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

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

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

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（8）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

１円以上１円単位

（7）【申込期間】

2019年10月26日から2020年4月27日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（8）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

おります。

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

＜商品分類の定義＞

1. 単位型投信・追加型投信の区分

(1)単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 投資対象地域による区分

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

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

(3)内外：目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

3. 投資対象資産による区分

(1)株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

(5)資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

＜補足として使用する商品分類＞

(1)インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分の定義＞

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

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

⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

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

⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

う。

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

①日経225

②TOPIX

③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

③　ファンドの特色

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

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

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

2 中長期的な運用に適したポートフォリオ構築を目指します。

ポートフォリオの構築プロセス

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

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

基本的資産配分比率の決定プロセス図

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

↓

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

↓

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

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

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

市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)プロセス図　[適時]

<定点観測>
- 投資環境の分析(主に定量分析)
- 主要国・地域のマクロ分析

↓

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

↓

- 市場見通しの策定
- 資産配分の見直し

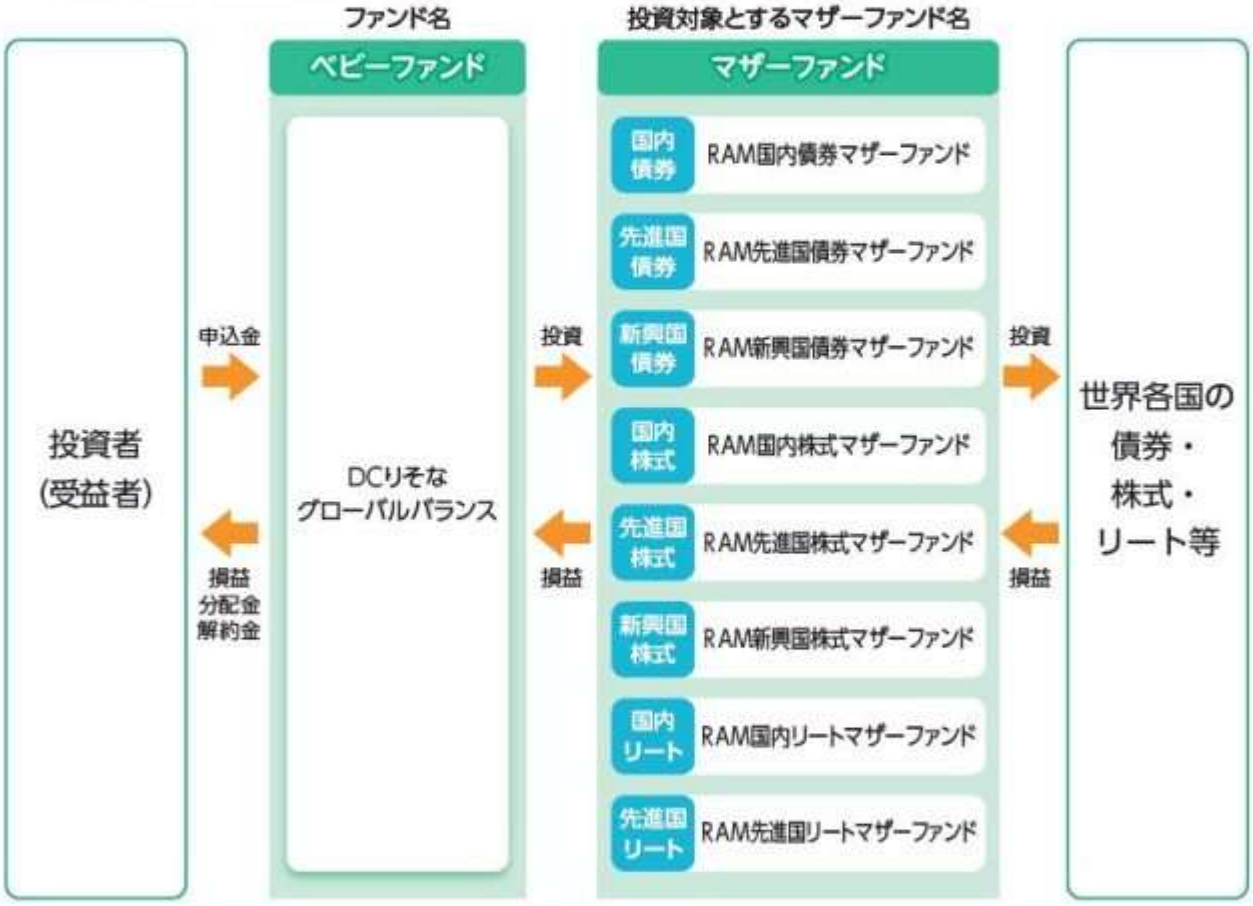
(3)各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記(1)による独自の定量モデルを用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、(2)の市況動向に応じた資産配分の見直し(調整)を適時行い決定します。

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
③留保益は、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先進国債券マザーファンド

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

RAM新興国債券マザーファンド

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

RAM国内株式マザーファンド

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

RAM先進国株式マザーファンド

「MSCI−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。

④　信託金限度額

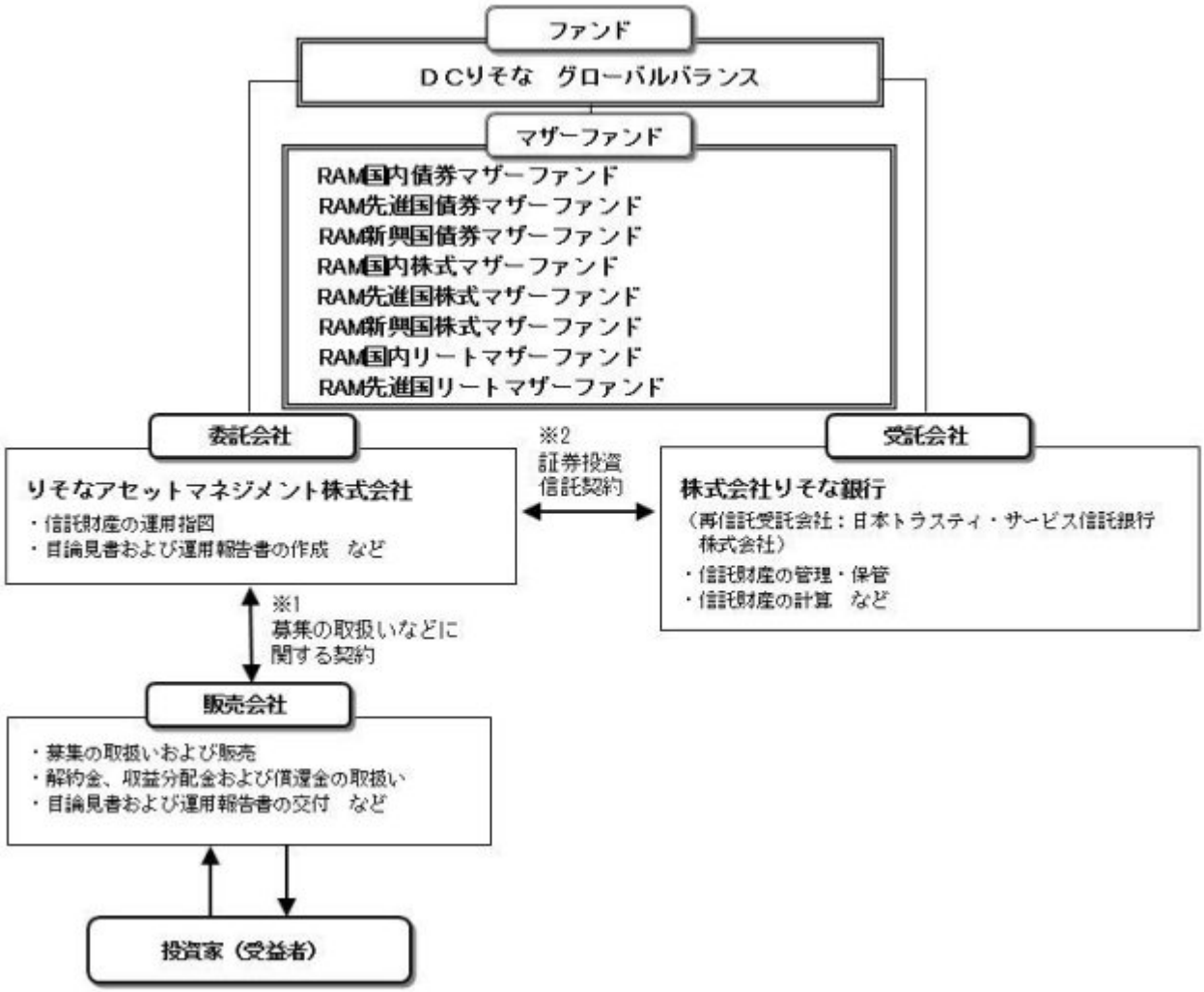
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

2016年5月12日
・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



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

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

② 委託会社の概況（2019年7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】

以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

ⅰ ＲＡＭ国内債券マザーファンド受益証券

ⅱ ＲＡＭ先進国債券マザーファンド受益証券

ⅲ　ＲＡＭ新興国債券マザーファンド受益証券
ⅳ　ＲＡＭ国内株式マザーファンド受益証券
ⅴ　ＲＡＭ先進国株式マザーファンド受益証券
ⅵ　ＲＡＭ新興国株式マザーファンド受益証券
ⅶ　ＲＡＭ国内リートマザーファンド受益証券
ⅷ　ＲＡＭ先進国リートマザーファンド受益証券

①　主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行います。
②　中長期的な運用に適したポートフォリオ構築にあたり、以下の２つの手法を組み合わせます。
１．原則年１回程度、独自の定量モデルを用いて「基本的資産配分比率」を決定します。すなわち、定量モデルを用いたポートフォリオの評価に従い、信託財産の着実な成長が期待でき、かつ運用期間中における信託財産の大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる投資比率を、「基本的資産配分比率」とします。
２．また、「基本的資産配分比率」をポートフォリオ構築の主体としつつ、適時、市場動向に応じた資産配分の見直し（調整）を行います。具体的には、投資環境やマクロ経済の状況に関する定点観測、および市場テーマ・金融政策の動向などに関する分析を行い、相対的な魅力度が高いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや高めに、また相対的な魅力度が低いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや低めに調整します。
③　各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記②１．による独自の定量モデル用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、上記②２．の市況動向に応じた資産配分の見直し（調整）を適時行い決定します。
④　株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。
⑤　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。
⑥　各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。
⑦　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類
この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ）有価証券
ロ）デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
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
②　有価証券の指図範囲
委託者は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権

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

③ 金融商品の指図範囲

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

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

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

④ その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

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

＜ＲＡＭ先進国債券マザーファンド＞

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

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	① 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。 ② 債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入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

＜ＲＡＭ新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針

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

＜ＲＡＭ国内株式マザーファンド＞

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

＜ＲＡＭ先進国株式マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	① 主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ② 株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

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

＜ＲＡＭ新興国株式マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、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	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、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。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。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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

＜ＲＡＭ国内リートマザーファンド＞

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

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

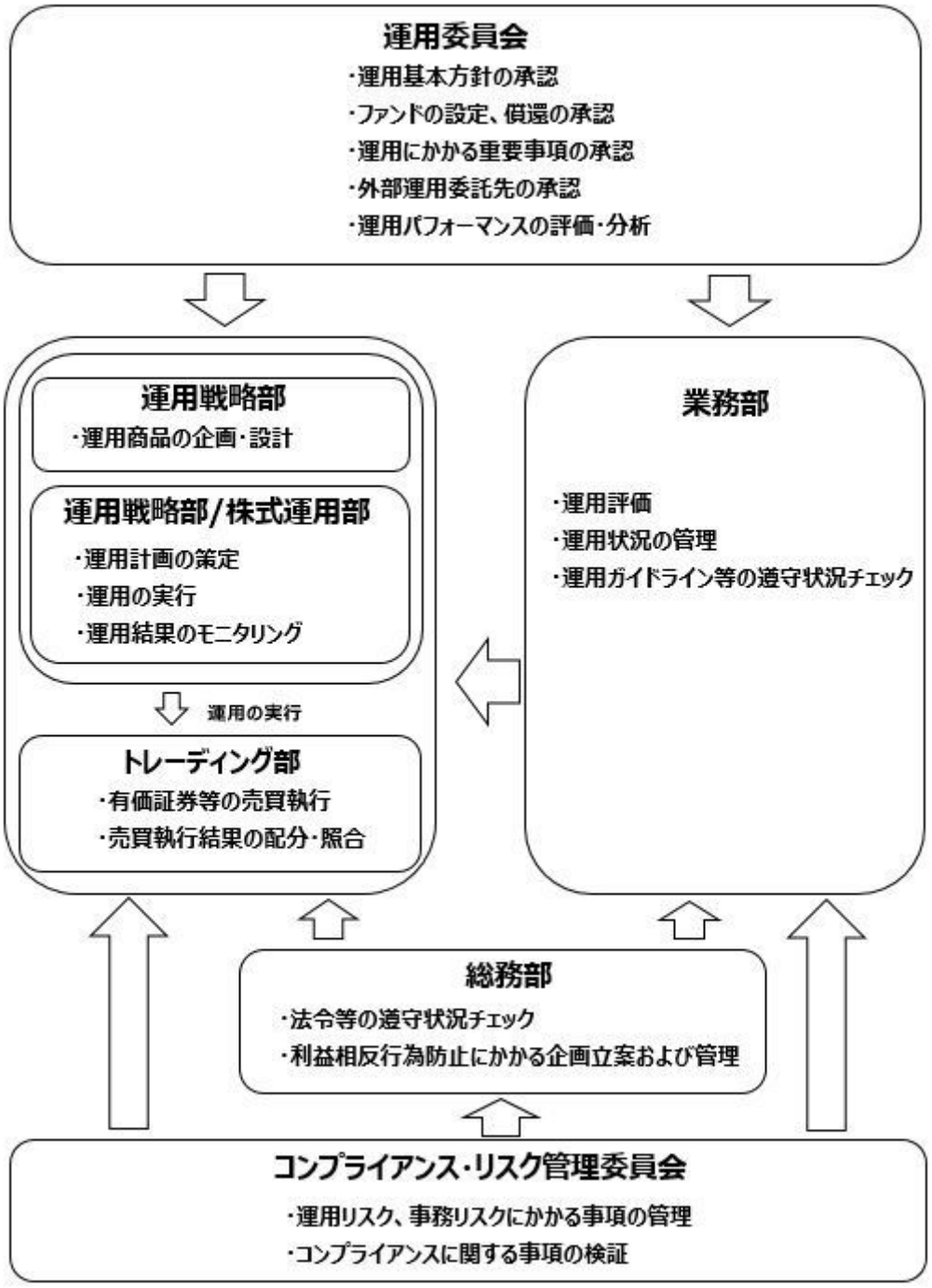
＜ＲＡＭ先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

① 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。

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

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

※上記の運用体制は、2019年7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針
原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

②　収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

11）スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

３．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

４．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

５．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

６．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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たときは、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たときは、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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16）外国為替予約取引の指図および範囲

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

17）資金の借入れ

1．委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

② 資産配分リスク

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

③ 信用リスク

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

④ 流動性リスク

時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期

待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。

⑤　カントリーリスク

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

①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。

②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。

③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。

④ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

（２）リスク管理体制

○委託会社における投資リスクに対する管理体制

①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス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。

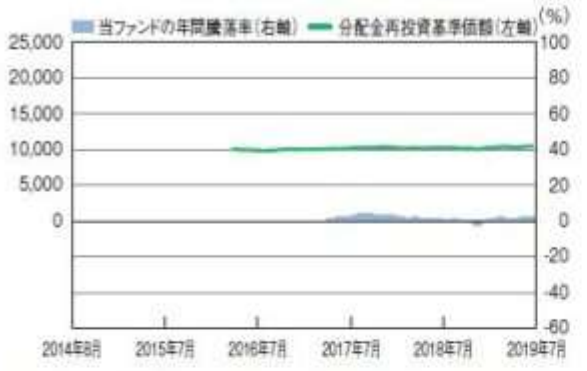
②運用委員会は、運用実績等を統括し運用戦略部および株式運用部に対する管理・指導を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会では、審議事項を代表取締役または取締役会に報告します。

