.76	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,007,636.70	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,682,953.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	972,402.30	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,153,726.47	
US TREASURY N/B	910,000.00	889,365.02	
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,281,649.92	
US TREASURY N/B	380,000.00	368,919.12	
US TREASURY N/B	850,000.00	824,732.39	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,079,356.20	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,512,458.70	
US TREASURY N/B	810,000.00	780,178.63	
US TREASURY N/B	900,000.00	866,214.80	
US TREASURY N/B	880,000.00	852,173.43	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,059,968.75	
US TREASURY N/B	970,000.00	926,842.56	
US TREASURY N/B	820,000.00	793,205.84	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	973,417.90	
US TREASURY N/B	1,690,000.00	1,643,954.09	
US TREASURY N/B	800,000.00	772,765.60	
US TREASURY N/B	970,000.00	943,305.98	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,976.50	
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,540,945.97	
US TREASURY N/B	900,000.00	899,929.62	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,022,295.08	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,349,447.93	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,780,769.48	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,107,540.94	
US TREASURY N/B	580,000.00	579,694.10	
US TREASURY N/B	900,000.00	906,257.79	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,040,188.90	

US TREASURY N/B	420,000.00	419,614.44	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,078.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,117.10	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,050,313.26	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	1,998,759.24	
US TREASURY N/B	1,950,000.00	1,799,179.59	
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,758,487.07	
US TREASURY N/B	1,840,000.00	1,735,601.52	
US TREASURY N/B	1,980,000.00	1,899,407.66	
US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,906,398.15	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,959,471.59	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,194,478.30	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,905,637.44	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,184,641.00	
US TREASURY N/B	220,000.00	268,851.15	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,224,249.08	
US TREASURY N/B	680,000.00	696,083.56	
US TREASURY N/B	380,000.00	459,406.62	
US TREASURY N/B	280,000.00	371,475.77	
US TREASURY N/B	450,000.00	564,354.45	
US TREASURY N/B	600,000.00	727,125.00	
US TREASURY N/B	340,000.00	409,155.45	
US TREASURY N/B	220,000.00	268,924.21	
US TREASURY N/B	460,000.00	493,718.32	
US TREASURY N/B	340,000.00	402,986.32	
US TREASURY N/B	340,000.00	416,035.15	
US TREASURY N/B	420,000.00	505,812.88	
US TREASURY N/B	680,000.00	846,055.45	
US TREASURY N/B	530,000.00	639,043.31	
US TREASURY N/B	480,000.00	540,806.20	
US TREASURY N/B	620,000.00	735,535.51	
US TREASURY N/B	550,000.00	697,490.20	
US TREASURY N/B	380,000.00	458,909.35	
US TREASURY N/B	480,000.00	530,953.10	
US TREASURY N/B	390,000.00	391,348.23	

	US TREASURY N/B	590,000.00	591,463.43	
	US TREASURY N/B	500,000.00	490,068.35	
	US TREASURY N/B	740,000.00	693,200.77	
	US TREASURY N/B	860,000.00	804,519.85	
	US TREASURY N/B	750,000.00	748,828.12	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,184,635.86	
	US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,203,244.32	
	US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,316,088.83	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,344,697.54	
	US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,374,759.27	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,147,461.83	
	US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,199,826.50	
	US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,079,318.75	
	US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,316,197.21	
	US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,274,413.16	
	US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,013,350.00	
	US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,075,029.59	
	US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,003,600.71	
	US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,075,537.50	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,092,455.03	
	US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,109,585.13	
	US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,128,349.16	
	US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,118,800.96	
	US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,099,889.98	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,350,091.71	
	US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,443,287.95	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,263,361.32	
	US TREASURY N/B	450,000.00	470,179.66	
	米ドル 小計	238,490,000.00	234,766,538.80 (26,415,930,945)	
カナダドル	GOV OF CANADA	410,000.00	406,937.30	
	GOV OF CANADA	560,000.00	557,065.60	
	GOV OF CANADA	350,000.00	349,076.00	
	GOV OF CANADA	460,000.00	470,317.80	
	GOV OF CANADA	440,000.00	438,345.60	

	GOV OF CANADA	760,000.00	744,245.20
	GOV OF CANADA	380,000.00	380,019.00
	GOV OF CANADA	190,000.00	190,970.90
	GOV OF CANADA	820,000.00	797,720.60
	GOV OF CANADA	290,000.00	298,642.00
	GOV OF CANADA	570,000.00	551,150.10
	GOV OF CANADA	450,000.00	428,967.00
	GOV OF CANADA	360,000.00	368,938.80
	GOV OF CANADA	460,000.00	443,568.80
	GOV OF CANADA	480,000.00	475,132.80
	GOV OF CANADA	400,000.00	391,436.00
	GOV OF CANADA	340,000.00	339,949.00
	GOV OF CANADA	100,000.00	101,139.00
	GOV OF CANADA	450,000.00	460,975.50
	GOV OF CANADA	360,000.00	364,662.00
	GOV OF CANADA	440,000.00	423,240.40
	GOV OF CANADA	650,000.00	596,557.00
	GOV OF CANADA	380,000.00	377,587.00
	GOV OF CANADA	340,000.00	455,933.20
	GOV OF CANADA	190,000.00	192,855.70
	GOV OF CANADA	360,000.00	520,124.40
	GOV OF CANADA	390,000.00	553,577.70
	GOV OF CANADA	460,000.00	601,946.80
	GOV OF CANADA	480,000.00	601,963.20
	GOV OF CANADA	440,000.00	489,984.00
	GOV OF CANADA	160,000.00	151,718.40
	GOV OF CANADA	130,000.00	150,911.80
	カナダドル 小計	13,050,000.00	13,675,658.60 (1,155,866,664)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	6,660,000.00	6,424,036.20
	UNITED MEXICAN STATE	7,230,000.00	7,154,988.75
	UNITED MEXICAN STATE	8,890,000.00	8,451,723.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,400,000.00	2,301,737.76
	UNITED MEXICAN STATE	8,360,000.00	7,770,202.00
	UNITED MEXICAN STATE	6,050,000.00	5,831,262.25
	UNITED MEXICAN STATE	7,270,000.00	7,623,867.25

	UNITED MEXICAN STATE	4,860,000.00	4,022,670.60
	UNITED MEXICAN STATE	8,190,000.00	7,440,983.55
	UNITED MEXICAN STATE	2,860,000.00	2,739,522.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,960,000.00	3,512,421.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,520,000.00	2,178,615.60
	UNITED MEXICAN STATE	2,850,000.00	2,990,277.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,570,000.00	3,257,821.35
	UNITED MEXICAN STATE	5,910,000.00	4,935,854.70
	UNITED MEXICAN STATE	2,510,000.00	2,138,207.00
	メキシコペソ 小計	84,090,000.00	78,774,190.51 (437,196,757)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	450,000.00	482,473.80
	GOV OF AUSTRIA	480,000.00	533,472.00
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	272,810.83
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	232,573.34
	GOV OF AUSTRIA	290,000.00	332,823.43
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	251,871.25
	GOV OF AUSTRIA	350,000.00	382,585.00
	GOV OF AUSTRIA	290,000.00	317,978.04
	GOV OF AUSTRIA	320,000.00	342,524.16
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	347,011.60
	GOV OF AUSTRIA	340,000.00	351,103.72
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	302,132.70
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	359,000.40
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	285,905.20
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	253,361.85
	GOV OF AUSTRIA	410,000.00	621,845.67
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	313,293.13
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	166,552.00
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	193,398.26
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	163,378.60
	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	66,652.18
	GOV OF BELGIUM	590,000.00	636,034.75
	GOV OF BELGIUM	470,000.00	532,075.25
	GOV OF BELGIUM	400,000.00	458,031.60

GOV OF BELGIUM	490,000.00	575,065.47
GOV OF BELGIUM	370,000.00	410,527.21
GOV OF BELGIUM	320,000.00	323,845.98
GOV OF BELGIUM	430,000.00	489,851.70
GOV OF BELGIUM	290,000.00	295,721.19
GOV OF BELGIUM	520,000.00	538,291.61
GOV OF BELGIUM	310,000.00	401,988.47
GOV OF BELGIUM	430,000.00	447,879.40
GOV OF BELGIUM	410,000.00	416,859.30
GOV OF BELGIUM	550,000.00	790,234.71
GOV OF BELGIUM	500,000.00	503,023.24
GOV OF BELGIUM	320,000.00	319,120.00
GOV OF BELGIUM	270,000.00	368,855.10
GOV OF BELGIUM	120,000.00	121,394.52
GOV OF BELGIUM	260,000.00	324,212.04
GOV OF BELGIUM	550,000.00	851,544.10
GOV OF BELGIUM	130,000.00	130,234.13
GOV OF BELGIUM	230,000.00	246,871.65
GOV OF BELGIUM	530,000.00	800,877.74
GOV OF BELGIUM	280,000.00	405,927.20
GOV OF BELGIUM	330,000.00	320,430.00
GOV OF BELGIUM	140,000.00	150,689.84
GOV OF BELGIUM	130,000.00	134,114.50
GOV OF FINLAND	210,000.00	221,203.08
GOV OF FINLAND	200,000.00	203,223.52
GOV OF FINLAND	170,000.00	185,978.94
GOV OF FINLAND	150,000.00	151,709.25
GOV OF FINLAND	160,000.00	171,628.80
GOV OF FINLAND	150,000.00	161,181.60
GOV OF FINLAND	130,000.00	130,814.45
GOV OF FINLAND	150,000.00	166,466.40
GOV OF FINLAND	150,000.00	188,185.65
GOV OF FINLAND	160,000.00	167,839.68
GOV OF FINLAND	160,000.00	163,000.16
GOV OF FINLAND	120,000.00	120,757.20

GOV OF FINLAND	180,000.00	217,987.20	
GOV OF FINLAND	90,000.00	89,631.90	
GOV OF FINLAND	140,000.00	140,133.14	
GOV OF FINLAND	120,000.00	123,975.72	
GOV OF FINLAND	140,000.00	187,049.89	
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,344.40	
GOV OF FRANCE	790,000.00	795,596.71	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,130,109.39	
GOV OF FRANCE	730,000.00	736,157.71	
GOV OF FRANCE	1,170,000.00	1,237,402.53	
GOV OF FRANCE	740,000.00	751,437.44	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,111,266.20	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,078,820.26	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,081,765.90	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,183,424.28	
GOV OF FRANCE	1,420,000.00	1,580,644.60	
GOV OF FRANCE	800,000.00	808,319.63	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,174,046.80	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,147,489.80	
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,226,334.76	
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	1,650,358.64	
GOV OF FRANCE	550,000.00	549,644.52	
GOV OF FRANCE	1,010,000.00	1,134,565.32	
GOV OF FRANCE	1,170,000.00	1,286,327.25	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,164,827.36	
GOV OF FRANCE	900,000.00	1,256,427.00	
GOV OF FRANCE	850,000.00	894,615.39	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,274,308.79	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	1,033,899.43	
GOV OF FRANCE	920,000.00	909,335.36	
GOV OF FRANCE	960,000.00	1,001,646.72	
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,351,349.82	
GOV OF FRANCE	960,000.00	971,408.64	
GOV OF FRANCE	600,000.00	603,814.20	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,634,230.60	



GOV OF FRANCE	990,000.00	1,172,869.62	
GOV OF FRANCE	1,370,000.00	1,464,646.45	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,528,105.36	
GOV OF FRANCE	270,000.00	275,500.65	
GOV OF FRANCE	770,000.00	1,193,184.30	
GOV OF FRANCE	850,000.00	852,707.25	
GOV OF FRANCE	860,000.00	1,275,696.22	
GOV OF FRANCE	390,000.00	419,184.09	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,830,042.00	
GOV OF FRANCE	740,000.00	1,020,347.52	
GOV OF FRANCE	770,000.00	840,724.50	
GOV OF FRANCE	460,000.00	746,577.70	
GOV OF FRANCE	410,000.00	682,543.43	
GOV OF FRANCE	300,000.00	293,836.27	
GOV OF GERMANY	370,000.00	372,418.53	
GOV OF GERMANY	690,000.00	719,410.56	
GOV OF GERMANY	470,000.00	473,841.68	
GOV OF GERMANY	550,000.00	554,913.15	
GOV OF GERMANY	320,000.00	323,127.04	
GOV OF GERMANY	610,000.00	645,139.05	
GOV OF GERMANY	470,000.00	493,943.11	
GOV OF GERMANY	360,000.00	364,077.64	
GOV OF GERMANY	610,000.00	620,033.89	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,830.90	
GOV OF GERMANY	600,000.00	639,252.05	
GOV OF GERMANY	630,000.00	638,824.41	
GOV OF GERMANY	550,000.00	604,522.60	
GOV OF GERMANY	490,000.00	528,073.19	
GOV OF GERMANY	610,000.00	619,624.58	
GOV OF GERMANY	650,000.00	700,954.80	
GOV OF GERMANY	570,000.00	579,636.31	
GOV OF GERMANY	530,000.00	572,522.96	
GOV OF GERMANY	520,000.00	558,403.56	
GOV OF GERMANY	610,000.00	620,341.33	
GOV OF GERMANY	500,000.00	540,170.00	

GOV OF GERMANY	480,000.00	487,872.00	
GOV OF GERMANY	590,000.00	639,539.94	
GOV OF GERMANY	530,000.00	588,815.16	
GOV OF GERMANY	420,000.00	426,222.72	
GOV OF GERMANY	830,000.00	917,973.36	
GOV OF GERMANY	600,000.00	657,190.80	
GOV OF GERMANY	560,000.00	598,844.40	
GOV OF GERMANY	700,000.00	728,437.50	
GOV OF GERMANY	660,000.00	708,874.98	
GOV OF GERMANY	780,000.00	810,528.42	
GOV OF GERMANY	780,000.00	779,154.48	
GOV OF GERMANY	780,000.00	791,375.52	
GOV OF GERMANY	410,000.00	635,357.03	
GOV OF GERMANY	640,000.00	660,560.00	
GOV OF GERMANY	430,000.00	643,144.33	
GOV OF GERMANY	620,000.00	637,432.54	
GOV OF GERMANY	360,000.00	515,583.00	
GOV OF GERMANY	470,000.00	469,836.47	
GOV OF GERMANY	290,000.00	478,682.99	
GOV OF GERMANY	510,000.00	820,307.46	
GOV OF GERMANY	610,000.00	993,921.80	
GOV OF GERMANY	700,000.00	1,102,549.86	
GOV OF GERMANY	450,000.00	756,051.75	
GOV OF GERMANY	450,000.00	814,135.45	
GOV OF GERMANY	460,000.00	706,254.10	
GOV OF GERMANY	800,000.00	1,107,625.60	
GOV OF GERMANY	790,000.00	1,109,527.35	
GOV OF GERMANY	320,000.00	350,246.08	
GOV OF IRELAND	320,000.00	341,751.61	
GOV OF IRELAND	200,000.00	220,518.28	
GOV OF IRELAND	190,000.00	196,132.44	
GOV OF IRELAND	130,000.00	130,353.08	
GOV OF IRELAND	240,000.00	280,557.12	
GOV OF IRELAND	230,000.00	268,995.58	
GOV OF IRELAND	340,000.00	444,893.40	

GOV OF IRELAND	350,000.00	360,478.00	
GOV OF IRELAND	220,000.00	220,065.34	
GOV OF IRELAND	260,000.00	295,695.55	
GOV OF IRELAND	130,000.00	132,043.34	
GOV OF IRELAND	130,000.00	128,449.75	
GOV OF IRELAND	170,000.00	174,032.23	
GOV OF IRELAND	240,000.00	253,179.84	
GOV OF ITALY	660,000.00	664,634.52	
GOV OF ITALY	600,000.00	627,520.80	
GOV OF ITALY	740,000.00	773,597.25	
GOV OF ITALY	480,000.00	480,893.76	
GOV OF ITALY	470,000.00	468,378.50	
GOV OF ITALY	590,000.00	622,704.88	
GOV OF ITALY	450,000.00	445,703.85	
GOV OF ITALY	460,000.00	458,965.00	
GOV OF ITALY	680,000.00	719,984.00	
GOV OF ITALY	440,000.00	429,408.98	
GOV OF ITALY	610,000.00	646,043.68	
GOV OF ITALY	570,000.00	560,817.30	
GOV OF ITALY	780,000.00	827,467.51	
GOV OF ITALY	770,000.00	838,090.33	
GOV OF ITALY	120,000.00	122,650.08	
GOV OF ITALY	500,000.00	486,138.60	
GOV OF ITALY	590,000.00	601,538.80	
GOV OF ITALY	590,000.00	651,738.83	
GOV OF ITALY	510,000.00	502,409.67	
GOV OF ITALY	550,000.00	543,889.22	
GOV OF ITALY	550,000.00	532,626.05	
GOV OF ITALY	410,000.00	463,759.20	
GOV OF ITALY	690,000.00	680,435.91	
GOV OF ITALY	700,000.00	792,666.70	
GOV OF ITALY	480,000.00	459,394.08	
GOV OF ITALY	450,000.00	430,825.50	
GOV OF ITALY	650,000.00	716,087.77	
GOV OF ITALY	600,000.00	669,631.44	

GOV OF ITALY	220,000.00	222,414.94	
GOV OF ITALY	600,000.00	559,728.00	
GOV OF ITALY	950,000.00	1,048,568.20	
GOV OF ITALY	570,000.00	554,871.06	
GOV OF ITALY	710,000.00	757,252.63	
GOV OF ITALY	580,000.00	546,769.13	
GOV OF ITALY	710,000.00	710,974.19	
GOV OF ITALY	580,000.00	660,383.36	
GOV OF ITALY	560,000.00	521,513.44	
GOV OF ITALY	590,000.00	552,146.48	
GOV OF ITALY	260,000.00	256,317.36	
GOV OF ITALY	470,000.00	450,429.67	
GOV OF ITALY	820,000.00	912,712.48	
GOV OF ITALY	520,000.00	482,393.60	
GOV OF ITALY	890,000.00	797,509.59	
GOV OF ITALY	680,000.00	643,986.52	
GOV OF ITALY	640,000.00	597,264.00	
GOV OF ITALY	760,000.00	965,428.00	
GOV OF ITALY	680,000.00	630,710.88	
GOV OF ITALY	690,000.00	790,717.08	
GOV OF ITALY	210,000.00	204,511.65	
GOV OF ITALY	790,000.00	939,740.55	
GOV OF ITALY	750,000.00	769,658.92	
GOV OF ITALY	880,000.00	1,118,646.32	
GOV OF ITALY	650,000.00	542,347.00	
GOV OF ITALY	610,000.00	764,381.24	
GOV OF ITALY	640,000.00	574,028.80	
GOV OF ITALY	760,000.00	897,493.88	
GOV OF ITALY	450,000.00	383,601.60	
GOV OF ITALY	790,000.00	843,285.50	
GOV OF ITALY	420,000.00	382,546.50	
GOV OF ITALY	610,000.00	721,819.10	
GOV OF ITALY	670,000.00	789,706.89	
GOV OF ITALY	510,000.00	590,133.24	
GOV OF ITALY	470,000.00	440,347.23	

GOV OF ITALY	540,000.00	461,906.82	
GOV OF ITALY	390,000.00	372,960.90	
GOV OF ITALY	190,000.00	157,624.00	
GOV OF NETHERLANDS	460,000.00	464,803.32	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	480,039.75	
GOV OF NETHERLANDS	480,000.00	527,775.84	
GOV OF NETHERLANDS	470,000.00	476,754.84	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	493,470.90	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	444,603.42	
GOV OF NETHERLANDS	520,000.00	568,595.35	
GOV OF NETHERLANDS	480,000.00	483,390.50	
GOV OF NETHERLANDS	430,000.00	480,335.62	
GOV OF NETHERLANDS	470,000.00	476,305.52	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	461,362.95	
GOV OF NETHERLANDS	500,000.00	519,179.50	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	543,579.58	
GOV OF NETHERLANDS	390,000.00	402,692.65	
GOV OF NETHERLANDS	410,000.00	511,924.77	
GOV OF NETHERLANDS	460,000.00	711,776.40	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	724,992.75	
GOV OF NETHERLANDS	420,000.00	606,583.32	
GOV OF SPAIN	700,000.00	714,193.81	
GOV OF SPAIN	640,000.00	678,562.61	
GOV OF SPAIN	590,000.00	603,677.38	
GOV OF SPAIN	530,000.00	580,295.83	
GOV OF SPAIN	610,000.00	611,995.92	
GOV OF SPAIN	670,000.00	759,580.86	
GOV OF SPAIN	690,000.00	704,981.97	
GOV OF SPAIN	100,000.00	100,074.56	
GOV OF SPAIN	670,000.00	792,021.74	
GOV OF SPAIN	640,000.00	646,872.32	
GOV OF SPAIN	570,000.00	575,861.31	
GOV OF SPAIN	670,000.00	811,823.24	
GOV OF SPAIN	510,000.00	508,719.90	
GOV OF SPAIN	510,000.00	606,653.26	

	GOV OF SPAIN	580,000.00	705,038.64	
	GOV OF SPAIN	650,000.00	759,452.98	
	GOV OF SPAIN	670,000.00	749,129.07	
	GOV OF SPAIN	670,000.00	703,600.50	
	GOV OF SPAIN	700,000.00	870,626.46	
	GOV OF SPAIN	670,000.00	724,532.64	
	GOV OF SPAIN	610,000.00	649,008.58	
	GOV OF SPAIN	560,000.00	756,987.88	
	GOV OF SPAIN	750,000.00	759,513.00	
	GOV OF SPAIN	530,000.00	540,377.40	
	GOV OF SPAIN	660,000.00	667,659.96	
	GOV OF SPAIN	660,000.00	660,949.74	
	GOV OF SPAIN	450,000.00	448,017.01	
	GOV OF SPAIN	570,000.00	763,529.25	
	GOV OF SPAIN	740,000.00	1,055,139.36	
	GOV OF SPAIN	640,000.00	658,412.80	
	GOV OF SPAIN	660,000.00	974,104.89	
	GOV OF SPAIN	470,000.00	491,892.41	
	GOV OF SPAIN	640,000.00	839,162.97	
	GOV OF SPAIN	540,000.00	776,294.22	
	GOV OF SPAIN	600,000.00	844,387.20	
	GOV OF SPAIN	420,000.00	631,789.62	
	GOV OF SPAIN	530,000.00	564,059.39	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	252,612.62	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	339,666.90	
	ユーロ 小計	156,100,000.00	175,595,611.38 (22,537,696,720)	
英ポンド	UK TREASURY	470,000.00	493,218.00	
	UK TREASURY	780,000.00	795,866.44	
	UK TREASURY	580,000.00	610,165.39	
	UK TREASURY	770,000.00	782,301.20	
	UK TREASURY	840,000.00	908,223.12	
	UK TREASURY	400,000.00	441,212.47	
	UK TREASURY	770,000.00	762,222.53	
	UK TREASURY	700,000.00	724,245.76	

UK TREASURY	880,000.00	875,029.58
UK TREASURY	510,000.00	542,640.00
UK TREASURY	330,000.00	331,062.60
UK TREASURY	350,000.00	385,497.00
UK TREASURY	460,000.00	572,424.00
UK TREASURY	540,000.00	575,667.00
UK TREASURY	510,000.00	526,462.80
UK TREASURY	710,000.00	714,863.78
UK TREASURY	410,000.00	519,080.50
UK TREASURY	580,000.00	599,180.60
UK TREASURY	380,000.00	550,004.40
UK TREASURY	350,000.00	480,690.00
UK TREASURY	470,000.00	629,875.20
UK TREASURY	590,000.00	828,756.70
UK TREASURY	620,000.00	859,979.68
UK TREASURY	410,000.00	410,857.06
UK TREASURY	490,000.00	741,912.92
UK TREASURY	450,000.00	646,209.00
UK TREASURY	520,000.00	755,239.68
UK TREASURY	570,000.00	870,167.70
UK TREASURY	710,000.00	911,973.70
UK TREASURY	710,000.00	953,948.90
UK TREASURY	540,000.00	825,552.00
UK TREASURY	690,000.00	639,906.00
UK TREASURY	430,000.00	678,742.96
UK TREASURY	540,000.00	811,258.20
UK TREASURY	520,000.00	876,532.80
UK TREASURY	500,000.00	503,925.00
UK TREASURY	470,000.00	787,527.30
UK TREASURY	530,000.00	667,625.10
UK TREASURY	510,000.00	816,459.00
UK TREASURY	300,000.00	293,367.60
	英bond 小計	21,890,000.00
		26,699,873.67
		(3,821,819,917)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	2,730,000.00
	GOV OF SWEDEN	2,980,000.00
		3,025,219.47
		3,367,817.20

	GOV OF SWEDEN	2,510,000.00	2,701,760.48	
	GOV OF SWEDEN	1,650,000.00	1,898,952.00	
	GOV OF SWEDEN	1,840,000.00	1,940,731.90	
	GOV OF SWEDEN	1,550,000.00	1,591,305.33	
	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,880,720.16	
	スウェーデンクローナ 小計	14,580,000.00	16,406,506.54	(204,261,006)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	2,680,000.00	2,848,518.40	
	GOV OF NORWAY	1,900,000.00	1,950,237.90	
	GOV OF NORWAY	1,430,000.00	1,539,054.66	
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,120,892.43	
	GOV OF NORWAY	1,290,000.00	1,276,264.08	
	GOV OF NORWAY	1,280,000.00	1,281,000.82	
	GOV OF NORWAY	700,000.00	711,480.00	
	ノルウェークローネ 小計	10,390,000.00	10,727,448.29	(142,031,415)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,510,000.00	1,535,420.85	
	GOV OF DENMARK	2,520,000.00	2,781,661.68	
	GOV OF DENMARK	1,710,000.00	1,858,588.74	
	GOV OF DENMARK	2,450,000.00	2,750,928.60	
	GOV OF DENMARK	2,350,000.00	2,408,327.00	
	GOV OF DENMARK	3,970,000.00	6,908,109.66	
	デンマーククローネ 小計	14,510,000.00	18,243,036.53	(313,597,797)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	960,000.00	961,285.63	
	GOV OF POLAND	1,040,000.00	1,110,824.00	
	GOV OF POLAND	640,000.00	644,864.00	
	GOV OF POLAND	830,000.00	830,581.00	
	GOV OF POLAND	520,000.00	576,810.00	
	GOV OF POLAND	710,000.00	715,893.00	
	GOV OF POLAND	740,000.00	837,384.00	
	GOV OF POLAND	990,000.00	1,002,375.00	
	GOV OF POLAND	790,000.00	849,447.50	
	GOV OF POLAND	400,000.00	400,800.00	
	GOV OF POLAND	850,000.00	878,823.50	



	GOV OF POLAND	1,040,000.00	1,016,340.00
	GOV OF POLAND	960,000.00	927,880.32
	GOV OF POLAND	690,000.00	674,785.50
	GOV OF POLAND	340,000.00	421,171.60
	ポーランドズロチ 小計	11,500,000.00	11,849,265.05 (354,530,010)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	785,885.22
	GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	757,618.46
	GOV OF AUSTRALIA	920,000.00	1,003,552.74
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	491,060.11
	GOV OF AUSTRALIA	750,000.00	848,570.32
	GOV OF AUSTRALIA	490,000.00	494,651.47
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	812,062.56
	GOV OF AUSTRALIA	770,000.00	793,129.72
	GOV OF AUSTRALIA	840,000.00	890,270.55
	GOV OF AUSTRALIA	940,000.00	1,062,624.31
	GOV OF AUSTRALIA	860,000.00	1,014,554.12
	GOV OF AUSTRALIA	930,000.00	954,860.38
	GOV OF AUSTRALIA	820,000.00	806,868.27
	GOV OF AUSTRALIA	750,000.00	770,166.60
	GOV OF AUSTRALIA	740,000.00	794,100.29
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	513,582.85
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	280,380.68
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	514,776.02
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	230,610.51
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	364,240.67
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	222,789.71
	GOV OF AUSTRALIA	120,000.00	116,821.66
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	421,938.50
	オーストラリアドル 小計	14,030,000.00	14,945,115.72 (1,210,703,824)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	160,042.41
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,485.80
	GOV OF SINGAPORE	270,000.00	271,593.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	78,352.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	118,992.00

	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	145,474.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	98,880.00	
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	236,923.00	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	157,275.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	131,950.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	129,714.00	
	GOV OF SINGAPORE	260,000.00	286,000.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	103,501.50	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	63,270.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	105,150.00	
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	177,726.40	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	67,369.05	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	153,675.00	
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	163,242.40	
	シンガポールドル 小計	2,690,000.00	2,771,615.56 (227,549,637)	
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	560,206.19	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	171,045.09	
	GOV OF MALAYSIA	370,000.00	371,047.50	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	283,358.65	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	343,442.16	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	139,784.20	
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	683,279.43	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	128,348.84	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	180,080.73	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	335,286.88	
	GOV OF MALAYSIA	440,000.00	438,617.08	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	229,501.59	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	151,532.13	
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	673,205.34	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	198,859.42	
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	328,983.20	
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	314,530.49	
	GOV OF MALAYSIA	510,000.00	501,440.72	
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	85,550.34	

	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	401,086.06	
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	311,193.12	
	GOV OF MALAYSIA	460,000.00	464,727.00	
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	400,650.40	
	GOV OF MALAYSIA	710,000.00	661,133.96	
	GOV OF MALAYSIA	400,000.00	405,886.56	
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	86,241.31	
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	349,236.93	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	347,004.10	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	190,731.78	
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	320,039.24	
	マレーシアリングット 小計	10,130,000.00	10,056,030.44	(271,512,821)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	1,120,000.00	1,132,880.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,360,000.00	1,347,216.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,300,000.00	2,254,816.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	5,990,000.00	6,474,591.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,330,000.00	2,989,130.54	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,780,000.00	3,088,071.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,660,000.00	2,378,306.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,810,000.00	2,590,258.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,440,000.00	2,435,176.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,190,000.00	2,810,298.76	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,350,000.00	2,147,547.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,610,000.00	1,805,076.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,910,000.00	3,450,163.66	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,590,000.00	5,815,016.00	
	南アフリカランド 小計	45,440,000.00	40,718,546.96	(322,898,077)
合計			57,415,595.590	(57,415,595,590)

(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 218銘柄	100.0%	45.9%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 294銘柄	100.0%	39.3%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 30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）

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,116,083
コール・ローン	2,737,453

2018年12月10日現在

投資信託受益証券	2,779,187,751
派生商品評価勘定	672
未収配当金	13,458,072
流動資産合計	2,796,500,031
資産合計	2,796,500,031
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,000,000
未払利息	7
その他未払費用	44
流動負債合計	3,000,051
負債合計	3,000,051
純資産の部	
元本等	
元本	2,646,201,057
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	147,298,923
元本等合計	2,793,499,980
純資産合計	2,793,499,980
負債純資産合計	2,796,500,031

## 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)

2018年12月10日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況

期首	2017年12月12日
期首元本額	1,314,276,430円
期中追加設定元本額	1,393,517,336円
期中一部解約元本額	61,592,709円
期末元本額	2,646,201,057円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	454,671,816円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	286,092,301円
りそなラップ型ファンド(成長型)	134,855,992円
DCりそな グローバルバランス	4,644,940円
つみたてバランスファンド	63,009,376円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	8,213,548円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	2,752,313円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	2,551,516円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,675,286,055円
Smart-i 8資産バランス 安定型	849,005円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	4,797,963円
Smart-i 8資産バランス 成長型	8,213,774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)	262,458円
2. 計算日における受益権の総数	2,646,201,057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	1.0557円
(10,000口当たり純資産額)	(10,557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

2018年12月10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

2018年12月10日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		369,225,591
合計		369,225,591

（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)

(2018年12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	360,672	-	360,000	672
	米ドル	360,672	-	360,000	672
	合計	360,672	-	360,000	672

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	756,030	24,699,500.10	
		米ドル 小計	756,030	24,699,500.10	
				(2,779,187,751)	
				2,779,187,751	



合計	(2,779,187,751)
----	-----------------

(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先進国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

2018年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	416,277,025
コール・ローン	22,653,315
株式	10,610,522,622
投資証券	286,691,451
派生商品評価勘定	23,392
未収入金	11,042
未収配当金	20,743,025
差入委託証拠金	142,982,213
<b>流動資産合計</b>	<b>11,499,904,085</b>
<b>資産合計</b>	<b>11,499,904,085</b>

2018年12月10日現在

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,884,380
未払金	2,736,274
未払解約金	17,000,000
未払利息	61
その他未払費用	352
流動負債合計	38,621,067
負債合計	38,621,067
純資産の部	
元本等	
元本	9,858,639,925
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,602,643,093
元本等合計	11,461,283,018
純資産合計	11,461,283,018
負債純資産合計	11,499,904,085

## 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	7,099,520,268円
期中追加設定元本額	10,362,022,460円
期中一部解約元本額	7,602,902,803円
期末元本額	9,858,639,925円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	945,735,446円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	860,156,834円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,083,190,765円
DCりそな グローバルバランス	9,681,709円
つみたてバランスファンド	226,320,365円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	44,756,639円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	13,721,430円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	12,526,073円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	5,186,199,358円
Smart-i 先進国株式インデックス	383,616,371円
Smart-i 8資産バランス 安定型	3,837,851円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	22,640,034円
Smart-i 8資産バランス 成長型	40,793,594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）	2,103,279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）	23,360,177円
2. 計算日における受益権の総数	9,858,639,925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	1.1626円
(10,000口当たり純資産額)	(11,626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

2018年12月10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

2018年12月10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)

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		816,051,123
投資証券		10,106,315
合計		805,944,808

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2018年12月10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	582,106,209	-	563,261,851	18,844,358
	合計	582,106,209	-	563,261,851	18,844,358

(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12月10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	8,821,400	-	8,799,260	22,140
	米ドル	7,668,360	-	7,650,000	18,360
	シンガポールドル	1,153,040	-	1,149,260	3,780
	売建	4,244,900	-	4,239,390	5,510
	ユーロ	1,924,050	-	1,925,100	1,050

	英ポンド	1,296,090	-	1,288,170	7,920
	イスラエルシェケル	1,024,760	-	1,026,120	1,360
	合計	13,066,300	-	13,038,650	16,630

## (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	1,506	52.06	78,402.36	
	ANTERO RESOURCES CORP	124	12.75	1,581.00	
	APACHE CORP	899	33.01	29,675.99	
	BAKER HUGHES A GE CO	1,530	21.66	33,139.80	
	CABOT OIL & GAS CORP	1,553	25.23	39,182.19	
	CHENIERE ENERGY INC	494	60.28	29,778.32	
	CHEVRON CORP	5,458	115.49	630,344.42	
	CIMAREX ENERGY CO	258	75.22	19,406.76	
	CONCHO RESOURCES INC	590	122.41	72,221.90	
	CONOCOPHILLIPS	3,196	65.91	210,648.36	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	47.23	17,994.63	
	DEVON ENERGY CORP	1,234	27.20	33,564.80	

DIAMONDBACK ENERGY INC	468	102.70	48,063.60
EOG RESOURCES INC	1,582	103.61	163,911.02
EXXON MOBIL CORP	12,042	77.64	934,940.88
HALLIBURTON CO	2,583	29.68	76,663.44
HELMERICH & PAYNE	441	60.74	26,786.34
HESS CORP	653	52.61	34,354.33
HOLLYFRONTIER CORP	486	56.85	27,629.10
KINDER MORGAN INC	5,414	16.35	88,518.90
MARATHON OIL CORP	2,010	16.05	32,260.50
MARATHON PETROLEUM CORP	1,919	61.56	118,133.64
NATIONAL OILWELL VARCO INC	896	29.81	26,709.76
NOBLE ENERGY INC	1,135	23.78	26,990.30
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,209	66.54	146,986.86
ONEOK INC	1,213	59.99	72,767.87
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	640	18.74	11,993.60
PHILLIPS 66	1,281	90.35	115,738.35
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	502	143.00	71,786.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	200	21.49	4,298.00
SCHLUMBERGER LTD	3,986	43.04	171,557.44
TARGA RESOURCES CORP	514	44.55	22,898.70
TECHNIPFMC PLC	1,027	21.00	21,567.00
VALERO ENERGY CORP	1,326	75.99	100,762.74
WILLIAMS COS INC	3,545	24.48	86,781.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	716	157.16	112,526.56
ALBEMARLE CORP	319	88.65	28,279.35
AVERY DENNISON CORP	202	91.97	18,577.94
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	486	23.79	11,561.94
BALL CORP	1,012	48.39	48,970.68
CELANESE CORP	312	91.26	28,473.12
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	535	41.03	21,951.05
CHEMOURS CO/THE	410	26.12	10,709.20
CROWN HOLDINGS INC	195	48.00	9,360.00
DOWDUPONT INC	6,543	53.75	351,686.25
EASTMAN CHEMICAL CO	455	73.20	33,306.00
ECOLAB INC	713	154.07	109,851.91

FMC CORP	309	80.08	24,744.72
FREEMPORT-MCMORAN INC	4,274	10.92	46,672.08
INTERNATIONAL PAPER CO	1,193	44.76	53,398.68
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	207	137.00	28,359.00
LINDE PLC	1,579	152.72	241,144.88
LYONDELLBASELL INDU-CL A	884	84.37	74,583.08
MARTIN MARIETTA MATERIALS	144	181.48	26,133.12
MOSAIC CO/THE	840	33.52	28,156.80
NEWMONT MINING CORP	1,643	33.39	54,859.77
NUCOR CORP	969	57.51	55,727.19
PACKAGING CORP OF AMERICA	263	92.95	24,445.85
PPG INDUSTRIES INC	726	103.23	74,944.98
SEALED AIR CORP	504	34.35	17,312.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	249	389.50	96,985.50
STEEL DYNAMICS INC	650	32.31	21,001.50
VULCAN MATERIALS CO	409	101.36	41,456.24
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	68.37	11,212.68
WESTROCK CO	588	45.29	26,630.52
3M CO	1,683	198.24	333,637.92
ACUITY BRANDS INC	165	117.90	19,453.50
AERCAP HOLDINGS NV	312	49.75	15,522.00
ALLEGION PLC	220	88.67	19,507.40
AMETEK INC	712	70.85	50,445.20
ARCONIC INC	1,007	20.29	20,432.03
BOEING CO/THE	1,524	323.22	492,587.28
CATERPILLAR INC	1,726	123.55	213,247.30
CUMMINS INC	467	138.60	64,726.20
DEERE & CO	931	147.26	137,099.06
DOVER CORP	359	79.50	28,540.50
EATON CORP PLC	1,280	71.25	91,200.00
EMERSON ELECTRIC CO	1,795	62.95	112,995.25
FASTENAL CO	881	55.25	48,675.25
FLOWSERVE CORP	456	45.40	20,702.40
FLUOR CORP	326	36.53	11,908.78
FORTIVE CORP	904	69.94	63,225.76



FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	586	42.59	24,957.74
GENERAL DYNAMICS CORP	800	167.38	133,904.00
GENERAL ELECTRIC CO	24,727	7.01	173,336.27
HARRIS CORP	278	139.40	38,753.20
HD SUPPLY HOLDINGS INC	708	37.89	26,826.12
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,085	138.71	289,210.35
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	103	198.49	20,444.47
IDEX CORP	178	133.64	23,787.92
ILLINOIS TOOL WORKS	884	129.47	114,451.48
INGERSOLL-RAND PLC	734	97.98	71,917.32
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	296	59.78	17,694.88
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	700	65.64	45,948.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	500	38.20	19,100.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,738	32.66	89,423.08
L3 TECHNOLOGIES INC	182	178.82	32,545.24
LENNOX INTERNATIONAL INC	86	211.05	18,150.30
LOCKHEED MARTIN CORP	713	285.40	203,490.20
MASCO CORP	720	30.13	21,693.60
MIDDLEBY CORP	123	109.37	13,452.51
NORTHROP GRUMMAN CORP	484	257.54	124,649.36
OWENS CORNING	260	49.01	12,742.60
PACCAR INC	1,058	57.09	60,401.22
PARKER HANNIFIN CORP	399	157.04	62,658.96
PENTAIR PLC	504	39.72	20,018.88
RAYTHEON COMPANY	883	165.11	145,792.13
ROCKWELL AUTOMATION INC	372	161.55	60,096.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	307	284.82	87,439.74
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	398	44.23	17,603.54
SMITH (A.O.) CORP	414	43.91	18,178.74
SNAP-ON INC	131	151.00	19,781.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	264	75.42	19,910.88
STANLEY BLACK & DECKER INC	465	122.59	57,004.35
TEXTRON INC	597	51.22	30,578.34
TRANSDIGM GROUP INC	145	343.38	49,790.10
UNITED RENTALS INC	194	103.94	20,164.36

UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,259	119.45	269,837.55
WABCO HOLDINGS INC	114	108.06	12,318.84
WABTEC CORP	201	84.61	17,006.61
WW GRAINGER INC	111	289.43	32,126.73
XYLEM INC	417	65.69	27,392.73
CINTAS CORP	280	171.40	47,992.00
COPART INC	478	47.28	22,599.84
COSTAR GROUP INC	83	366.85	30,448.55
EQUIFAX INC	276	99.36	27,423.36
IHS MARKIT LTD	1,196	50.89	60,864.44
MANPOWERGROUP INC	288	73.16	21,070.08
NIELSEN HOLDINGS PLC	1,233	26.43	32,588.19
REPUBLIC SERVICES INC	702	74.89	52,572.78
ROBERT HALF INTL INC	346	58.26	20,157.96
ROLLINS INC	225	57.25	12,881.25
TRANSUNION	421	60.53	25,483.13
VERISK ANALYTICS INC	563	114.45	64,435.35
WASTE CONNECTIONS INC	803	76.88	61,734.64
WASTE MANAGEMENT INC	1,263	91.21	115,198.23
AMERCO	6	340.08	2,040.48
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	33.57	6,646.86
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	329	87.69	28,850.01
CSX CORP	2,388	68.03	162,455.64
DELTA AIR LINES INC	414	56.07	23,212.98
EXPEDITORS INTL WASH INC	413	70.57	29,145.41
FEDEX CORP	738	201.39	148,625.82
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	208	99.84	20,766.72
KANSAS CITY SOUTHERN	243	98.22	23,867.46
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	250	28.82	7,205.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	830	156.99	130,301.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	146	128.75	18,797.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	380	51.36	19,516.80
UNION PACIFIC CORP	2,157	147.45	318,049.65
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	121	88.23	10,675.83
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,950	105.32	205,374.00

XPO LOGISTICS INC	285	66.46	18,941.10
APTIV PLC	784	67.09	52,598.56
AUTOLIV INC	349	77.97	27,211.53
BORGWARNER INC	483	35.74	17,262.42
FORD MOTOR CO	10,800	8.82	95,256.00
GENERAL MOTORS CO	3,898	34.69	135,221.62
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	537	22.12	11,878.44
HARLEY-DAVIDSON INC	382	38.25	14,611.50
LEAR CORP	208	127.54	26,528.32
TESLA INC	400	357.96	143,186.00
DR HORTON INC	1,139	36.46	41,527.94
GARMIN LTD	251	64.68	16,234.68
HANESBRANDS INC	1,521	15.16	23,058.36
HASBRO INC	264	83.93	22,157.52
LEGGETT & PLATT INC	366	38.38	14,047.08
LENNAR CORP-A	928	42.00	38,976.00
LULULEMON ATHLETICA INC	228	113.87	25,962.36
MATTEL INC	1,378	13.43	18,506.54
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	333	40.48	13,479.84
MOHAWK INDUSTRIES INC	141	120.44	16,982.04
NEWELL RUBBERMAID INC	1,345	22.68	30,504.60
NIKE INC -CL B	3,698	73.34	271,211.32
NVR INC	8	2,456.76	19,654.08
POLARIS INDUSTRIES INC	141	88.46	12,472.86
PULTEGROUP INC	1,087	26.23	28,512.01
PVH CORP	171	102.44	17,517.24
RALPH LAUREN CORP	168	104.90	17,623.20
TAPESTRY INC	640	35.34	22,617.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	23.45	9,591.05
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	152	22.07	3,354.64
VF CORP	1,016	76.00	77,216.00
WHIRLPOOL CORP	201	120.37	24,194.37
ARAMARK	575	36.46	20,964.50
CARNIVAL CORP	1,310	56.73	74,316.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	58	467.43	27,110.94

DARDEN RESTAURANTS INC	289	104.83	30,295.87
DOMINO'S PIZZA INC	94	258.32	24,282.08
H&R BLOCK INC	571	27.04	15,439.84
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	866	72.86	63,096.76
LAS VEGAS SANDS CORP	1,230	53.34	65,608.20
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	913	111.25	101,571.25
MCDONALD'S CORP	2,178	182.96	398,486.88
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	17.04	18,744.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,234	25.99	32,071.66
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	498	47.59	23,699.82
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	517	104.92	54,243.64
STARBUCKS CORP	3,893	65.47	254,874.71
VAIL RESORTS INC	94	223.25	20,985.50
WYNN RESORTS LTD	228	104.99	23,937.72
YUM! BRANDS INC	953	90.43	86,179.79
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,024	47.23	95,593.52
ALPHABET INC-CL A	853	1,046.58	892,732.74
ALPHABET INC-CL C	898	1,036.58	930,848.84
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	1,055	51.10	53,910.50
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	497	315.70	156,902.90
COMCAST CORP-CLASS A	13,101	37.41	490,108.41
DISCOVERY INC - A	622	28.93	17,994.46
DISCOVERY INC-C	722	26.90	19,421.80
DISH NETWORK CORP-A	555	31.93	17,721.15
ELECTRONIC ARTS INC	925	82.52	76,331.00
FACEBOOK INC-A	6,877	137.42	945,037.34
IAC/INTERACTIVECORP	183	179.11	32,777.13
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	911	22.64	20,625.04
LIBERTY BROADBAND-C	252	80.43	20,268.36
LIBERTY GLOBAL PLC-A	356	23.73	8,447.88
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,280	23.20	29,696.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	450	32.38	14,571.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	418	38.63	16,147.34
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	206	38.64	7,959.84
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	330	55.11	18,186.30

NETFLIX INC	1,254	265.14	332,485.56
NEWS CORP - CLASS A	910	12.36	11,247.60
OMNICOM GROUP	703	75.50	53,076.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	4,458	6.22	27,728.76
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	268	102.67	27,515.56
TRIPADVISOR INC	171	61.61	10,535.31
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	1,351	48.99	66,185.49
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	3,117	49.26	153,543.42
TWITTER INC	2,092	32.83	68,680.36
VIACOM INC-CLASS B	834	29.91	24,944.94
WALT DISNEY CO/THE	4,263	111.98	477,370.74
ZILLOW GROUP INC - C	458	36.10	16,533.80
ADVANCE AUTO PARTS INC	177	167.59	29,663.43
AMAZON.COM INC	1,179	1,629.13	1,920,744.27
AUTOZONE INC	81	870.16	70,482.96
BEST BUY CO INC	607	60.58	36,772.06
BOOKING HOLDINGS INC	137	1,834.51	251,327.87
BURLINGTON STORES INC	215	157.79	33,924.85
CARMAX INC	426	62.56	26,650.56
DOLLAR GENERAL CORP	841	102.70	86,370.70
DOLLAR TREE INC	734	83.39	61,208.26
EBAY INC	2,836	29.06	82,414.16
EXPEDIA GROUP INC	296	118.24	34,999.04
GAP INC/THE	696	26.99	18,785.04
GENUINE PARTS CO	351	99.54	34,938.54
GRUBHUB INC	288	76.80	22,118.40
HOME DEPOT INC	3,273	172.79	565,541.67
KOHL'S CORP	403	62.48	25,179.44
L BRANDS INC	683	31.82	21,733.06
LKQ CORP	741	25.63	18,991.83
LOWE'S COS INC	2,371	89.40	211,967.40
MACY'S INC	733	31.69	23,228.77
MERCADOLIBRE INC	98	346.56	33,962.88
NORDSTROM INC	281	49.36	13,870.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	242	331.45	80,210.90

QURATE RETAIL INC	1,054	21.36	22,513.44
ROSS STORES INC	1,107	78.34	86,722.38
TARGET CORP	1,514	67.81	102,664.34
TIFFANY & CO	268	86.02	23,053.36
TJX COMPANIES INC	3,606	45.29	163,315.74
TRACTOR SUPPLY COMPANY	292	88.79	25,926.68
ULTA BEAUTY INC	138	254.47	35,116.86
WAYFAIR INC- CLASS A	181	104.77	18,963.37
COSTCO WHOLESALE CORP	1,266	224.86	284,672.76
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	9.05	905.00
KROGER CO	2,428	29.17	70,824.76
SYSCO CORP	1,478	65.02	96,099.56
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,427	81.19	197,048.13
WALMART INC	4,237	93.19	394,846.03
ALTRIA GROUP INC	5,241	54.18	283,957.38
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,683	44.46	74,826.18
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	636	45.93	29,211.48
BUNGE LTD	338	59.47	20,100.86
CAMPBELL SOUP CO	398	37.77	15,032.46
COCA-COLA CO/THE	11,546	49.09	566,793.14
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	756	47.04	35,562.24
CONAGRA BRANDS INC	1,513	30.84	46,660.92
CONSTELLATION BRANDS INC-A	503	188.61	94,870.83
GENERAL MILLS INC	1,793	38.48	68,994.64
HERSHEY CO/THE	339	107.14	36,320.46
HORMEL FOODS CORP	834	44.34	36,979.56
INGREDION INC	294	97.21	28,579.74
JM SMUCKER CO/THE	273	98.17	26,800.41
KELLOGG CO	624	60.84	37,964.16
KRAFT HEINZ CO/THE	1,813	48.71	88,311.23
LAMB WESTON HOLDINGS INC	461	73.45	33,860.45
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	374	150.39	56,245.86
MOLSON COORS BREWING CO -B	454	63.37	28,769.98
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	4,139	43.80	181,288.20
MONSTER BEVERAGE CORP	1,251	57.41	71,819.91

PEPSICO INC	4,048	115.82	468,839.36
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,460	84.56	377,137.60
TYSON FOODS INC-CL A	714	56.21	40,133.94
CHURCH & DWIGHT CO INC	784	66.81	52,379.04
CLOROX COMPANY	378	162.47	61,413.66
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,280	62.71	142,978.80
COTY INC-CL A	785	7.50	5,887.50
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	654	137.12	89,676.48
KIMBERLY-CLARK CORP	1,008	113.50	114,408.00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	7,086	92.45	655,100.70
ABBOTT LABORATORIES	4,884	69.95	341,635.80
ABIOMED INC	98	317.52	31,116.96
ALIGN TECHNOLOGY INC	178	210.28	37,429.84
AMERISOURCEBERGEN CORP	378	84.32	31,872.96
ANTHEM INC	748	280.53	209,836.44
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,487	65.02	96,684.74
BECTON DICKINSON AND CO	735	234.44	172,313.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	4,067	35.48	144,297.16
CARDINAL HEALTH INC	933	53.91	50,298.03
CENTENE CORP	605	133.22	80,598.10
CERNER CORP	691	53.73	37,127.43
CIGNA CORP	705	206.11	145,307.55
COOPER COS INC/THE	112	243.01	27,217.12
CVS HEALTH CORP	3,752	74.09	277,985.68
DANAHER CORP	1,893	101.87	192,839.91
DAVITA INC	412	58.96	24,291.52
DENTSPLY SIRONA INC	521	36.31	18,917.51
DEXCOM INC	270	121.41	32,780.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	614	157.21	96,526.94
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,630	95.85	156,235.50
HCA HEALTHCARE INC	808	135.86	109,774.88
HENRY SCHEIN INC	444	85.16	37,811.04
HOLOGIC INC	625	41.98	26,237.50
HUMANA INC	401	306.00	122,706.00
IDEXX LABORATORIES INC	202	190.01	38,382.02

INTUITIVE SURGICAL INC	329	491.69	161,766.01
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	236	141.96	33,502.56
MCKESSON CORP	591	124.94	73,839.54
MEDTRONIC PLC	3,863	94.24	364,049.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	311	87.56	27,231.16
RESMED INC	328	109.99	36,076.72
STRYKER CORP	998	168.85	168,512.30
TELEFLEX INC	104	256.64	26,690.56
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,741	269.18	737,822.38
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	242	126.22	30,545.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	258	118.81	30,652.98
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	276	88.56	24,442.56
WELLCARE HEALTH PLANS INC	153	238.85	36,544.05
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	605	109.92	66,501.60
ABBVIE INC	4,309	86.96	374,710.64
AGILENT TECHNOLOGIES INC	922	70.25	64,770.50
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	643	115.60	74,330.80
ALKERMES PLC	613	34.01	20,848.13
ALLERGAN PLC	971	152.42	147,999.82
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	358	74.38	26,628.04
AMGEN INC	1,842	191.44	352,632.48
BEIGENE LTD-ADR	100	137.59	13,759.00
BIOGEN INC	602	316.73	190,671.46
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	408	92.70	37,821.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,653	53.08	246,981.24
CELGENE CORP	2,013	70.08	141,071.04
ELI LILLY & CO	2,752	113.58	312,572.16
GILEAD SCIENCES INC	3,695	68.15	251,814.25
ILLUMINA INC	421	321.41	135,313.61
INCYTE CORP	414	64.51	26,707.14
IQVIA HOLDINGS INC	373	117.98	44,006.54
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	138	141.17	19,481.46
JOHNSON & JOHNSON	7,617	145.43	1,107,740.31
MERCK & CO. INC.	7,559	76.72	579,926.48
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	58	590.78	34,265.24



MYLAN NV	1,195	30.55	36,507.25
NEKTAR THERAPEUTICS	394	36.99	14,574.06
PERRIGO CO PLC	394	59.93	23,612.42
PFIZER INC	16,653	43.92	731,399.76
REGENERON PHARMACEUTICALS	229	372.83	85,378.07
SEATTLE GENETICS INC	255	59.99	15,297.45
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,915	19.41	56,580.15
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,159	235.86	273,361.74
UNITED THERAPEUTICS CORP	172	109.44	18,823.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	732	172.21	126,057.72
WATERS CORP	243	188.94	45,912.42
ZOETIS INC	1,381	88.09	121,652.29
BANK OF AMERICA CORP	27,029	25.43	687,347.47
BB&T CORP	2,262	47.66	107,806.92
CIT GROUP INC	280	44.28	12,398.40
CITIGROUP INC	7,189	58.35	419,478.15
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,165	33.01	38,456.65
COMERICA INC	414	74.03	30,648.42
EAST WEST BANCORP INC	349	48.17	16,811.33
FIFTH THIRD BANCORP	1,648	25.59	42,172.32
FIRST REPUBLIC BANK/CA	389	94.47	36,748.83
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,658	13.42	35,670.36
JPMORGAN CHASE & CO	9,561	103.29	987,555.69
KEYCORP	2,552	16.73	42,694.96
M & T BANK CORP	407	157.87	64,253.09
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	1,365	16.14	22,031.10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,342	126.56	169,843.52
REGIONS FINANCIAL CORP	2,700	14.90	40,230.00
SIGNATURE BANK	161	116.26	18,717.86
SUNTRUST BANKS INC	1,360	56.94	77,438.40
SVB FINANCIAL GROUP	127	205.80	26,136.60
US BANCORP	4,451	51.76	230,383.76
WELLS FARGO & CO	13,037	50.26	655,239.62
ZIONS BANCORPORATION	474	45.11	21,382.14
AFFILIATED MANAGERS GROUP	216	103.04	22,256.64