※上記体制は2019年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

2014年8月末～2019年7月末

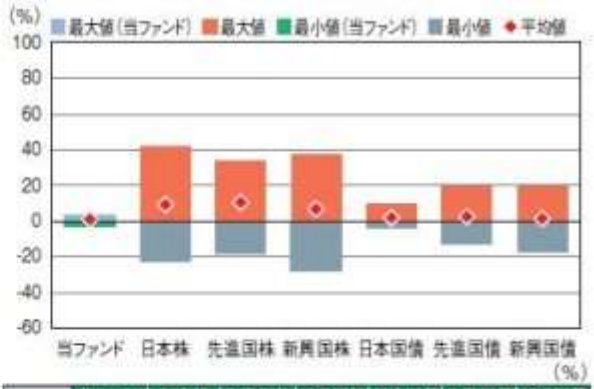


＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2017年5月から2019年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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。

2014年8月末～2019年7月末



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	3.8	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△2.9	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.3	9.3	10.6	6.9	2.0	2.7	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8月から2019年7月の5年間（当ファンドは2017年5月から2019年7月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX,配当込み)

東証株価指数(TOPIX,配当込み)は、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】

①　換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬

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

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

③ 支払時期

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

（4）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の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。

② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）

③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。

④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。

⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

≪確定拠出年金の場合≫

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

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

≪確定拠出年金でない場合≫

①　個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

②　法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③　個別元本

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

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

④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

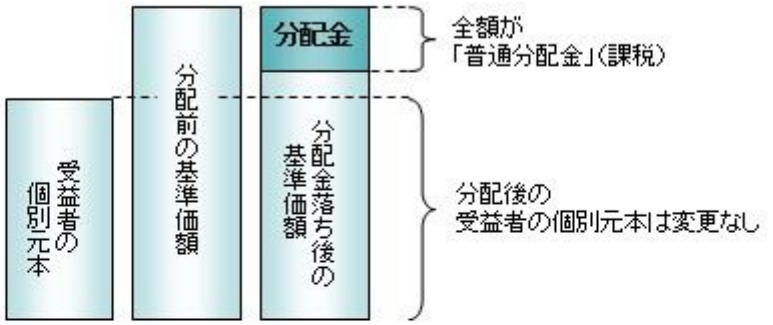
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

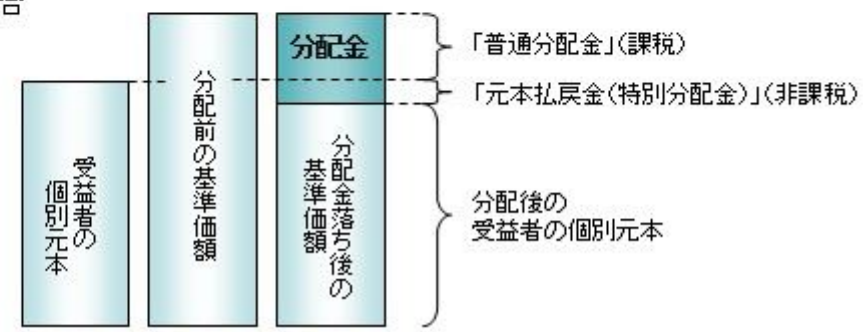
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※上記は2019年7月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【ＤＣりそな　グローバルバランス】

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	348,573,539	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	1,021,940	0.29
合計（純資産総額）		349,595,479	100.00

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	206,074,069	1.0513	216,647,614	1.0691	220,313,787	63.02

日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	53,092,342	0.9677	51,380,113	0.9908	52,603,892	15.05
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	31,058,049	1.0703	33,241,543	1.0829	33,632,761	9.62
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	10,546,069	1.1725	12,365,858	1.2867	13,569,626	3.88
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	5,842,698	1.2586	7,353,935	1.2823	7,492,091	2.14
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	5,379,370	1.2114	6,516,985	1.3449	7,234,714	2.07
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	6,114,703	1.0543	6,446,866	1.1281	6,897,996	1.97
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	6,091,590	1.0752	6,549,679	1.1210	6,828,672	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.71
合　　計	99.71

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2017年 1月25日)	44	44	1.0004	1.0004
第2計算期間末　(2018年 1月25日)	117	117	1.0382	1.0382
第3計算期間末　(2019年 1月25日)	273	273	1.0147	1.0147
2018年 7月末日	248	—	1.0225	—
8月末日	252	—	1.0174	—
9月末日	266	—	1.0254	—
10月末日	270	—	1.0096	—
11月末日	255	—	1.0184	—
12月末日	254	—	1.0036	—
2019年 1月末日	281	—	1.0171	—
2月末日	290	—	1.0282	—
3月末日	304	—	1.0353	—

4月末日	300	—	1.0366	—
5月末日	320	—	1.0268	—
6月末日	340	—	1.0387	—
7月末日	349	—	1.0430	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.04
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.78
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	△2.26
当中間期	2019年 1月26日～2019年 7月25日	2.84

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	47,045,838	2,987,019
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	94,737,024	26,010,237
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	234,142,892	77,862,922
当中間期	2019年 1月26日～2019年 7月25日	103,013,910	48,467,260

(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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	60,744,303,410	84.22
地方債証券	日本	3,734,916,700	5.18
特殊債券	日本	4,438,217,667	6.15
社債券	日本	2,740,444,000	3.80
	フランス	100,833,000	0.14
	オーストラリア	100,496,000	0.14
	小計	2,941,773,000	4.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	269,017,078	0.37
合計（純資産総額）		72,128,227,855	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	850,000,000	101.57	863,372,400	101.61	863,736,000	0.100	2024/3/20	1.20
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	810,000,000	101.07	818,686,300	101.14	819,258,300	0.100	2022/12/20	1.14
日本	国債証券	第１２６回利付国債（５年）	780,000,000	100.46	783,607,600	100.39	783,088,800	0.100	2020/12/20	1.09
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	740,000,000	100.98	747,316,600	101.04	747,710,800	0.100	2022/9/20	1.04
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	680,000,000	101.92	693,059,400	102.77	698,836,000	0.100	2028/3/20	0.97
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	690,000,000	100.91	696,308,500	100.92	696,410,100	0.100	2022/6/20	0.97
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	670,000,000	101.32	678,881,900	101.52	680,244,300	0.100	2023/12/20	0.94
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	651,000,000	103.57	674,255,700	103.71	675,171,630	0.400	2025/3/20	0.94
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	634,000,000	103.73	657,676,800	104.05	659,683,340	0.400	2025/9/20	0.91
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	630,000,000	101.97	642,464,200	102.68	646,902,900	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	581,000,000	104.08	604,756,400	104.17	605,268,370	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	580,000,000	102.10	592,214,000	102.48	594,424,600	0.100	2026/6/20	0.82
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	540,000,000	101.66	549,003,000	102.72	554,698,800	0.100	2028/12/20	0.77
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	540,000,000	101.95	550,532,500	102.64	554,277,600	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第３１９回利付国債（１０年）	490,000,000	103.69	508,090,800	103.12	505,332,100	1.100	2021/12/20	0.70
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	490,000,000	101.22	495,998,200	101.37	496,727,700	0.100	2023/6/20	0.69
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	477,000,000	104.26	497,320,200	104.07	496,452,060	0.800	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	103.23	485,218,600	0.800	2022/9/20	0.67
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	470,000,000	102.60	482,220,000	101.92	479,042,800	1.200	2020/12/20	0.66
日本	国債証券	第３２８回利付国債（１０年）	461,000,000	103.18	475,696,680	103.05	475,101,990	0.600	2023/3/20	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	100.56	472,664,900	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	103.95	462,617,550	0.600	2024/3/20	0.64
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	450,000,000	101.41	456,375,000	102.74	462,348,000	0.100	2028/9/20	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	101.44	456,484,500	0.100	2023/9/20	0.63
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	440,000,000	101.13	444,980,100	101.24	445,482,400	0.100	2023/3/20	0.62
日本	国債証券	第１４８回利付国債（２０年）	365,000,000	118.58	432,817,000	121.50	443,489,600	1.500	2034/3/20	0.61
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	360,000,000	119.84	431,451,000	121.78	438,418,800	1.500	2034/6/20	0.61
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	360,000,000	117.49	422,975,600	120.46	433,663,200	1.400	2034/9/20	0.60
日本	国債証券	第１４３回利付国債（２０年）	355,000,000	119.49	424,214,350	121.97	433,021,900	1.600	2033/3/20	0.60
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	360,000,000	117.37	422,564,400	119.41	429,901,200	1.300	2035/6/20	0.60

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.22
地方債証券	5.18
特殊債券	6.15
社債券	4.08
合　　計	99.63

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券	アメリカ	16,870,840,333	46.72
	カナダ	690,540,782	1.91
	メキシコ	273,940,811	0.76
	ドイツ	2,349,880,926	6.51
	イタリア	3,181,641,585	8.81
	フランス	3,584,247,580	9.93
	オランダ	707,577,016	1.96
	スペイン	2,078,802,272	5.76
	ベルギー	906,426,485	2.51
	オーストリア	524,499,418	1.45
	フィンランド	208,286,507	0.58
	アイルランド	259,510,152	0.72
	イギリス	2,229,116,965	6.17
	スウェーデン	117,776,122	0.33
	ノルウェー	83,499,144	0.23
	デンマーク	191,763,630	0.53
	ポーランド	212,980,911	0.59
	オーストラリア	714,462,393	1.98
	シンガポール	151,715,408	0.42
	マレーシア	168,769,419	0.47
	南アフリカ	202,515,192	0.56
	小計	35,708,793,051	98.88
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	403,007,794	1.12
合計（純資産総額）		36,111,800,845	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	—	121,116,566	0.34

(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	10,709.73	186,349,452	10,822.19	188,306,255	1.625	2020/7/31	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,660,000	10,659.18	176,942,451	10,791.85	179,144,799	1.375	2020/8/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,685.33	170,965,395	10,807.34	172,917,525	1.500	2020/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	10,558.68	162,603,799	11,080.00	170,632,104	2.250	2027/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,490,000	10,716.83	159,680,834	10,937.41	162,967,509	2.000	2024/4/30	0.45

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	10,601.87	153,727,125	10,749.20	155,863,480	1.250	2021/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,310,000	11,294.70	147,960,583	11,852.36	155,266,029	3.125	2028/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	11,166.25	150,744,400	11,165.09	150,728,762	2.375	2029/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,528.70	140,031,766	11,067.06	147,191,942	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	10,949.43	141,247,699	11,397.43	147,026,958	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,649.79	141,642,315	10,785.27	143,444,202	1.375	2020/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	10,917.68	140,838,114	11,058.36	142,652,888	2.750	2021/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,320,000	10,476.97	138,296,004	10,702.94	141,278,924	1.125	2021/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	10,841.50	136,602,990	11,146.63	140,447,581	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	11,014.86	132,178,377	11,613.65	139,363,900	2.875	2028/8/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	19,664.53	121,920,097	22,211.58	137,711,808	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	10,640.35	135,132,516	10,842.56	137,700,621	1.750	2021/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	11,013.59	129,960,384	11,604.53	136,933,498	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,906.36	128,695,161	11,491.65	135,601,472	2.750	2028/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	10,283.73	129,575,069	10,660.72	134,325,118	1.625	2026/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,639.04	127,668,587	11,178.46	134,141,541	2.375	2027/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,210,000	10,601.81	128,282,010	11,001.07	133,112,973	2.125	2025/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	10,675.84	127,042,557	11,076.61	131,811,679	2.250	2025/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,716.99	126,460,540	11,054.75	130,446,116	2.250	2024/1/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,698.59	126,243,404	10,945.48	129,156,664	2.000	2024/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,510.72	124,026,610	10,770.21	127,088,503	1.625	2023/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	10,565.02	123,610,816	10,840.02	126,828,258	1.750	2022/9/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	10,363.23	120,213,549	10,897.31	126,408,835	2.000	2026/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	10,527.32	122,116,962	10,720.98	124,363,428	1.250	2021/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,120,000	10,548.84	118,147,051	11,072.15	124,008,140	2.250	2027/8/15	0.34

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.88
合　　計	98.88

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	593,800.00	64,612,684	64,498,556	0.18
	カナダドル	買建	98,500.00	8,138,651	8,142,010	0.02
	ユーロ	買建	400,000.00	48,490,720	48,476,000	0.13

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	3,378,110,071	99.89
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	3,579,880	0.11
合計（純資産総額）		3,381,689,951	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	―	2,259,504	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	895,322	3,676.11	3,291,307,563	3,773.06	3,378,110,071	99.89

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.89
合　　計	99.89

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	20,800.00	2,263,456	2,259,504	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,372,107,930	97.06
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	858,613,024	2.94
合計（純資産総額）		29,230,720,954	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	837,810,000	2.87

(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	141,100	6,738.64	950,823,407	7,024.00	991,086,400	3.39
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	98,600	4,350.58	428,967,188	5,628.00	554,920,800	1.90
日本	株式	ソニー	電気機器	85,000	5,310.64	451,404,957	6,170.00	524,450,000	1.79
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	859,800	574.29	493,776,922	524.20	450,707,160	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	85,000	4,732.79	402,287,729	4,922.00	418,370,000	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	110,600	4,420.44	488,900,782	3,635.00	402,031,000	1.38
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,200	56,538.18	350,536,721	63,130.00	391,406,000	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	88,000	3,977.00	349,976,297	3,807.00	335,016,000	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	86,700	2,886.48	250,258,351	3,718.00	322,350,600	1.10
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	101,900	2,695.64	274,685,994	2,853.50	290,771,650	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	106,800	3,190.85	340,783,689	2,710.50	289,481,400	0.99
日本	株式	任天堂	その他製品	7,200	34,056.40	245,206,140	40,100.00	288,720,000	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,697,200	175.66	298,138,464	154.40	262,047,680	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	44,700	5,383.61	240,647,586	5,797.00	259,125,900	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	87,500	3,095.64	270,868,820	2,936.50	256,943,750	0.88

日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,300	23,256.74	262,801,235	21,920.00	247,696,000	0.85
日本	株式	花王	化学	30,700	7,764.30	238,364,035	7,979.00	244,955,300	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	21,900	9,164.02	200,692,242	11,155.00	244,294,500	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	36,200	4,050.34	146,622,353	6,647.00	240,621,400	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,300	12,195.39	210,980,263	13,585.00	235,020,500	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	12,000	18,755.58	225,066,966	19,530.00	234,360,000	0.80
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,500	10,051.66	226,162,494	10,005.00	225,112,500	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	15,200	13,237.30	201,207,057	14,715.00	223,668,000	0.77
日本	株式	日立製作所	電気機器	57,000	3,453.64	196,857,774	3,892.00	221,844,000	0.76
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	25,500	6,491.82	165,541,495	8,405.00	214,327,500	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	14,300	11,341.54	162,184,062	14,440.00	206,492,000	0.71
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	78,700	2,583.07	203,287,789	2,615.00	205,800,500	0.70
日本	株式	資生堂	化学	25,200	6,670.10	168,086,695	8,046.00	202,759,200	0.69
日本	株式	キヤノン	電気機器	68,200	3,134.61	213,780,923	2,970.50	202,588,100	0.69
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	52,300	4,607.56	240,975,648	3,728.00	194,974,400	0.67

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	0.26
		建設業	2.69
		食料品	3.91
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.12
		医薬品	5.42
		石油・石炭製品	0.57
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.82
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.57
		機械	4.90
		電気機器	13.46
		輸送用機器	7.51
		精密機器	2.08
		その他製品	2.13
		電気・ガス業	1.65
		陸運業	4.53
		海運業	0.16
		空運業	0.53
		倉庫・運輸関連業	0.19

		情報・通信業	8.77
		卸売業	4.81
		小売業	4.52
		銀行業	5.63
		証券、商品先物取引業	0.70
		保険業	2.31
		その他金融業	1.06
		不動産業	2.36
		サービス業	5.12
合　　計			97.06

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	53	日本円	823,578,620	829,980,000	2.84
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	5	日本円	7,779,490	7,830,000	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。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	15,377,671,332	54.57
	カナダ	909,777,770	3.23
	モーリシャス	140,052	0.00
	パナマ	14,175,838	0.05
	ドイツ	734,526,500	2.61
	イタリア	162,493,645	0.58
	フランス	874,386,536	3.10
	オランダ	433,116,328	1.54
	スペイン	251,510,817	0.89
	ベルギー	88,884,463	0.32
	オーストリア	17,368,664	0.06
	ルクセンブルク	21,626,543	0.08
	フィンランド	94,701,878	0.34

	アイルランド	436,021,941	1.55
	ポルトガル	14,905,343	0.05
	イギリス	1,415,994,381	5.02
	スイス	881,443,562	3.13
	スウェーデン	207,038,639	0.73
	ノルウェー	54,847,726	0.19
	デンマーク	146,066,683	0.52
	ケイマン	59,057,080	0.21
	リベリア	14,592,136	0.05
	オーストラリア	576,103,010	2.04
	バミューダ	88,545,726	0.31
	ニュージーランド	19,690,842	0.07
	パプアニューギニア	3,539,307	0.01
	香港	240,276,713	0.85
	シンガポール	105,299,477	0.37
	イスラエル	51,521,042	0.18
	キュラソー	36,148,238	0.13
	ジャージー	88,663,640	0.31
	英ヴァージン諸島	3,188,016	0.01
	マン島	1,203,171	0.00
	小計	23,424,527,039	83.13
投資証券	アメリカ	523,493,480	1.86
	カナダ	636,116	0.00
	フランス	24,735,654	0.09
	イギリス	12,758,600	0.05
	オーストラリア	46,003,760	0.16
	香港	17,938,935	0.06
	シンガポール	14,641,779	0.05
	小計	640,208,324	2.27
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	4,114,858,331	14.60
合計（純資産総額）		28,179,593,694	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,190,748,646	11.32
	買建	ドイツ	923,036,963	3.28

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	96,619,520	0.34

(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	12,039.55	507,286,739	15,247.62	642,458,637	2.28
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	17,299.18	471,766,201	22,681.85	618,556,982	2.20
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2,417	183,645.98	443,872,339	206,256.29	498,521,475	1.77
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	13,864	16,558.25	229,563,671	21,406.42	296,778,685	1.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,831	117,398.50	214,956,656	133,099.20	243,704,653	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	18,999	11,274.30	214,200,599	12,557.69	238,583,697	0.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1,744	118,376.02	206,447,781	133,409.91	232,666,900	0.83
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	14,053.37	217,068,505	14,349.17	221,637,298	0.79
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	17,808	9,609.37	171,123,717	11,537.01	205,451,113	0.73
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	24,655	7,851.23	193,572,269	8,186.02	201,826,422	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	10,162	15,578.27	158,306,402	19,721.41	200,409,062	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	14,514	10,528.04	152,803,977	13,081.34	189,862,604	0.67
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	53,361	3,138.22	167,458,828	3,355.88	179,073,625	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	7,607	21,905.81	166,637,538	22,576.47	171,739,271	0.61
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	10,518	12,474.69	131,208,863	15,745.19	165,607,963	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	5,308	22,915.45	121,635,253	30,219.30	160,404,057	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	42,552	3,358.52	142,912,122	3,713.31	158,008,988	0.56
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,623	5,132.85	131,519,068	6,134.90	157,194,563	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	6,585	19,723.60	129,879,931	23,613.99	155,498,127	0.55
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	5,578	28,538.27	159,186,478	27,695.59	154,486,030	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	11,091	12,506.89	138,713,968	13,508.29	149,820,529	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	24,137	6,214.82	150,007,238	6,152.28	148,497,660	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	26,136	5,338.68	139,531,751	5,616.68	146,797,758	0.52

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	23,657	5,234.38	123,829,836	5,836.14	138,065,583	0.49
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	4,486.92	144,896,283	4,214.14	136,087,404	0.48
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	8,128.28	122,143,705	9,046.45	135,941,046	0.48
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	25,194	5,372.39	135,352,089	5,274.47	132,885,048	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	26,490	4,064.65	107,672,667	4,788.85	126,856,668	0.45
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	8,593.08	108,779,892	9,956.90	126,044,400	0.45
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,102	28,439.52	116,658,933	29,221.09	119,864,948	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.94
		素材	3.75
		資本財	5.95
		商業・専門サービス	1.09
		運輸	1.69
		自動車・自動車部品	0.94
		耐久消費財・アパレル	1.61
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	5.21
		小売	4.16
		食品・生活必需品小売り	1.28
		食品・飲料・タバコ	4.29
		家庭用品・パーソナル用品	1.85
		ヘルスケア機器・サービス	4.19
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.63
		銀行	6.71
		各種金融	3.66
		保険	3.37
		不動産	0.48
		ソフトウェア・サービス	8.33
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.71
		電気通信サービス	2.02
		公益事業	2.96

		半導体・半導体製造装置	2.63
投資証券	―	―	2.27
合　　計			85.40

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	195	米ドル	28,772,590	3,125,854,178	29,369,925	3,190,748,646	11.32
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6001909	買建	397	ユーロ	7,651,760	927,316,795	7,616,445	923,036,963	3.28

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	667,000.00	72,424,888	72,449,960	0.26
	カナダドル	買建	40,000.00	3,294,252	3,306,400	0.01
	ユーロ	買建	40,000.00	4,852,180	4,847,600	0.02
	英ポンド	買建	60,000.00	7,956,634	7,917,400	0.03
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,291,900	3,291,900	0.01
	オーストラリアドル	買建	57,000.00	4,270,365	4,251,060	0.02
	香港ドル	買建	40,000.00	554,848	555,200	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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	21,010,770	0.28
	アルゼンチン	17,167,802	0.23
	メキシコ	142,423,975	1.91
	ブラジル	474,444,383	6.35
	チリ	54,407,828	0.73
	コロンビア	24,973,087	0.33

	ペルー	4,227,096	0.06
	オランダ	4,125,387	0.06
	ルクセンブルク	6,722,407	0.09
	ギリシャ	19,259,186	0.26
	トルコ	32,834,055	0.44
	チェコ	8,730,664	0.12
	ハンガリー	17,879,410	0.24
	ポーランド	63,189,383	0.85
	ロシア	217,389,751	2.91
	ケイマン	991,946,130	13.28
	バミューダ	54,197,531	0.73
	香港	190,274,944	2.55
	シンガポール	2,051,970	0.03
	マレーシア	125,661,847	1.68
	タイ	173,659,949	2.32
	フィリピン	68,132,331	0.91
	インドネシア	130,274,301	1.74
	韓国	702,917,548	9.41
	台湾	651,830,829	8.73
	中国	660,367,980	8.84
	インド	510,220,431	6.83
	カタール	60,775,032	0.81
	エジプト	5,685,805	0.08
	南アフリカ	328,841,656	4.40
	アラブ首長国連邦	46,103,274	0.62
	マン島	3,540,903	0.05
	小計	5,815,267,645	77.84
投資証券	メキシコ	4,351,015	0.06
	南アフリカ	11,255,997	0.15
	小計	15,607,012	0.21
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	1,639,481,845	21.95
合計（純資産総額）		7,470,356,502	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	1,639,672,550	21.95

(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	—	22,300,426	0.30
	売建	—	4,724	△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	4,587.17	259,175,309	5,183.74	292,881,762	3.92
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	14,030	17,003.06	238,553,068	18,914.22	265,366,563	3.55
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	244,000	782.76	190,995,528	910.00	222,040,000	2.97
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	3,963.59	194,889,815	4,282.60	210,575,442	2.82
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,332	22,479.99	97,383,357	27,074.63	117,287,306	1.57
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	959,000	92.68	88,887,794	85.42	81,921,136	1.10
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	55,500	1,034.67	57,424,247	1,321.63	73,350,659	0.98
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	61,500	1,131.09	69,562,629	937.57	57,660,863	0.77
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	16,297	3,140.95	51,188,221	3,382.32	55,121,791	0.74
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	73,200	736.04	53,878,641	751.77	55,030,003	0.74
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,400	1,992.59	56,589,790	1,877.63	53,324,720	0.71
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	50,000	1,031.28	51,564,412	1,014.21	50,710,500	0.68
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	48,800	1,064.56	51,950,961	1,024.81	50,010,752	0.67
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	639,000	81.25	51,923,197	74.58	47,662,563	0.64
ブラジル	株式	VALE SA	素材	32,000	1,585.38	50,732,247	1,432.78	45,849,168	0.61
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	34,862	1,164.23	40,587,660	1,260.39	43,939,821	0.59
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	26,697	1,440.01	38,444,145	1,638.29	43,737,460	0.59
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	51,229	529.78	27,140,284	802.19	41,095,788	0.55
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	5,355	6,502.61	34,821,500	7,258.80	38,870,874	0.52
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	801,000	48.46	38,820,879	44.86	35,936,625	0.48
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	4,012	8,597.76	34,494,252	8,684.68	34,842,943	0.47
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	245.66	30,413,068	272.30	33,710,740	0.45
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,750	17,290.62	47,549,230	12,249.16	33,685,190	0.45
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	179,000	178.61	31,972,915	182.23	32,620,387	0.44
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	9,012	3,052.93	27,513,060	3,464.84	31,225,215	0.42

ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	46,400	491.96	22,826,970	582.74	27,039,182	0.36
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	46,300	583.04	26,994,845	583.30	27,006,910	0.36
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	343,100	84.19	28,885,763	78.60	26,968,689	0.36
ブラジル	株式	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	各種金融	21,300	924.61	19,694,203	1,235.67	26,319,867	0.35
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	101,500	214.27	21,749,271	242.58	24,621,870	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	6.03
		素材	5.42
		資本財	2.52
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	1.47
		自動車・自動車部品	1.77
		耐久消費財・アパレル	0.97
		消費者サービス	1.04
		メディア・娯楽	5.80
		小売	6.87
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	0.83
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.48
		銀行	14.23
		各種金融	2.00
		保険	3.20
		不動産	2.13
		ソフトウェア・サービス	1.57
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.37
		電気通信サービス	3.54
		公益事業	2.18
		半導体・半導体製造装置	4.30
投資証券	―	―	0.21
合　　計			78.05

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（各通貨）	契約額等（円）	評価額（各通貨）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 1909	買建	291	米ドル	15,130,965	1,643,828,036	15,092,715	1,639,672,550	21.95

(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	100,043.52	10,847,826	10,867,726	0.15
	メキシコペソ	買建	390,000.00	2,225,982	2,219,100	0.03
	ポーランドズロチ	買建	60,000.00	1,697,640	1,690,800	0.02
	香港ドル	買建	520,000.00	7,218,144	7,217,600	0.10
	南アフリカランド	買建	40,000.00	303,868	305,200	0.00
	オフショア人民元	売建	299.97	4,736	4,724	△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国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	14,712,572,780	98.33
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	249,406,577	1.67
合計（純資産総額）		14,961,979,357	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	240,720,000	1.61

(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	1,400	714,275.69	999,985,966	764,000	1,069,600,000	7.15

日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,446	639,674.62	924,969,500	681,000	984,726,000	6.58
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,508	156,564.08	705,790,872	172,900	779,433,200	5.21
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,880	187,819.79	540,920,995	211,300	608,544,000	4.07
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,732	219,353.9	599,274,854	218,800	597,761,600	4.00
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,246	172,491.39	559,907,051	184,100	597,588,600	3.99
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,077	234,092.37	486,209,852	261,700	543,550,900	3.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,949	251,878.45	490,911,099	266,500	519,408,500	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,338	318,706.27	426,428,989	337,500	451,575,000	3.02
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	915	442,358.2	404,757,753	481,500	440,572,500	2.94
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	3,601	114,188.11	411,191,384	121,400	437,161,400	2.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,657	83,676.46	389,681,274	90,800	422,855,600	2.83
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	6,341	52,288.87	331,563,735	62,500	396,312,500	2.65
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	724	467,042.28	338,138,610	499,500	361,638,000	2.42
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,227	76,729.58	324,335,934	84,400	356,758,800	2.38
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	447	747,325.59	334,054,538	782,000	349,554,000	2.34
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	480	564,903.72	271,153,785	641,000	307,680,000	2.06
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	334	735,242.71	245,571,065	805,000	268,870,000	1.80
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,663	146,113.18	242,986,218	160,300	266,578,900	1.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,779	121,123.98	215,479,560	142,400	253,329,600	1.69
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	945	233,636.97	220,786,936	261,300	246,928,500	1.65
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	492	453,343.53	223,045,016	469,000	230,748,000	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,175	178,627.47	209,887,277	194,200	228,185,000	1.53
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,295	155,640.51	201,554,460	162,000	209,790,000	1.40
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,484	131,987.69	195,869,731	141,300	209,689,200	1.40
日本	投資証券	日本リート投資法人	470	391,100.7	183,817,329	437,000	205,390,000	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	602	294,680.32	177,397,552	325,500	195,951,000	1.31
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,306	134,609.24	175,799,667	146,700	191,590,200	1.28
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	969	171,159.39	165,853,448	197,300	191,183,700	1.28
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	1,033	170,919.77	176,560,122	181,100	187,076,300	1.25

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.33
合　　計	98.33

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	120	日本円	229,638,560	240,720,000	1.61

(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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	10,571,158,981	72.81
	カナダ	281,555,386	1.94
	ドイツ	39,874,658	0.27
	イタリア	3,417,194	0.02
	フランス	541,890,023	3.73
	オランダ	39,351,983	0.27
	スペイン	100,643,322	0.69
	ベルギー	145,028,959	1.00
	アイルランド	37,891,265	0.26
	イギリス	664,176,648	4.57
	オーストラリア	1,029,949,287	7.09
	ニュージーランド	70,318,815	0.48
	香港	332,617,441	2.29
	シンガポール	563,242,516	3.88
	韓国	2,696,980	0.02
	イスラエル	10,533,709	0.07
	ガーンジー	23,257,244	0.16
	マン島	3,817,549	0.03
	小計	14,461,421,960	99.61
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	57,145,149	0.39
合計（純資産総額）		14,518,567,109	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	—	39,516,960	0.27

(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	67,935	7,306.01	496,334,284	8,909.56	605,271,393	4.17
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	33,201	18,911.02	627,864,843	17,405.21	577,870,523	3.98
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	16,141	22,668.49	365,892,209	26,410.38	426,290,008	2.94
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	43,519	8,252.64	359,146,927	9,120.32	396,907,554	2.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	39,840	7,780.09	309,958,985	8,641.22	344,266,428	2.37
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,985	20,529.69	307,637,474	22,907.83	343,273,839	2.36
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	39,718	6,837.35	271,566,111	7,354.92	292,123,030	2.01
香港	投資証券	LINK REIT	226,400	1,165.05	263,769,052	1,281.35	290,098,206	2.00
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,411	11,625.91	260,548,284	12,384.96	277,559,339	1.91
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	33,889	7,153.66	242,430,620	7,606.97	257,792,701	1.78
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	16,637	13,463.44	223,991,389	14,450.20	240,408,084	1.66
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,073	29,057.25	205,521,986	33,317.71	235,656,200	1.62
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,811	17,954.31	265,921,305	15,179.04	224,816,872	1.55
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,168	13,883.36	168,932,770	16,080.89	195,672,304	1.35
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	172,613	905.21	156,251,881	1,109.89	191,583,031	1.32
アメリカ	投資証券	HCP INC	51,480	3,278.32	168,768,186	3,503.63	180,367,387	1.24
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	18,353	7,971.43	146,299,786	9,385.40	172,250,422	1.19
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	573,752	290.75	166,818,793	295.37	169,472,800	1.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,763	10,333.31	142,217,425	12,156.81	167,314,259	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,272	11,179.59	137,196,037	12,952.06	158,947,690	1.09
アメリカ	投資証券	UDR INC	30,338	4,634.50	140,601,495	5,062.62	153,589,887	1.06
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	79,917	1,900.17	151,855,932	1,920.75	153,500,993	1.06
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	38,765	3,149.39	122,086,438	3,658.99	141,840,949	0.98
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	9,725	11,895.04	115,679,265	14,498.00	140,993,128	0.97
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	45,333	2,538.09	115,059,275	3,015.84	136,717,365	0.94
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	18,726	7,173.21	134,325,582	7,008.36	131,238,669	0.90
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	18,045	6,804.34	122,784,396	7,271.27	131,210,161	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,710	11,373.10	110,432,828	13,453.97	130,638,123	0.90
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	117,425	864.75	101,543,687	1,032.26	121,214,227	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	10,442	10,300.02	107,552,887	11,525.61	120,350,499	0.83