ALLY FINANCIAL INC	1,249	24.76	30,925.24
AMERICAN EXPRESS CO	2,041	106.68	217,733.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	432	115.82	50,034.24
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	743	17.36	12,898.48
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,998	47.71	143,034.58
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,697	204.88	757,441.36
BLACKROCK INC	348	393.10	136,798.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,400	82.67	115,738.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	260	104.34	27,128.40
CME GROUP INC	1,033	187.11	193,284.63
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,025	64.84	66,461.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	609	45.74	27,855.66
EATON VANCE CORP	362	36.82	13,328.84
FRANKLIN RESOURCES INC	899	32.24	28,983.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,037	179.67	186,317.79
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,671	78.55	131,257.05
INVESCO LTD	1,112	18.52	20,594.24
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	716	19.02	13,618.32
MOODY'S CORP	515	145.78	75,076.70
MORGAN STANLEY	3,855	41.32	159,288.60
MSCI INC	206	149.75	30,848.50
NASDAQ INC	353	87.36	30,838.08
NORTHERN TRUST CORP	640	88.93	56,915.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	303	75.38	22,840.14
S&P GLOBAL INC	696	169.14	117,721.44
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,585	41.47	148,669.95
SEI INVESTMENTS COMPANY	534	49.40	26,379.60
STATE STREET CORP	1,128	65.04	73,365.12
SYNCHRONY FINANCIAL	2,140	25.36	54,270.40
T ROWE PRICE GROUP INC	730	93.28	68,094.40
TD AMERITRADE HOLDING CORP	655	49.58	32,474.90
VOYA FINANCIAL INC	390	42.87	16,719.30
AFLAC INC	2,142	43.25	92,641.50
ALLEGHANY CORP	36	624.48	22,481.28
ALLSTATE CORP	1,038	83.81	86,994.78

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	178	95.19	16,943.82
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,540	37.90	96,266.00
AON PLC	682	158.73	108,253.86
ARCH CAPITAL GROUP LTD	958	27.74	26,574.92
ARTHUR J GALLAGHER & CO	429	74.52	31,969.08
ASSURANT INC	206	91.03	18,752.18
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	570	39.92	22,754.40
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	121	34.47	4,170.87
CHUBB LTD	1,312	130.96	171,819.52
CINCINNATI FINANCIAL CORP	367	80.14	29,411.38
EVEREST RE GROUP LTD	97	228.87	22,200.39
FNF GROUP	646	32.49	20,988.54
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,127	41.63	46,917.01
LINCOLN NATIONAL CORP	514	56.40	28,989.60
LOEWS CORP	638	45.78	29,207.64
MARKEL CORP	44	1,048.23	46,122.12
MARSH & MCLENNAN COS	1,408	84.77	119,356.16
METLIFE INC	2,357	40.63	95,764.91
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	675	44.40	29,970.00
PROGRESSIVE CORP	1,587	63.42	100,647.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,300	85.87	111,631.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	152	139.60	21,219.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	157	139.20	21,854.40
TORCHMARK CORP	254	80.25	20,383.50
TRAVELERS COS INC/THE	797	123.56	98,477.32
UNUM GROUP	535	32.25	17,253.75
WILLIS TOWERS WATSON PLC	402	156.50	62,913.00
WR BERKLEY CORP	280	75.73	21,204.40
CBRE GROUP INC - A	738	41.15	30,368.70
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	3,800	6.59	25,042.00
JONES LANG LASALLE INC	107	133.40	14,273.80
ACCENTURE PLC-CL A	1,843	157.45	290,180.35
ADOBE INC	1,378	238.00	327,964.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	399	66.65	26,593.35
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	136	180.44	24,539.84

ANSYS INC	197	152.37	30,016.89
AUTODESK INC	650	132.57	86,170.50
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,251	139.33	174,301.83
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	276	98.64	27,224.64
CADENCE DESIGN SYS INC	660	42.67	28,162.20
CDK GLOBAL INC	509	47.98	24,421.82
CHECK POINT SOFTWARE TECH	416	106.28	44,212.48
CITRIX SYSTEMS INC	317	107.37	34,036.29
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,694	68.00	115,192.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	605	104.00	62,920.00
DXC TECHNOLOGY CO	674	58.93	39,718.82
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	972	104.62	101,690.64
FIRST DATA CORP- CLASS A	1,233	17.72	21,848.76
FISERV INC	1,271	74.74	94,994.54
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	211	186.93	39,442.23
FORTINET INC	334	71.61	23,917.74
GARTNER INC	214	143.90	30,794.60
GLOBAL PAYMENTS INC	488	103.84	50,673.92
GODADDY INC - CLASS A	376	63.72	23,958.72
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,596	119.34	309,806.64
INTUIT INC	681	202.46	137,875.26
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	181	133.75	24,208.75
LEIDOS HOLDINGS INC	338	58.87	19,898.06
MASTERCARD INC-CLASS A	2,638	196.50	518,367.00
MICROSOFT CORP	20,697	104.82	2,169,459.54
ORACLE CORP	8,328	46.00	383,088.00
PAYCHEX INC	976	67.68	66,055.68
PAYPAL HOLDINGS INC	3,240	82.77	268,174.80
PTC INC	351	83.78	29,406.78
RED HAT INC	527	177.10	93,331.70
SABRE CORP	980	24.99	24,490.20
SALESFORCE.COM INC	2,071	135.95	281,552.45
SERVICENOW INC	530	182.38	96,661.40
SPLUNK INC	340	105.66	35,924.40
SQUARE INC - A	919	60.78	55,856.82

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	502	46.53	23,358.06
SYMANTEC CORP	1,455	21.78	31,689.90
SYNOPSYS INC	349	87.82	30,649.18
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	385	84.89	32,682.65
VERISIGN INC	339	153.95	52,189.05
VISA INC-CLASS A SHARES	5,069	137.11	695,010.59
VMWARE INC-CLASS A	173	159.21	27,543.33
WESTERN UNION CO	1,078	18.15	19,565.70
WIX.COM LTD	197	89.42	17,615.74
WORKDAY INC-CLASS A	445	160.43	71,391.35
WORLDPAY INC-CLASS A	906	81.88	74,183.28
AMPHENOL CORP-CL A	897	83.58	74,971.26
APPLE INC	13,718	168.49	2,311,345.82
ARISTA NETWORKS INC	121	225.09	27,235.89
ARROW ELECTRONICS INC	224	71.72	16,065.28
CDW CORP/DE	352	91.48	32,200.96
CISCO SYSTEMS INC	13,419	46.44	623,178.36
COGNEX CORP	401	41.40	16,601.40
COMMSCOPE HOLDING CO INC	750	16.93	12,697.50
CORNING INC	2,417	31.43	75,966.31
F5 NETWORKS INC	186	165.32	30,749.52
FLEX LTD	1,502	8.41	12,631.82
FLIR SYSTEMS INC	391	43.33	16,942.03
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	4,455	14.71	65,533.05
HP INC	5,091	22.93	116,736.63
IPG PHOTONICS CORP	85	124.35	10,569.75
JUNIPER NETWORKS INC	810	27.66	22,404.60
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	434	58.68	25,467.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	490	127.53	62,489.70
NETAPP INC	629	64.39	40,501.31
PALO ALTO NETWORKS INC	286	175.09	50,075.74
SEAGATE TECHNOLOGY	633	39.90	25,256.70
TE CONNECTIVITY LTD	1,126	73.33	82,569.58
TRIMBLE INC	684	35.49	24,275.16
WESTERN DIGITAL CORP	697	42.03	29,294.91

XEROX CORP	555	25.51	14,158.05
AT&T INC	20,909	30.14	630,197.26
CENTURYLINK INC	2,709	17.47	47,326.23
SPRINT CORP	1,246	6.01	7,488.46
T-MOBILE US INC	906	65.69	59,515.14
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,875	57.68	684,950.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	876	24.97	21,873.72
AES CORP	1,539	15.53	23,900.67
ALLIANT ENERGY CORP	539	45.84	24,707.76
AMEREN CORPORATION	743	70.42	52,322.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,466	79.32	116,283.12
AMERICAN WATER WORKS CO INC	550	97.80	53,790.00
ATMOS ENERGY CORP	303	98.79	29,933.37
CENTERPOINT ENERGY INC	1,145	28.38	32,495.10
CMS ENERGY CORP	657	52.93	34,775.01
CONSOLIDATED EDISON INC	926	82.46	76,357.96
DOMINION ENERGY INC	1,950	75.61	147,439.50
DTE ENERGY COMPANY	545	119.52	65,138.40
DUKE ENERGY CORP	2,068	89.99	186,099.32
EDISON INTERNATIONAL	987	58.51	57,749.37
ENTERGY CORP	421	88.46	37,241.66
EVERGY INC	829	60.31	49,996.99
EVERSOURCE ENERGY	950	69.46	65,987.00
EXELON CORP	2,791	46.96	131,065.36
FIRSTENERGY CORP	1,470	39.23	57,668.10
NEXTERA ENERGY INC	1,324	182.86	242,106.64
NISOURCE INC	844	27.14	22,906.16
NRG ENERGY INC	936	40.53	37,936.08
OGE ENERGY CORP	654	40.46	26,460.84
P G & E CORP	1,615	25.79	41,650.85
PINNACLE WEST CAPITAL	260	90.78	23,602.80
PPL CORP	2,096	31.09	65,164.64
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,491	55.44	82,661.04
SCANA CORP	548	46.86	25,679.28
SEMPRA ENERGY	792	115.95	91,832.40

	SOUTHERN CO/THE	2,902	46.98	136,335.96	
	UGI CORP	499	58.96	29,421.04	
	VISTRA ENERGY CORP	791	23.95	18,944.45	
	WEC ENERGY GROUP INC	944	73.77	69,638.88	
	XCEL ENERGY INC	1,511	53.19	80,370.09	
	ADVANCED MICRO DEVICES	2,718	19.46	52,892.28	
	ANALOG DEVICES INC	1,075	86.42	92,901.50	
	APPLIED MATERIALS INC	2,841	33.64	95,571.24	
	BROADCOM INC	1,232	228.56	281,585.92	
	INTEL CORP	13,116	46.24	606,483.84	
	KLA-TENCOR CORP	351	92.19	32,358.69	
	LAM RESEARCH CORP	460	138.03	63,493.80	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,383	15.44	21,353.52	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	630	52.90	33,327.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	534	70.26	37,518.84	
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,431	35.31	121,148.61	
	NVIDIA CORP	1,575	147.61	232,485.75	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,027	76.50	78,565.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,652	17.37	28,695.24	
	QORVO INC	422	61.13	25,796.86	
	QUALCOMM INC	3,942	55.99	220,712.58	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	411	67.57	27,771.27	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,727	92.38	251,920.26	
	XILINX INC	739	87.23	64,462.97	
	米ドル 小計	859,257		64,187,387.78	(7,222,364,873)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	570	9.14	5,209.80	
	CAMECO CORP	601	15.28	9,183.28	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,579	35.83	128,235.57	
	CENOVUS ENERGY INC	3,225	10.16	32,766.00	
	ENBRIDGE INC	5,116	42.43	217,071.88	
	ENCANA CORP	2,129	8.55	18,202.95	
	HUSKY ENERGY INC	1,391	16.13	22,436.83	
	IMPERIAL OIL LTD	922	37.46	34,538.12	
	INTER PIPELINE LTD	802	20.92	16,777.84	

KEYERA CORP	888	27.83	24,713.04
PEMBINA PIPELINE CORP	1,515	43.26	65,538.90
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	16.81	8,690.77
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	460	9.74	4,480.40
SUNCOR ENERGY INC	4,858	41.88	203,453.04
TOURMALINE OIL CORP	465	17.78	8,267.70
TRANSCANADA CORP	2,684	53.54	143,701.36
VERMILION ENERGY INC	590	31.23	18,425.70
AGNICO EAGLE MINES LTD	469	53.13	24,917.97
BARRICK GOLD CORP	3,640	18.22	66,320.80
CCL INDUSTRIES INC - CL B	295	53.45	15,767.75
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,487	12.09	30,067.83
FRANCO-NEVADA CORP	590	96.08	56,687.20
GOLDCORP INC	1,779	12.52	22,273.08
KINROSS GOLD CORP	3,281	3.78	12,402.18
LUNDIN MINING CORP	1,800	6.00	10,800.00
METHANEX CORP	131	71.50	9,366.50
NUTRIEN LTD	1,968	66.31	130,498.08
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,092	28.55	31,176.60
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	828	2.29	1,896.12
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	71.08	23,811.80
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,332	21.99	29,290.68
BOMBARDIER INC-B	8,071	2.25	18,159.75
CAE INC	869	25.68	22,315.92
FINNING INTERNATIONAL INC	736	24.98	18,385.28
SNC-LAVALIN GROUP INC	358	47.07	16,851.06
WSP GLOBAL INC	212	61.14	12,961.68
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,141	104.88	224,548.08
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	434	252.00	109,368.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	748	60.54	45,283.92
GILDAN ACTIVEWEAR INC	486	43.10	20,946.60
RESTAURANT BRANDS INTERN	758	72.73	55,129.34
STARS GROUP INC/THE	623	23.77	14,808.71
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	988	25.25	24,947.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	230	144.90	33,327.00



DOLLARAMA INC	696	32.80	22,828.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,344	66.58	89,483.52
EMPIRE CO LTD 'A'	133	25.37	3,374.21
LOBLAW COMPANIES LTD	432	61.01	26,356.32
METRO INC	786	45.94	36,108.84
WESTON (GEORGE) LTD	297	94.81	28,158.57
SAPUTO INC	512	40.67	20,823.04
AURORA CANNABIS INC	1,309	7.60	9,948.40
BAUSCH HEALTH COS INC	636	31.45	20,002.20
CANOPY GROWTH CORP	600	41.75	25,050.00
BANK OF MONTREAL	1,820	92.71	168,732.20
BANK OF NOVA SCOTIA	3,558	71.60	254,752.80
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,297	107.47	139,388.59
NATIONAL BANK OF CANADA	786	58.96	46,342.56
ROYAL BANK OF CANADA	4,042	94.56	382,211.52
TORONTO-DOMINION BANK	5,205	69.83	363,465.15
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,657	55.48	147,410.36
CI FINANCIAL CORP	775	18.84	14,601.00
IGM FINANCIAL INC	81	33.49	2,712.69
ONEX CORPORATION	292	78.50	22,922.00
THOMSON REUTERS CORP	561	67.18	37,687.98
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	90	614.00	55,260.00
GREAT-WEST LIFECO INC	888	28.78	25,556.64
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	304	45.12	13,716.48
INTACT FINANCIAL CORP	423	100.31	42,431.13
MANULIFE FINANCIAL CORP	6,232	20.19	125,824.08
POWER CORP OF CANADA	745	25.02	18,639.90
POWER FINANCIAL CORP	1,074	27.02	29,019.48
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,858	45.56	84,650.48
FIRST CAPITAL REALTY INC	101	20.04	2,024.04
BLACKBERRY LTD	1,407	10.65	14,984.55
CGI GROUP INC - CLASS A	781	83.29	65,049.49
CONSTELLATION SOFTWARE INC	63	900.57	56,735.91
OPEN TEXT CORP	792	44.00	34,848.00
SHOPIFY INC - CLASS A	282	195.13	55,026.66

	BCE INC	404	56.96	23,011.84
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,161	71.22	82,686.42
	TELUS CORP	320	47.80	15,296.00
	ALTAGAS LTD	544	14.12	7,681.28
	ATCO LTD -CLASS I	63	40.97	2,581.11
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	105	32.61	3,424.05
	EMERA INC	50	44.96	2,248.00
	FORTIS INC	1,306	46.54	60,781.24
	HYDRO ONE LTD	550	21.25	11,687.50
	カナダドル 小計	114,355		4,739,527.14 (400,584,833)
ユーロ	ENAGAS SA	618	24.62	15,215.16
	ENI SPA	6,882	14.11	97,132.54
	GALP ENERGIA SGPS SA	1,024	14.52	14,868.48
	NESTE OYJ	434	69.00	29,946.00
	OMV AG	551	43.10	23,748.10
	REPSOL SA	3,976	14.78	58,785.16
	SNAM SPA	7,459	3.93	29,313.87
	TENARIS SA	1,257	10.31	12,965.95
	TOTAL SA	6,871	48.16	330,941.71
	VOPAK	56	39.26	2,198.56
	AIR LIQUIDE SA	1,285	105.45	135,503.25
	AKZO NOBEL	725	71.88	52,113.00
	ARCELORMITTAL	2,120	19.29	40,911.76
	ARKEMA	151	80.26	12,119.26
	BASF SE	2,582	58.90	152,079.80
	COVESTRO AG	686	44.40	30,458.40
	CRH PLC	2,484	22.82	56,684.88
	EVONIK INDUSTRIES AG	393	22.50	8,842.50
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	35.00	1,960.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	535	55.70	29,799.50
	IMERYS SA	29	47.42	1,375.18
	KONINKLIJKE DSM NV	588	75.00	44,100.00
	LANXESS AG	195	44.00	8,580.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	482	22.36	10,777.52

SOLVAY SA	275	92.66	25,481.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,169	10.56	12,344.64
SYMRISE AG	294	71.76	21,097.44
THYSSENKRUPP AG	1,039	15.78	16,395.42
UMICORE	702	35.39	24,843.78
UPM-KYMMENE OYJ	1,506	22.49	33,869.94
VOESTALPINE AG	203	27.91	5,665.73
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	568	32.10	18,232.80
AIRBUS SE	1,706	89.07	151,953.42
ALSTOM	344	37.16	12,783.04
ANDRITZ AG	216	40.62	8,773.92
BOUYGUES SA	494	32.99	16,297.06
BRENTAG AG	373	38.27	14,274.71
CNH INDUSTRIAL NV	3,484	8.49	29,593.09
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	1,542	29.94	46,167.48
DASSAULT AVIATION SA	11	1,266.00	13,926.00
EIFFAGE	276	77.50	21,390.00
FERROVIAL SA	1,385	17.88	24,763.80
GEA GROUP AG	434	22.29	9,673.86
HOCHTIEF AG	17	119.70	2,034.90
KINGSPAN GROUP PLC	481	35.80	17,219.80
KION GROUP AG	150	47.75	7,162.50
KONE OYJ-B	1,094	42.00	45,948.00
LEGRAND SA	838	50.48	42,302.24
LEONARDO SPA	873	8.32	7,266.85
METSO OYJ	90	23.71	2,133.90
MTU AERO ENGINES AG	126	171.50	21,609.00
OSRAM LICHT AG	172	39.64	6,818.08
PRYSMIAN SPA	475	15.10	7,172.50
REXEL SA	790	9.57	7,560.30
SAFRAN SA	991	105.65	104,699.15
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,693	61.36	103,882.48
SIEMENS AG-REG	2,235	97.70	218,359.50
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	12.64	5,056.00
THALES SA	245	104.10	25,504.50

VINCI SA	1,502	72.68	109,165.36
WARTSILA OYJ ABP	1,335	13.99	18,676.65
BUREAU VERITAS SA	842	18.38	15,475.96
EDENRED	716	32.03	22,933.48
RANDSTAD NV	211	39.65	8,366.15
SOCIETE BIC SA	23	90.10	2,072.30
TELEPERFORMANCE	129	141.30	18,227.70
WOLTERS KLUWER	853	52.58	44,850.74
ADP	115	163.60	18,814.00
AENA SME SA	243	140.00	34,020.00
ATLANTIA SPA	1,683	17.71	29,814.34
BOLLORE	3,240	3.63	11,774.16
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	526	19.10	10,049.23
DEUTSCHE POST AG-REG	2,764	26.05	72,002.20
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	35	65.94	2,307.90
GETLINK	1,078	11.10	11,965.80
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	1,317	6.77	8,916.09
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	933	71.80	66,989.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	119	63.95	7,610.05
CONTINENTAL AG	351	124.60	43,734.60
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,490	46.79	116,507.10
FAURECIA	200	31.55	6,310.00
FERRARI NV	388	93.60	36,316.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	3,016	13.76	41,506.19
MICHELIN (CGDE)	515	86.20	44,393.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	27.74	11,734.02
PEUGEOT SA	1,349	17.91	24,167.33
PIRELLI & C SPA	1,734	5.95	10,331.17
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	366	53.52	19,588.32
RENAULT SA	442	57.57	25,445.94
VALEO SA	536	25.05	13,426.80
VOLKSWAGEN AG	79	141.30	11,162.70
VOLKSWAGEN AG-PREF	515	143.00	73,645.00
ADIDAS AG	567	194.45	110,253.15
HERMES INTERNATIONAL	101	482.10	48,692.10

HUGO BOSS AG -ORD	184	60.96	11,216.64
KERING	227	395.30	89,733.10
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	789	249.50	196,855.50
MONCLER SPA	678	29.45	19,967.10
PUMA SE	20	459.50	9,190.00
SEB SA	21	118.50	2,488.50
ACCOR SA	537	37.64	20,212.68
PADDY POWER BETFAIR PLC	211	72.40	15,276.40
SODEXO	260	88.22	22,937.20
AXEL SPRINGER SE	35	53.85	1,884.75
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	17.72	7,249.52
JC DECAUX SA	60	27.44	1,646.40
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	510	16.80	8,568.00
PUBLICIS GROUPE	704	48.45	34,108.80
RTL GROUP	32	49.58	1,586.56
SES	1,135	18.13	20,577.55
TELENET GROUP HOLDING NV	192	41.04	7,879.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	178	68.16	12,132.48
VIVENDI	2,968	21.25	63,070.00
DELIVERY HERO SE	416	30.46	12,671.36
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	3,083	26.80	82,624.40
ZALANDO SE	220	25.68	5,649.60
CARREFOUR SA	1,406	14.58	20,499.48
CASINO GUICHARD PERRACHON	45	36.05	1,622.25
COLRUYT SA	54	57.52	3,106.08
JERONIMO MARTINS	703	10.49	7,377.98
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	3,511	22.18	77,873.98
METRO AG	170	13.27	2,256.75
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,255	62.66	141,298.30
DANONE	1,856	63.80	118,412.80
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	1,400	7.73	10,822.00
HEINEKEN HOLDING NV	291	75.80	22,057.80
HEINEKEN NV	738	78.56	57,977.28
KERRY GROUP PLC-A	486	90.00	43,740.00
PERNOD RICARD SA	636	138.00	87,768.00

REMY COINTREAU	18	99.50	1,791.00
BEIERSDORF AG	250	94.02	23,505.00
HENKEL AG & CO KGAA	257	89.55	23,014.35
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	559	100.65	56,263.35
L'OREAL	734	206.00	151,204.00
UNILEVER NV-CVA	4,319	48.95	211,436.64
BIOMERIEUX	110	61.30	6,743.00
ESSILORLUXOTTICA	817	109.90	89,788.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	698	62.48	43,611.04
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,166	39.26	45,777.16
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,603	32.20	83,816.60
SARTORIUS AG-VORZUG	166	110.00	18,260.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	400	38.10	15,240.00
BAYER AG-REG	2,714	63.37	171,986.18
EUROFINS SCIENTIFIC	48	325.80	15,638.40
GRIFOLS SA	628	24.40	15,323.20
IPSEN	158	118.40	18,707.20
MERCK KGAA	309	95.92	29,639.28
ORION OYJ-CLASS B	184	29.28	5,387.52
QIAGEN N.V.	673	30.88	20,782.24
RECORDATI SPA	180	28.10	5,058.00
SANOFI	3,221	76.55	246,567.55
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	88	88.20	7,761.60
UCB SA	284	75.40	21,413.60
ABN AMRO GROUP NV-CVA	1,414	21.65	30,613.10
AIB GROUP PLC	2,000	3.64	7,280.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	18,164	4.69	85,207.32
BANCO DE SABADELL SA	20,523	1.05	21,549.15
BANCO SANTANDER SA	47,342	3.97	188,373.81
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,800	5.25	19,969.00
BANKIA SA	1,600	2.72	4,361.60
BANKINTER SA	2,829	7.09	20,057.61
BNP PARIBAS	3,276	41.59	136,265.22
CAIXABANK S.A	11,572	3.36	38,905.06
COMMERZBANK AG	2,539	6.84	17,366.76

CREDIT AGRICOLE SA	2,735	10.19	27,875.12
ERSTE GROUP BANK AG	733	32.98	24,174.34
ING GROEP NV-CVA	10,707	10.12	108,397.66
INTESA SANPAOLO	40,763	1.98	80,792.26
KBC GROEP NV	793	59.40	47,104.20
MEDIOBANCA SPA	1,301	7.49	9,747.09
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	403	23.98	9,663.94
SOCIETE GENERALE SA	2,295	30.45	69,894.22
UNICREDIT SPA	6,093	10.93	66,608.67
AMUNDI SA	140	49.20	6,888.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,596	7.69	43,038.83
DEUTSCHE BOERSE AG	543	111.20	60,381.60
EURAZEO	34	63.15	2,147.10
EXOR NV	212	50.40	10,684.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	178	76.42	13,602.76
NATIXIS	3,105	4.55	14,127.75
WENDEL	24	104.00	2,496.00
AEGON NV	4,388	4.51	19,824.98
AGEAS	674	40.43	27,249.82
ALLIANZ SE-REG	1,259	175.24	220,627.16
ASSICURAZIONI GENERALI	3,289	14.32	47,114.92
AXA SA	5,304	19.72	104,594.88
CNP ASSURANCES	139	19.05	2,647.95
HANNOVER RUECK SE	166	118.50	19,671.00
MAPFRE SA	942	2.40	2,268.33
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	422	187.45	79,103.90
NN GROUP NV	1,028	35.43	36,422.04
POSTE ITALIANE SPA	2,118	6.57	13,915.26
SAMPO OYJ-A SHS	1,254	38.06	47,727.24
SCOR SE	382	40.50	15,471.00
AROUNDTOWN SA	2,775	7.26	20,146.50
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,178	42.11	49,605.58
VONOVIA SE	1,399	42.01	58,771.99
AMADEUS IT GROUP SA	1,193	61.32	73,154.76
ATOS SE	219	67.88	14,865.72

CAPGEMINI SA	500	96.48	48,240.00
DASSAULT SYSTEMES SA	416	104.75	43,576.00
SAP SE	2,865	88.85	254,555.25
WIRECARD AG	334	132.50	44,255.00
INGENICO GROUP	134	57.58	7,715.72
NOKIA OYJ	15,554	4.90	76,230.15
1&1 DRILLISCH AG	130	42.90	5,577.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	9,559	15.03	143,719.56
ELISA OYJ	308	36.47	11,232.76
ILIAD SA	98	124.05	12,156.90
KONINKLIJKE KPN NV	9,944	2.62	26,122.88
ORANGE	5,451	14.66	79,911.66
PROXIMUS	252	23.27	5,864.04
TELECOM ITALIA SPA	34,468	0.56	19,302.08
TELECOM ITALIA-RSP	9,717	0.48	4,670.96
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	3.53	2,194.18
TELEFONICA SA	12,836	7.68	98,580.48
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	260	37.50	9,750.00
E.ON SE	6,335	8.85	56,071.08
EDF	1,335	13.89	18,549.82
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	4,996	3.09	15,452.62
ENDESA SA	677	20.20	13,675.40
ENEL SPA	22,212	4.74	105,462.57
ENGIE	5,138	12.12	62,298.25
FORTUM OYJ	1,376	18.74	25,786.24
IBERDROLA SA	17,021	6.59	112,270.51
INNOGY SE	500	40.47	20,235.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,082	22.28	24,106.96
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,501	19.52	29,307.02
RWE AG	1,800	18.89	34,002.00
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	667	12.63	8,424.21
TERNA SPA	4,575	4.96	22,692.00
UNIPER SE	490	23.03	11,284.70
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,222	18.00	22,002.11
VERBUND AG	245	36.64	8,976.80