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.61
合　　計	99.61

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	294,000.00	32,007,780	31,937,220	0.22
	ユーロ	買建	13,000.00	1,576,939	1,575,470	0.01
	英ポンド	買建	10,000.00	1,329,420	1,319,600	0.01
	オーストラリアドル	買建	49,000.00	3,683,575	3,654,420	0.03
	シンガポールドル	買建	13,000.00	1,032,928	1,030,250	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2019年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,430円	純資産総額	3.49億円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	63.0
RAM先進国債券マザーファンド	15.0
RAM国内株式マザーファンド	9.6
RAM先進国株式マザーファンド	3.9
RAM新興国株式マザーファンド	2.1
RAM新興国債券マザーファンド	2.0
RAM国内リートマザーファンド	2.1
RAM先進国リートマザーファンド	2.0
現金等	0.3
合計	100.0

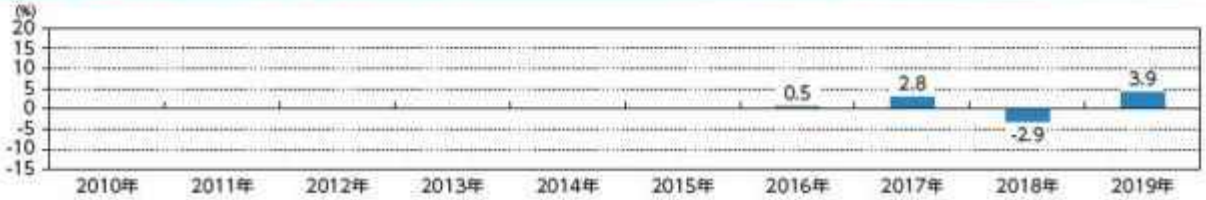
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.20
	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.14
	日本	第126回利付国債(5年)	2020/12/20	1.09
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/7/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/8/31	0.50
	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/8/15	0.48
国内株式	日本	トヨタ自動車	－	3.39
	日本	ソフトバンクグループ	－	1.90
	日本	ソニー	－	1.79
先進国株式	アメリカ	MICROSOFT CORP	－	2.28
	アメリカ	APPLE INC	－	2.20
	アメリカ	AMAZON.COM INC	－	1.77
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	－	3.92
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	－	3.55
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	－	2.97
新興国債券	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	－	99.89
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	－	7.15
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	－	6.58
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	－	5.21
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	－	4.17
	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	－	3.98
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	－	2.94

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2016年5月12日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は5月12日から12月末までの騰落率です。2019年は7月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第２【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。

・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会等に限るものとします。

・当ファンドは、収益分配金を無手数料で自動的にファンドに再投資する＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞専用です。

（2）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（3）取扱時間

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

（4）取得申込不可日

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

●ニューヨークの銀行の休業日

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ロンドンの銀行の休業日

●ロンドン証券取引所の休業日

（5）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（6）申込単位

１円以上１円単位

（7）申込代金の支払い

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

（8）受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

（1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（2）取扱時間

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

（3）解約請求不可日

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

●ニューヨークの銀行の休業日

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ロンドンの銀行の休業日

●ロンドン証券取引所の休業日

（4）解約制限

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

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

（６）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

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

（７）解約単位

１口単位

（８）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

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

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

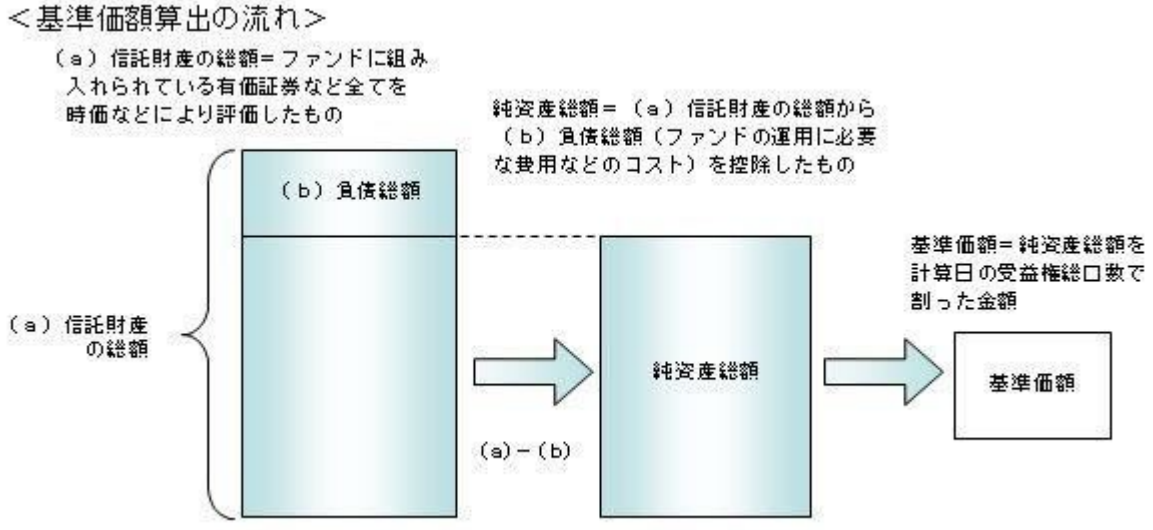
3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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



②　有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

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

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③　基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

①　信託の終了（繰上償還）

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

イ）受益者の解約によりファンドの純資産総額が20億円を下回ることとなった場合

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

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

② 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。

③ 信託約款の変更など

1）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、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。

④ 書面決議

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

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

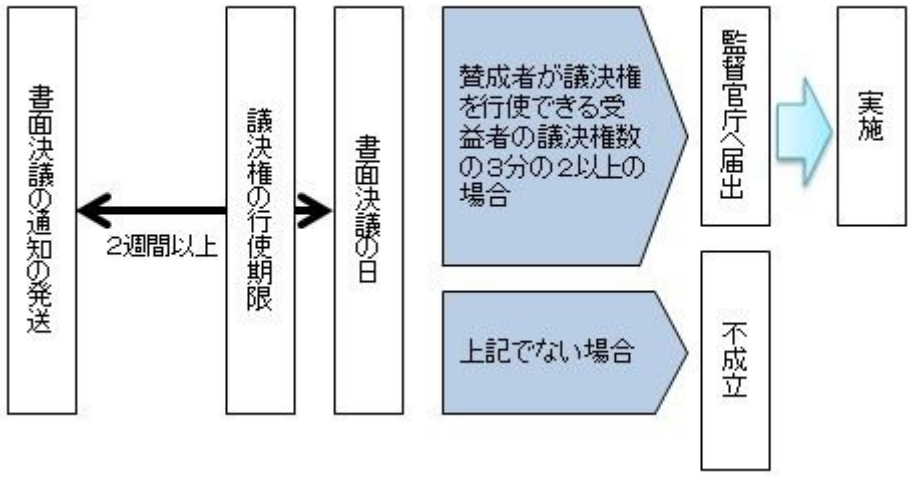
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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

5）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6）当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

＜書面決議の主な流れ＞



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥ 運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦ 関係法人との契約について

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

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年 1月26日から2019年 1月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣりそな　グローバルバランス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年 1月25日現在	第3期 2019年 1月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,117,376	1,952,598
親投資信託受益証券	116,257,048	271,915,873
流動資産合計	117,374,424	273,868,471
資産合計	117,374,424	273,868,471
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,857	-
未払受託者報酬	18,103	55,369
未払委託者報酬	253,380	775,079
未払利息	3	5
その他未払費用	4,438	13,773
流動負債合計	279,781	844,226
負債合計	279,781	844,226
純資産の部		
元本等		
元本	112,785,606	269,065,576
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,309,037	3,958,669
（分配準備積立金）	2,439,641	3,578,869
元本等合計	117,094,643	273,024,245
純資産合計	117,094,643	273,024,245
負債純資産合計	117,374,424	273,868,471

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　2017年 1月26日 至　2018年 1月25日	第3期 自　2018年 1月26日 至　2019年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,117,104	△1,991,175
営業収益合計	3,117,104	△1,991,175
営業費用		
支払利息	447	1,501
受託者報酬	27,875	93,754
委託者報酬	390,056	1,312,470
その他費用	6,798	23,332
営業費用合計	425,176	1,431,057
営業利益又は営業損失（△）	2,691,928	△3,422,232
経常利益又は経常損失（△）	2,691,928	△3,422,232
当期純利益又は当期純損失（△）	2,691,928	△3,422,232
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（△）	335,575	△972,491
期首剰余金又は期首欠損金（△）	16,300	4,309,037
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,118,925	4,273,979
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,118,925	4,273,979
剰余金減少額又は欠損金増加額	182,541	2,174,606
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	182,541	2,174,606
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,309,037	3,958,669

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

第2期 2018年 1月25日現在		第3期 2019年 1月25日現在	
１．投資信託財産に係る元本の状況		１．投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	44,058,819円	期首元本額	112,785,606円
期中追加設定元本額	94,737,024円	期中追加設定元本額	234,142,892円
期中一部解約元本額	26,010,237円	期中一部解約元本額	77,862,922円
２．計算期間の末日における受益権の総数	112,785,606口	２．計算期間の末日における受益権の総数	269,065,576口
３．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0382円	３．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0147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)	(10,382円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,147円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2017年 1月26日 至 2018年 1月25日		第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	740,492円	A 費用控除後の配当等収益額	1,859,251円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,615,861円	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	1,869,396円	C 収益調整金額	5,506,937円
D 分配準備積立金額	83,288円	D 分配準備積立金額	1,719,618円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	4,309,037円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	9,085,806円
F 当ファンドの期末残存口数	112,785,606口	F 当ファンドの期末残存口数	269,065,576口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	382円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	337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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年 1月26日 至 2018年 1月25日	第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日
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。	1 .金融商品に対する取組方針 同左
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、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2 .金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
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。	3 .金融商品に係るリスク管理体制 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 1月25日現在	第3期 2019年 1月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。 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。	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 同左
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。	3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年 1月26日 至 2018年 1月25日	第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 1月26日 至 2018年 1月25日	第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,602,783	△632,285
合計	2,602,783	△632,285

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	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	167,698,114	175,797,932	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	37,166,215	35,620,100	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	4,644,940	4,977,982	
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	24,604,054	26,311,575	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	10,986,879	12,596,456	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	4,031,944	5,031,059	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	4,805,170	5,732,087	
	ＲＡＭ先進国リ－トマザーファンド	5,671,175	5,848,682	
合計		259,608,491	271,915,873	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	728,750
コール・ローン	83,044,669
国債証券	53,797,568,840
地方債証券	3,612,073,600
特殊債券	4,326,538,097
社債券	2,626,014,000
未収利息	133,413,879
前払費用	3,176,703
流動資産合計	64,582,558,538
資産合計	64,582,558,538
負債の部	
流動負債	
未払金	27,155,600
未払利息	225
その他未払費用	1,511
流動負債合計	27,157,336
負債合計	27,157,336
純資産の部	
元本等	
元本	61,581,519,887
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,973,881,315
元本等合計	64,555,401,202
純資産合計	64,555,401,202
負債純資産合計	64,582,558,538

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 1月25日現在	
1．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	44,564,485,799円
期中追加設定元本額	30,827,391,731円
期中一部解約元本額	13,810,357,643円
期末元本額	61,581,519,887円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	15,753,351,837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）	141,806,762円
ＤＣりそな　グローバルバランス	167,698,114円
つみたてバランスファンド	320,278,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	94,245,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	13,332,955円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	3,582,995円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	44,234,131,174円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	77,864,040円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	21,630,565円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	27,774,230円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	16,027,772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）	3,192,786円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	410,748,538円
２．　計算日における受益権の総数	
	61,581,519,887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	1.0483円
(10,000口当たり純資産額)	(10,483円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	372,047,000
地方債証券	16,376,400
特殊債券	11,370,483
社債券	6,665,000
合計	406,458,883

(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３８５回利付国債（２年）	210,000,000	210,638,400	
	第３８６回利付国債（２年）	200,000,000	200,654,000	
	第３８７回利付国債（２年）	300,000,000	301,035,000	
	第３８８回利付国債（２年）	300,000,000	301,107,000	
	第３８９回利付国債（２年）	320,000,000	321,222,400	
	第３９０回利付国債（２年）	350,000,000	351,396,500	
	第３９１回利付国債（２年）	200,000,000	200,846,000	
	第３９２回利付国債（２年）	300,000,000	301,338,000	
	第３９３回利付国債（２年）	150,000,000	150,691,500	
	第３９４回利付国債（２年）	160,000,000	160,776,000	
	第３９５回利付国債（２年）	150,000,000	150,747,000	
	第１２３回利付国債（５年）	395,000,000	396,260,050	
	第１２４回利付国債（５年）	305,000,000	306,168,150	
	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	381,983,600	
	第１２７回利付国債（５年）	350,000,000	352,065,000	
	第１２８回利付国債（５年）	470,000,000	473,045,600	
	第１２９回利付国債（５年）	310,000,000	312,222,700	
	第１３０回利付国債（５年）	120,000,000	120,942,000	
	第１３１回利付国債（５年）	540,000,000	544,600,800	
	第１３２回利付国債（５年）	360,000,000	363,315,600	
	第１３３回利付国債（５年）	460,000,000	464,549,400	
	第１３４回利付国債（５年）	530,000,000	535,607,400	
	第１３５回利付国債（５年）	480,000,000	485,400,000	
	第１３６回利付国債（５年）	370,000,000	374,417,800	
	第１３７回利付国債（５年）	540,000,000	546,820,200	
	第１回利付国債（４０年）	40,000,000	58,584,800	
	第２回利付国債（４０年）	70,000,000	99,474,900	
	第３回利付国債（４０年）	80,000,000	114,333,600	
	第４回利付国債（４０年）	130,000,000	186,797,000	
	第５回利付国債（４０年）	130,000,000	180,310,000	
	第６回利付国債（４０年）	130,000,000	177,134,100	

第７回利付国債（４０年）	130,000,000	169,774,800	
第８回利付国債（４０年）	150,000,000	182,122,500	
第９回利付国債（４０年）	230,000,000	205,125,500	
第１０回利付国債（４０年）	220,000,000	231,501,600	
第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	142,332,400	
第３０６回利付国債（１０年）	480,000,000	488,659,200	
第３０７回利付国債（１０年）	250,000,000	254,225,000	
第３０８回利付国債（１０年）	180,000,000	183,702,600	
第３０９回利付国債（１０年）	120,000,000	122,133,600	
第３１０回利付国債（１０年）	130,000,000	132,518,100	
第３１１回利付国債（１０年）	200,000,000	203,214,000	
第３１２回利付国債（１０年）	770,000,000	790,027,700	
第３１３回利付国債（１０年）	520,000,000	536,411,200	
第３１４回利付国債（１０年）	130,000,000	133,545,100	
第３１５回利付国債（１０年）	375,000,000	387,337,500	
第３１６回利付国債（１０年）	300,000,000	309,147,000	
第３１７回利付国債（１０年）	180,000,000	186,069,600	
第３１８回利付国債（１０年）	366,000,000	377,371,620	
第３１９回利付国債（１０年）	490,000,000	508,090,800	
第３２０回利付国債（１０年）	352,000,000	363,971,520	
第３２１回利付国債（１０年）	291,000,000	301,697,160	
第３２２回利付国債（１０年）	120,000,000	124,033,200	
第３２３回利付国債（１０年）	340,000,000	352,348,800	
第３２４回利付国債（１０年）	183,000,000	189,022,530	
第３２５回利付国債（１０年）	470,000,000	486,623,900	
第３２６回利付国債（１０年）	280,000,000	289,489,200	
第３２７回利付国債（１０年）	387,000,000	401,632,470	
第３２８回利付国債（１０年）	461,000,000	475,696,680	
第３２９回利付国債（１０年）	557,000,000	580,778,330	
第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	268,603,550	
第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	93,221,100	
第３３２回利付国債（１０年）	312,000,000	323,771,760	
第３３３回利付国債（１０年）	445,000,000	462,524,100	
第３３４回利付国債（１０年）	481,000,000	500,879,730	
第３３５回利付国債（１０年）	135,000,000	140,073,300	
第３３６回利付国債（１０年）	230,000,000	239,029,800	
第３３７回利付国債（１０年）	150,000,000	154,104,000	
第３３８回利付国債（１０年）	621,000,000	642,561,120	
第３３９回利付国債（１０年）	205,000,000	212,412,800	
第３４０回利付国債（１０年）	534,000,000	553,891,500	
第３４１回利付国債（１０年）	240,000,000	247,608,000	
第３４２回利付国債（１０年）	240,000,000	244,418,400	

第３４３回利付国債（１０年）	220,000,000	224,109,600	
第３４４回利付国債（１０年）	340,000,000	346,303,600	
第３４５回利付国債（１０年）	410,000,000	417,519,400	
第３４６回利付国債（１０年）	430,000,000	437,774,400	
第３４７回利付国債（１０年）	310,000,000	315,378,500	
第３４８回利付国債（１０年）	290,000,000	294,799,500	
第３４９回利付国債（１０年）	370,000,000	375,794,200	
第３５０回利付国債（１０年）	510,000,000	517,257,300	
第３５１回利付国債（１０年）	280,000,000	283,561,600	
第３５２回利付国債（１０年）	510,000,000	515,910,900	
第１回利付国債（３０年）	10,000,000	12,911,500	
第１１回利付国債（３０年）	10,000,000	12,106,800	
第１２回利付国債（３０年）	40,000,000	50,812,400	
第１３回利付国債（３０年）	90,000,000	113,183,100	
第１４回利付国債（３０年）	20,000,000	26,388,000	
第１５回利付国債（３０年）	100,000,000	133,844,000	
第１６回利付国債（３０年）	20,000,000	26,835,200	
第１７回利付国債（３０年）	110,000,000	146,150,400	
第１８回利付国債（３０年）	120,000,000	157,918,800	
第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	131,865,000	
第２０回利付国債（３０年）	60,000,000	81,182,400	
第２１回利付国債（３０年）	90,000,000	119,132,100	
第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	67,931,500	
第２３回利付国債（３０年）	160,000,000	217,822,400	
第２４回利付国債（３０年）	100,000,000	136,521,000	
第２５回利付国債（３０年）	100,000,000	133,284,000	
第２６回利付国債（３０年）	225,000,000	304,452,000	
第２７回利付国債（３０年）	105,000,000	144,383,400	
第２８回利付国債（３０年）	150,000,000	207,106,500	
第２９回利付国債（３０年）	140,000,000	191,343,600	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	257,043,400	
第３１回利付国債（３０年）	150,000,000	200,721,000	
第３２回利付国債（３０年）	175,000,000	238,645,750	
第３３回利付国債（３０年）	240,000,000	313,677,600	
第３４回利付国債（３０年）	195,000,000	263,706,300	
第３５回利付国債（３０年）	226,000,000	297,070,220	
第３６回利付国債（３０年）	235,000,000	309,713,550	
第３７回利付国債（３０年）	260,000,000	338,036,400	
第３８回利付国債（３０年）	160,000,000	204,801,600	
第３９回利付国債（３０年）	70,000,000	91,305,200	
第４０回利付国債（３０年）	195,000,000	250,342,950	
第４１回利付国債（３０年）	145,000,000	182,911,700	
第４２回利付国債（３０年）	130,000,000	164,287,500	

第４３回利付国債（３０年）	140,000,000	177,053,800	
第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	189,834,000	
第４５回利付国債（３０年）	150,000,000	182,919,000	
第４６回利付国債（３０年）	150,000,000	182,985,000	
第４７回利付国債（３０年）	220,000,000	273,867,000	
第４８回利付国債（３０年）	183,000,000	218,891,790	
第４９回利付国債（３０年）	170,000,000	203,376,100	
第５０回利付国債（３０年）	190,000,000	198,867,300	
第５１回利付国債（３０年）	180,000,000	165,542,400	
第５２回利付国債（３０年）	160,000,000	155,102,400	
第５３回利付国債（３０年）	190,000,000	188,871,400	
第５４回利付国債（３０年）	190,000,000	198,430,300	
第５５回利付国債（３０年）	80,000,000	83,476,000	
第５６回利付国債（３０年）	150,000,000	156,376,500	
第５７回利付国債（３０年）	170,000,000	177,063,500	
第５８回利付国債（３０年）	270,000,000	280,953,900	
第５９回利付国債（３０年）	180,000,000	182,444,400	
第６０回利付国債（３０年）	140,000,000	149,255,400	
第４６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,333,300	
第４７回利付国債（２０年）	210,000,000	218,253,000	
第４８回利付国債（２０年）	60,000,000	63,058,800	
第４９回利付国債（２０年）	30,000,000	31,469,400	
第５０回利付国債（２０年）	150,000,000	156,702,000	
第５１回利付国債（２０年）	90,000,000	94,706,100	
第５２回利付国債（２０年）	190,000,000	201,491,200	
第５３回利付国債（２０年）	20,000,000	21,323,000	
第５４回利付国債（２０年）	180,000,000	192,430,800	
第５５回利付国債（２０年）	100,000,000	106,855,000	
第５６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,738,400	
第５７回利付国債（２０年）	110,000,000	117,747,300	
第５８回利付国債（２０年）	100,000,000	107,570,000	
第５９回利付国債（２０年）	40,000,000	42,922,800	
第６０回利付国債（２０年）	30,000,000	31,839,600	
第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	52,427,500	
第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	83,415,200	
第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	65,215,200	
第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	131,564,400	
第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	418,604,200	
第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	22,129,200	
第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	100,980,900	
第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	67,009,800	
第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	125,281,200	

	第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	112,804,000	
	第７２回利付国債（２０年）	150,000,000	169,258,500	
	第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	203,068,800	
	第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	113,978,000	
	第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	112,738,000	
	第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	22,671,600	
	第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	56,633,000	
	第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,782,400	
	第８０回利付国債（２０年）	180,000,000	206,202,600	
	第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	34,328,400	
	第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	195,668,300	
	第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	11,567,100	
	第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	137,970,000	
	第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	174,294,000	
	第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	117,639,000	
	第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	105,225,300	
	第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	218,714,400	
	第８９回利付国債（２０年）	70,000,000	82,233,900	
	第９０回利付国債（２０年）	90,000,000	106,189,200	
	第９１回利付国債（２０年）	10,000,000	11,876,000	
	第９２回利付国債（２０年）	105,000,000	123,574,500	
	第９３回利付国債（２０年）	20,000,000	23,465,800	
	第９４回利付国債（２０年）	90,000,000	106,335,900	
	第９５回利付国債（２０年）	35,000,000	42,108,500	
	第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	83,032,600	
	第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	155,866,100	
	第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	83,318,200	
	第９９回利付国債（２０年）	205,000,000	244,808,950	
	第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	182,193,580	
	第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	24,499,000	
	第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	178,268,800	
	第１０３回利付国債（２０年）	20,000,000	24,400,400	
	第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	12,011,700	
	第１０５回利付国債（２０年）	132,000,000	159,038,880	
	第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	48,580,000	
	第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	157,085,500	
	第１０８回利付国債（２０年）	130,000,000	154,511,500	
	第１０９回利付国債（２０年）	130,000,000	154,966,500	
	第１１０回利付国債（２０年）	115,000,000	139,415,650	
	第１１１回利付国債（２０年）	200,000,000	245,214,000	
	第１１２回利付国債（２０年）	55,000,000	66,863,500	
	第１１３回利付国債（２０年）	275,000,000	335,395,500	
	第１１４回利付国債（２０年）	210,000,000	256,918,200	

第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	123,427,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	173,248,600	
第１１７回利付国債（２０年）	145,000,000	177,830,900	
第１１８回利付国債（２０年）	261,000,000	318,109,410	
第１１９回利付国債（２０年）	60,000,000	71,771,400	
第１２０回利付国債（２０年）	40,000,000	46,942,800	
第１２１回利付国債（２０年）	245,000,000	296,611,700	
第１２２回利付国債（２０年）	20,000,000	23,982,200	
第１２３回利付国債（２０年）	275,000,000	340,241,000	
第１２４回利付国債（２０年）	50,000,000	61,273,500	
第１２５回利付国債（２０年）	60,000,000	75,157,200	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	122,862,000	
第１２７回利付国債（２０年）	50,000,000	60,831,000	
第１２８回利付国債（２０年）	285,000,000	347,366,550	
第１２９回利付国債（２０年）	20,000,000	24,132,000	
第１３０回利付国債（２０年）	250,000,000	302,310,000	
第１３１回利付国債（２０年）	30,000,000	35,903,400	
第１３２回利付国債（２０年）	190,000,000	227,680,800	
第１３３回利付国債（２０年）	125,000,000	151,373,750	
第１３４回利付国債（２０年）	85,000,000	103,138,150	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	48,020,000	
第１３６回利付国債（２０年）	80,000,000	95,008,000	
第１３７回利付国債（２０年）	260,000,000	312,699,400	
第１３８回利付国債（２０年）	50,000,000	58,822,500	
第１３９回利付国債（２０年）	30,000,000	35,687,100	
第１４０回利付国債（２０年）	290,000,000	349,397,800	
第１４１回利付国債（２０年）	155,000,000	187,060,200	
第１４２回利付国債（２０年）	120,000,000	146,448,000	
第１４３回利付国債（２０年）	355,000,000	424,214,350	
第１４５回利付国債（２０年）	325,000,000	393,471,000	
第１４６回利付国債（２０年）	280,000,000	339,511,200	
第１４７回利付国債（２０年）	275,000,000	329,725,000	
第１４８回利付国債（２０年）	365,000,000	432,817,000	
第１４９回利付国債（２０年）	260,000,000	308,625,200	
第１５０回利付国債（２０年）	340,000,000	398,864,200	
第１５１回利付国債（２０年）	205,000,000	234,230,950	
第１５２回利付国債（２０年）	180,000,000	205,729,200	
第１５３回利付国債（２０年）	240,000,000	278,148,000	
第１５４回利付国債（２０年）	298,000,000	340,515,660	
第１５５回利付国債（２０年）	250,000,000	277,467,500	
第１５６回利付国債（２０年）	290,000,000	292,815,900	
第１５７回利付国債（２０年）	160,000,000	155,809,600	

	第１５８回利付国債（２０年）	240,000,000	245,572,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	210,000,000	218,103,900	
	第１６０回利付国債（２０年）	150,000,000	158,278,500	
	第１６１回利付国債（２０年）	250,000,000	259,007,500	
	第１６２回利付国債（２０年）	270,000,000	279,366,300	
	第１６３回利付国債（２０年）	180,000,000	185,995,800	
	第１６４回利付国債（２０年）	250,000,000	253,317,500	
	第１６５回利付国債（２０年）	250,000,000	252,905,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	300,000,000	314,385,000	
	国債証券合計	48,939,000,000	53,797,568,840	
地方債証券	第６８０回東京都公募公債	100,000,000	101,580,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	103,299,000	
	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	103,489,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	103,496,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	103,126,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	100,542,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	100,085,000	
	平成２９年度第６回北海道公募公債	100,000,000	99,964,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	102,523,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,499,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	114,107,400	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,128,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	100,925,000	
	平成２７年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	100,205,000	
	平成２４年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	102,996,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	100,346,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	101,260,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	100,646,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,797,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	103,081,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	103,641,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,428,000	
	第１２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,789,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,793,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,560,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,645,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,354,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	103,181,000	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	119,287,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	103,042,000	
	平成２９年度第２回福岡市公募公債	100,000,000	99,999,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	103,136,000	

	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	121,327,200	
	平成２９年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,038,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	100,759,000	
	地方債証券合計	3,530,000,000	3,612,073,600	
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	101,438,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,165,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	112,282,000	
	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	104,096,660	
	第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	118,332,000	
	第２２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	131,331,970	
	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	103,093,000	
	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	103,475,000	
	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	136,509,870	
	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	101,208,000	
	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	101,541,000	
	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	100,717,000	
	第１３回公営企業債券	100,000,000	113,602,000	
	第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	131,527,550	
	第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,980,000	
	Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,814,000	
	Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,627,000	
	第６６回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,000,000	
	第５７回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,367,000	
	第２０８回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,263,000	
	第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	118,342,000	
	第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,870,000	
	第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,364,000	
	第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,435,000	95,624,881	
	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,978,000	95,884,090	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,788,000	96,530,357	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,699,000	96,589,000	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,534,000	99,152,793	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,037,000	100,266,049	
	第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	91,567,000	91,928,689	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	94,274,000	94,716,145	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	98,775,000	99,094,043	

	第５２回日本学生支援債券	100,000,000	100,002,000	
	第３１０回信金中金債	100,000,000	100,358,000	
	第３２７回信金中金債	100,000,000	99,969,000	
	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,128,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	103,317,000	
	第３６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,096,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,942,000	
	第６１回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,347,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,647,000	
	特殊債券合計	4,165,087,000	4,326,538,097	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,988,000	
	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	100,116,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,887,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,231,000	
	第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	101,026,000	
	第２６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,742,000	
	第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,195,000	
	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	99,299,000	
	第１２４回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	103,240,000	
	第１４７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	103,536,000	
	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	99,636,000	
	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	100,096,000	
	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	100,515,000	
	第５８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,960,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,914,000	
	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,380,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,979,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,500,000	
	第８１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,018,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,546,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,375,000	
	第４８４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,612,000	
	第５２１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,887,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,740,000	

	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	100,549,000	
	社債券合計	2,600,000,000	2,626,014,000	
合計			64,362,194,537	

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。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	39,528,441
コール・ローン	32,902,096
国債証券	30,857,796,129
未収利息	214,988,963
前払費用	40,175,902
流動資産合計	31,185,391,531
資産合計	31,185,391,531
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,000,000
未払利息	89
その他未払費用	692
流動負債合計	1,000,781
負債合計	1,000,781
純資産の部	
元本等	
元本	32,538,384,108
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,353,993,358
元本等合計	31,184,390,750
純資産合計	31,184,390,750
負債純資産合計	31,185,391,531

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 1月25日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	18,306,428,860円
期中追加設定元本額	21,623,380,050円
期中一部解約元本額	7,391,424,802円
期末元本額	32,538,384,108円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	3,438,023,949円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	9,868,647,916円
りそなラップ型ファンド（成長型）	156,276,926円
ＤＣりそな　グローバルバランス	37,166,215円
つみたてバランスファンド	87,124,011円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	57,078,625円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	7,940,291円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	1,951,078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）	18,776,981,617円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	24,292,092円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	13,321,763円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	15,697,973円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	10,014,629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）	418,991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）	43,448,032円
２． 計算日における受益権の総数	
	32,538,384,108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	1,353,993,358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	0.9584円