	ASML HOLDING NV	1,187	141.56	168,031.72
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,178	17.63	56,044.03
	STMICROELECTRONICS NV	2,255	11.96	26,981.07
	ユーロ 小計	545,951		9,811,042.50 (1,259,247,304)
英ポンド	BP PLC	57,291	5.14	294,934.06
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	13,174	23.42	308,600.95
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	10,762	23.65	254,521.30
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	1,490	6.28	9,357.20
	ANGLO AMERICAN PLC	2,933	16.07	47,156.77
	ANTOFAGASTA PLC	1,120	7.74	8,677.76
	BHP GROUP PLC	5,758	15.34	88,362.26
	CRODA INTERNATIONAL PLC	281	46.76	13,139.56
	FRESNILLO PLC	180	8.00	1,441.08
	GLENCORE PLC	31,387	2.79	87,695.27
	JOHNSON MATTHEY PLC	413	26.82	11,076.66
	MONDI PLC	1,010	16.30	16,468.05
	RANDGOLD RESOURCES LTD	268	66.52	17,827.36
	RIO TINTO PLC	3,220	35.84	115,420.90
	ASHTREAD GROUP PLC	1,092	16.25	17,745.00
	BAE SYSTEMS PLC	8,837	4.49	39,731.15
	BUNZL PLC	1,003	23.01	23,079.03
	DCC PLC	194	58.15	11,281.10
	FERGUSON PLC	744	48.25	35,901.72
	MEGGITT PLC	2,323	4.80	11,171.30
	MELROSE INDUSTRIES PLC	16,106	1.54	24,883.77
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,680	7.88	36,897.12
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT	215,280	0.00	215.28
	SMITHS GROUP PLC	858	13.68	11,737.44
	WEIR GROUP PLC/THE	572	14.07	8,048.04
	BABCOCK INTL GROUP PLC	204	5.22	1,066.10
	EXPERIAN PLC	2,582	18.62	48,089.75
	G4S PLC	2,741	1.83	5,016.03
	INTERTEK GROUP PLC	466	45.92	21,398.72
	RELX PLC	5,406	16.09	87,009.57

EASYJET PLC	130	11.11	1,444.95
ROYAL MAIL PLC	2,932	3.03	8,907.41
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,065	4.62	9,558.88
BERKELEY GROUP HOLDINGS	280	33.56	9,396.80
BURBERRY GROUP PLC	1,245	17.30	21,544.72
PERSIMMON PLC	1,075	19.46	20,919.50
TAYLOR WIMPEY PLC	9,369	1.34	12,554.46
CARNIVAL PLC	394	43.73	17,229.62
COMPASS GROUP PLC	4,391	16.68	73,263.83
GVC HOLDINGS PLC	1,500	6.69	10,035.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	621	41.81	25,964.01
MERLIN ENTERTAINMENT	2,373	3.27	7,776.32
TUI AG-DI	1,248	11.13	13,896.48
WHITBREAD PLC	513	45.20	23,187.60
AUTO TRADER GROUP PLC	3,830	4.36	16,733.27
INFORMA PLC	4,271	6.51	27,838.37
ITV PLC	10,960	1.31	14,395.96
PEARSON PLC	2,390	9.12	21,801.58
WPP PLC	3,665	8.15	29,899.07
KINGFISHER PLC	6,032	2.28	13,777.08
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,884	2.82	8,138.64
NEXT PLC	446	46.77	20,859.42
SAINSBURY (J) PLC	4,054	3.00	12,162.00
TESCO PLC	26,983	1.99	53,709.66
WM MORRISON SUPERMARKETS	9,127	2.28	20,832.37
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,198	22.42	26,859.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	6,673	26.63	177,735.35
COCA-COLA HBC AG-DI	749	23.68	17,736.32
DIAGEO PLC	7,142	27.84	198,868.99
IMPERIAL BRANDS PLC	2,628	23.37	61,429.50
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,951	62.73	122,386.23
UNILEVER PLC	3,274	42.61	139,521.51
CONVATEC GROUP PLC	2,000	1.50	3,008.00
NMC HEALTH PLC	438	31.64	13,858.32
SMITH & NEPHEW PLC	2,739	14.75	40,400.25

	ASTRAZENECA PLC	3,628	59.27	215,031.56	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	14,203	14.37	204,153.92	
	SHIRE PLC	2,454	45.35	111,288.90	
	BARCLAYS PLC	46,752	1.54	72,166.38	
	HSBC HOLDINGS PLC	57,012	6.43	367,043.25	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	195,275	0.54	105,546.13	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	15,371	2.10	32,279.10	
	STANDARD CHARTERED PLC	8,583	5.93	50,914.35	
	3I GROUP PLC	3,239	7.65	24,797.78	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	692	18.43	12,753.56	
	INVESTEC PLC	2,302	4.41	10,156.42	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	989	38.73	38,303.97	
	SCHRODERS PLC	320	23.75	7,600.00	
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,140	9.48	10,807.20	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	5,053	2.36	11,927.60	
	ADMIRAL GROUP PLC	445	20.07	8,931.15	
	AVIVA PLC	11,164	3.81	42,601.82	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	3,088	3.08	9,526.48	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	16,667	2.30	38,384.10	
	PRUDENTIAL PLC	7,671	14.22	109,119.97	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,270	5.05	11,477.12	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	959	14.65	14,054.14	
	SAGE GROUP PLC/THE	4,159	5.80	24,122.20	
	BT GROUP PLC	23,401	2.52	59,087.52	
	VODAFONE GROUP PLC	80,484	1.62	131,011.85	
	CENTRICA PLC	12,225	1.39	17,066.10	
	NATIONAL GRID PLC	9,208	8.29	76,352.73	
	SEVERN TRENT PLC	1,000	18.61	18,610.00	
	SSE PLC	3,223	10.89	35,098.47	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,011	7.62	15,339.90	
	英ポンド 小計	1,058,933		4,841,134.60 (692,960,006)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	18.99	11,014.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	23	512.00	11,776.00	
	GIVAUDAN-REG	29	2,426.00	70,354.00	

LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,734	42.16	73,105.44
SIKA AG-REG	422	123.50	52,117.00
ABB LTD-REG	5,124	18.94	97,074.18
GEBERIT AG-REG	122	377.90	46,103.80
SCHINDLER HOLDING AG-REG	52	188.10	9,781.20
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	117	195.20	22,838.40
ADECCO SA-REG	451	46.57	21,003.07
SGS SA-REG	18	2,332.00	41,976.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	155	135.25	20,963.75
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1,532	64.02	98,078.64
SWATCH GROUP AG/THE-BR	70	291.10	20,377.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	57.05	14,319.55
DUFREY AG-REG	57	99.10	5,648.70
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	1,625.00	3,250.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	6,750.00	20,250.00
NESTLE SA-REG	8,767	84.80	743,441.60
SONOVA HOLDING AG-REG	130	163.00	21,190.00
STRAUMANN HOLDING AG-REG	24	622.00	14,928.00
LONZA GROUP AG-REG	207	307.60	63,673.20
NOVARTIS AG-REG	6,191	87.00	538,617.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,008	250.70	503,405.60
VIFOR PHARMA AG	107	123.75	13,241.25
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	7,121	11.09	79,007.49
JULIUS BAER GROUP LTD	531	37.10	19,700.10
PARGESA HOLDING SA-BR	29	67.85	1,967.65
PARTNERS GROUP HOLDING AG	41	626.00	25,666.00
UBS GROUP AG-REG	10,527	12.56	132,219.12
BALOISE HOLDING AG - REG	158	139.70	22,072.60
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	116	382.20	44,335.20
SWISS RE AG	888	89.28	79,280.64
ZURICH INSURANCE GROUP AG	419	300.10	125,741.90
SWISS PRIME SITE-REG	195	81.50	15,892.50
TEMENOS GROUP AG-REG	146	118.00	17,228.00
SWISSCOM AG-REG	94	476.40	44,781.60
	48,441		3,146,420.38

スイスフラン 小計				(357,622,140)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	392	246.00	96,432.00
	BOLIDEN AB	792	193.84	153,521.28
	ALFA LAVAL AB	659	191.25	126,033.75
	ASSA ABLOY AB-B	2,773	161.90	448,948.70
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,049	208.35	426,909.15
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,290	195.06	251,627.40
	EPIROC AB-A	2,606	74.23	193,443.38
	EPIROC AB-B	1,290	72.13	93,047.70
	SANDVIK AB	3,152	126.35	398,255.20
	SKANSKA AB-B SHS	1,380	137.55	189,819.00
	SKF AB-B SHARES	1,113	129.80	144,467.40
	VOLVO AB-B SHS	4,319	117.05	505,538.95
	SECURITAS AB-B SHS	933	145.95	136,171.35
	ELECTROLUX AB-SER B	732	196.00	143,472.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	337	63.88	21,527.56
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,536	159.04	403,325.44
	ICA GRUPPEN AB	65	332.00	21,580.00
	SWEDISH MATCH AB	558	358.80	200,210.40
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,329	226.20	300,619.80
	NORDEA BANK ABP	8,357	78.27	654,102.39
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,891	90.36	441,950.76
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,593	97.42	447,450.06
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,521	206.30	520,082.30
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	180.20	114,066.60
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	481	221.10	106,349.10
	INVESTOR AB-B SHS	1,256	378.40	475,270.40
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	259.60	23,364.00
ERICSSON LM-B SHS	8,741	79.20	692,287.20	
HEXAGON AB-B SHS	801	417.00	334,017.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	144	538.50	77,544.00	
TELE2 AB-B SHS	965	111.00	107,115.00	
TELIA CO AB	9,189	41.68	382,997.52	
スウェーデンクローナ 小計		70,967		8,631,546.79 (107,462,757)

ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	242	252.60	61,129.20	
	EQUINOR ASA	3,561	200.60	714,336.60	
	NORSK HYDRO ASA	3,829	40.14	153,696.06	
	YARA INTERNATIONAL ASA	387	337.60	130,651.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	71	272.00	19,312.00	
	MARINE HARVEST	996	193.70	192,925.20	
	ORKLA ASA	2,391	69.36	165,839.76	
	DNB ASA	3,333	148.25	494,117.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	130.70	86,523.40	
	TELENOR ASA	1,762	165.60	291,787.20	
ノルウェークローネ 小計		17,234		2,310,317.87	(30,588,608)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	205	604.60	123,943.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	758	303.50	230,053.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	622	499.60	310,751.20	
	ISS A/S	284	196.95	55,933.80	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	10	8,370.00	83,700.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	22	8,900.00	195,800.00	
	DSV A/S	532	503.00	267,596.00	
	PANDORA A/S	432	343.00	148,176.00	
	CARLSBERG AS-B	348	715.40	248,959.20	
	COLOPLAST-B	376	628.80	236,428.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	550	203.20	111,760.00	
	GENMAB A/S	128	997.80	127,718.40	
	H LUNDBECK A/S	120	264.80	31,776.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	5,192	300.25	1,558,898.00	
	DANSKE BANK A/S	1,643	142.20	233,634.60	
	TRYG A/S	94	161.90	15,218.60	
ORSTED A/S	595	441.00	262,395.00		
デンマーククローネ 小計		11,911		4,242,741.60	(72,932,728)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	829	27.16	22,515.64	
	OIL SEARCH LTD	3,060	7.29	22,307.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	3,969	6.94	27,544.86	
	SANTOS LTD	3,962	5.61	22,226.82	

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	27.06	9,660.42
WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,801	31.03	86,915.03
WORLEYPARSONS LTD	1,064	13.00	13,832.00
ALUMINA LTD	7,748	2.20	17,045.60
AMCOR LIMITED	2,553	13.49	34,439.97
BHP BILLITON LIMITED	9,416	31.18	293,590.88
BLUESCOPE STEEL LTD	2,175	12.02	26,143.50
BORAL LTD	3,791	5.02	19,030.82
FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,154	4.07	12,836.78
INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.70	19,765.40
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,601	15.77	25,247.77
NEWCREST MINING LTD	2,487	20.97	52,152.39
ORICA LTD	747	17.31	12,930.57
RIO TINTO LTD	950	72.32	68,704.00
SOUTH32 LTD	11,515	3.09	35,581.35
CIMIC GROUP LTD	82	41.46	3,399.72
BRAMBLES LTD	5,151	10.33	53,209.83
SEEK LTD	909	17.10	15,543.90
AURIZON HOLDINGS LTD	5,129	4.42	22,670.18
SYDNEY AIRPORT	5,230	7.10	37,133.00
TRANSURBAN GROUP	8,168	11.86	96,872.48
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,299	22.20	28,837.80
CROWN RESORTS LTD	773	11.72	9,059.56
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	49	46.24	2,265.76
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	46.92	2,064.48
TABCORP HOLDINGS LTD	5,825	4.34	25,280.50
REA GROUP LTD	43	75.24	3,235.32
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	3.27	1,445.34
WESFARMERS LTD	3,513	31.95	112,240.35
COLES GROUP LTD	3,513	12.60	44,263.80
WOOLWORTHS GROUP LTD	3,987	29.23	116,540.01
COCA-COLA AMATIL LTD	469	8.57	4,019.33
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,675	14.56	24,388.00
COCHLEAR LTD	122	174.40	21,276.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	611	55.74	34,057.14

	SONIC HEALTHCARE LTD	1,331	22.25	29,614.75	
	CSL LTD	1,321	183.90	242,931.90	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	8,418	25.71	216,426.78	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	304	9.74	2,960.96	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	368	10.61	3,904.48	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	5,112	70.37	359,731.44	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,006	24.00	192,144.00	
	WESTPAC BANKING CORP	9,887	25.73	254,392.51	
	AMP LTD	11,656	2.33	27,158.48	
	ASX LTD	421	60.00	25,260.00	
	CHALLENGER LTD	1,796	9.49	17,044.04	
	MACQUARIE GROUP LTD	969	113.32	109,807.08	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	7,566	7.12	53,869.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	5,841	2.38	13,901.58	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,084	10.69	32,967.96	
	SUNCORP GROUP LTD	4,236	13.31	56,381.16	
	LENDLEASE GROUP	1,220	12.28	14,981.60	
	COMPUTERSHARE LTD	1,073	17.32	18,584.36	
	TELSTRA CORP LTD	9,523	3.08	29,330.84	
	TPG TELECOM LTD	287	7.37	2,115.19	
	AGL ENERGY LTD	2,285	19.69	44,991.65	
	APA GROUP	3,668	9.12	33,452.16	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.59	2,284.83	
	オーストラリアドル 小計	204,364		3,264,512.17 (264,458,130)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	1,115	4.72	5,262.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,787	7.25	27,455.75	
	A2 MILK CO LTD	1,410	11.02	15,538.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,400	12.38	17,332.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	11.40	18,205.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	3,528	4.20	14,817.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,074	3.26	3,501.24	
	ニュージーランドドル 小計	13,911		102,113.39 (7,886,217)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,500	78.50	588,750.00	



NWS HOLDINGS LTD	1,000	15.54	15,540.00
MTR CORP	3,500	40.90	143,150.00
MINTH GROUP LTD	2,000	25.65	51,300.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	4,500	44.80	201,600.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	22.55	11,275.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	7,000	48.75	341,250.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	800	13.84	11,072.00
SANDS CHINA LTD	8,200	35.00	287,000.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	2,000	11.04	22,080.00
SJM HOLDINGS LTD	2,000	7.25	14,500.00
WYNN MACAU LTD	5,200	18.50	96,200.00
WH GROUP LTD	20,000	5.89	117,800.00
BANK OF EAST ASIA	3,600	25.50	91,800.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	11,500	29.70	341,550.00
HANG SENG BANK LTD	2,400	181.00	434,400.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,200	229.00	732,800.00
AIA GROUP LTD	35,000	63.05	2,206,750.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	7,500	56.80	426,000.00
HANG LUNG GROUP LTD	1,200	21.30	25,560.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	15.70	47,100.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,015	39.85	159,997.75
HYSAN DEVELOPMENT CO	2,300	38.55	88,665.00
KERRY PROPERTIES LTD	500	27.90	13,950.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	19,000	10.70	203,300.00
SINO LAND CO	6,000	13.72	82,320.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,700	113.20	532,040.00
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,700	81.95	139,315.00
SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	28.95	144,750.00
WHARF HOLDINGS LTD	2,000	20.70	41,400.00
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	48.75	195,000.00
WHEELLOCK & CO LTD	3,400	45.50	154,700.00
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	16,000	11.52	184,320.00
PCCW LTD	4,000	4.60	18,400.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,400	58.65	82,110.00
CLP HOLDINGS LTD	4,000	88.70	354,800.00

	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.59	3,795.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	25,800	15.94	411,252.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	5,000	53.20	266,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	76.70	122,720.00	
	香港ドル 小計	242,515		9,406,311.75 (135,450,889)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	2,900	6.17	17,893.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	800	2.63	2,104.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	3.47	10,410.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	1.25	1,875.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	6,700	2.11	14,137.00	
	SATS LTD	1,200	4.65	5,580.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,700	9.43	25,461.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	28,800	0.99	28,512.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	2,900	2.52	7,308.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	35.32	3,532.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,700	0.25	1,453.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,600	3.15	11,340.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,000	24.16	120,800.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	8,700	11.23	97,701.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,900	24.85	96,915.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,400	7.15	10,010.00	
	CAPITALAND LTD	10,200	3.22	32,844.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,600	8.65	13,840.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.25	13,125.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	14.90	19,370.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	23,000	3.08	70,840.00		
	シンガポールドル 小計	117,100		605,050.50 (49,674,646)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	1,130	21.40	24,182.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	52	455.50	23,686.00	
	BANK HAPOLIM BM	2,328	24.43	56,873.04	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,355	23.80	79,849.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	110	66.23	7,285.30	
	AZRIELI GROUP	234	190.60	44,600.40	

NICE SYSTEMS LTD	153	419.40	64,168.20
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,770	3.98	7,056.99
イスラエルシュケル 小計	9,132		307,700.93 (9,289,491)
合 計	3,314,071		10,610,522,622 (10,610,522,622)

(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	1,778	31,701.74	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	235	29,649.95	
		AMERICAN TOWER CORP	1,275	212,198.25	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	2,982	30,297.12	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	422	79,593.42	
		BOSTON PROPERTIES INC	470	60,667.60	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	544	9,335.04	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	212	19,701.16	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,180	136,596.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	579	67,001.88	
		DUKE REALTY CORP	816	23,272.32	
		EQUINIX INC	236	91,206.92	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,157	82,922.19	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	203	53,522.98	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	288	28,425.60	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	167	22,381.34	
		HCP INC	1,074	32,080.38	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,318	42,628.02	
		INVITATION HOMES INC	800	17,424.00	
		IRON MOUNTAIN INC	621	21,145.05	
KIMCO REALTY CORP	1,097	18,572.21			
LIBERTY PROPERTY TRUST	348	16,101.96			
MACERICH CO/THE	178	9,013.92			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	260	26,478.40
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	352	17,888.64
	PROLOGIS INC	1,883	125,859.72
	PUBLIC STORAGE	468	100,217.52
	REALTY INCOME CORP	887	58,479.91
	REGENCY CENTERS CORP	349	22,705.94
	SBA COMMUNICATIONS CORP	366	61,550.22
	SIMON PROPERTY GROUP INC	899	169,389.58
	SL GREEN REALTY CORP	202	18,832.46
	UDR INC	612	25,967.16
	VENTAS INC	1,123	73,522.81
	VEREIT INC	3,812	29,771.72
	VORNADO REALTY TRUST	391	27,628.06
	WELLTOWER INC	1,166	85,969.18
	WEYERHAEUSER CO	2,463	62,240.01
	WP CAREY INC	450	31,333.50
	米ドル 小計	34,663	2,073,274.68 (233,284,866)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,440.74
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	130	3,221.40
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,713.49
	カナダドル 小計	297	7,375.63 (623,388)
ユーロ	COVIVIO	27	2,338.20
	GECINA SA	97	11,979.50
	ICADE	30	2,026.50
	KLEPIERRE	683	19,192.30
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	421	60,935.54
	ユーロ 小計	1,258	96,472.04 (12,382,186)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,984	11,070.72
	HAMMERSON PLC	1,987	7,357.86
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,575	12,952.80
	SEGRO PLC	3,101	18,810.66
	英ポンド 小計	8,647	50,192.04 (7,184,488)

オーストラリアドル	DEXUS	3,337	36,940.59	
	GOODMAN GROUP	5,229	57,309.84	
	GPT GROUP	3,772	20,708.28	
	MIRVAC GROUP	7,755	17,914.05	
	SCENTRE GROUP	16,658	69,297.28	
	STOCKLAND	7,747	29,748.48	
	VICINITY CENTRES	8,539	23,567.64	
オーストラリアドル 小計		53,037	255,486.16	(20,696,933)
香港ドル	LINK REIT	6,000	476,100.00	
	香港ドル 小計	6,000	476,100.00	(6,855,840)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	8,600	22,102.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,600	13,452.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	8,100	18,387.00	
	SUNTEC REIT	8,500	15,045.00	
シンガポールドル 小計		32,800	68,986.00	(5,663,750)
合計			286,691,451	(286,691,451)

(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 596銘柄	96.9%		66.2%
	投資証券 39銘柄		3.1%	2.1%
カナダドル	株式 88銘柄	99.8%		3.7%
	投資証券 3銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.0%		11.5%
	投資証券 5銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 95銘柄	99.0%		6.3%

	投資証券	4銘柄		1.0%	0.1%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.0%		3.3%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%		0.7%
オーストラリアドル	株式	62銘柄	92.7%		2.4%
	投資証券	7銘柄		7.3%	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	40銘柄	95.2%		1.2%
	投資証券	1銘柄		4.8%	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	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

### R A M新興国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	187,790,251
コール・ローン	3,115,498
株式	5,126,498,265
投資証券	18,969,842
派生商品評価勘定	564,469
未収入金	58,012
未収配当金	1,451,101

2018年12月10日現在

差入委託証拠金	49,902,170
流動資産合計	5,388,349,608
資産合計	5,388,349,608
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,301,244
未払解約金	2,170,000
未払利息	8
その他未払費用	177
流動負債合計	6,471,429
負債合計	6,471,429
純資産の部	
元本等	
元本	4,383,035,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	998,842,898
元本等合計	5,381,878,179
純資産合計	5,381,878,179
負債純資産合計	5,388,349,608

## 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	2,084,707,441円
期中追加設定元本額	3,450,934,994円
期中一部解約元本額	1,152,607,154円
期末元本額	4,383,035,281円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	386,923,047円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,628,078,904円
りそなラップ型ファンド(成長型)	468,232,238円
DCりそな グローバルバランス	4,031,944円
つみたてバランスファンド	53,009,976円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	15,314,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	4,649,402円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	4,351,759円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,627,345,428円
Smart-i 新興国株式インデックス	168,487,636円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,070,301円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	7,073,383円
Smart-i 8資産バランス 成長型	14,036,545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)	430,182円
2. 計算日における受益権の総数	4,383,035,281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	1.2279円
(10,000口当たり純資産額)	(12,279円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

2018年12月10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

2018年12月10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)

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	482,528,975	
投資証券	3,219,286	
合計	485,748,261	

(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)

(2018年12月10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	233,270,837	-	229,534,048	3,736,789
合計		233,270,837	-	229,534,048	3,736,789

(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12月10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	24,949	-	24,782	167
	米ドル	24,949	-	24,782	167
	売建	24,949	-	24,768	181
	ブラジルリアル	19,639	-	19,484	155
	オフショア人民元	5,310	-	5,284	26

合計	49,898	-	49,550	14
----	--------	---	--------	----

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	47,429	4.91	233,255.82	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	7,200	1.23	8,877.60	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,505	79.98	360,309.90	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	889	169.00	150,241.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	10,217	6.53	66,778.31	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	16,010	4.20	67,242.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,570	69.78	179,334.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	1,190	15.06	17,921.40	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	1,150	9.20	10,580.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	6,309	19.08	120,375.72	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,112	23.53	26,165.36	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	600	13.08	7,848.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	330	37.00	12,210.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	2,000	14.30	28,600.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	885	32.68	28,921.80	

51JOB INC-ADR	300	68.79	20,637.00	
DP WORLD LTD	1,270	17.15	21,780.50	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,200	30.11	36,132.00	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,250	57.50	71,875.00	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,200	27.63	88,416.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	3,550	34.98	124,179.00	
58.COM INC-ADR	860	58.06	49,931.60	
AUTOHOME INC-ADR	520	86.69	45,078.80	
BAIDU INC - SPON ADR	2,650	179.56	475,834.00	
MOMO INC-SPON ADR	1,350	24.57	33,169.50	
NETEASE INC-ADR	782	236.61	185,029.02	
SINA CORP	630	63.22	39,828.60	
WEIBO CORP-SPON ADR	330	61.62	20,334.60	
YY INC-ADR	420	62.66	26,317.20	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	12,230	153.06	1,871,923.80	
BAOZUN INC-SPN ADR	200	33.54	6,708.00	
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	3,620	28.57	103,423.40	
JD.COM INC-ADR	7,020	20.93	146,928.60	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,300	5.20	22,360.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	3,115	13.85	43,158.32	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,150	24.66	28,359.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	31.62	18,972.00	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	9,664	4.02	38,849.28	
CREDICORP LTD	644	220.68	142,117.92	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	25,566	11.69	298,866.54	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	7,102	1.23	8,778.07	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	200	46.46	9,292.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	8,400	1.35	11,382.00	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	400	27.74	11,096.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,500	7.31	32,895.00	
米ドル 小計	209,419		5,352,314.26 (602,242,400)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	132,300	10.19	1,348,137.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	31,800	42.49	1,351,182.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	246.29	338,648.75	

	MEXICHEM SAB DE CV-*	10,000	52.76	527,600.00	
	ALFA S.A.B.-A	28,900	22.06	637,534.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,000	68.41	136,820.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,400	145.56	494,904.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,970	285.51	562,454.70	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,750	181.56	317,730.00	
	ALSEA SAB DE CV	2,700	50.11	135,297.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	22,300	55.38	1,234,974.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	3,600	93.55	336,780.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	800	123.68	98,944.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	50,800	49.75	2,527,300.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	103.07	443,201.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	5,600	121.64	681,184.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	18,800	168.15	3,161,220.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,365	220.51	521,506.15	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,600	39.00	608,400.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	14,900	29.66	441,934.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	19,300	25.95	500,835.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	25,400	95.84	2,434,336.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	19,200	27.93	536,256.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	322,100	13.99	4,506,179.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	5,300	76.50	405,450.00	
	メキシコペソ 小計	746,560		24,288,806.60	(134,802,876)
ブラジルリアル	COSAN SA	700	34.29	24,003.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	66,900	24.77	1,657,113.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3,400	48.02	163,268.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,600	49.81	79,696.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	2,400	66.99	160,776.00	
	GERDAU SA-PREF	10,100	15.67	158,267.00	
	KLABIN SA - UNIT	6,900	15.93	109,917.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	4,300	38.15	164,045.00	
	VALE SA	30,100	51.29	1,543,829.00	
	EMBRAER SA	6,400	20.47	131,008.00	
	WEG SA	7,950	17.69	140,635.50	

CCR SA	11,700	12.25	143,325.00	
LOCALIZA RENT A CAR	4,900	27.07	132,643.00	
RUMO SA	10,800	16.21	175,068.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	12,900	10.14	130,806.00	
B2W CIA DIGITAL	900	37.98	34,182.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	7,300	19.47	142,131.00	
LOJAS RENNER S.A.	7,000	39.14	273,980.00	
MAGAZINE LUIZA SA	700	164.35	115,045.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	3,500	24.23	84,805.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	4,900	17.12	83,888.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1,500	83.60	125,400.00	
RAIA DROGASIL SA	2,300	61.43	141,289.00	
AMBEV SA	43,400	16.11	699,174.00	
BRF SA	5,100	22.80	116,280.00	
JBS SA	9,400	12.05	113,270.00	
M DIAS BRANCO SA	500	42.58	21,290.00	
NATURA COSMETICOS SA	1,600	42.66	68,256.00	
HYPERA SA	3,900	31.55	123,045.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	39,950	37.89	1,513,705.50	
BANCO DO BRASIL S.A.	7,800	44.03	343,434.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,900	43.65	170,235.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	45,000	35.56	1,600,200.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	43,300	12.12	524,796.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	20,000	28.50	570,000.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	6,400	28.69	183,616.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,300	75.90	98,670.00	
PORTO SEGURO SA	700	55.30	38,710.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	2,800	29.09	81,452.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	9,300	13.06	121,458.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,500	23.20	81,200.00	
CIELO SA	11,300	9.48	107,124.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	46.76	191,716.00	
TIM PARTICIPACOES SA	9,600	11.82	113,472.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,900	29.04	113,256.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	9,800	12.20	119,560.00	

	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,200	28.83	63,426.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	700	44.53	31,171.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,700	70.37	119,629.00	
	ブラジルリアル 小計	500,300		13,243,265.00 (381,538,464)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	3,614	8,975.50	32,437,457.00	
	EMPRESAS CMPC SA	11,717	2,246.90	26,326,927.30	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,121	29,746.00	33,345,266.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	6,694.40	19,822,118.40	
	S.A.C.I. FALABELLA	6,754	4,917.80	33,214,821.20	
	CENCOSUD SA	13,424	1,224.10	16,432,318.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,479	8,454.80	12,504,649.20	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	2,603.50	7,419,975.00	
	BANCO DE CHILE	230,670	96.01	22,146,626.70	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	386	43,444.00	16,769,384.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	612,457	51.81	31,731,397.17	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	6.42	12,082,760.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	5,531.50	5,537,031.50	
	AGUAS ANDINAS SA-A	31,578	378.68	11,957,957.04	
	COLBUN SA	83,944	140.85	11,823,512.40	
	ENEL AMERICAS SA	270,858	117.78	31,901,655.24	
ENEL CHILE SA	276,505	65.92	18,227,209.60		
	チリペソ 小計	3,431,319		343,681,066.15 (57,291,633)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	48,792	3,100.00	151,255,200.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	2,000	6,980.00	13,960,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	16,700.00	48,430,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,300	32,100.00	73,830,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,129	32,420.00	133,862,180.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	30,000	1,045.00	31,350,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,748	32,780.00	90,079,440.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	480	30,760.00	14,764,800.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,406	13,740.00	60,538,440.00	
	コロンビアペソ 小計	97,755		618,070,060.00 (22,126,908)	

ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	604	21.15	12,774.60	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	280	19.60	5,488.00	
	OPAP SA	2,215	8.55	18,938.25	
	JUMBO SA	1,110	13.82	15,340.20	
	ALPHA BANK AE	14,218	1.27	18,085.29	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,403	10.93	26,264.79	
ユーロ 小計		20,830		96,891.13	(12,435,976)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,237	128.50	158,954.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	13,819	7.83	108,202.77	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	3,410	5.19	17,697.90	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,600	26.58	95,688.00	
	KOC HOLDING AS	7,765	15.10	117,251.50	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	3,500	5.33	18,655.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	22.64	33,960.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	16.19	89,045.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	51.55	23,197.50	
	ARCELIK AS	1,000	15.47	15,470.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,102	83.85	176,252.70	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	21.10	40,512.00	
	AKBANK T.A.S.	21,716	6.89	149,623.24	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	22,540	7.97	179,643.80	
	TURKIYE HALK BANKASI	6,000	7.34	44,040.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,000	4.11	49,320.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,100	7.57	53,747.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,100	12.34	136,974.00		
トルコリラ 小計		126,259		1,508,234.91	(31,944,415)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	888.00	665,112.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,600	77.15	354,890.00	
	CEZ AS	1,553	539.50	837,843.50	
チェココルナ 小計		6,902		1,857,845.50	(9,214,913)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,230	3,084.00	9,961,320.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,233	5,585.00	6,886,305.00	



	OTP BANK PLC	1,985	11,270.00	22,370,950.00	
	ハンガリーフォリント 小計	6,448		39,218,575.00 (15,581,539)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	1,113	82.34	91,644.42	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,775	106.85	296,508.75	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	17,440	7.00	122,080.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	450	68.62	30,879.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,396	89.00	124,244.00	
	CCC SA	371	204.20	75,758.20	
	LPP SA	13	7,755.00	100,815.00	
	CD PROJEKT SA	659	144.00	94,896.00	
	CYFROWY POLSAT SA	3,290	22.20	73,038.00	
	DINO POLSKA SA	350	98.60	34,510.00	
	ALIOR BANK SA	690	54.85	37,846.50	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	250	69.50	17,375.00	
	BANK MILLENNIUM SA	2,800	9.01	25,228.00	
	BANK PEKAO SA	1,633	108.75	177,588.75	
	MBANK SA	65	416.20	27,053.00	
	PKO BANK POLSKI SA	8,156	40.03	326,484.68	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	345	347.00	119,715.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	5,852	42.86	250,816.72	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	4.84	20,328.00	
PGE SA	8,891	11.65	103,580.15		
	ポーランドズロチ 小計	60,739		2,150,389.17 (64,339,643)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	7,000	3.15	22,050.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	18,000	7.30	131,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	246,000	6.41	1,576,860.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	31,000	17.42	540,020.00	
	CNOOC LTD	171,000	12.78	2,185,380.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	30,000	9.20	276,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	204,000	5.31	1,083,240.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	18,000	6.93	124,740.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	48,000	2.74	131,520.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	4,000	6.09	24,360.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	12,000	38.60	463,200.00	
BBMG CORP-H	25,000	2.54	63,500.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	27,500	4.49	123,475.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	45,000	3.09	139,050.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	38,000	5.73	217,740.00	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	16,000	5.07	81,120.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	24,000	7.20	172,800.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	3.54	60,888.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.33	139,950.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	19,000	7.09	134,710.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	24,000	3.58	85,920.00	
MMG LTD	32,000	3.64	116,480.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	17,000	8.13	138,210.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	3.54	120,360.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,000	7.42	89,040.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	2.89	167,620.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	5.24	136,240.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	61.20	134,640.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	7.42	311,640.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	15,000	24.25	363,750.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	19,500	10.02	195,390.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	36,000	7.06	254,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	14,000	6.37	89,180.00	
CITIC LTD	53,000	12.92	684,760.00	
CRRC CORP LTD - H	40,000	7.19	287,600.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	12.24	299,880.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	67,500	2.76	186,300.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	16.04	128,320.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	1.94	62,080.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	14,000	2.66	37,240.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	7,000	16.76	117,320.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	6.66	116,550.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,500	12.32	117,040.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	20,000	8.51	170,200.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	7.79	46,740.00	

ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	5,300	43.95	232,935.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	33,000	6.76	223,080.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	4,000	12.66	50,640.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	6.42	64,200.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	7.39	133,020.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	18,000	8.44	151,920.00	
CAR INC	9,000	6.70	60,300.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	4.79	19,160.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	14.76	206,640.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	5.35	128,400.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	4.22	42,200.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	34,500	3.02	104,190.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	7.44	133,920.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	10.54	126,480.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	9,500	15.24	144,780.00	
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	3.04	45,600.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.40	115,200.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,000	4.38	52,560.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	28,000	6.59	184,520.00	
BYD CO LTD-H	6,000	54.60	327,600.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	26,000	3.86	100,360.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	26,000	6.90	179,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	24.05	125,060.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	45,000	14.32	644,400.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	37,000	4.66	172,420.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	7.48	209,440.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	11.76	129,360.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,000	36.30	363,000.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	12,000	18.24	218,880.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	180,000	0.26	46,800.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	7,000	98.75	691,250.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	12,000	2.20	26,400.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.23	172,200.00	
CHINA LITERATURE LTD	1,800	40.60	73,080.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	53,700	310.60	16,679,220.00	

GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	43,000	0.68	29,240.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	16.14	32,280.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	23,500	8.62	202,570.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	24,000	2.85	68,400.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	25,000	23.85	596,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	14,000	27.70	387,800.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	7,500	5.76	43,200.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	10.26	184,680.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	30.70	61,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	5,000	6.63	33,150.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	47,000	5.55	260,850.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	3,000	19.94	59,820.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	6,500	62.55	406,575.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	32,000	7.02	224,640.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	20,000	6.68	133,600.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,200	17.86	110,732.00
SINOPHARM GROUP CO-H	10,800	35.00	378,000.00
3SBIO INC	13,000	10.24	133,120.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	10,000	7.77	77,700.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	17,500	11.30	197,750.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	5.15	123,600.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	42,000	13.22	555,240.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	12.12	72,720.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	7,500	5.60	42,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	5,500	25.15	138,325.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	17,000	1.73	29,410.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	64,500	5.38	347,010.00
SSY GROUP LTD	10,000	7.16	71,600.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	4,000	10.70	42,800.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,500	59.00	265,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	285,000	3.42	974,700.00
BANK OF CHINA LTD-H	757,000	3.31	2,505,670.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	81,000	5.85	473,850.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	83,000	4.74	393,420.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	908,000	6.49	5,892,920.00

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	11,000	3.47	38,170.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	38,000	31.70	1,204,600.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	58,600	5.57	326,402.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	10,000	4.38	43,800.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	659,000	5.47	3,604,730.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	29,000	4.47	129,630.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	98,000	2.03	198,940.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	8,000	24.00	192,000.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	10,000	14.36	143,600.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	37,000	4.01	148,370.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.53	157,590.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	10,800	15.28	165,024.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	22,000	14.24	313,280.00
FAR EAST HORIZON LTD	22,000	7.54	165,880.00
GF SECURITIES CO LTD-H	10,600	11.36	120,416.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	15.66	119,016.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	8.45	267,020.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,400	12.78	209,592.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	72,000	16.44	1,183,680.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	23,600	26.80	632,480.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	1.61	88,550.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,800	24.75	366,300.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	7,700	33.05	254,485.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	69,000	3.19	220,110.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	62,000	7.86	487,320.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	49,500	75.00	3,712,500.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,700	30.45	51,765.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	9.99	179,820.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	26,000	25.00	650,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	52,000	3.55	184,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	38,000	26.45	1,005,100.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	26,000	29.25	760,500.00
CHINA VANKE CO LTD-H	12,300	26.50	325,950.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	26,000	3.76	97,760.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	74,000	9.24	683,760.00

FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	6,000	4.97	29,820.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	8,000	6.05	48,400.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	11.86	137,576.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	10,000	13.44	134,400.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	15,000	2.38	35,700.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	6.85	27,400.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	16,000	8.98	143,680.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	14,500	22.25	322,625.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	10,000	2.55	25,500.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	12,000	19.22	230,640.00
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.78	49,840.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	13,000	3.46	44,980.00
SOHO CHINA LTD	12,000	2.96	35,520.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	24,000	25.75	618,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	24,000	1.41	33,840.00
YUZHOU PROPERTIES CO	12,000	3.30	39,600.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	27,000	7.65	206,550.00
KINGSOFT CORP LTD	5,000	12.58	62,900.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	20.80	187,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	6,500	50.75	329,875.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,500	10.64	37,240.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	5.45	81,750.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	7,000	22.75	159,250.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	15,500	7.30	113,150.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	22.40	76,160.00
LENOVO GROUP LTD	70,000	5.51	385,700.00
MEITU INC	7,000	3.00	21,000.00
SUNNY OPTICAL TECH	7,000	67.30	471,100.00
ZTE CORP-H	9,600	15.60	149,760.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	5.98	71,760.00
CHINA MOBILE LTD	58,000	77.55	4,497,900.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	126,000	3.96	498,960.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	398,000	1.24	493,520.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	8.75	490,000.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	5,000	45.40	227,000.00

	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	56,000	4.37	244,720.00	
	CGN POWER CO LTD-H	105,000	1.86	195,300.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	16,200	28.35	459,270.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	5.80	185,600.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.78	105,020.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,000	31.45	251,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	18,000	14.78	266,040.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	1.88	60,160.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	7,000	70.00	490,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	28,000	15.00	420,000.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	3.44	68,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	42,000	5.00	210,000.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	58,000	2.27	131,660.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	6.09	66,990.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	15.16	45,480.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	19,000	7.29	138,510.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	10,000	2.94	29,400.00	
	香港ドル 小計	8,567,400		82,397,386.00	(1,186,522,358)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	37,000	3.18	117,660.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,600	25.30	65,780.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,800	9.20	209,760.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,400	4.83	79,212.00	
	GAMUDA BHD	13,300	2.35	31,255.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,800	9.72	27,216.00	
	IJM CORP BHD	23,600	1.67	39,412.00	
	SIME DARBY BERHAD	17,000	2.34	39,780.00	
	AIRASIA GROUP BHD	7,500	3.12	23,400.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	9,900	7.81	77,319.00	
	MISC BHD	9,000	6.10	54,900.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.73	25,364.00	
	GENTING BHD	20,400	6.26	127,704.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	28,900	2.87	82,943.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	1,800	37.28	67,104.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,700	32.70	55,590.00	

	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.69	29,070.00	
	IOI CORP BHD	19,700	4.35	85,695.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,300	24.14	103,802.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	144.50	86,700.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,820	17.00	98,940.00	
	QL RESOURCES BHD	8,400	6.74	56,616.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,600	4.69	110,684.00	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	13,600	6.25	85,000.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.36	129,176.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	14,600	5.90	86,140.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	6,500	4.00	26,000.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	19,000	4.40	83,600.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	43,700	5.78	252,586.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,500	20.60	133,900.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,500	19.36	29,040.00	
	MALAYAN BANKING BHD	35,200	9.42	331,584.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	28,100	24.80	696,880.00	
	RHB BANK BHD	5,500	5.34	29,370.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	11,000	1.69	18,590.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	11,900	0.97	11,543.00	
	SP SETIA BHD	7,000	2.38	16,660.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,200	3.88	117,176.00	
	DIGI.COM BHD	30,200	4.49	135,598.00	
	MAXIS BHD	22,900	5.40	123,660.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	5,000	2.61	13,050.00	
	PETRONAS GAS BHD	6,900	19.10	131,790.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	28,500	13.70	390,450.00	
	YTL CORP BHD	19,380	1.05	20,349.00	
	マレーシアリングット 小計	658,200		4,558,048.00	(123,067,296)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	13,000	17.50	227,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	6,700	48.75	326,625.00	
	IRPC PCL - NVDR	51,600	6.10	314,760.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	12,900	135.00	1,741,500.00	
	PTT PCL-NVDR	102,700	49.50	5,083,650.00	



	THAI OIL PCL-NVDR	11,200	73.50	823,200.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	54.50	899,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	21,200	79.25	1,680,100.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	3,600	440.00	1,584,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	41,700	65.25	2,720,925.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	78,900	9.20	725,880.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	63,000	9.55	601,650.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	26,100	35.75	933,075.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	42,000	15.40	646,800.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	69.00	227,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	12,000	53.50	642,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	45,300	71.50	3,238,950.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	37,900	25.25	956,975.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	9,000	17.30	155,700.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	37,200	26.75	995,100.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	2,800	196.50	550,200.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	2,700	213.00	575,100.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,900	192.50	3,253,250.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	41,400	20.50	848,700.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	16,800	139.00	2,335,200.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	85,000	2.34	198,900.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,800	49.25	384,150.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	13,200	76.50	1,009,800.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	30,000	10.10	303,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,200	69.25	152,350.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	9,600	175.00	1,680,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	102,100	5.95	607,495.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	900	243.00	218,700.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	6,300	86.25	543,375.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	5,200	76.00	395,200.00	
	タイパーツ 小計	978,700		37,580,760.00 (128,902,006)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	14,500	50.30	729,350.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	18,000	11.86	213,480.00	
	DMCI HOLDINGS INC	18,000	12.58	226,440.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	21,700	50.10	1,087,170.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,440	940.00	2,293,600.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,500	94.50	236,250.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	295.00	1,327,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,510	127.00	1,207,770.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	7,200	94.25	678,600.00	
	BDO UNIBANK INC	19,610	133.20	2,612,052.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	19,320	79.80	1,541,736.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	160.00	224,000.00	
	AYALA CORPORATION	2,480	910.00	2,256,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	704	920.00	647,680.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.77	691,650.00	
	AYALA LAND INC	71,900	40.75	2,929,925.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	4.80	470,400.00	
	ROBINSONS LAND CO	22,000	21.00	462,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	100,100	36.00	3,603,600.00	
	GLOBE TELECOM INC	430	2,076.00	892,680.00	
	PLDT INC	870	1,165.00	1,013,550.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	33.00	528,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,400	376.00	526,400.00	
	フィリピンペソ 小計	597,564		26,400,633.00 (56,233,348)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,300.00	196,170,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	3,990.00	159,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	16,100	29,375.00	472,937,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	11,500.00	309,350,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,900	20,700.00	287,730,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	10,700.00	160,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	30,700	11,875.00	364,562,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	4,520.00	83,620,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	182,800	8,225.00	1,503,530,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	36,000	1,900.00	68,400,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	71,900	7,000.00	503,300,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,700	83,825.00	393,977,500.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	3,730.00	339,803,000.00	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	28,400	9,700.00	275,480,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	30,000	6,700.00	201,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	14,300	44,000.00	629,200,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	220,000	1,635.00	359,700,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	95,400	25,950.00	2,475,630,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	22,000	7,375.00	162,250,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	170,000	7,500.00	1,275,000,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	71,300	8,575.00	611,397,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	540,900	3,620.00	1,958,058,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	2,740.00	71,240,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	1,345.00	88,770,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	635.00	61,595,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	487,500	3,670.00	1,789,125,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	13,000	3,960.00	51,480,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	81,000	2,130.00	172,530,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,661,300		15,025,936,000.00	(117,202,300)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	590	50,700.00	29,913,000.00	
	S-OIL CORP	428	108,500.00	46,438,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	588	187,500.00	110,250,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	800	19,450.00	15,560,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	44,750.00	35,218,250.00	
	KOREA ZINC CO LTD	85	433,500.00	36,847,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	110	88,400.00	9,724,000.00	
	LG CHEM LTD	472	351,500.00	165,908,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	166	278,500.00	46,231,000.00	
	OCI CO LTD	198	108,500.00	21,483,000.00	
	POSCO	756	249,500.00	188,622,000.00	
	POSCO CHEMTECH CO LTD	291	64,500.00	18,769,500.00	
	CJ CORP	181	127,000.00	22,987,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	296	97,100.00	28,741,600.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	582	4,970.00	2,892,540.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	33,550.00	17,244,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	32,500.00	18,850,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	531	43,750.00	23,231,250.00	

HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	41,500.00	11,578,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	760	56,900.00	43,244,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	367	135,500.00	49,728,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	97	400,500.00	38,848,500.00	
KCC CORP	65	287,500.00	18,687,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	777	32,000.00	24,864,000.00	
LG CORP	899	70,500.00	63,379,500.00	
LOTTE CORP	242	54,300.00	13,140,600.00	
POSCO DAEWOO CORP.	500	18,800.00	9,400,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	702	105,500.00	74,061,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	19,350.00	31,037,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	4,450	7,410.00	32,974,500.00	
SK HOLDINGS CO LTD	294	268,500.00	78,939,000.00	
S-1 CORPORATION	210	104,000.00	21,840,000.00	
CJ LOGISTICS	36	160,500.00	5,778,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	133	122,000.00	16,226,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	594	31,700.00	18,829,800.00	
PAN OCEAN CO LTD	950	4,460.00	4,237,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	637	42,400.00	27,008,800.00	
HANON SYSTEMS	2,300	9,920.00	22,816,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	617	181,000.00	111,677,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,507	111,000.00	167,277,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	72,500.00	17,400,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,425	30,950.00	75,053,750.00	
COWAY CO LTD	500	75,300.00	37,650,000.00	
FILA KOREA LTD	546	54,700.00	29,866,200.00	
HLB INC	309	83,800.00	25,894,200.00	
LG ELECTRONICS INC	992	66,900.00	66,364,800.00	
KANGWON LAND INC	1,025	32,750.00	33,568,750.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	320	22,700.00	7,264,000.00	
KAKAO CORP	472	114,500.00	54,044,000.00	
NAVER CORP	1,359	121,000.00	164,439,000.00	
NCSOFT CORP	162	488,500.00	79,137,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	123	112,500.00	13,837,500.00	
PEARL ABYSS CORP	40	186,100.00	7,444,000.00	

CJ ENM CO LTD	113	218,000.00	24,634,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	324	79,000.00	25,596,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	183	91,500.00	16,744,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	83	210,000.00	17,430,000.00	
SHINSEGAE INC	79	268,000.00	21,172,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	99	194,000.00	19,206,000.00	
E-MART INC	200	192,500.00	38,500,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	101	38,050.00	3,843,050.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	85	340,500.00	28,942,500.00	
KT&G CORP	1,063	108,000.00	114,804,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	185	114,500.00	21,182,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	731,000.00	9,503,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	348	169,500.00	58,986,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	205	62,900.00	12,894,500.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	99	1,139,000.00	112,761,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	523	81,400.00	42,572,200.00	
CELLTRION INC	786	245,500.00	192,963,000.00	
CELLTRION PHARM INC	60	63,400.00	3,804,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	65	468,000.00	30,420,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	76	76,200.00	5,791,200.00	
MEDY-TOX INC	45	586,900.00	26,410,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	154	334,500.00	51,513,000.00	
SILLAJEN INC	564	80,200.00	45,232,800.00	
VIROMED CO LTD	138	198,300.00	27,365,400.00	
YUHAN CORP	95	216,500.00	20,567,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	1,900	7,570.00	14,383,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	750	8,680.00	6,510,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	2,731	36,650.00	100,091,150.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,691	14,800.00	25,026,800.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	3,851	47,050.00	181,189,550.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,141	41,300.00	171,023,300.00	
WOORI BANK	4,802	15,650.00	75,151,300.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	434	65,300.00	28,340,200.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,101	6,930.00	28,419,930.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	620	13,650.00	8,463,000.00	

	SAMSUNG CARD CO	180	32,350.00	5,823,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	698	31,550.00	22,021,900.00	
	DB INSURANCE CO LTD	482	69,400.00	33,450,800.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	4,260.00	17,563,980.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	720	39,400.00	28,368,000.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	200	29,200.00	5,840,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	282	271,500.00	76,563,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	651	85,200.00	55,465,200.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	321	194,500.00	62,434,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	2,274	16,950.00	38,544,300.00	
	LG INNOTEK CO LTD	160	94,300.00	15,088,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	524	116,500.00	61,046,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	47,500	40,950.00	1,945,125,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	5,200	34,000.00	176,800,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	500	208,000.00	104,000,000.00	
	KT CORP	75	30,300.00	2,272,500.00	
	LG UPLUS CORP	1,512	17,600.00	26,611,200.00	
	SK TELECOM	190	283,000.00	53,770,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,425	31,250.00	75,781,250.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	50,800.00	11,430,000.00	
	SK HYNIX INC	5,536	66,800.00	369,804,800.00	
	韓国ウォン 小計	138,973		7,135,687,450.00 (714,995,882)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	113.00	1,356,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	33.50	737,000.00	
	CHINA STEEL CORP	115,000	23.90	2,748,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	32,000	105.50	3,376,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	43,000	100.50	4,321,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	47,000	73.20	3,440,400.00	
	TAIWAN CEMENT	43,100	35.05	1,510,655.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	319.00	319,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	32,000	28.75	920,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,050	234.50	480,725.00	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	10.80	183,600.00	
	EVA AIRWAYS CORP	9,733	15.55	151,348.15	

EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,550	12.00	138,600.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	21,000	30.55	641,550.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	19,000	41.80	794,200.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	332.00	670,640.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,000	191.00	764,000.00
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	4,000	33.50	134,000.00
GIANT MANUFACTURING	2,000	148.00	296,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	237.50	237,500.00
POU CHEN	23,000	33.80	777,400.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	85.30	204,720.00
TATUNG CO LTD	21,000	36.95	775,950.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	242.00	484,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	313.00	1,565,000.00
STANDARD FOODS CORP	3,120	48.60	151,632.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	44,000	68.90	3,031,600.00
TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	151.50	151,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	59,348	17.65	1,047,492.20
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	142,000	10.05	1,427,100.00
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	159,000	20.20	3,211,800.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	90,830	20.35	1,848,390.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	92,477	19.85	1,835,668.45
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	72,810	17.70	1,288,737.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	100,000	25.85	2,585,000.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	114,995	10.45	1,201,697.75
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	86,630	13.50	1,169,505.00
TAIWAN BUSINESS BANK	51,139	10.65	544,630.35
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	83,754	17.90	1,499,196.60
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,200	97.30	1,089,760.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	68,000	48.00	3,264,000.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	96,000	15.30	1,468,800.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	80,000	48.15	3,852,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	29.30	771,176.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	99,835	10.00	998,350.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	10,000	46.30	463,000.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	4,320	47.70	206,064.00

ACER INC	31,000	19.30	598,300.00	
ADVANTECH CO LTD	4,000	230.50	922,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	214.00	1,498,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	12.55	1,079,300.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	6,000	236.00	1,416,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	9,015	60.80	548,112.00	
COMPAL ELECTRONICS	49,000	17.55	859,950.00	
DELTA ELECTRONICS INC	19,000	127.50	2,422,500.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	10,000	62.20	622,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	127,800	69.10	8,830,980.00	
INNOLUX CORP	91,000	10.20	928,200.00	
INVENTEC CORP	27,000	22.35	603,450.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	500	3,100.00	1,550,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	22,000	40.55	892,100.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	9,000	70.60	635,400.00	
PEGATRON CORP	19,000	50.80	965,200.00	
QUANTA COMPUTER INC	26,000	49.05	1,275,300.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	11,000	36.40	400,400.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	184.50	553,500.00	
WISTRON CORP	21,951	19.10	419,264.10	
WPG HOLDINGS LTD	11,960	36.70	438,932.00	
YAGEO CORPORATION	2,198	356.50	783,587.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	79.90	479,400.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	37,000	107.00	3,959,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	15,000	72.80	1,092,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	15,000	108.00	1,620,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	32,000	60.20	1,926,400.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	323.50	647,000.00	
MEDIATEK INC	14,000	233.50	3,269,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	55.70	668,400.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	137.50	825,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	239.00	239,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	8,000	70.60	564,800.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	138.50	692,500.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	232,000	221.00	51,272,000.00	