(10,000口当たり純資産額)	(9,584円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	291,127,258
合計	291,127,258

(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	1,070,000.00	1,055,684.47	
		US TREASURY N/B	320,000.00	317,906.24	
		US TREASURY N/B	330,000.00	326,190.81	
		US TREASURY N/B	940,000.00	927,460.49	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,271.46	
		US TREASURY N/B	530,000.00	523,323.21	

		US TREASURY N/B	530,000.00	535,589.80	
		US TREASURY N/B	550,000.00	542,834.93	
		US TREASURY N/B	330,000.00	328,807.61	
		US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,543,607.67	
		US TREASURY N/B	590,000.00	580,158.97	
		US TREASURY N/B	400,000.00	398,453.12	
		US TREASURY N/B	530,000.00	523,250.76	
		US TREASURY N/B	600,000.00	591,093.72	
		US TREASURY N/B	650,000.00	648,324.17	
		US TREASURY N/B	380,000.00	384,349.21	
		US TREASURY N/B	370,000.00	364,898.03	
		US TREASURY N/B	550,000.00	541,245.10	
		US TREASURY N/B	500,000.00	499,482.40	
		US TREASURY N/B	330,000.00	325,197.18	
		US TREASURY N/B	580,000.00	572,262.85	
		US TREASURY N/B	600,000.00	599,332.02	
		US TREASURY N/B	250,000.00	246,113.27	
		US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,715,293.19	
		US TREASURY N/B	380,000.00	380,215.23	
		US TREASURY N/B	450,000.00	450,246.06	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,573,687.36	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,080,042.87	
		US TREASURY N/B	410,000.00	402,224.39	
		US TREASURY N/B	780,000.00	764,567.54	
		US TREASURY N/B	360,000.00	360,977.32	
		US TREASURY N/B	400,000.00	393,601.56	
		US TREASURY N/B	340,000.00	335,152.31	
		US TREASURY N/B	430,000.00	421,164.83	
		US TREASURY N/B	510,000.00	512,619.71	
		US TREASURY N/B	580,000.00	580,396.43	
		US TREASURY N/B	650,000.00	640,605.42	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,876.94	
		US TREASURY N/B	680,000.00	668,378.86	
		US TREASURY N/B	740,000.00	742,384.72	
		US TREASURY N/B	400,000.00	394,953.12	

		US TREASURY N/B	800,000.00	788,078.08	
		US TREASURY N/B	250,000.00	247,270.50	
		US TREASURY N/B	640,000.00	625,049.98	
		US TREASURY N/B	430,000.00	439,162.65	
		US TREASURY N/B	460,000.00	457,089.02	
		US TREASURY N/B	650,000.00	631,007.78	
		US TREASURY N/B	480,000.00	478,246.84	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,118,869.04	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,025.37	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,798.80	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,266,408.13	
		US TREASURY N/B	380,000.00	377,417.17	
		US TREASURY N/B	580,000.00	587,419.88	
		US TREASURY N/B	490,000.00	490,698.58	
		US TREASURY N/B	480,000.00	473,924.97	
		US TREASURY N/B	560,000.00	545,048.39	
		US TREASURY N/B	420,000.00	420,803.88	
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,305,676.66	
		US TREASURY N/B	350,000.00	350,635.74	
		US TREASURY N/B	680,000.00	656,492.12	
		US TREASURY N/B	550,000.00	544,220.65	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,296,374.40	
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,272,975.00	
		US TREASURY N/B	210,000.00	211,148.42	
		US TREASURY N/B	500,000.00	481,953.30	
		US TREASURY N/B	600,000.00	593,578.08	
		US TREASURY N/B	500,000.00	504,335.90	
		US TREASURY N/B	560,000.00	540,815.57	
		US TREASURY N/B	810,000.00	798,451.10	
		US TREASURY N/B	340,000.00	343,094.50	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,144,840.32	
		US TREASURY N/B	500,000.00	490,966.75	
		US TREASURY N/B	500,000.00	501,376.95	
		US TREASURY N/B	560,000.00	551,796.83	
		US TREASURY N/B	950,000.00	921,704.06	

		US TREASURY N/B	490,000.00	480,592.33	
		US TREASURY N/B	470,000.00	462,738.82	
		US TREASURY N/B	470,000.00	459,177.12	
		US TREASURY N/B	400,000.00	392,210.92	
		US TREASURY N/B	290,000.00	283,146.45	
		US TREASURY N/B	460,000.00	450,889.83	
		US TREASURY N/B	370,000.00	361,010.14	
		US TREASURY N/B	700,000.00	685,548.78	
		US TREASURY N/B	240,000.00	234,056.23	
		US TREASURY N/B	510,000.00	499,262.10	
		US TREASURY N/B	450,000.00	438,688.44	
		US TREASURY N/B	390,000.00	384,835.54	
		US TREASURY N/B	410,000.00	399,565.78	
		US TREASURY N/B	360,000.00	353,559.34	
		US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,202,853.40	
		US TREASURY N/B	280,000.00	271,364.82	
		US TREASURY N/B	390,000.00	381,164.04	
		US TREASURY N/B	480,000.00	465,028.08	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,137,802.06	
		US TREASURY N/B	350,000.00	341,926.72	
		US TREASURY N/B	330,000.00	322,162.50	
		US TREASURY N/B	410,000.00	402,104.26	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,092,502.53	
		US TREASURY N/B	670,000.00	656,796.24	
		US TREASURY N/B	720,000.00	708,764.04	
		US TREASURY N/B	400,000.00	387,937.48	
		US TREASURY N/B	560,000.00	556,445.28	
		US TREASURY N/B	650,000.00	636,428.65	
		US TREASURY N/B	430,000.00	412,615.22	
		US TREASURY N/B	300,000.00	300,978.51	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,045,058.75	
		US TREASURY N/B	390,000.00	389,352.51	
		US TREASURY N/B	380,000.00	365,928.10	
		US TREASURY N/B	450,000.00	453,708.94	
		US TREASURY N/B	580,000.00	561,206.60	

		US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,222,126.84	
		US TREASURY N/B	400,000.00	403,531.24	
		US TREASURY N/B	470,000.00	447,050.73	
		US TREASURY N/B	450,000.00	451,573.20	
		US TREASURY N/B	490,000.00	462,992.57	
		US TREASURY N/B	500,000.00	504,404.25	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,257,391.29	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,139,250.47	
		US TREASURY N/B	360,000.00	363,353.90	
		US TREASURY N/B	540,000.00	512,135.35	
		US TREASURY N/B	480,000.00	486,900.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	306,818.72	
		US TREASURY N/B	500,000.00	507,285.15	
		US TREASURY N/B	710,000.00	716,573.03	
		US TREASURY N/B	340,000.00	333,439.05	
		US TREASURY N/B	600,000.00	609,269.52	
		US TREASURY N/B	490,000.00	483,224.18	
		US TREASURY N/B	680,000.00	670,317.95	
		US TREASURY N/B	590,000.00	595,335.31	
		US TREASURY N/B	490,000.00	479,922.41	
		US TREASURY N/B	290,000.00	283,899.79	
		US TREASURY N/B	790,000.00	768,213.22	
		US TREASURY N/B	900,000.00	896,958.90	
		US TREASURY N/B	330,000.00	320,712.28	
		US TREASURY N/B	390,000.00	378,772.25	
		US TREASURY N/B	380,000.00	371,279.26	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,078,610.25	
		US TREASURY N/B	400,000.00	385,710.92	
		US TREASURY N/B	820,000.00	800,396.83	
		US TREASURY N/B	340,000.00	333,937.08	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,443,212.63	
		US TREASURY N/B	300,000.00	292,494.12	
		US TREASURY N/B	400,000.00	392,546.84	
		US TREASURY N/B	430,000.00	427,732.39	
		US TREASURY N/B	590,000.00	570,179.65	

		US TREASURY N/B	400,000.00	403,460.92	
		US TREASURY N/B	830,000.00	831,231.96	
		US TREASURY N/B	320,000.00	325,012.48	
		US TREASURY N/B	910,000.00	884,495.06	
		US TREASURY N/B	440,000.00	446,892.16	
		US TREASURY N/B	890,000.00	897,613.59	
		US TREASURY N/B	850,000.00	863,563.45	
		US TREASURY N/B	790,000.00	760,776.16	
		US TREASURY N/B	910,000.00	917,535.89	
		US TREASURY N/B	430,000.00	440,237.65	
		US TREASURY N/B	570,000.00	583,637.64	
		US TREASURY N/B	750,000.00	732,656.25	
		US TREASURY N/B	480,000.00	487,790.59	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,431,267.11	
		US TREASURY N/B	800,000.00	746,468.72	
		US TREASURY N/B	890,000.00	820,225.78	
		US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,106,531.19	
		US TREASURY N/B	740,000.00	717,713.27	
		US TREASURY N/B	880,000.00	860,835.88	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,431,350.76	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,158,445.20	
		US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,234,852.71	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,196,248.01	
		US TREASURY N/B	120,000.00	147,963.27	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,216,664.00	
		US TREASURY N/B	800,000.00	828,328.08	
		US TREASURY N/B	310,000.00	378,339.24	
		US TREASURY N/B	120,000.00	160,647.64	
		US TREASURY N/B	170,000.00	215,421.87	
		US TREASURY N/B	200,000.00	246,183.58	
		US TREASURY N/B	130,000.00	159,128.12	
		US TREASURY N/B	230,000.00	286,174.78	
		US TREASURY N/B	320,000.00	349,500.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	120,566.40	
		US TREASURY N/B	190,000.00	236,442.36	

		US TREASURY N/B	200,000.00	244,898.42	
		US TREASURY N/B	260,000.00	329,062.50	
		US TREASURY N/B	190,000.00	232,994.91	
		US TREASURY N/B	550,000.00	630,673.78	
		US TREASURY N/B	180,000.00	217,248.03	
		US TREASURY N/B	430,000.00	554,481.60	
		US TREASURY N/B	190,000.00	233,481.04	
		US TREASURY N/B	230,000.00	259,041.98	
		US TREASURY N/B	130,000.00	132,851.35	
		US TREASURY N/B	180,000.00	183,986.71	
		US TREASURY N/B	480,000.00	479,756.20	
		US TREASURY N/B	300,000.00	286,839.84	
		US TREASURY N/B	670,000.00	639,980.85	
		US TREASURY N/B	590,000.00	601,050.93	
		US TREASURY N/B	630,000.00	614,336.11	
		US TREASURY N/B	380,000.00	420,070.69	
		US TREASURY N/B	770,000.00	868,340.39	
		US TREASURY N/B	740,000.00	818,783.93	
		US TREASURY N/B	640,000.00	680,337.47	
		US TREASURY N/B	760,000.00	774,383.52	
		US TREASURY N/B	640,000.00	637,737.47	
		US TREASURY N/B	680,000.00	615,041.36	
		US TREASURY N/B	790,000.00	786,944.91	
		US TREASURY N/B	630,000.00	612,650.36	
		US TREASURY N/B	710,000.00	707,295.89	
		US TREASURY N/B	660,000.00	594,876.54	
		US TREASURY N/B	660,000.00	594,322.21	
		US TREASURY N/B	580,000.00	494,687.85	
		US TREASURY N/B	700,000.00	679,656.25	
		US TREASURY N/B	670,000.00	666,820.10	
		US TREASURY N/B	480,000.00	477,018.72	
		US TREASURY N/B	500,000.00	472,343.75	
		US TREASURY N/B	670,000.00	632,495.67	
		US TREASURY N/B	600,000.00	595,289.04	
		US TREASURY N/B	830,000.00	843,763.06	

	US TREASURY N/B	800,000.00	793,859.35	
	US TREASURY N/B	580,000.00	618,821.42	
	米ドル 小計	130,760,000.00	129,766,368.85 (14,244,454,308)	
カナダドル	GOV OF CANADA	210,000.00	208,775.70	
	GOV OF CANADA	360,000.00	358,686.00	
	GOV OF CANADA	300,000.00	299,652.00	
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,711.10	
	GOV OF CANADA	140,000.00	139,795.60	
	GOV OF CANADA	450,000.00	442,291.50	
	GOV OF CANADA	120,000.00	120,289.20	
	GOV OF CANADA	500,000.00	488,710.00	
	GOV OF CANADA	110,000.00	113,494.70	
	GOV OF CANADA	490,000.00	476,412.30	
	GOV OF CANADA	280,000.00	268,595.60	
	GOV OF CANADA	150,000.00	154,294.50	
	GOV OF CANADA	260,000.00	252,267.60	
	GOV OF CANADA	240,000.00	238,896.00	
	GOV OF CANADA	210,000.00	206,820.60	
	GOV OF CANADA	230,000.00	231,368.50	
	GOV OF CANADA	40,000.00	40,730.00	
	GOV OF CANADA	260,000.00	268,252.40	
	GOV OF CANADA	230,000.00	234,977.20	
	GOV OF CANADA	200,000.00	194,572.00	
	GOV OF CANADA	260,000.00	241,758.40	
	GOV OF CANADA	60,000.00	87,918.60	
	GOV OF CANADA	210,000.00	211,186.50	
	GOV OF CANADA	120,000.00	162,188.40	
	GOV OF CANADA	160,000.00	164,385.60	
	GOV OF CANADA	200,000.00	291,404.00	
	GOV OF CANADA	200,000.00	286,656.00	
	GOV OF CANADA	250,000.00	330,587.50	
	GOV OF CANADA	270,000.00	342,435.60	
	GOV OF CANADA	230,000.00	259,647.00	
	GOV OF CANADA	90,000.00	86,635.80	

	GOV OF CANADA	70,000.00	82,637.10	
カナダドル 小計		7,070,000.00	7,460,033.00 (613,513,113)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,790,000.00	4,772,181.20	
	UNITED MEXICAN STATE	4,550,000.00	4,378,374.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,630,000.00	1,586,552.35	
	UNITED MEXICAN STATE	4,890,000.00	4,636,746.90	
	UNITED MEXICAN STATE	2,620,000.00	2,588,429.00	
	UNITED MEXICAN STATE	4,310,000.00	4,637,646.20	
	UNITED MEXICAN STATE	2,600,000.00	2,228,928.00	
	UNITED MEXICAN STATE	4,300,000.00	4,047,117.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,801,438.70	
	UNITED MEXICAN STATE	2,150,000.00	1,997,973.50	
	UNITED MEXICAN STATE	1,460,000.00	1,332,731.80	
	UNITED MEXICAN STATE	1,510,000.00	1,672,808.20	
	UNITED MEXICAN STATE	1,900,000.00	1,841,575.00	
	UNITED MEXICAN STATE	2,720,000.00	2,428,361.60	
	UNITED MEXICAN STATE	2,100,000.00	1,916,507.66	
メキシコペソ 小計		43,340,000.00	41,867,371.11 (241,574,731)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	244,951.38	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	243,372.80	
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	113,112.00	
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	141,740.36	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	217,449.11	
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	171,813.90	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	175,160.80	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	176,010.01	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	193,975.02	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	214,043.24	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	197,910.65	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	183,195.00	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	195,249.34	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	134,170.66	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	146,258.88	
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	352,842.49	

GOV OF AUSTRIA	120,000.00	172,814.76	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	84,901.60	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	107,427.81	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	84,398.97	
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	38,828.32	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	289,399.12	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	304,163.37	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	216,684.93	
GOV OF BELGIUM	320,000.00	374,209.28	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	277,429.50	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	142,135.00	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	330,923.35	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	112,777.94	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	249,930.48	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	208,084.80	
GOV OF BELGIUM	230,000.00	241,472.86	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	246,288.48	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	418,027.07	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	294,712.21	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	151,483.65	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	206,809.65	
GOV OF BELGIUM	60,000.00	61,500.48	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	126,386.60	
GOV OF BELGIUM	340,000.00	531,557.02	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	91,689.48	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	119,918.48	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	413,191.26	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	235,857.28	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	188,367.55	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	77,234.15	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	74,241.51	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,881.68	
GOV OF FINLAND	150,000.00	152,198.44	
GOV OF FINLAND	100,000.00	108,898.00	
GOV OF FINLAND	110,000.00	111,379.23	