	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	11.20	1,276,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	10,000	58.10	581,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	116.50	233,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	37,000	14.10	521,700.00	
	新台湾ドル 小計	3,132,055		158,244,863.10 (577,593,750)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,346	325.40	2,390,388.40	
	COAL INDIA LTD	6,701	236.75	1,586,461.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,166	224.80	1,610,916.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	16,201	129.75	2,102,079.75	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,545	139.40	2,166,973.00	
	PETRONET LNG LTD	2,982	210.60	628,009.20	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	27,076	1,133.80	30,698,768.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	6,999	212.45	1,486,937.55	
	ASIAN PAINTS LTD	2,681	1,318.65	3,535,300.65	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,105	802.30	2,491,141.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	11,115	218.80	2,431,962.00	
	JSW STEEL LTD	7,943	302.40	2,401,963.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,412	1,140.10	1,609,821.20	
	SHREE CEMENT LTD	98	16,337.90	1,601,114.20	
	TATA STEEL LTD	3,407	509.30	1,735,185.10	
	ULTRATECH CEMENT LTD	895	3,932.50	3,519,587.50	
	UPL LTD	3,443	757.70	2,608,761.10	
	VEDANTA LTD	12,337	195.70	2,414,350.90	
	ASHOK LEYLAND LTD	8,200	102.90	843,780.00	
	HAVELLS INDIA LTD	2,526	676.70	1,709,344.20	
	LARSEN & TOUBRO LTD	4,340	1,399.90	6,075,566.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	5,155	373.45	1,925,134.75	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,995	660.85	1,318,395.75	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	850	1,021.05	867,892.50	
BAJAJ AUTO LTD	800	2,786.20	2,228,960.00		
BHARAT FORGE LTD	2,575	505.50	1,301,662.50		
BOSCH LTD	73	18,533.05	1,352,912.65		
EICHER MOTORS LTD	124	22,369.25	2,773,787.00		
HERO MOTOCORP LTD	370	3,066.80	1,134,716.00		

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	6,761	721.10	4,875,357.10	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	950	7,313.95	6,948,252.50	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	11,193	154.80	1,732,676.40	
TATA MOTORS LTD	14,842	162.40	2,410,340.80	
PAGE INDUSTRIES LTD	54	24,257.15	1,309,886.10	
TITAN CO LTD	2,932	916.60	2,687,471.20	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	4,637	477.40	2,213,703.80	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,191	1,513.15	1,802,161.65	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	564	3,005.35	1,695,017.40	
ITC LTD	33,153	274.05	9,085,579.65	
NESTLE INDIA LTD	220	10,404.60	2,289,012.00	
UNITED SPIRITS LTD	3,184	636.85	2,027,730.40	
DABUR INDIA LTD	5,088	411.45	2,093,457.60	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,395	752.10	2,553,379.50	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	6,302	1,824.30	11,496,738.60	
MARICO LTD	4,549	354.85	1,614,212.65	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,579	751.35	1,937,731.65	
CADILA HEALTHCARE LTD	870	349.40	303,978.00	
CIPLA LTD	3,351	513.60	1,721,073.60	
DIVI'S LABORATORIES LTD	700	1,491.80	1,044,260.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,084	2,692.55	2,918,724.20	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	600	644.55	386,730.00	
LUPIN LTD	2,417	841.30	2,033,422.10	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	800	2,085.60	1,668,480.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	7,697	411.25	3,165,391.25	
AXIS BANK LTD	16,090	603.95	9,717,555.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	15,263	1,951.35	29,783,455.05	
ICICI BANK LTD	21,463	352.20	7,559,268.60	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	2,636	716.85	1,889,616.60	
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,382	439.15	606,905.30	
STATE BANK OF INDIA	16,376	275.40	4,509,950.40	
YES BANK LTD	15,733	166.20	2,614,824.60	
BAJAJ FINANCE LTD	1,607	2,486.35	3,995,564.45	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,300	418.25	961,975.00	
REC LTD	3,000	104.65	313,950.00	

	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,483	1,093.90	1,622,253.70	
	BAJAJ FINSERV LTD	358	5,849.90	2,094,264.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	5,023	961.95	4,831,874.85	
	INFOSYS LTD	33,323	682.80	22,752,944.40	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	8,631	1,995.20	17,220,571.20	
	TECH MAHINDRA LTD	4,321	694.25	2,999,854.25	
	WIPRO LTD	10,349	333.30	3,449,321.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	12,772	303.95	3,882,049.40	
	BHARTI INFRA TEL LTD	2,400	252.85	606,840.00	
	VODAFONE IDEA LTD	14,000	33.80	473,200.00	
	GAIL INDIA LTD	7,475	334.70	2,501,882.50	
	NTPC LTD	18,566	137.85	2,559,323.10	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	14,819	182.65	2,706,690.35	
	TATA POWER CO LTD	14,068	79.45	1,117,702.60	
	インドルピー 小計	526,011		291,338,479.85 (466,141,567)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	1,800	137.99	248,382.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	1,440	41.00	59,040.00	
	MASRAF AL RAYAN	3,700	42.21	156,177.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,201	155.99	187,343.99	
	QATAR NATIONAL BANK	4,180	196.50	821,370.00	
	QATAR INSURANCE CO	1,130	36.55	41,301.50	
	BARWA REAL ESTATE CO	2,143	40.69	87,198.67	
	EZDAN HOLDING GROUP	7,870	12.95	101,916.50	
	OOREDOO QPSC	580	81.92	47,513.60	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	500	186.90	93,450.00	
	カタールリアル 小計	24,544		1,843,693.26 (57,080,743)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,451	128.19	314,193.69	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	320	483.36	154,675.20	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	3,882	153.42	595,576.44	
	GOLD FIELDS LTD	8,800	43.02	378,576.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	750	272.86	204,645.00	
	MONDI LTD	1,146	299.06	342,722.76	
	SAPPI LIMITED	5,098	77.11	393,106.78	

SASOL LTD	5,609	431.44	2,419,946.96
BIDVEST GROUP LTD	3,162	199.89	632,052.18
NASPERS LTD-N SHS	4,132	2,814.00	11,627,448.00
MR PRICE GROUP LTD	2,412	248.31	598,923.72
THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	175.53	412,846.56
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	4,631	89.21	413,131.51
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	9,500	55.35	525,825.00
BID CORP LTD	3,032	256.19	776,768.08
CLICKS GROUP LTD	2,381	174.10	414,532.10
PICK N PAY STORES LTD	4,350	70.35	306,022.50
SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,022	189.06	760,399.32
SPAR GROUP LIMITED/THE	1,400	194.48	272,272.00
TIGER BRANDS LTD	1,537	269.78	414,651.86
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	26.49	338,091.87
NETCARE LTD	12,611	25.79	325,237.69
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,629	144.55	524,571.95
ABSA GROUP LTD	6,561	154.92	1,016,430.12
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	391	1,069.00	417,979.00
NEDBANK GROUP LTD	3,670	262.50	963,375.00
STANDARD BANK GROUP LTD	12,461	171.60	2,138,307.60
FIRSTRAND LTD	32,166	65.40	2,103,656.40
INVESTEC LTD	2,200	79.71	175,362.00
PSG GROUP LTD	1,100	228.50	251,350.00
REINET INVESTMENTS SCA	1,442	212.21	306,006.82
REMGRO LTD	4,835	197.98	957,233.30
RMB HOLDINGS LTD	6,716	77.24	518,743.84
DISCOVERY LTD	3,279	146.95	481,849.05
LIBERTY HOLDINGS LTD	800	105.00	84,000.00
MMI HOLDINGS LTD	3,900	17.03	66,417.00
OLD MUTUAL LTD	44,402	21.50	954,643.00
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,300	36.06	191,118.00
SANLAM LTD	17,452	73.72	1,286,561.44
NEPI ROCKCASTLE PLC	3,590	108.68	390,161.20
MTN GROUP LTD	15,190	86.39	1,312,264.10
TELKOM SA SOC LTD	2,500	60.12	150,300.00

	VODACOM GROUP LTD	5,505	123.16	677,995.80
	南アフリカランド 小計	273,430		37,589,970.84 (298,088,468)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	21,748	8.13	176,811.24
	DUBAI ISLAMIC BANK	13,700	5.13	70,281.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	26,833	13.92	373,515.36
	ALDAR PROPERTIES PJSC	26,700	1.58	42,186.00
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	8,000	1.68	13,440.00
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	9,000	4.78	43,020.00
	EMAAR MALLS PJSC	9,000	1.72	15,480.00
	EMAAR PROPERTIES PJSC	34,480	4.17	143,781.60
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	16,189	16.78	271,651.42
	アラブディルハム 小計	165,650		1,150,166.62 (35,287,111)
オフショア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	3,200	5.86	18,752.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	500	19.08	9,540.00
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	5.35	2,675.00
	PETROCHINA CO LTD-A	2,100	7.57	15,897.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	700	7.86	5,502.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	7.72	2,316.00
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	6.17	2,468.00
	ANGANG STEEL CO LTD-A	600	5.50	3,300.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	500	31.04	15,520.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	2,000	6.92	13,840.00
	BBMG CORPORATION-A	900	3.87	3,483.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	800	4.05	3,240.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	9.76	4,880.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	300	13.87	4,161.00
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	3.00	4,500.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	3,900	1.54	6,006.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	13.29	3,987.00
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	25.71	5,142.00
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.10	2,440.00
	MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	3.65	2,555.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	400	8.40	3,360.00	

RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	10.24	4,096.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	300	28.09	8,427.00
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	4.15	2,075.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	5.02	3,012.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	33.61	6,722.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.06	3,090.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	200	35.50	7,100.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	9.25	3,700.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.05	3,220.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,800	3.40	6,120.00
AECC AVIATION POWER CO-A	200	23.60	4,720.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	14.71	5,884.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	31.23	3,123.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	14.69	1,469.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	11.83	3,549.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.84	3,420.00
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	200	11.11	2,222.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.70	2,850.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	1,300	11.29	14,677.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	4,900	4.26	20,874.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	17.56	1,756.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,800	5.94	28,512.00
CRRCCORP LTD-A	2,200	9.10	20,020.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	7.84	4,704.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	200	18.81	3,762.00
HAN'S LASER TECHNOLOGY IN-A	100	32.97	3,297.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	600	15.15	9,090.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	3.14	5,652.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	500	18.28	9,140.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,000	4.83	4,830.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	800	8.19	6,552.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.03	4,024.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.88	1,764.00
SUZHOUGOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.86	3,544.00
TBEA CO LTD-A	400	7.03	2,812.00

WEICHAI POWER CO LTD-A	800	7.62	6,096.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	3.36	3,696.00
XIAMEN C & D INC-A	300	7.50	2,250.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.21	4,484.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	23.20	4,640.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	11.67	2,334.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	3.72	3,348.00
JIHUA GROUP CORP LTD-A	400	3.63	1,452.00
TUS-SOUND ENVIRONMEN-RES A	200	10.87	2,174.00
AIR CHINA LTD-A	800	8.34	6,672.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	5.29	6,877.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	7.37	8,107.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.36	3,540.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.09	4,908.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	2,100	7.92	16,632.00
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	3.26	3,260.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	1,000	3.66	3,660.00
S F HOLDING CO LTD-A	200	35.89	7,178.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	100	49.93	4,993.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	5.52	5,520.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	34.19	3,419.00
BYD CO LTD -A	200	56.89	11,378.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	200	22.46	4,492.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	6.29	3,145.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	21.96	4,392.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	10.37	2,074.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	300	17.82	5,346.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	900	24.72	22,248.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	13.87	1,387.00
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	5.55	2,220.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	18.46	1,846.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	400	36.48	14,592.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	20.95	2,095.00
HEILAN HOME CO LTD -A	200	8.53	1,706.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	900	38.48	34,632.00

OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	84.01	8,401.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	700	13.75	9,625.00
TCL CORP-A	1,900	2.56	4,864.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.07	3,628.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	300	58.45	17,535.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.01	6,611.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	13.81	2,762.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	11.98	2,396.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.42	1,242.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.67	1,835.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	19.17	3,834.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	25.83	2,583.00
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	300	10.02	3,006.00
WUHU SHUNRONG SANQI INTERA-A	200	11.58	2,316.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	4.36	2,180.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	11.73	2,346.00
SUNING.COM CO LTD-A	1,300	10.61	13,793.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	1,100	7.28	8,008.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	3.54	1,770.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	300	66.18	19,854.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	400	22.59	9,036.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	700	23.02	16,114.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	200	102.28	20,456.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	587.00	117,400.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	200	42.61	8,522.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	200	29.62	5,924.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	500	7.31	3,655.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	100	38.34	3,834.00
TONGWEI CO LTD-A	400	9.38	3,752.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	31.88	3,188.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	500	53.20	26,600.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	200	29.88	5,976.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.60	2,920.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	400	16.24	6,496.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	18.36	3,672.00



BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	29.02	5,804.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	23.55	2,355.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	45.07	4,507.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	38.09	7,618.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	500	58.38	29,190.00
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A	700	11.01	7,707.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	200	27.38	5,476.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	26.12	5,224.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	23.51	2,351.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	22.47	4,494.00
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	20.14	4,028.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	14.69	2,938.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	200	76.07	15,214.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	100	86.85	8,685.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,500	3.58	30,430.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,500	6.00	15,000.00
BANK OF CHINA LTD-A	5,400	3.60	19,440.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	4,400	5.86	25,784.00
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	200	11.12	2,224.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	7.71	3,855.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	1,200	6.29	7,548.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	900	6.95	6,255.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	500	16.77	8,385.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	1,200	11.55	13,860.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.63	3,378.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,000	6.63	6,630.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	4,300	3.85	16,555.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	2,500	28.58	71,450.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,900	6.07	23,673.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,400	7.72	10,808.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	6,000	5.35	32,100.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	2,500	16.03	40,075.00
PING AN BANK CO LTD-A	1,700	10.28	17,476.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,500	10.89	38,115.00
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	4.79	2,395.00

AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.54	4,086.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	5.68	4,544.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	600	14.07	8,442.00
CITIC SECURITIES CO-A	1,100	17.05	18,755.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.22	2,044.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	9.88	3,952.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	5.40	2,700.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	800	5.46	4,368.00
GF SECURITIES CO LTD-A	800	13.41	10,728.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	8.93	5,358.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	800	16.33	13,064.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.69	3,845.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	800	9.65	7,720.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.00	2,000.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	700	17.30	12,110.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	5.04	3,528.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	600	8.97	5,382.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.33	2,532.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,600	4.45	11,570.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	7.65	2,295.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	7.04	2,112.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.38	4,190.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	300	21.55	6,465.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	700	30.60	21,420.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	6.05	3,630.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	300	43.79	13,137.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	1,300	63.00	81,900.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	400	27.80	11,120.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	900	18.21	16,389.00
CHINA VANKE CO LTD -A	1,400	25.34	35,476.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.80	2,720.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	300	26.32	7,896.00
GEMDALE CORP-A	600	9.69	5,814.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.15	7,380.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	5.86	4,102.00

POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	1,700	12.68	21,556.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.26	4,956.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	200	14.19	2,838.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.00	3,600.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	500	7.87	3,935.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	800	3.62	2,896.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	22.16	6,648.00	
AISINO CORP-A	200	23.15	4,630.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	28.90	2,890.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.17	2,868.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	100	55.38	5,538.00	
IFLYTEK CO LTD - A	300	24.48	7,344.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	600	3.83	2,298.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	200	23.90	4,780.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	4,700	2.75	12,925.00	
DONGXU OPTOELECTRONIC TECH-A	800	4.72	3,776.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,700	5.88	9,996.00	
GOERTEK INC -A	500	7.31	3,655.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	7.60	2,280.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	1,300	27.31	35,503.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	17.29	3,458.00	
NINESTAR CORP-A	100	24.04	2,404.00	
O-FILM TECH CO LTD-A	400	10.69	4,276.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	10.42	3,126.00	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	100	35.13	3,513.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	12.74	5,096.00	
ZTE CORP-A	500	19.99	9,995.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	3,400	5.26	17,884.00	
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	800	3.75	3,000.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,800	5.32	9,576.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	2,200	14.35	31,570.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.55	7,140.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.73	6,149.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	7.36	5,888.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.65	2,190.00	

SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	7.60	8,360.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	4.97	3,479.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	5.35	2,675.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	8.17	5,719.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	1,400	4.60	6,440.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	200	19.12	3,824.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	300	14.22	4,266.00	
オフショア人民元 小計	203,300		2,075,041.00 (33,864,669)	
合 計	23,133,658		5,126,498,265 (5,126,498,265)	

(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	31,700	683,769.00	
		メキシコペソ 小計	31,700	683,769.00 (3,794,917)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	212,960.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	8,600	116,530.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	28,867	682,704.55	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	2,850	242,734.50	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	51,557	502,680.75	
		RESILIENT REIT LTD	2,600	156,000.00	
	南アフリカランド 小計	106,574	1,913,609.80 (15,174,925)		
	合 計			18,969,842 (18,969,842)	

(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 45銘柄	100.0%		11.7%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.3%		2.6%
	投資証券 1銘柄		2.7%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	100.0%		7.4%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%		1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%		0.4%
ユーロ	株式 6銘柄	100.0%		0.2%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%		0.6%
チェココルナ	株式 3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 20銘柄	100.0%		1.3%
香港ドル	株式 202銘柄	100.0%		23.0%
マレーシアリングット	株式 44銘柄	100.0%		2.4%
タイバーツ	株式 35銘柄	100.0%		2.5%
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 28銘柄	100.0%		2.3%
韓国ウォン	株式 109銘柄	100.0%		13.9%
新台湾ドル	株式 86銘柄	100.0%		11.2%
インドルピー	株式 78銘柄	100.0%		9.1%
カタールリアル	株式 10銘柄	100.0%		1.1%
南アフリカランド	株式 43銘柄	95.2%		5.8%
	投資証券 6銘柄		4.8%	0.3%
アラブディルハム	株式 9銘柄	100.0%		0.7%
オフショア人民元	株式 238銘柄	100.0%		0.7%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2018年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	709,057,251
投資証券	13,487,988,320
派生商品評価勘定	23,204,772
未収入金	689,224
未収配当金	86,784,913
差入委託証拠金	13,175,000
流動資産合計	14,320,899,480
資産合計	14,320,899,480
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	444,984
前受金	35,158,600
未払解約金	15,300,000
未払利息	1,923
その他未払費用	8,174
流動負債合計	50,913,681
負債合計	50,913,681
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	12,246,315,328
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,023,670,471
元本等合計	14,269,985,799
純資産合計	14,269,985,799
負債純資産合計	14,320,899,480

### 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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	9,094,856,412円
期中追加設定元本額	16,980,152,216円
期中一部解約元本額	13,828,693,300円
期末元本額	12,246,315,328円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	420,868,692円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	260,989,493円
りそなラップ型ファンド(成長型)	591,530,243円
DCりそな グローバルバランス	4,200,052円
つみたてバランスファンド	114,469,079円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	10,051,088円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	3,040,766円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	2,743,944円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,062,032,788円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,231,861,267円
Smart-i リートインデックス	516,365,880円
Smart-i 8資産バランス 安定型	761,443円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	5,418,316円
Smart-i 8資産バランス 成長型	9,001,759円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,012,418,568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)	561,950円
2. 計算日における受益権の総数	12,246,315,328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	1.1652円
(10,000口当たり純資産額)	(11,652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

2018年12月10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

2018年12月10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）

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		356,578,856
合計		356,578,856

(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)

(2018年12月10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	720,784,212	-	743,544,000	22,759,788
合計		720,784,212	-	743,544,000	22,759,788

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	512	278,528,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,736	156,587,200	

森ヒルズリート投資法人	1,767	248,616,900
産業ファンド投資法人	1,795	195,655,000
アドバンス・レジデンス投資法人	1,501	455,553,500
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	914	153,095,000
アクティビア・プロパティーズ投資法人	738	340,956,000
G L P 投資法人	3,817	429,030,800
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	587	169,466,900
日本プロロジスリート投資法人	2,066	483,444,000
星野リゾート・リート投資法人	234	121,446,000
O n e リート投資法人	224	57,590,400
イオンリート投資法人	1,581	201,419,400
ヒューリックリート投資法人	1,245	207,292,500
日本リート投資法人	497	182,399,000
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	9,131	148,104,820
日本ヘルスケア投資法人	71	11,928,000
積水ハウス・リート投資法人	3,975	273,082,500
トーセイ・リート投資法人	297	32,283,900
ケネディクス商業リート投資法人	565	138,764,000
ヘルスケア&メディカル投資法人	204	22,868,400
サムティ・レジデンシャル投資法人	308	27,104,000
野村不動産マスターファンド投資法人	4,566	676,681,200
いちごホテルリート投資法人	269	36,261,200
ラサールロジポート投資法人	1,162	121,196,600
スターアジア不動産投資法人	478	49,998,800
マリモ地方創生リート投資法人	132	14,454,000
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	263	85,475,000
大江戸温泉リート投資法人	249	20,592,300
さくら総合リート投資法人	333	28,737,900
投資法人みらい	415	75,198,000
森トラスト・ホテルリート投資法人	361	47,832,500
三菱地所物流リート投資法人	163	39,935,000
C R E ロジスティクスファンド投資法人	154	16,231,600
ザイマックス・リート投資法人	142	15,946,600
タカラレーベン不動産投資法人	230	20,125,000
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	238	20,491,800
日本ビルファンド投資法人	1,492	1,062,304,000
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,541	952,338,000
日本リテールファンド投資法人	2,912	639,475,200
オリックス不動産投資法人	3,069	550,885,500
日本プライムリアルティ投資法人	975	426,075,000
プレミア投資法人	1,465	180,781,000
東急リアル・エステート投資法人	1,033	170,445,000

グローバル・ワン不動産投資法人	985	114,949,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,398	593,630,600	
森トラスト総合リート投資法人	1,101	177,040,800	
インヴィンシブル投資法人	5,390	251,713,000	
フロンティア不動産投資法人	524	228,202,000	
平和不動産リート投資法人	959	114,504,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,016	229,514,400	
福岡リート投資法人	797	134,055,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	477	350,118,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,278	119,365,200	
大和証券オフィス投資法人	356	249,912,000	
阪急阪神リート投資法人	693	100,415,700	
スタートアップリート投資法人	243	40,119,300	
大和ハウスリート投資法人	1,929	476,463,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,460	362,598,000	
日本賃貸住宅投資法人	1,733	147,998,200	
ジャパンエクセレント投資法人	1,379	210,711,200	
合計	82,125	13,487,988,320	

(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先進国リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2018年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	80,561,023
コール・ローン	10,399,875
投資証券	8,606,114,260
未収入金	15,260,523
未収配当金	7,708,549
流動資産合計	8,720,044,230
資産合計	8,720,044,230
負債の部	
流動負債	

2018年12月10日現在

未払金	89,406,681
未払解約金	9,200,000
未払利息	28
その他未払費用	681
流動負債合計	98,607,390
負債合計	98,607,390
純資産の部	
元本等	
元本	8,033,074,914
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	588,361,926
元本等合計	8,621,436,840
純資産合計	8,621,436,840
負債純資産合計	8,720,044,230

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況 期首	2017年12月12日

期首元本額	6,251,996,628円
期中追加設定元本額	7,435,676,423円
期中一部解約元本額	5,654,598,137円
期末元本額	8,033,074,914円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	456,902,086円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	992,952,573円
りそなラップ型ファンド(成長型)	965,939,325円
DCりそな グローバルバランス	4,648,157円
つみたてバランスファンド	63,105,808円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	12,311,723円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	3,677,317円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	3,474,188円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	3,317,992,664円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	1,758,022,808円
Smart-i 先進国リートインデックス	434,709,043円
Smart-i 8資産バランス 安定型	841,923円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	6,000,426円
Smart-i 8資産バランス 成長型	11,488,787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)	1,008,086円
2. 計算日における受益権の総数	8,033,074,914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	1.0732円
(10,000口当たり純資産額)	(10,732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

2018年12月10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、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。
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

2018年12月10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。

## 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）

2018年12月10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	2018年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		213,751,742
合計		213,751,742

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	5,298	151,098.96	
		AGREE REALTY CORP	2,258	139,792.78	
		ALEXANDER'S INC	235	73,524.45	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,286	919,274.62	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,572	108,538.40	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	9,074	396,806.02	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	16,880	353,467.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST	3,575	99,599.50	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	10,547	496,552.76	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,557	227,671.48	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,236	24,661.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,399	1,772,745.39	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,220	21,223.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,608	1,369,280.64	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	2,809	28,005.73	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	12,680	177,773.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	20,374	340,042.06	
		BRT APARTMENTS CORP	100	1,125.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,220	578,024.60	
		CARETRUST REIT INC	5,510	111,081.60	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	12,565	32,292.05	
		CEDAR REALTY TRUST INC	7,920	27,957.60	
		CHATHAM LODGING TRUST	2,865	55,982.10	

CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,797	108,442.32	
CITY OFFICE REIT INC	3,175	34,829.75	
CLIPPER REALTY INC	1,350	16,875.00	
COLONY CAPITAL INC	32,742	198,743.94	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	8,378	179,959.44	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,023	31,743.69	
CORECIVIC INC	7,713	170,611.56	
CORESITE REALTY CORP	2,464	239,476.16	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	7,134	174,069.60	
COUSINS PROPERTIES INC	27,419	226,480.94	
CUBESMART	12,447	400,046.58	
CYRUSONE INC	6,907	396,669.01	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	13,959	140,287.95	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,113	1,633,156.36	
DOUGLAS EMMETT INC	10,590	389,712.00	
DUKE REALTY CORP	23,844	680,030.88	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,762	69,145.56	
EASTGROUP PROPERTIES INC	2,357	236,713.51	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	9,150	148,138.50	
EPR PROPERTIES	4,960	350,721.60	
EQUITY COMMONWEALTH	8,353	263,704.21	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,040	619,462.40	
EQUITY RESIDENTIAL	25,120	1,800,350.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,435	1,169,332.10	
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,677	856,419.90	
FARMLAND PARTNERS INC	1,320	7,616.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,090	682,161.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	8,224	262,181.12	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,533	128,011.92	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	7,980	60,328.80	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	3,875	37,548.75	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	13,983	485,489.76	
GEO GROUP INC/THE	8,265	190,342.95	
GETTY REALTY CORP	2,074	64,916.20	



GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,732	33,358.32	
GLADSTONE LAND CORP	420	5,632.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	800	7,768.00	
GLOBAL NET LEASE INC	4,438	88,804.38	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	6,172	52,894.04	
HCP INC	31,479	940,277.73	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,408	266,113.20	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	13,850	396,802.50	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,257	42,341.32	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	6,786	294,173.10	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	11,474	300,389.32	
HOST HOTELS & RESORTS INC	51,392	945,098.88	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	10,482	329,973.36	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	6,450	66,435.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	1,449	31,110.03	
INFRAREIT INC	2,841	60,257.61	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	600	29,964.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,900	46,992.00	
INVITATION HOMES INC	19,890	433,204.20	
IRON MOUNTAIN INC	19,126	651,240.30	
JBG SMITH PROPERTIES	7,423	292,391.97	
KILROY REALTY CORP	6,694	473,064.98	
KIMCO REALTY CORP	27,886	472,109.98	
KITE REALTY GROUP TRUST	5,214	86,708.82	
LEXINGTON REALTY TRUST	14,480	127,568.80	
LIBERTY PROPERTY TRUST	10,224	473,064.48	
LIFE STORAGE INC	3,088	312,412.96	
LTC PROPERTIES INC	2,690	119,731.90	
MACERICH CO/THE	7,110	360,050.40	
MACK-CALI REALTY CORP	5,660	122,482.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	71,800	54,927.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,150	21,231.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,942	406,295.74	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,826	796,999.84	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	5,772	79,595.88	

NATIONAL RETAIL PROPERTIES	10,665	541,995.30	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,558	104,961.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,802	225,420.90	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	6,318	31,463.64	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,579	57,744.03	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	3,640	57,766.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	13,711	511,420.30	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,050	27,709.50	
PARAMOUNT GROUP INC	14,464	205,533.44	
PARK HOTELS & RESORTS INC	14,107	425,467.12	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9,192	317,399.76	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,914	31,312.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	12,650	226,182.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	8,689	162,571.19	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2,429	36,507.87	
PROLOGIS INC	42,765	2,858,412.60	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,299	182,600.43	
PUBLIC STORAGE	10,188	2,181,658.32	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	3,453	139,742.91	
REALTY INCOME CORP	19,963	1,316,160.59	
REGENCY CENTERS CORP	11,373	739,927.38	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	7,645	137,151.30	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	14,288	183,172.16	
RETAIL VALUE INC	928	26,930.56	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6,025	195,210.00	
RLJ LODGING TRUST	11,508	224,751.24	
RPT REALTY	4,972	71,149.32	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,389	249,430.40	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	11,639	224,283.53	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	700	13,307.00	
SAUL CENTERS INC	830	43,965.10	
SELECT INCOME REIT	5,825	111,607.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	15,912	211,629.60	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,734	65,527.86	
SIMON PROPERTY GROUP INC	21,037	3,963,791.54	

	SITE CENTERS CORP	9,902	127,438.74	
	SL GREEN REALTY CORP	5,957	555,371.11	
	SPIRIT MTA REIT	2,853	25,734.06	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	27,937	213,997.42	
	STAG INDUSTRIAL INC	6,894	184,414.50	
	STORE CAPITAL CORP	12,823	393,409.64	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6,569	71,996.24	
	SUN COMMUNITIES INC	5,854	634,105.28	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	14,983	220,399.93	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	6,359	154,905.24	
	TAUBMAN CENTERS INC	4,035	215,428.65	
	TERRENO REALTY CORP	3,947	152,512.08	
	TIER REIT INC	3,626	84,485.80	
	UDR INC	18,436	782,239.48	
	UMH PROPERTIES INC	2,280	29,754.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	934	65,912.38	
	URBAN EDGE PROPERTIES	7,731	149,208.30	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,881	39,350.52	
	VENTAS INC	24,391	1,596,878.77	
	VEREIT INC	66,815	521,825.15	
	VICI PROPERTIES INC	24,788	533,685.64	
	VORNADO REALTY TRUST	11,850	837,321.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	11,582	71,229.30	
	WASHINGTON REIT	5,527	149,339.54	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	7,878	225,704.70	
	WELLTOWER INC	25,381	1,871,341.13	
	WHITESTONE REIT	2,655	37,647.90	
	WP CAREY INC	11,216	780,970.08	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	8,000	159,040.00	
	米ドル 小計	1,535,271	56,171,218.27 (6,320,385,479)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	1,620	22,971.60	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3,118	141,931.36	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,299	41,227.41	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,316	53,495.40	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,861	228,710.05
	CHOICE PROPERTIES REIT	9,603	116,676.45
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	5,166	61,475.40
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,460	45,291.40
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,120	25,821.60
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	5,561	73,627.64
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	3,400	34,374.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,242	53,830.42
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,604	87,947.32
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	9,578	205,064.98
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,680	48,796.80
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,000	50,610.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	720	13,132.80
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,512	38,767.68
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,395	35,172.20
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,358	256,671.24
	SLATE OFFICE REIT	1,569	10,935.93
	SLATE RETAIL REIT - U	2,120	25,143.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	4,576	147,942.08
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	3,300	30,756.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,000	11,960.00
	カナダドル 小計	94,178	1,862,332.96 (157,404,381)
ユーロ	AEDIFICA	1,099	83,194.30
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	11,398	143,728.78
	ALTAREA	224	39,468.80
	BEFIMMO	1,391	71,358.30
	BENI STABILI SPA	62,406	45,962.01
	COFINIMMO	1,458	160,525.80
	COVIVIO	3,620	313,492.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	2,966	84,056.44
	GECINA SA	3,800	469,300.00
	GREEN REIT PLC	41,464	59,956.94
	HAMBORNER REIT AG	5,026	43,977.50
	HIBERNIA REIT PLC	43,772	59,880.09

	ICADE	3,092	208,864.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,320	19,309.12
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	19,043	164,436.30
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,434	29,612.10
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	22,443	31,824.17
	KLEPIERRE	13,867	389,662.70
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,485	36,328.50
	MERCIALYS	3,438	42,768.72
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	24,740	277,582.80
	NSI NV	1,162	40,670.00
	RETAIL ESTATES	561	41,233.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	9,414	1,362,582.36
	VASTNED RETAIL NV	1,059	34,152.75
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,178	136,176.80
	WERELDHAVE NV	2,542	70,108.36
	ユーロ 小計	290,402	4,460,213.74 (572,468,433)
英bond	ASSURA PLC	162,807	89,543.85
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,285	89,890.90
	BRITISH LAND CO PLC	69,130	385,745.40
	CAPITAL & REGIONAL PLC	46,200	16,632.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	18,200	17,726.80
	DERWENT LONDON PLC	7,441	216,756.33
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	34,126	31,839.55
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	19,102	134,287.06
	HAMMERSON PLC	53,839	199,365.81
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	24,365	22,220.88
	INTU PROPERTIES PLC	59,235	67,498.28
	LAND SECURITIES GROUP PLC	50,662	416,644.28
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	47,659	84,833.02
	LXI REIT PLC	23,200	27,608.00
	NEWRIVER REIT PLC	18,735	39,624.52
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	44,228	48,473.88
	RDI REIT PLC	78,145	24,342.16
	REGIONAL REIT LTD	21,400	20,715.20
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	14,682	76,493.22

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	39,200	22,344.00	
	SEGRO PLC	69,612	422,266.39	
	SHAFTESBURY PLC	15,742	138,057.34	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	19,000	18,620.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	102,105	136,003.86	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	49,040	40,310.88	
	UNITE GROUP PLC	17,923	149,298.59	
	WORKSPACE GROUP PLC	8,057	67,034.24	
	英債券 小計	1,124,120	3,004,176.44 (430,017,815)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	22,800	76,836.00	
	ARENA REIT	14,244	34,897.80	
	BWP TRUST	33,692	124,323.48	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	17,600	51,392.00	
	CHARTER HALL GROUP	31,475	231,341.25	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	12,600	53,298.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	23,319	109,366.11	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	101,694	103,727.88	
	DEXUS	67,990	752,649.30	
	GDI PROPERTY GROUP	44,000	57,200.00	
	GOODMAN GROUP	109,030	1,194,968.80	
	GPT GROUP	118,740	651,882.60	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	19,226	73,058.80	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	14,520	46,318.80	
	INDUSTRIA REIT	5,250	14,122.50	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,320	34,526.00	
	MIRVAC GROUP	244,631	565,097.61	
	NATIONAL STORAGE REIT	39,211	69,599.52	
	PROPERTYLINK GROUP	37,600	44,556.00	
	RURAL FUNDS GROUP	18,937	42,418.88	
	SCENTRE GROUP	363,920	1,513,907.20	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	61,350	167,485.50	
	STOCKLAND	164,444	631,464.96	
	VICINITY CENTRES	219,495	605,806.20	
	VIVA ENERGY REIT	30,950	68,399.50	

オーストラリアドル 小計		1,828,038	7,318,644.69 (592,883,406)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	57,000	66,120.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	61,770	96,052.35
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	86,688	118,762.56
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	60,885	87,978.82
	STRIDE STAPLED GROUP	22,111	40,463.13
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	26,700	56,604.00
ニュージーランドドル 小計		315,154	465,980.86 (35,987,701)
香港ドル	CHAMPION REIT	147,000	805,560.00
	FORTUNE REIT	99,000	910,800.00
	LINK REIT	144,900	11,497,815.00
	PROSPERITY REIT	96,000	283,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	59,000	294,410.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	77,000	384,230.00
香港ドル 小計		622,900	14,176,015.00 (204,134,616)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	41,700	56,295.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	41,400	32,913.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	169,400	435,358.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	71,500	78,650.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	86,400	60,912.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	184,700	326,919.00
	CAPITALAND MALL TRUST	180,400	409,508.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	35,300	49,067.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	45,400	68,554.00
	ESR REIT	112,000	56,000.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	83,200	50,336.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	44,000	45,760.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	41,500	90,470.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	39,400	54,766.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	111,300	117,978.00
	KEPPEL DC REIT	56,600	78,108.00
	KEPPEL REIT	125,200	146,484.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	138,000	27,600.00

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	130,700	214,348.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	90,200	170,478.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	149,400	189,738.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	153,800	175,332.00	
		OUE HOSPITALITY TRUST	67,700	46,036.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	28,000	77,000.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	38,400	15,552.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	65,900	39,210.50	
		SPH REIT	42,500	42,925.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	96,600	64,722.00	
		SUNTEC REIT	152,100	269,217.00	
		シンガポールドル 小計	2,622,700	3,490,236.50 (286,548,416)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	14,365	208,148.85	
		イスラエルシュケル 小計	14,365	208,148.85 (6,284,013)	
		合計		8,606,114,260 (8,606,114,260)	

(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 156銘柄	100.0%	73.4%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.7%
英ポンド	投資証券 27銘柄	100.0%	5.0%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシュケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%



（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【中間財務諸表】

FWりそな国内債券インデックスファンド  
FWりそな国内株式インデックスファンド  
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)  
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)  
FWりそな新興国債券インデックスファンド  
FWりそな先進国株式インデックスファンド  
FWりそな新興国株式インデックスファンド  
FWりそな国内リートインデックスファンド  
FWりそな先進国リートインデックスファンド

- (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12月11日から2019年6月10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。

## 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	151,809,503	107,936,646
親投資信託受益証券	47,582,711,764	45,729,303,640
未収入金	30,000,000	-
流動資産合計	47,764,521,267	45,837,240,286
資産合計	47,764,521,267	45,837,240,286
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	87,553,692	17,334,754
未払受託者報酬	7,509,891	7,413,474
未払委託者報酬	55,072,458	54,365,386
未払利息	411	292
その他未払費用	2,504,733	2,471,074
流動負債合計	152,641,185	81,584,980
負債合計	152,641,185	81,584,980
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	47,514,995,849	44,594,855,201
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	96,884,233	1,160,800,105
（分配準備積立金）	309,036,484	249,759,137
元本等合計	47,611,880,082	45,755,655,306
純資産合計	47,611,880,082	45,755,655,306
負債純資産合計	47,764,521,267	45,837,240,286

## (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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	173,192,012	1,166,291,876
営業収益合計	173,192,012	1,166,291,876
営業費用		
支払利息	47,506	63,227
受託者報酬	5,732,733	7,413,474
委託者報酬	42,039,937	54,365,386
その他費用	1,911,999	2,475,155
営業費用合計	49,732,175	64,317,242
営業利益又は営業損失( )	123,459,837	1,101,974,634
経常利益又は経常損失( )	123,459,837	1,101,974,634
中間純利益又は中間純損失( )	123,459,837	1,101,974,634
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( )	4,332,516	107,265,191
期首剰余金又は期首欠損金( )	7,873,281	96,884,233
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,772,242	93,422,319
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	506,955	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,265,287	93,422,319
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	24,215,890
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	24,215,890
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	134,026,282	1,160,800,105

## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 28,966,582,797円	期首元本額 47,514,995,849円
期中追加設定元本額 26,877,211,328円	期中追加設定元本額 6,705,885,651円
期中一部解約元本額 8,328,798,276円	期中一部解約元本額 9,626,026,299円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 47,514,995,849口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 44,594,855,201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 1.0020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 1.0260円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,020円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,260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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	62,252,717	46,304,106
親投資信託受益証券	16,821,725,624	18,102,029,262
未収入金	10,800,000	-
流動資産合計	16,894,778,341	18,148,333,368
資産合計	16,894,778,341	18,148,333,368
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	33,221,016	8,167,585
未払受託者報酬	2,584,525	2,876,324
未払委託者報酬	23,260,669	25,886,853
未払利息	168	125
その他未払費用	861,979	958,691
流動負債合計	59,928,357	37,889,578
負債合計	59,928,357	37,889,578
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,924,914,167	17,331,427,459
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	909,935,817	779,016,331
( 分配準備積立金 )	1,035,492,938	890,418,237
元本等合計	16,834,849,984	18,110,443,790
純資産合計	16,834,849,984	18,110,443,790
負債純資産合計	16,894,778,341	18,148,333,368

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	106,863,741	169,586,362
営業収益合計	106,863,741	169,586,362
営業費用		
支払利息	14,558	26,213
受託者報酬	1,657,807	2,876,324
委託者報酬	14,920,211	25,886,853
その他費用	552,860	960,382
営業費用合計	17,145,436	29,749,772
営業利益又は営業損失（ ）	89,718,305	199,336,134
経常利益又は経常損失（ ）	89,718,305	199,336,134
中間純利益又は中間純損失（ ）	89,718,305	199,336,134
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（ ）	8,393,863	18,350,649
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,277,263,187	909,935,817
剰余金増加額又は欠損金減少額	943,183,910	189,728,060
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	943,183,910	189,728,060
剰余金減少額又は欠損金増加額	164,040,721	139,662,061
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	164,040,721	139,662,061
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,137,730,818	779,016,331



## ( 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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 6,908,921,204円	期首元本額 15,924,914,167円
期中追加設定元本額 10,773,198,886円	期中追加設定元本額 3,959,134,450円
期中一部解約元本額 1,757,205,923円	期中一部解約元本額 2,552,621,158円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 15,924,914,167口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 17,331,427,459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 1.0571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 1.0449円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,571円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,449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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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国内株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【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)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	66,897,259	51,628,053
親投資信託受益証券	19,801,804,178	19,291,467,263
流動資産合計	19,868,701,437	19,343,095,316
資産合計	19,868,701,437	19,343,095,316
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	30,794,215	4,875,837
未払受託者報酬	2,000,137	3,013,570
未払委託者報酬	21,334,805	32,144,677
未払利息	181	140
その他未払費用	667,097	1,004,423
流動負債合計	54,796,435	41,038,647
負債合計	54,796,435	41,038,647
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	19,541,836,461	18,788,022,996
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	272,068,541	514,033,673
(分配準備積立金)	441,299,750	358,129,360
元本等合計	19,813,905,002	19,302,056,669
純資産合計	19,813,905,002	19,302,056,669
負債純資産合計	19,868,701,437	19,343,095,316

## (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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	503,082,620	246,593,085
<b>営業収益合計</b>	<b>503,082,620</b>	<b>246,593,085</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	13,759	23,805
受託者報酬	1,525,283	3,013,570
委託者報酬	16,269,644	32,144,677
その他費用	508,715	1,005,865
<b>営業費用合計</b>	<b>18,317,401</b>	<b>36,187,917</b>
営業利益又は営業損失( )	521,400,021	210,405,168
経常利益又は経常損失( )	521,400,021	210,405,168
中間純利益又は中間純損失( )	521,400,021	210,405,168
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( )	114,005,396	28,348,538
期首剰余金又は期首欠損金( )	425,183,780	272,068,541
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,509,284	56,596,930
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,509,284	56,596,930
剰余金減少額又は欠損金増加額	132,107,243	53,385,504
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	132,107,243	53,385,504
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	58,808,804	514,033,673

## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 8,363,296,428円	期首元本額 19,541,836,461円
期中追加設定元本額 16,644,523,180円	期中追加設定元本額 3,095,928,884円
期中一部解約元本額 5,465,983,147円	期中一部解約元本額 3,849,742,349円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 19,541,836,461口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 18,788,022,996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 1.0139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 1.0274円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,139円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,274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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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先進国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

## （ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	192,311,792	141,269,625
親投資信託受益証券	47,533,577,926	56,470,081,091
流動資産合計	47,725,889,718	56,611,350,716
資産合計	47,725,889,718	56,611,350,716
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	75,732,020	14,281,667
未払受託者報酬	7,477,619	7,973,671
未払委託者報酬	79,761,274	85,052,420
未払利息	521	383
その他未払費用	2,493,978	2,657,798
流動負債合計	165,465,412	109,965,939
負債合計	165,465,412	109,965,939
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	48,045,026,028	54,664,743,479
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	484,601,722	1,836,641,298
（分配準備積立金）	996,408,055	877,865,502
元本等合計	47,560,424,306	56,501,384,777
純資産合計	47,560,424,306	56,501,384,777
負債純資産合計	47,725,889,718	56,611,350,716

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	768,148,196	2,313,203,165
営業収益合計	768,148,196	2,313,203,165
営業費用		
支払利息	48,878	61,490
受託者報酬	5,669,924	7,973,671
委託者報酬	60,479,057	85,052,420
その他費用	1,891,209	2,661,422
営業費用合計	68,089,068	95,749,003
営業利益又は営業損失（ ）	836,237,264	2,217,454,162
経常利益又は経常損失（ ）	836,237,264	2,217,454,162
中間純利益又は中間純損失（ ）	836,237,264	2,217,454,162
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（ ）	28,827,156	63,629,242
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	258,698,303	484,601,722
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	167,418,100
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	55,805,299
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	111,612,801
剰余金減少額又は欠損金増加額	107,551,131	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,276,637	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	91,274,494	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	656,262,936	1,836,641,298



## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 28,727,931,088円	期首元本額 48,045,026,028円
期中追加設定元本額 27,497,514,870円	期中追加設定元本額 12,734,592,152円
期中一部解約元本額 8,180,419,930円	期中一部解約元本額 6,114,874,701円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 48,045,026,028口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 54,664,743,479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 484,601,722円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9899円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,899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 1.0336円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,336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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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

<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <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> <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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>
--	---

（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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,731,019	5,446,915
親投資信託受益証券	1,768,599,488	1,415,084,047
流動資産合計	1,776,330,507	1,420,530,962
資産合計	1,776,330,507	1,420,530,962
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,595,505	413,547
未払受託者報酬	223,430	230,420
未払委託者報酬	3,872,657	3,993,938
未払利息	20	14
その他未払費用	74,456	76,704
流動負債合計	6,766,068	4,714,623
負債合計	6,766,068	4,714,623
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,806,368,468	1,429,085,089
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	36,804,029	13,268,750
（分配準備積立金）	79,281,730	54,168,917
元本等合計	1,769,564,439	1,415,816,339
純資産合計	1,769,564,439	1,415,816,339
負債純資産合計	1,776,330,507	1,420,530,962

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	78,622,136	15,914,559
営業収益合計	78,622,136	15,914,559
営業費用		
支払利息	1,524	2,199
受託者報酬	149,384	230,420
委託者報酬	2,589,243	3,993,938
その他費用	49,750	76,837
営業費用合計	2,789,901	4,303,394
営業利益又は営業損失（ ）	81,412,037	11,611,165
経常利益又は経常損失（ ）	81,412,037	11,611,165
中間純利益又は中間純損失（ ）	81,412,037	11,611,165
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（ ）	622,768	17,432
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	54,374,651	36,804,029
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,394,942	11,941,546
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	11,805,037
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,394,942	136,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,823,718	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,823,718	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,843,394	13,268,750

## ( 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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 688,292,151円	期首元本額 1,806,368,468円
期中追加設定元本額 1,230,517,990円	期中追加設定元本額 205,930,241円
期中一部解約元本額 112,441,673円	期中一部解約元本額 583,213,620円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,806,368,468口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,429,085,089口
3. 元本の欠損	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 36,804,029円	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 13,268,750円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9796円	4. 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 0.9907円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,796円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,907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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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

<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <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> <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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>
--	---

（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新興国債券マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	33,520,443	34,212,185
親投資信託受益証券	6,029,475,373	13,230,197,882
流動資産合計	6,062,995,816	13,264,410,067
資産合計	6,062,995,816	13,264,410,067
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,236,771	2,793,730
未払受託者報酬	1,484,700	1,875,215
未払委託者報酬	18,311,196	23,127,588
未払利息	90	92
その他未払費用	495,105	624,974
流動負債合計	29,527,862	28,421,599
負債合計	29,527,862	28,421,599
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,484,626,857	11,336,516,867
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	548,841,097	1,899,471,601
（分配準備積立金）	316,280,514	273,619,745
元本等合計	6,033,467,954	13,235,988,468
純資産合計	6,033,467,954	13,235,988,468
負債純資産合計	6,062,995,816	13,264,410,067

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	139,657,550	1,065,922,509
営業収益合計	139,657,550	1,065,922,509
営業費用		
支払利息	10,618	15,274
受託者報酬	1,185,762	1,875,215
委託者報酬	14,624,340	23,127,588
その他費用	395,435	626,083
営業費用合計	16,216,155	25,644,160
営業利益又は営業損失（ ）	123,441,395	1,040,278,349
経常利益又は経常損失（ ）	123,441,395	1,040,278,349
中間純利益又は中間純損失（ ）	123,441,395	1,040,278,349
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（ ）	6,794,708	152,082,420
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	774,534,515	548,841,097
剰余金増加額又は欠損金減少額	477,110,485	589,205,266
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	477,110,485	589,205,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,617,915	126,770,691
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,617,915	126,770,691
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,286,263,188	1,899,471,601



## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 5,138,361,469円	期首元本額 5,484,626,857円
期中追加設定元本額 6,421,790,557円	期中追加設定元本額 7,415,015,648円
期中一部解約元本額 6,075,525,169円	期中一部解約元本額 1,563,125,638円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 5,484,626,857口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 11,336,516,867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 1.1001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 1.1676円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,001円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,676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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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先進国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,880,403	7,131,400
親投資信託受益証券	1,998,217,451	1,697,028,115
未収入金	120,000	-
流動資産合計	2,008,217,854	1,704,159,515
資産合計	2,008,217,854	1,704,159,515
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,151,445	556,105
未払受託者報酬	268,200	290,219
未払委託者報酬	5,095,703	5,514,199
未払利息	26	19
その他未払費用	89,395	96,651
流動負債合計	8,604,769	6,457,193
負債合計	8,604,769	6,457,193
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,820,179,340	1,548,990,615
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	179,433,745	148,711,707
( 分配準備積立金 )	89,052,823	63,399,223
元本等合計	1,999,613,085	1,697,702,322
純資産合計	1,999,613,085	1,697,702,322
負債純資産合計	2,008,217,854	1,704,159,515

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	17,123,595	12,019,336
営業収益合計	17,123,595	12,019,336
営業費用		
支払利息	1,935	3,023
受託者報酬	176,981	290,219
委託者報酬	3,362,466	5,514,199
その他費用	58,951	96,841
営業費用合計	3,600,333	5,904,282
営業利益又は営業損失（ ）	20,723,928	17,923,618
経常利益又は経常損失（ ）	20,723,928	17,923,618
中間純利益又は中間純損失（ ）	20,723,928	17,923,618
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（ ）	3,315,074	6,249,210
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	171,886,880	179,433,745
剰余金増加額又は欠損金減少額	125,470,217	36,095,479
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	125,470,217	36,095,479
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,465,660	55,143,109
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,465,660	55,143,109
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	251,852,435	148,711,707

## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 701,866,069円	期首元本額 1,820,179,340円
期中追加設定元本額 1,273,924,653円	期中追加設定元本額 291,845,487円
期中一部解約元本額 155,611,382円	期中一部解約元本額 563,034,212円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,820,179,340口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,548,990,615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 1.0986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 1.0960円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,986円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,960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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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新興国株式マザーファンド」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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【FWりそな国内リートインデックスファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,106,106	5,591,635
親投資信託受益証券	2,600,564,748	2,177,579,482
流動資産合計	2,608,670,854	2,183,171,117
資産合計	2,608,670,854	2,183,171,117
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,762,928	1,049,689
未払受託者報酬	330,344	343,974
未払委託者報酬	2,973,033	3,095,736
未払利息	21	15
その他未払費用	110,089	114,558
流動負債合計	6,176,415	4,603,972
負債合計	6,176,415	4,603,972
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,516,252,459	1,933,037,458
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	86,241,980	245,529,687
（分配準備積立金）	159,085,643	104,910,925
元本等合計	2,602,494,439	2,178,567,145
純資産合計	2,602,494,439	2,178,567,145
負債純資産合計	2,608,670,854	2,183,171,117

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	86,208,482	165,924,734
営業収益合計	86,208,482	165,924,734
営業費用		
支払利息	2,120	2,917
受託者報酬	230,609	343,974
委託者報酬	2,075,451	3,095,736
その他費用	76,820	114,750
営業費用合計	2,385,000	3,557,377
営業利益又は営業損失（ ）	83,823,482	162,367,357
経常利益又は経常損失（ ）	83,823,482	162,367,357
中間純利益又は中間純損失（ ）	83,823,482	162,367,357
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（ ）	3,994,547	1,287,315
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	91,387,947	86,241,980
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,882,471	26,112,022
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,882,471	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	26,112,022
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,142,814	30,478,987
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	30,478,987
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,142,814	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,819,355	245,529,687



## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 1,259,761,806円	期首元本額 2,516,252,459円
期中追加設定元本額 1,606,741,957円	期中追加設定元本額 294,612,751円
期中一部解約元本額 350,251,304円	期中一部解約元本額 877,827,752円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,516,252,459口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,933,037,458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 1.0343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 1.1270円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,343円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,270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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2018年12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,081,239	7,047,890
親投資信託受益証券	1,886,710,077	2,692,405,730
流動資産合計	1,893,791,316	2,699,453,620
資産合計	1,893,791,316	2,699,453,620
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,647,403	434,994
未払受託者報酬	327,335	395,845
未払委託者報酬	4,037,028	4,882,003
未払利息	19	19
その他未払費用	109,095	131,847
流動負債合計	6,120,880	5,844,708
負債合計	6,120,880	5,844,708
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,837,841,788	2,516,562,818
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	49,828,648	177,046,094
（分配準備積立金）	99,774,968	85,705,828
元本等合計	1,887,670,436	2,693,608,912
純資産合計	1,887,670,436	2,693,608,912
負債純資産合計	1,893,791,316	2,699,453,620

## （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12月12日 至 2018年 6月11日	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	55,470,232	166,198,653
営業収益合計	55,470,232	166,198,653
営業費用		
支払利息	2,355	3,107
受託者報酬	261,890	395,845
委託者報酬	3,229,937	4,882,003
その他費用	87,259	132,060
営業費用合計	3,581,441	5,413,015
営業利益又は営業損失（ ）	59,051,673	160,785,638
経常利益又は経常損失（ ）	59,051,673	160,785,638
中間純利益又は中間純損失（ ）	59,051,673	160,785,638
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（ ）	44,964,954	19,672,410
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	39,361,184	49,828,648
剰余金増加額又は欠損金減少額	385,596	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	385,596	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	59,767,422	13,895,782
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,170,513
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	59,767,422	9,725,269
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	34,107,361	177,046,094

## (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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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 1,479,548,942円	期首元本額 1,837,841,788円
期中追加設定元本額 1,601,705,660円	期中追加設定元本額 1,038,842,304円
期中一部解約元本額 1,243,412,814円	期中一部解約元本額 360,121,274円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,837,841,788口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 2,516,562,818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 1.0271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 1.0704円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,271円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,704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12月10日現在	第3期中間計算期間末 2019年 6月10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> <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>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>
--	---

（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。

「RAM国内債券マザーファンド」「RAM国内株式マザーファンド」「RAM先進国債券マザーファンド」「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」「RAM新興国債券マザーファンド」「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」及び「RAM先進国リートマザーファンド」の状況は次の通りです。

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）

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	970,799
コール・ローン	220,550,253
国債証券	55,930,740,810
地方債証券	3,534,171,200
特殊債券	4,298,416,430