		GOV OF FINLAND	60,000.00	64,365.90	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	96,813.99	
		GOV OF FINLAND	120,000.00	121,244.88	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	100,131.57	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	100,746.80	
		GOV OF FINLAND	110,000.00	116,138.44	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	61,629.72	
		GOV OF FINLAND	110,000.00	111,890.02	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	109,976.31	
		GOV OF FINLAND	20,000.00	20,145.88	
		GOV OF FINLAND	70,000.00	71,036.98	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	62,766.68	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	108,425.52	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	53,829.05	
		GOV OF FRANCE	250,000.00	251,432.60	
		GOV OF FRANCE	400,000.00	420,083.32	
		GOV OF FRANCE	310,000.00	312,221.89	
		GOV OF FRANCE	770,000.00	810,722.99	
		GOV OF FRANCE	600,000.00	608,442.00	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	525,158.86	
		GOV OF FRANCE	420,000.00	460,044.90	
		GOV OF FRANCE	680,000.00	687,364.50	
		GOV OF FRANCE	680,000.00	749,287.58	
		GOV OF FRANCE	650,000.00	721,705.40	
		GOV OF FRANCE	590,000.00	596,923.65	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	537,289.90	
		GOV OF FRANCE	500,000.00	504,814.50	
		GOV OF FRANCE	880,000.00	956,134.08	
		GOV OF FRANCE	640,000.00	775,605.76	
		GOV OF FRANCE	290,000.00	291,103.45	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	629,839.84	
		GOV OF FRANCE	640,000.00	705,804.16	
		GOV OF FRANCE	790,000.00	811,427.63	
		GOV OF FRANCE	340,000.00	474,792.66	
		GOV OF FRANCE	510,000.00	539,781.96	

		GOV OF FRANCE	530,000.00	657,283.74	
		GOV OF FRANCE	700,000.00	714,177.10	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	518,178.96	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	599,138.40	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	685,684.92	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	582,060.06	
		GOV OF FRANCE	380,000.00	386,099.38	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	834,764.00	
		GOV OF FRANCE	690,000.00	824,032.50	
		GOV OF FRANCE	650,000.00	702,183.30	
		GOV OF FRANCE	550,000.00	898,994.25	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	123,873.96	
		GOV OF FRANCE	450,000.00	702,960.30	
		GOV OF FRANCE	510,000.00	518,072.28	
		GOV OF FRANCE	430,000.00	643,736.61	
		GOV OF FRANCE	180,000.00	195,769.14	
		GOV OF FRANCE	620,000.00	1,006,024.40	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	573,445.68	
		GOV OF FRANCE	350,000.00	388,164.70	
		GOV OF FRANCE	250,000.00	411,494.25	
		GOV OF FRANCE	190,000.00	320,917.42	
		GOV OF FRANCE	210,000.00	209,645.10	
		GOV OF GERMANY	150,000.00	155,544.90	
		GOV OF GERMANY	220,000.00	221,520.20	
		GOV OF GERMANY	470,000.00	473,510.90	
		GOV OF GERMANY	150,000.00	151,277.81	
		GOV OF GERMANY	430,000.00	452,401.28	
		GOV OF GERMANY	190,000.00	198,781.42	
		GOV OF GERMANY	160,000.00	161,605.13	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	314,598.85	
		GOV OF GERMANY	40,000.00	40,444.52	
		GOV OF GERMANY	520,000.00	551,836.48	
		GOV OF GERMANY	340,000.00	344,493.10	
		GOV OF GERMANY	230,000.00	251,634.03	
		GOV OF GERMANY	200,000.00	214,885.00	

		GOV OF GERMANY	310,000.00	314,826.70	
		GOV OF GERMANY	420,000.00	451,899.00	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	356,066.90	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	312,819.52	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	268,314.00	
		GOV OF GERMANY	420,000.00	427,729.68	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	291,744.99	
		GOV OF GERMANY	300,000.00	305,615.10	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	281,935.94	
		GOV OF GERMANY	460,000.00	511,173.62	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	244,456.32	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	387,685.90	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	318,458.86	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	332,689.52	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	366,103.85	
		GOV OF GERMANY	420,000.00	453,496.26	
		GOV OF GERMANY	460,000.00	481,303.98	
		GOV OF GERMANY	390,000.00	392,917.20	
		GOV OF GERMANY	520,000.00	532,493.00	
		GOV OF GERMANY	140,000.00	217,488.88	
		GOV OF GERMANY	470,000.00	489,986.28	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	255,440.81	
		GOV OF GERMANY	330,000.00	343,113.87	
		GOV OF GERMANY	130,000.00	187,260.97	
		GOV OF GERMANY	400,000.00	404,844.40	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	348,659.01	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	405,298.00	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	593,190.36	
		GOV OF GERMANY	330,000.00	527,221.86	
		GOV OF GERMANY	230,000.00	392,549.05	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	478,015.98	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	376,007.76	
		GOV OF GERMANY	450,000.00	636,930.45	
		GOV OF GERMANY	390,000.00	560,808.30	
		GOV OF GERMANY	200,000.00	224,960.00	

		GOV OF IRELAND	170,000.00	180,458.80	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	131,329.87	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	124,024.74	
		GOV OF IRELAND	80,000.00	80,461.76	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	128,382.02	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	175,623.45	
		GOV OF IRELAND	170,000.00	223,136.90	
		GOV OF IRELAND	240,000.00	249,477.23	
		GOV OF IRELAND	100,000.00	101,352.30	
		GOV OF IRELAND	190,000.00	218,616.28	
		GOV OF IRELAND	20,000.00	20,550.40	
		GOV OF IRELAND	60,000.00	60,173.10	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	93,399.21	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	161,536.37	
		GOV OF ITALY	330,000.00	344,615.70	
		GOV OF ITALY	370,000.00	386,505.29	
		GOV OF ITALY	230,000.00	231,482.69	
		GOV OF ITALY	270,000.00	270,737.10	
		GOV OF ITALY	550,000.00	582,552.46	
		GOV OF ITALY	290,000.00	289,666.50	
		GOV OF ITALY	180,000.00	181,087.02	
		GOV OF ITALY	390,000.00	416,471.25	
		GOV OF ITALY	450,000.00	445,435.60	
		GOV OF ITALY	400,000.00	428,392.24	
		GOV OF ITALY	230,000.00	229,637.79	
		GOV OF ITALY	310,000.00	333,296.50	
		GOV OF ITALY	420,000.00	462,881.49	
		GOV OF ITALY	290,000.00	287,255.29	
		GOV OF ITALY	350,000.00	363,271.40	
		GOV OF ITALY	210,000.00	235,661.58	
		GOV OF ITALY	420,000.00	423,115.56	
		GOV OF ITALY	390,000.00	394,581.72	
		GOV OF ITALY	440,000.00	436,854.00	
		GOV OF ITALY	230,000.00	265,050.85	
		GOV OF ITALY	320,000.00	323,363.20	

		GOV OF ITALY	190,000.00	219,470.14	
		GOV OF ITALY	380,000.00	374,255.54	
		GOV OF ITALY	270,000.00	266,081.76	
		GOV OF ITALY	390,000.00	440,064.33	
		GOV OF ITALY	280,000.00	320,420.35	
		GOV OF ITALY	300,000.00	312,259.77	
		GOV OF ITALY	280,000.00	269,993.36	
		GOV OF ITALY	460,000.00	522,038.36	
		GOV OF ITALY	190,000.00	191,249.82	
		GOV OF ITALY	400,000.00	440,290.80	
		GOV OF ITALY	280,000.00	273,904.40	
		GOV OF ITALY	250,000.00	259,021.75	
		GOV OF ITALY	290,000.00	340,588.03	
		GOV OF ITALY	210,000.00	203,655.06	
		GOV OF ITALY	470,000.00	456,645.42	
		GOV OF ITALY	70,000.00	71,701.00	
		GOV OF ITALY	370,000.00	368,516.11	
		GOV OF ITALY	390,000.00	449,483.84	
		GOV OF ITALY	400,000.00	385,333.60	
		GOV OF ITALY	400,000.00	373,192.24	
		GOV OF ITALY	310,000.00	305,961.01	
		GOV OF ITALY	520,000.00	505,970.40	
		GOV OF ITALY	290,000.00	382,409.66	
		GOV OF ITALY	360,000.00	346,840.01	
		GOV OF ITALY	390,000.00	462,560.28	
		GOV OF ITALY	180,000.00	182,320.07	
		GOV OF ITALY	510,000.00	627,943.11	
		GOV OF ITALY	400,000.00	426,652.11	
		GOV OF ITALY	410,000.00	539,944.74	
		GOV OF ITALY	400,000.00	347,896.51	
		GOV OF ITALY	320,000.00	417,198.40	
		GOV OF ITALY	250,000.00	233,947.75	
		GOV OF ITALY	350,000.00	430,197.25	
		GOV OF ITALY	270,000.00	239,679.61	
		GOV OF ITALY	490,000.00	542,326.36	

		GOV OF ITALY	200,000.00	190,130.40	
		GOV OF ITALY	410,000.00	504,570.22	
		GOV OF ITALY	340,000.00	416,762.48	
		GOV OF ITALY	340,000.00	409,058.76	
		GOV OF ITALY	230,000.00	223,304.47	
		GOV OF ITALY	260,000.00	230,089.09	
		GOV OF ITALY	240,000.00	237,768.25	
		GOV OF ITALY	90,000.00	76,442.22	
		GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	262,272.92	
		GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	275,744.56	
		GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	317,573.20	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	243,605.76	
		GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	186,166.66	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	291,903.25	
		GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	295,445.88	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	253,029.00	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	269,037.36	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	245,096.40	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	248,282.88	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	262,091.50	
		GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	324,757.62	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	198,305.00	
		GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	277,449.26	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	392,465.75	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	410,099.75	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	355,601.76	
		GOV OF SPAIN	370,000.00	376,513.14	
		GOV OF SPAIN	360,000.00	379,474.20	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	337,170.57	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	250,708.02	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	402,061.60	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	316,049.10	
		GOV OF SPAIN	520,000.00	532,449.84	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	389,011.59	
		GOV OF SPAIN	410,000.00	416,379.19	

		GOV OF SPAIN	300,000.00	304,864.91	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	412,125.90	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	261,504.10	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	393,911.03	
		GOV OF SPAIN	370,000.00	451,541.34	
		GOV OF SPAIN	390,000.00	458,408.14	
		GOV OF SPAIN	270,000.00	304,291.08	
		GOV OF SPAIN	410,000.00	435,178.92	
		GOV OF SPAIN	350,000.00	438,634.70	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	284,271.52	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	344,856.64	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	545,780.80	
		GOV OF SPAIN	290,000.00	298,217.73	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	331,628.16	
		GOV OF SPAIN	350,000.00	360,044.30	
		GOV OF SPAIN	310,000.00	315,892.48	
		GOV OF SPAIN	310,000.00	314,292.88	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	434,288.00	
		GOV OF SPAIN	490,000.00	707,203.28	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	356,983.34	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	480,718.90	
		GOV OF SPAIN	220,000.00	236,083.54	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	443,274.22	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	502,520.68	
		GOV OF SPAIN	310,000.00	448,916.58	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	387,770.00	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	276,516.75	
		GOV OF SPAIN	130,000.00	136,908.59	
		GOV OF SPAIN	180,000.00	214,189.34	
		ユーロ 小計	85,060,000.00	96,569,463.82 (11,981,373,376)	
	英ポンド	UK TREASURY	200,000.00	208,780.80	
		UK TREASURY	430,000.00	437,888.86	
		UK TREASURY	430,000.00	450,498.10	
		UK TREASURY	460,000.00	466,621.05	

		UK TREASURY	370,000.00	398,491.48	
		UK TREASURY	180,000.00	197,774.96	
		UK TREASURY	470,000.00	464,926.82	
		UK TREASURY	390,000.00	402,677.34	
		UK TREASURY	490,000.00	486,611.65	
		UK TREASURY	290,000.00	307,735.24	
		UK TREASURY	140,000.00	140,268.80	
		UK TREASURY	190,000.00	208,609.36	
		UK TREASURY	250,000.00	309,514.09	
		UK TREASURY	320,000.00	340,512.00	
		UK TREASURY	310,000.00	319,646.76	
		UK TREASURY	420,000.00	422,856.00	
		UK TREASURY	170,000.00	214,276.50	
		UK TREASURY	300,000.00	309,879.60	
		UK TREASURY	170,000.00	245,010.80	
		UK TREASURY	260,000.00	356,300.88	
		UK TREASURY	270,000.00	361,216.80	
		UK TREASURY	340,000.00	478,249.64	
		UK TREASURY	380,000.00	529,262.78	
		UK TREASURY	160,000.00	161,697.92	
		UK TREASURY	250,000.00	380,275.00	
		UK TREASURY	290,000.00	418,760.00	
		UK TREASURY	280,000.00	409,303.44	
		UK TREASURY	290,000.00	446,428.43	
		UK TREASURY	340,000.00	441,762.00	
		UK TREASURY	310,000.00	421,838.70	
		UK TREASURY	330,000.00	510,236.10	
		UK TREASURY	390,000.00	367,243.50	
		UK TREASURY	70,000.00	69,844.60	
		UK TREASURY	240,000.00	383,352.00	
		UK TREASURY	270,000.00	410,537.70	
		UK TREASURY	300,000.00	511,104.00	
		UK TREASURY	280,000.00	286,011.60	
		UK TREASURY	240,000.00	406,927.20	
		UK TREASURY	300,000.00	382,732.05	

	UK TREASURY	280,000.00	454,188.00	
	UK TREASURY	190,000.00	189,609.36	
英ポンド 小計		12,040,000.00	14,709,461.91 (2,116,103,190)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,500,000.00	1,650,657.00	
	GOV OF SWEDEN	1,710,000.00	1,924,943.58	
	GOV OF SWEDEN	1,570,000.00	1,688,807.39	
	GOV OF SWEDEN	1,030,000.00	1,185,684.50	
	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	1,141,562.16	
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	959,246.26	
	GOV OF SWEDEN	550,000.00	559,922.00	
	GOV OF SWEDEN	760,000.00	1,090,144.00	
スウェーデンクローナ 小計		9,130,000.00	10,200,966.89 (123,329,689)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,410,000.00	1,492,767.00	
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,140,862.21	
	GOV OF NORWAY	610,000.00	658,174.14	
	GOV OF NORWAY	700,000.00	710,188.08	
	GOV OF NORWAY	610,000.00	607,414.82	
	GOV OF NORWAY	630,000.00	634,592.70	
	GOV OF NORWAY	530,000.00	542,073.40	
ノルウェークローネ 小計		5,600,000.00	5,786,072.35 (74,003,865)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	790,000.00	801,981.93	
	GOV OF DENMARK	1,370,000.00	1,506,223.21	
	GOV OF DENMARK	910,000.00	989,712.54	
	GOV OF DENMARK	1,330,000.00	1,498,742.42	
	GOV OF DENMARK	1,430,000.00	1,478,517.04	
	GOV OF DENMARK	2,130,000.00	3,753,726.69	
デンマーククローネ 小計		7,960,000.00	10,028,903.83 (166,680,381)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	710,000.00	712,158.40	
	GOV OF POLAND	270,000.00	288,063.00	
	GOV OF POLAND	510,000.00	516,375.00	
	GOV OF POLAND	620,000.00	623,720.00	
	GOV OF POLAND	180,000.00	200,050.20	