2019年 6月10日現在	
社債券	2,638,431,000
未収利息	180,570,039
前払費用	6,264,310
流動資産合計	66,810,114,841
資産合計	66,810,114,841
負債の部	
流動負債	
未払金	125,998,800
未払解約金	190,000
未払利息	598
流動負債合計	126,189,398
負債合計	126,189,398
純資産の部	
元本等	
元本	62,540,817,050
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,143,108,393
元本等合計	66,683,925,443
純資産合計	66,683,925,443
負債純資産合計	66,810,114,841

## 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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	62,165,264,291円
期中追加設定元本額	8,501,031,666円
期中一部解約元本額	8,125,478,907円
期末元本額	62,540,817,050円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	15,760,015,050円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	320,497,201円
りそなラップ型ファンド(成長型)	161,279,781円
DCりそな グローバルバランス	190,432,340円
つみたてバランスファンド	514,122,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	276,792,525円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	45,140,916円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	10,264,965円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	146,490円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	80,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	25,048円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,329円
FWりそな国内債券インデックスファンド	42,889,986,532円
Smart-i 国内債券インデックス	199,832,012円
Smart-i 8資産バランス 安定型	55,457,277円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	54,527,855円
Smart-i 8資産バランス 成長型	25,307,366円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,436,553,201円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	4,436,685円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	595,918,233円
2. 計算日における受益権の総数	62,540,817,050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	1.0662円
(10,000口当たり純資産額)	(10,662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

2019年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額	
が異なることもあります。	

(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。



## RAM国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	636,262,261
株式	26,211,531,320
派生商品評価勘定	866,220
未収配当金	208,923,799
前払金	30,351,000
差入委託証拠金	23,175,000
流動資産合計	27,111,109,600
資産合計	27,111,109,600
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,400,300
未払金	361,450,741
未払解約金	4,247,000
未払利息	1,725
流動負債合計	385,099,766
負債合計	385,099,766
純資産の部	
元本等	
元本	24,910,444,714
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,815,565,120
元本等合計	26,726,009,834
純資産合計	26,726,009,834
負債純資産合計	27,111,109,600

## 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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	21,251,159,523円
期中追加設定元本額	9,094,132,934円
期中一部解約元本額	5,434,847,743円
期末元本額	24,910,444,714円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,420,579,176円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,072,261,959円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,265,404,071円
DCりそな グローバルバランス	28,916,875円
つみたてバランスファンド	785,842,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	205,188,815円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	80,710,861円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	49,113,393円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	164,570円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	213,655円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	253,816円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	271,665円
FWりそな国内株式インデックスファンド	16,872,056,354円
Smart-i TOPIXインデックス	294,467,595円
Smart-i 8資産バランス 安定型	15,359,300円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	67,363,517円
Smart-i 8資産バランス 成長型	96,676,783円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	109,650,435円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,728,535円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	435,367,750円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	106,853,172円
2. 計算日における受益権の総数	24,910,444,714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	1.0729円
(10,000口当たり純資産額)	(10,729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

2019年 6月10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）

（2019年 6月10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	819,359,080	-	800,825,000	18,534,080
	合計	819,359,080	-	800,825,000	18,534,080

（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。

R A M先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	51,659,227
コール・ローン	38,234,570
国債証券	34,454,374,444
派生商品評価勘定	76,188
未収利息	207,423,055
前払費用	19,715,924
流動資産合計	34,771,483,408
資産合計	34,771,483,408
負債の部	
流動負債	
未払金	54,971,432
未払利息	103
流動負債合計	54,971,535
負債合計	54,971,535
純資産の部	
元本等	
元本	35,194,021,340
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	477,509,467
元本等合計	34,716,511,873
純資産合計	34,716,511,873
負債純資産合計	34,771,483,408

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	34,054,275,259円
期中追加設定元本額	5,256,067,960円
期中一部解約元本額	4,116,321,879円
期末元本額	35,194,021,340円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,084,910,722円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	10,767,994,694円
りそなラップ型ファンド（成長型）	174,242,630円
DCりそな グローバルバランス	49,376,675円
つみたてバランスファンド	138,657,580円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	163,398,316円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	26,907,177円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	5,899,517円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	85,503円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	44,981円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	14,589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）	19,557,448,564円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	79,555,858円
Smart-i 8資産バランス 安定型	33,749,026円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	30,473,158円
Smart-i 8資産バランス 成長型	15,729,870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）	454,620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）	65,077,860円
2. 計算日における受益権の総数	35,194,021,340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	477,509,467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	0.9864円
(10,000口当たり純資産額)	(9,864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

2019年 6月10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）

（2019年 6月10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	28,328,884	-	28,405,072	76,188
	米ドル	13,243,234	-	13,247,850	4,616
	ユーロ	15,085,650	-	15,157,222	71,572
	合計	28,328,884	-	28,405,072	76,188

## （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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	109,435,510
コール・ローン	86,649,029
国債証券	74,107,007,445
派生商品評価勘定	247,514,221
未収入金	23,012,048
未収利息	418,783,072
前払費用	68,473,529
流動資産合計	75,060,874,854
資産合計	
75,060,874,854	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	294,050,969
未払金	139,615,808
未払解約金	25,210,000
未払利息	235
流動負債合計	458,877,012
負債合計	
458,877,012	
純資産の部	
元本等	
元本	74,004,722,107
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	597,275,735
元本等合計	74,601,997,842
純資産合計	
74,601,997,842	
負債純資産合計	
75,060,874,854	

### 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	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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	60,557,036,701円
期中追加設定元本額	17,200,053,277円
期中一部解約元本額	3,752,367,871円
期末元本額	74,004,722,107円
期末元本の内訳	
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	294,856,073円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	48,076,073円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	10,834,908円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	157,295円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	85,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	26,895円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,427円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	56,016,348,667円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	118,481,780円
Smart-i 8資産バランス 安定型	59,070,388円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	58,088,785円
Smart-i 8資産バランス 成長型	26,965,086円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	6,095,165,625円
先進国債券インデックスファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	11,271,860,566円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	4,702,556円
2. 計算日における受益権の総数	74,004,722,107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	1.0081円
(10,000口当たり純資産額)	(10,081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

2019年 6月10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）

（2019年 6月10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	68,081,728	-	68,216,668	134,940
	オーストラリアドル	68,081,728	-	68,216,668	134,940
	売建	73,999,377,552	-	74,046,049,240	46,671,688
	米ドル	35,187,678,501	-	34,947,087,980	240,590,521
	カナダドル	1,441,957,908	-	1,458,646,470	16,688,562
	メキシコペソ	638,702,094	-	641,066,790	2,364,696
	ユーロ	28,138,984,569	-	28,383,187,910	244,203,341
	英ポンド	4,783,357,315	-	4,792,387,950	9,030,635
	スウェーデンクローナ	254,489,480	-	256,211,080	1,721,600
	ノルウェークローネ	203,071,833	-	205,318,380	2,246,547

デンマーククローネ	376,215,219	-	379,616,650	3,401,431
ポーランドズロチ	421,540,467	-	427,733,030	6,192,563
オーストラリアドル	1,548,850,590	-	1,554,563,500	5,712,910
シンガポールドル	289,410,550	-	290,518,360	1,107,810
マレーシアリンギット	313,084,548	-	313,521,600	437,052
南アフリカランド	402,034,478	-	396,189,540	5,844,938
合計	74,067,459,280	-	74,114,265,908	46,536,748

## (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新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	350,987
コール・ローン	2,830,470
投資信託受益証券	2,754,594,120
派生商品評価勘定	928
未収配当金	14,036,495
流動資産合計	2,771,813,000
資産合計	2,771,813,000
負債の部	
流動負債	
未払金	2,532,978
未払利息	7
流動負債合計	2,532,985
負債合計	2,532,985
純資産の部	

2019年 6月10日現在

元本等	
元本	2,585,861,694
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	183,418,321
元本等合計	2,769,280,015
純資産合計	2,769,280,015
負債純資産合計	2,771,813,000

## 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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	2,646,201,057円
期中追加設定元本額	497,979,565円
期中一部解約元本額	558,318,928円
期末元本額	2,585,861,694円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	490,600,080円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	317,810,877円
りそなラップ型ファンド(成長型)	160,538,867円
DCりそな グローバルバランス	5,949,361円
つみたてバランスファンド	127,929,184円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	42,525,865円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	16,757,482円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	10,371,348円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	35,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	44,573円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	53,596円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	58,108円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,321,397,000円
Smart-i 8資産バランス 安定型	3,834,351円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	13,999,279円
Smart-i 8資産バランス 成長型	18,187,686円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	55,349,381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）	419,106円
2. 計算日における受益権の総数	2,585,861,694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	1.0709円
(10,000口当たり純資産額)	(10,709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

2019年 6月10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)

(2019年 6月10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	2,516,504	-	2,517,432	928
	米ドル	2,516,504	-	2,517,432	928
	合計	2,516,504	-	2,517,432	928

(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先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,074,281,566
コール・ローン	122,467,190
株式	20,720,852,580
投資証券	588,220,465
派生商品評価勘定	15,960,746
未収入金	1,121,799
未収配当金	40,265,585
差入委託証拠金	295,288,791
流動資産合計	22,858,458,722

2019年 6月10日現在

資産合計	22,858,458,722
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,733,806
未払金	1,154,562,884
未払利息	332
流動負債合計	1,162,297,022
負債合計	1,162,297,022
純資産の部	
元本等	
元本	17,543,946,009
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,152,215,691
元本等合計	21,696,161,700
純資産合計	21,696,161,700
負債純資産合計	22,858,458,722

## 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）

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	9,858,639,925円
期中追加設定元本額	10,207,608,006円
期中一部解約元本額	2,522,301,922円
期末元本額	17,543,946,009円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	852,778,266円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	274,819,636円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,218,607,232円
DCりそな グローバルバランス	10,128,550円
つみたてバランスファンド	457,622,758円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	202,818,126円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	79,975,854円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	49,372,116円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	162,439円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	208,984円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	248,546円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	267,164円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	10,697,984,865円
Smart-i 先進国株式インデックス	853,239,032円
Smart-i 8資産バランス 安定型	16,756,293円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	64,299,686円
Smart-i 8資産バランス 成長型	90,870,536円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	574,023,172円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	3,654,500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）	96,108,254円
2. 計算日における受益権の総数	17,543,946,009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	1.2367円
(10,000口当たり純資産額)	(12,367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

2019年 6月10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）

（2019年 6月10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	1,977,639,132	-	1,985,557,321	7,918,189
	合計	1,977,639,132	-	1,985,557,321	7,918,189

（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）

（2019年 6月10日現在）

（単位：円）

--	--	--	--	--



区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,718,040,119	-	1,718,348,870	308,751
	米ドル	1,183,005,134	-	1,183,099,950	94,816
	カナダドル	67,778,320	-	67,836,500	58,180
	ユーロ	191,995,783	-	192,106,120	110,337
	英ポンド	105,590,082	-	105,615,900	25,818
	スイスフラン	60,254,810	-	60,274,500	19,690
	スウェーデンクローナ	17,311,650	-	17,310,000	1,650
	ノルウェークローネ	5,033,080	-	5,028,000	5,080
	デンマーククローネ	11,502,635	-	11,515,000	12,365
	オーストラリアドル	47,762,700	-	47,766,900	4,200
	ニュージーランドドル	722,253	-	722,200	53
	香港ドル	19,925,360	-	19,915,200	10,160
シンガポールドル	7,158,312	-	7,158,600	288	
合計		1,718,040,119	-	1,718,348,870	308,751

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 6月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	378,924,628
コール・ローン	6,054,661
株式	5,604,078,589
投資証券	15,122,901
派生商品評価勘定	5,697,612
未収入金	108,438
未収配当金	14,775,231
差入委託証拠金	143,584,006
流動資産合計	6,168,346,066
資産合計	
6,168,346,066	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,424,288
未払解約金	490,000
未払利息	16
流動負債合計	8,914,304
負債合計	
8,914,304	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,011,175,560
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,148,256,202
元本等合計	6,159,431,762
純資産合計	
6,159,431,762	
負債純資産合計	
6,168,346,066	

## 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	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</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>

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	4,383,035,281円
期中追加設定元本額	1,675,879,111円
期中一部解約元本額	1,047,738,832円
期末元本額	5,011,175,560円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	471,006,338円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,654,973,543円
りそなラップ型ファンド(成長型)	777,666,890円
DCりそな グローバルバランス	5,715,440円
つみたてバランスファンド	110,742,468円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	72,136,209円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	28,657,965円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	17,350,260円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	54,602円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	69,280円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	83,958円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	88,361円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,380,707,929円
Smart-i 新興国株式インデックス	336,845,009円
Smart-i 8資産バランス 安定型	5,046,624円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	21,425,826円
Smart-i 8資産バランス 成長型	31,643,294円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	96,266,176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)	695,388円
2. 計算日における受益権の総数	5,011,175,560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	1.2291円
(10,000口当たり純資産額)	(12,291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

2019年 6月10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）

（2019年 6月10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	802,971,493	-	800,276,399	2,695,094
合計		802,971,493	-	800,276,399	2,695,094

## （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)

(2019年 6月10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	267,451,852	-	267,420,148	31,704
	米ドル	184,491,008	-	184,487,538	3,470
	メキシコペソ	5,902,785	-	5,901,000	1,785
	トルコリラ	1,852,310	-	1,854,000	1,690
	ハンガリーフォリント	2,188,857	-	2,184,810	4,047
	ポーランドズロチ	4,030,162	-	4,034,800	4,638
	香港ドル	51,204,300	-	51,171,000	33,300
	南アフリカランド	17,782,430	-	17,787,000	4,570
	売建	54,438	-	54,316	122
	タイバーツ	17,983	-	17,931	52
	オフショア人民元	36,455	-	36,385	70
	合計		267,506,290	-	267,474,464

(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国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 6月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	324,379,459
投資証券	16,133,331,460
派生商品評価勘定	10,862,508
未収配当金	98,447,596
差入委託証拠金	5,046,000
流動資産合計	16,572,067,023
<b>資産合計</b>	<b>16,572,067,023</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	11,838,300
未払金	219,435,810
未払利息	879
流動負債合計	231,274,989
<b>負債合計</b>	<b>231,274,989</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	12,847,588,029
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,493,204,005
元本等合計	16,340,792,034
<b>純資産合計</b>	<b>16,340,792,034</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>16,572,067,023</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	12,246,315,328円

期中追加設定元本額	5,763,696,001円
期中一部解約元本額	5,162,423,300円
期末元本額	12,847,588,029円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	427,131,067円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	443,674,404円
りそなラップ型ファンド(成長型)	345,894,355円
DCりそな グローバルバランス	5,151,247円
つみたてバランスファンド	214,259,540円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	43,287,395円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	17,067,835円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	10,220,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	35,540円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	47,547円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	55,552円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	59,554円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,636,549,421円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,712,068,152円
Smart-i Jリートインデックス	864,808,043円
Smart-i 8資産バランス 安定型	3,175,652円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	14,516,753円
Smart-i 8資産バランス 成長型	18,273,180円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	45,105,949円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	5,045,177,337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)	1,028,612円
2. 計算日における受益権の総数	12,847,588,029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	1.2719円
(10,000口当たり純資産額)	(12,719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

2019年 6月10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

## （投資証券関連）

（2019年 6月10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	323,304,492	-	334,167,000	10,862,508
	合計	323,304,492	-	334,167,000	10,862,508

## （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先進国リートマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2019年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	49,824,155
コール・ローン	17,943,566
投資証券	12,955,968,160
派生商品評価勘定	37,660
未収入金	320,023
未収配当金	20,510,715



2019年 6月10日現在

流動資産合計	13,044,604,279
資産合計	13,044,604,279
負債の部	
流動負債	
未払金	48,928,559
未払利息	48
流動負債合計	48,928,607
負債合計	48,928,607
純資産の部	
元本等	
元本	11,594,198,807
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,401,476,865
元本等合計	12,995,675,672
純資産合計	12,995,675,672
負債純資産合計	13,044,604,279

## 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)

2019年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	8,033,074,914円
期中追加設定元本額	5,231,882,507円

期中一部解約元本額	1,670,758,614円
期末元本額	11,594,198,807円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	473,377,712円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	859,692,799円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,444,738,655円
DCりそな グローバルバランス	5,592,386円
つみたてバランスファンド	123,082,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	54,432,827円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	21,588,374円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	13,410,593円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	44,469円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	62,472円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	71,474円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	75,975円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,516,343,873円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,402,003,507円
Smart-i 先進国リートインデックス	528,646,988円
Smart-i 8資産バランス 安定型	3,614,428円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	16,496,064円
Smart-i 8資産バランス 成長型	24,578,954円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	104,768,657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)	1,576,073円
2. 計算日における受益権の総数	11,594,198,807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	1.1209円
(10,000口当たり純資産額)	(11,209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

2019年 6月10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)

(2019年 6月10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	16,417,890	-	16,455,550	37,660
	米ドル	9,328,420	-	9,331,860	3,440
	オーストラリアドル	6,260,690	-	6,293,890	33,200
	香港ドル	828,780	-	829,800	1,020
	合計	16,417,890	-	16,455,550	37,660

(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。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 6月28日現在です。

## 【FWりそな国内債券インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	46,239,428,001円
負債総額	72,938,962円
純資産総額（ - ）	46,166,489,039円
発行済口数	44,929,906,422口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0275円

## 【FWりそな国内株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	18,294,003,632円
負債総額	28,594,407円
純資産総額（ - ）	18,265,409,225円
発行済口数	17,477,729,045口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0451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）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	19,509,560,451円
負債総額	24,868,146円
純資産総額（ - ）	19,484,692,305円
発行済口数	18,940,643,480口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0287円

## 【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	57,352,227,393円
負債総額	72,371,723円

純資産総額（ - ）	57,279,855,670円
発行済口数	55,084,498,054口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0399円

## 【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,473,614,533円
負債総額	2,093,425円
純資産総額（ - ）	1,471,521,108円
発行済口数	1,440,713,201口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0214円

## 【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	13,525,170,932円
負債総額	15,634,010円
純資産総額（ - ）	13,509,536,922円
発行済口数	11,423,753,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1826円

## 【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,792,117,782円
負債総額	2,550,271円
純資産総額（ - ）	1,789,567,511円
発行済口数	1,562,684,875口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1452円

## 【FWりそな国内リートインデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	2,225,017,152円
------	----------------

負債総額	2,203,666円
純資産総額（ - ）	2,222,813,486円
発行済口数	1,947,070,799口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1416円

## 【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	2,666,310,894円
負債総額	2,220,278円
純資産総額（ - ）	2,664,090,616円
発行済口数	2,535,423,239口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0507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	72,157,676,621円
負債総額	235,797,663円
純資産総額（ - ）	71,921,878,958円
発行済口数	67,351,141,462口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0679円

## RAM国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	27,848,395,354円
負債総額	107,032,487円
純資産総額（ - ）	27,741,362,867円
発行済口数	25,849,681,467口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0732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	35,633,645,059円
負債総額	285,473,518円
純資産総額（ - ）	35,348,171,541円
発行済口数	35,781,132,552口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9879円

## R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

資産総額	93,136,446,869円
負債総額	328,453,269円
純資産総額（ - ）	92,807,993,600円
発行済口数	91,491,933,167口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0144円

## R A M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	3,194,898,382円
負債総額	3,510,596円
純資産総額（ - ）	3,191,387,786円
発行済口数	2,889,790,125口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1044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	25,865,714,800円
負債総額	21,794,729円
純資産総額（ - ）	25,843,920,071円
発行済口数	20,627,126,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2529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	7,142,124,259円
負債総額	1,000,451円
純資産総額（ - ）	7,141,123,808円
発行済口数	5,558,765,943口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2847円

## RAM国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	16,364,809,658円
負債総額	440,816,739円
純資産総額（ - ）	15,923,992,919円
発行済口数	12,357,323,888口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2886円

## RAM先進国リートマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	13,629,347,843円
負債総額	75,554,943円
純資産総額（ - ）	13,553,792,900円
発行済口数	12,314,901,333口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1006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

2019年6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（2019年6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

- 運用戦略部は、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

- 運用戦略部および株式運用部のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
- ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
- 運用戦略部長および株式運用部長は、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トレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

###### CHECK：検証 ACTION：改善

- 法令等や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戦略部および株式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、運用戦略部および株式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】

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

2019年6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	65	628,627
単体型株式投資信託	2	36,481
合計	67	665,108

### 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4期事業年度(自2018年4月1日至2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
預金	1,159,736	1,344,092
前払費用	45,871	21,505
未収入金	2	238
未収委託者報酬	213,404	369,524
未収投資助言報酬	-	38,188
流動資産計	1,438,271	1,773,550
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	3,519
器具備品	1	5,451
有形固定資産計	8,970	11,958
無形固定資産		
ソフトウェア	30,292	29,501
無形固定資産計	30,292	29,501
投資その他の資産		
投資有価証券	1,716	599
差入敷金保証金	15,266	-
長期前払費用	2,416	1,416
繰延税金資産	41,682	34,080
投資その他の資産計	61,082	36,097
固定資産計	100,345	77,557
資産合計	1,538,616	1,851,107

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	52,802	87,317
その他未払金	94,427	163,133
未払費用	21,235	23,612
未払法人税等	8,252	17,310
未払消費税等	12,000	39,930
預り金	106	444
賞与引当金	31,097	36,596
流動負債計	219,921	368,344
負債合計	219,921	368,344
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	171,316	7,236
利益剰余金計	171,316	7,236
株主資本計	1,318,683	1,482,763
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	11	0
評価・換算差額等計	11	0
純資産合計	1,318,695	1,482,762
負債・純資産合計	1,538,616	1,851,107

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	854,946	1,786,724
投資助言報酬	-	35,360
営業収益計	854,946	1,822,084
営業費用		
支払手数料	213,554	437,713
広告宣伝費	24,143	48,845
調査費		
調査費	155,859	192,459
委託調査費	111,085	199,514
委託計算費	92,905	149,138
営業雑経費		
印刷費	26,910	49,857
協会費	2,097	3,294

販売促進費	1,592	5,915
その他	41,568	42,522
営業費用計	669,717	1,129,261
一般管理費		
給料		
役員報酬	61,599	65,787
給料・手当	195,821	216,403
賞与	20,138	18,883
賞与引当金繰入額	31,097	36,596
旅費交通費	4,892	8,181
租税公課	7,802	14,129
不動産賃借料	16,648	23,852
固定資産減価償却費	11,306	15,147
諸経費	48,459	72,402
一般管理費計	397,765	471,383
営業利益	212,537	221,439
営業外収益		
投資有価証券売却益	1,616	176
雑収入	14	2
営業外収益計	1,630	179
営業外費用		
株式交付費	3,630	-
営業外費用計	3,630	-
経常利益	214,536	221,618
税引前当期純利益	214,536	221,618
法人税、住民税及び事業税	17,669	49,931
法人税等調整額	32,394	7,606
法人税等計	50,063	57,538
当期純利益	164,472	164,079

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	-	-	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

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683
当期変動額						
当期純利益				164,079	164,079	164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	164,079	164,079	164,079
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763

	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	11	11	1,318,695
当期変動額			
当期純利益			164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	11	11	11
当期変動額合計	11	11	164,067
当期末残高	0	0	1,482,762

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 4～20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。

### (表示方法の変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」22,764千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」41,682千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当金の合計額を除く。)及び同注解(注9)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取り扱いに従って記載しておりません。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	1,273千円	540千円
器具備品	3,324千円	6,957千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
流動資産		
未収入金	18,947千円	-
流動負債		
その他未払金	-	44,766千円

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

## （金融商品関係）

## 1 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

当社の未収入金は、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。

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2018年3月31日）



	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	-

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	1,344,092	1,344,092	-
未収委託者報酬	369,524	369,524	-
未収投資助言報酬	38,188	38,188	-
資産計	1,751,805	1,751,805	-
未払手数料	87,317	87,317	-
その他未払金	163,133	163,133	-
負債計	250,451	250,451	-

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 資産

預金、未収委託者報酬、未収投資助言報酬

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

## 負債

未払手数料、その他未払金

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

（税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	9,518千円	11,202千円
未払事業所税	281千円	341千円
未払事業税	1,954千円	3,323千円
未確定債務	1,190千円	913千円
減価償却超過額	2,966千円	5,341千円
税務上の繰越欠損金(*1)	75,767千円	54,381千円
その他有価証券評価差額金	-	0千円
その他	-	1,399千円
繰延税金資産小計	91,677千円	76,903千円
税務上の繰越欠損金に係る評価性引当額(*1)	-	37,635千円
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	-	5,186千円
評価性引当額小計	49,990千円	42,822千円
繰延税金資産合計	41,687千円	34,080千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	5千円	-
繰延税金負債合計	5千円	-
繰延税金資産の純額	41,682千円	34,080千円

## （\* 1）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

当事業年度（2019年3月31日）

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超	合計
税務上の 繰越欠損金	-	-	-	-	-	54,381千円	54,381千円
評価性引当額	-	-	-	-	-	37,635千円	37,635千円
繰延税金資産	-	-	-	-	-	16,746千円	16,746千円

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

税引前当期純損失のため注記を省略しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.43%
評価性引当額の増減	3.23%
その他	1.89%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.96%

## （セグメント情報等）

前事業年度（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

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、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 2018年4月1日 至 2019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

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、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 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)

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 親会社及び主要株主(会社等に限る)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,472	持株会社としての経営管理	(直接)100%	連結納税	連結納税に係る個別帰属額	44,766	その他未払金	44,766

#### (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 投資一任	支払手数料	340,304	未払 手数料	72,673
							委託調査費	130,062	その他 未払金	51,486

### 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) 投資一任の費用については、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3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

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

## 2. 親会社に関する注記

### 親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

#### (1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	333円	374円43銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失( )	47円97銭	41円43銭

なお、前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益又は当期純損失( ) (千円)	164,472	164,079
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失( ) (千円)	164,472	164,079
普通株式の期中平均株式数(株)	3,428,493	3,960,000

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 5【その他】

## (1) 定款の変更

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 (2019年3月末現在)	事業の内容

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

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 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（2019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 (2019年3月末現在)	事業の内容
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円 (2019年4月1日現在)	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【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

2019年5月24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2018年4月1日から2019年3月31日までの第4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2019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

2019年1月31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FWりそな国内債券インデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな国内債券インデックスファンドの2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな国内株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな国内株式インデックスファンドの2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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）の2017年12月12日から2018年12月10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、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）の2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな新興国債券インデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな新興国債券インデックスファンドの2018年12月10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。

## 独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな先進国株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな先進国株式インデックスファンドの2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな新興国株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな新興国株式インデックスファンドの2018年12月10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。

独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな国内リートインデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな国内リートインデックスファンドの2018年12月10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。



独立監査人の監査報告書

2019年1月31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FWりそな先進国リートインデックスファンドの2017年12月12日から2018年12月10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、FWりそな先進国リートインデックスファンドの2018年12月10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

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

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FWりそな国内債券インデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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応じて追加の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、FWりそな国内債券インデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

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FWRりそな国内株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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応じて追加の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、FWRりそな国内株式インデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

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FWR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）の2018年12月11日から2019年6月10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応じて追加の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、FWR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）の2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

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FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2018年12月11日から2019年6月10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応じて追加の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、FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 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FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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に応じて追加の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、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

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FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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に応じて追加の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、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 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FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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に応じて追加の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、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。



独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 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FWRりそな国内リートインデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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に応じて追加の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、FWRりそな国内リートインデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

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FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2018年12月11日から2019年6月10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応じて追加の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、FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2019年6月10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12月11日から2019年6月10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。