	GOV OF POLAND	550,000.00	558,635.00	
	GOV OF POLAND	310,000.00	352,259.20	
	GOV OF POLAND	620,000.00	632,710.00	
	GOV OF POLAND	380,000.00	412,851.00	
	GOV OF POLAND	190,000.00	192,603.00	
	GOV OF POLAND	480,000.00	502,488.00	
	GOV OF POLAND	620,000.00	614,500.60	
	GOV OF POLAND	530,000.00	521,153.24	
	GOV OF POLAND	460,000.00	457,309.00	
	GOV OF POLAND	160,000.00	201,731.20	
ポーランドズロチ 小計		6,590,000.00	6,786,606.84 (196,404,401)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	463,923.39	
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	279,508.26	
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	511,484.59	
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	312,055.70	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	464,915.40	
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	244,131.52	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	471,355.72	
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	458,339.11	
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	503,739.79	
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	628,644.88	
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	596,357.70	
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	468,694.26	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	419,579.70	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	437,718.33	
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	359,267.79	
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	281,994.31	
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	285,521.51	
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	325,219.72	
	GOV OF AUSTRALIA	100,000.00	103,060.67	
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	210,353.31	
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	142,187.65	
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	70,361.98	
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	198,239.58	

オーストラリアドル 小計		7,630,000.00	8,236,654.87 (640,811,748)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	90,018.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	122,306.40	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	100,550.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	68,614.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	99,180.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,900.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,670.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	133,794.70	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	83,784.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,085.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	39,952.00	
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	153,958.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,803.50	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,400.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	95,040.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	77,700.35	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	57,717.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	92,070.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	81,578.00	
シンガポールドル 小計		1,500,000.00	1,543,120.95 (124,560,723)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	210,117.01	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	130,791.93	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	190,522.23	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	121,626.48	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	222,479.11	
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	300,272.31	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	140,898.59	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	138,604.48	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,251.17	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	158,315.52	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	120,050.10	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	119,898.44	

	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	263,944.72	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,762.14	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	169,362.27	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	249,485.57	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	194,419.07	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	277,045.10	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	95,868.74	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	265,599.83	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	253,216.10	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	254,949.07	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	207,989.50	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	318,491.60	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	123,124.17	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	68,007.86	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	184,416.76	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	176,886.37	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,076.18	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	148,518.62	
マレーシアリンギット 小計		5,460,000.00	5,448,991.04 (144,234,792)	
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	480,000.00	484,704.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	940,000.00	934,595.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,290,000.00	1,283,388.75	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,947,040.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,446,474.67	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,611,849.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,040,000.00	1,852,592.74	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,890,000.00	1,773,887.09	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,230,000.00	887,458.65	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,789,479.64	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,472,408.16	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,290,000.00	910,417.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,300,000.00	2,071,169.55	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,720,000.00	3,348,744.00	
南アフリカランド 小計		25,870,000.00	23,814,208.75 (190,751,812)	

合計		30,857,796,129 (30,857,796,129)	

(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%	46.2%
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	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	290銘柄	100.0%	38.8%
英ポンド	国債証券	41銘柄	100.0%	6.9%
スウェーデンクローナ	国債証券	8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%
マレーシアリンギット	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

該当事項はありません。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	11,540,696
コール・ローン	1,359,764
投資信託受益証券	2,396,329,014
派生商品評価勘定	1,782
流動資産合計	2,409,231,256
資産合計	2,409,231,256
負債の部	
流動負債	
未払金	10,713,345
未払解約金	200,000
未払利息	3
その他未払費用	30
流動負債合計	10,913,378
負債合計	10,913,378
純資産の部	
元本等	
元本	2,237,772,471
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	160,545,407
元本等合計	2,398,317,878
純資産合計	2,398,317,878
負債純資産合計	2,409,231,256

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 1月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	1,416,556,538円
期中追加設定元本額	1,332,511,849円
期中一部解約元本額	511,295,916円
期末元本額	2,237,772,471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）	138,608,690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	77,820,588円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	14,389,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	5,315,052円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	3,868,152円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	1,232,452,984円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,464,162円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	6,975,805円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	11,198,256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）	269,831円
2． 計算日における受益権の総数	
	2,237,772,471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	1.0717円
(10,000口当たり純資産額)	(10,717円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△218,380,381
合計	△218,380,381

(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)

（2019年 1月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	887,112	－	888,894	1,782
	米ドル	887,112	－	888,894	1,782
合計		887,112	－	888,894	1,782

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	645,108	21,830,454.72	
	米ドル 小計		645,108	21,830,454.72 (2,396,329,014)	
合計				2,396,329,014 (2,396,329,014)	

(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。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	940,246,210
株式	24,079,864,040
派生商品評価勘定	8,459,724
未収配当金	37,768,099
前払金	18,501,800
差入委託証拠金	31,828,500
流動資産合計	25,116,668,373
資産合計	25,116,668,373
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,032,068
未払金	2,625,000
未払解約金	90,000
未払利息	2,550
その他未払費用	11,006
流動負債合計	19,760,624
負債合計	19,760,624
純資産の部	
元本等	
元本	23,469,138,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,627,768,837
元本等合計	25,096,907,749
純資産合計	25,096,907,749
負債純資産合計	25,116,668,373

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 1月25日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	12,835,574,668円
期中追加設定元本額	19,081,723,341円
期中一部解約元本額	8,448,159,097円
期末元本額	23,469,138,912円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,435,863,648円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,080,849,224円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,017,125,351円
ＤＣりそな　グローバルバランス	24,604,054円
つみたてバランスファンド	470,494,665円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	75,222,952円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	26,147,264円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	18,712,219円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	16,533,941,712円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	183,316,614円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	5,968,117円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	33,345,991円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	58,505,317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）	1,959,065円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	435,588,409円
りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	67,494,310円
２．　計算日における受益権の総数	
	23,469,138,912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	1.0694円
(10,000口当たり純資産額)	(10,694円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

株式	△2,929,658,003
合計	△2,929,658,003

(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)

（2019年 1月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,015,510,344	－	1,006,938,000	△8,572,344
合計		1,015,510,344	－	1,006,938,000	△8,572,344

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	500	2,828.00	1,414,000	
日本水産	14,800	672.00	9,945,600	
マルハニチロ	2,100	3,700.00	7,770,000	
カネコ種苗	400	1,269.00	507,600	
サカタのタネ	1,800	3,535.00	6,363,000	
ホクト	1,300	1,998.00	2,597,400	
ホクリヨウ	300	609.00	182,700	
住石ホールディングス	3,200	100.00	320,000	

日鉄鉱業	300	4,570.00	1,371,000	
三井松島ホールディングス	600	1,397.00	838,200	
国際石油開発帝石	59,200	1,029.00	60,916,800	
石油資源開発	2,100	2,066.00	4,338,600	
K＆Oエナジーグループ	700	1,479.00	1,035,300	
ヒノキヤグループ	300	1,926.00	577,800	
ショーボンドホールディングス	1,100	7,590.00	8,349,000	
ミライト・ホールディングス	4,200	1,536.00	6,451,200	
タマホーム	1,000	1,229.00	1,229,000	
サンヨーホームズ	200	839.00	167,800	
日本アクア	600	406.00	243,600	
ファーストコーポレーション	500	756.00	378,000	
ベステラ	300	1,478.00	443,400	
ＴＡＴＥＲＵ	1,600	329.00	526,400	
スペースバリューホールディングス	1,900	936.00	1,778,400	
ダイセキ環境ソリューション	300	675.00	202,500	
第一カッター興業	200	1,780.00	356,000	
安藤・間	9,400	715.00	6,721,000	
東急建設	4,400	989.00	4,351,600	
コムシスホールディングス	5,200	2,840.00	14,768,000	
ミサワホーム	1,200	775.00	930,000	
ビーアールホールディングス	1,400	345.00	483,000	
高松コンストラクショングループ	900	2,807.00	2,526,300	
東建コーポレーション	500	6,390.00	3,195,000	
ソネック	100	701.00	70,100	
ヤマウラ	600	972.00	583,200	
大成建設	12,100	5,110.00	61,831,000	
大林組	36,500	1,031.00	37,631,500	
清水建設	37,300	927.00	34,577,100	
飛島建設	1,100	1,424.00	1,566,400	
長谷工コーポレーション	15,200	1,211.00	18,407,200	
松井建設	1,400	743.00	1,040,200	
錢高組	100	5,140.00	514,000	
鹿島建設	28,500	1,549.00	44,146,500	
不動テトラ	800	1,645.00	1,316,000	
大末建設	500	911.00	455,500	

鉄建建設	800	2,600.00	2,080,000	
西松建設	2,600	2,504.00	6,510,400	
三井住友建設	8,800	693.00	6,098,400	
大豊建設	800	3,410.00	2,728,000	
前田建設工業	8,700	1,067.00	9,282,900	
佐田建設	900	399.00	359,100	
ナカノフドー建設	1,100	503.00	553,300	
奥村組	2,000	3,415.00	6,830,000	
東鉄工業	1,500	2,906.00	4,359,000	
イチケン	200	1,994.00	398,800	
富士ピー・エス	500	423.00	211,500	
淺沼組	400	2,973.00	1,189,200	
戸田建設	14,200	682.00	9,684,400	
熊谷組	1,700	3,315.00	5,635,500	
青木あすなろ建設	700	990.00	693,000	
北野建設	300	3,135.00	940,500	
植木組	100	2,251.00	225,100	
矢作建設工業	1,700	693.00	1,178,100	
ピーエス三菱	1,400	560.00	784,000	
日本ハウスホールディングス	2,400	431.00	1,034,400	
大東建託	4,300	15,095.00	64,908,500	
新日本建設	1,500	1,063.00	1,594,500	
ＮＩＰＰＯ	3,300	2,077.00	6,854,100	
東亜道路工業	200	3,035.00	607,000	
前田道路	3,800	2,114.00	8,033,200	
日本道路	300	6,350.00	1,905,000	
東亜建設工業	1,100	1,437.00	1,580,700	
若築建設	600	1,509.00	905,400	
東洋建設	4,500	394.00	1,773,000	
五洋建設	14,500	624.00	9,048,000	
世紀東急工業	1,800	613.00	1,103,400	
福田組	400	4,095.00	1,638,000	
住友林業	8,600	1,465.00	12,599,000	
日本基礎技術	1,300	345.00	448,500	
巴コーポレーション	1,600	386.00	617,600	
大和ハウス工業	33,700	3,595.00	121,151,500	

ライト工業	2,400	1,336.00	3,206,400	
積水ハウス	37,300	1,680.00	62,664,000	
日特建設	1,100	642.00	706,200	
北陸電気工事	700	905.00	633,500	
ユアテック	2,000	911.00	1,822,000	
四電工	200	2,623.00	524,600	
中電工	1,600	2,310.00	3,696,000	
関電工	5,500	1,034.00	5,687,000	
きんでん	8,100	1,774.00	14,369,400	
東京エネシス	1,300	952.00	1,237,600	
トーエネック	300	3,065.00	919,500	
住友電設	800	1,757.00	1,405,600	
日本電設工業	2,100	2,369.00	4,974,900	
協和エクシオ	4,800	2,666.00	12,796,800	
新日本空調	1,000	1,685.00	1,685,000	
九電工	2,400	3,830.00	9,192,000	
三機工業	2,800	1,154.00	3,231,200	
日揮	10,500	1,676.00	17,598,000	
中外炉工業	300	2,154.00	646,200	
ヤマト	1,200	492.00	590,400	
太平電業	800	2,446.00	1,956,800	
高砂熱学工業	3,100	1,753.00	5,434,300	
三晃金属工業	100	2,889.00	288,900	
朝日工業社	200	3,090.00	618,000	
明星工業	2,300	724.00	1,665,200	
大氣社	1,700	2,939.00	4,996,300	
ダイダン	800	2,528.00	2,022,400	
日比谷総合設備	1,200	1,709.00	2,050,800	
東芝プラントシステム	2,600	2,080.00	5,408,000	
ＯＳＪＢホールディングス	5,400	303.00	1,636,200	
東洋エンジニアリング	1,400	722.00	1,010,800	
千代田化工建設	8,800	332.00	2,921,600	
新興プランテック	2,200	1,151.00	2,532,200	
日本製粉	3,600	1,835.00	6,606,000	
日清製粉グループ本社	12,200	2,194.00	26,766,800	
日東富士製粉	100	5,600.00	560,000	

昭和産業	1,000	2,941.00	2,941,000	
鳥越製粉	1,000	821.00	821,000	
中部飼料	1,400	1,237.00	1,731,800	
フィード・ワン	7,300	177.00	1,292,100	
東洋精糖	200	1,043.00	208,600	
日本甜菜製糖	600	1,778.00	1,066,800	
三井製糖	900	3,000.00	2,700,000	
塩水港精糖	1,300	221.00	287,300	
日新製糖	500	2,082.00	1,041,000	
森永製菓	2,700	4,540.00	12,258,000	
中村屋	300	4,220.00	1,266,000	
江崎グリコ	3,200	5,370.00	17,184,000	
名糖産業	500	1,325.00	662,500	
井村屋グループ	500	2,501.00	1,250,500	
不二家	600	2,247.00	1,348,200	
山崎製パン	8,800	2,132.00	18,761,600	
第一屋製パン	200	1,007.00	201,400	
モロゾフ	200	5,050.00	1,010,000	
亀田製菓	700	4,900.00	3,430,000	
寿スピリッツ	1,100	4,320.00	4,752,000	
カルビー	4,900	3,520.00	17,248,000	
森永乳業	2,200	3,220.00	7,084,000	
六甲バター	800	2,035.00	1,628,000	
ヤクルト本社	8,000	7,140.00	57,120,000	
明治ホールディングス	7,700	8,450.00	65,065,000	
雪印メグミルク	2,600	2,895.00	7,527,000	
プリマハム	1,500	2,098.00	3,147,000	
日本ハム	4,700	4,600.00	21,620,000	
林兼産業	400	582.00	232,800	
丸大食品	1,200	1,865.00	2,238,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,000	3,850.00	3,850,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	7,000	708.00	4,956,000	
サッポロホールディングス	4,000	2,550.00	10,200,000	
アサヒグループホールディングス	22,900	4,347.00	99,546,300	
キリンホールディングス	49,400	2,572.50	127,081,500	
宝ホールディングス	8,100	1,313.00	10,635,300	

オエノンホールディングス	3,100	362.00	1,122,200	
養命酒製造	300	2,087.00	626,100	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	8,400	3,290.00	27,636,000	
サントリー食品インターナショナル	7,300	4,890.00	35,697,000	
ダイドーグループホールディングス	600	5,420.00	3,252,000	
伊藤園	3,700	4,780.00	17,686,000	
キーコーヒー	1,100	2,019.00	2,220,900	
ユニカフェ	300	1,013.00	303,900	
ジャパンフーズ	100	1,213.00	121,300	
日清オイリオグループ	1,400	3,205.00	4,487,000	
不二製油グループ本社	2,700	3,465.00	9,355,500	
かどや製油	100	5,370.00	537,000	
Ｊ－オイルミルズ	600	3,920.00	2,352,000	
キッコーマン	7,200	5,700.00	41,040,000	
味の素	24,100	1,874.00	45,163,400	
キユーピー	6,100	2,509.00	15,304,900	
ハウス食品グループ本社	4,200	3,890.00	16,338,000	
カゴメ	4,400	2,955.00	13,002,000	
焼津水産化学工業	500	1,020.00	510,000	
アリアケジャパン	1,000	6,670.00	6,670,000	
ピエトロ	100	1,635.00	163,500	
エバラ食品工業	200	2,115.00	423,000	
ニチレイ	5,700	2,985.00	17,014,500	
東洋水産	5,600	3,910.00	21,896,000	
イートアンド	400	1,614.00	645,600	
大冷	100	1,709.00	170,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	481.00	144,300	
日清食品ホールディングス	4,700	6,910.00	32,477,000	
永谷園ホールディングス	600	2,511.00	1,506,600	
一正蒲鉾	400	1,098.00	439,200	
フジッコ	1,200	2,340.00	2,808,000	
ロック・フィールド	1,200	1,564.00	1,876,800	
日本たばこ産業	63,000	2,749.00	173,187,000	
ケンコーマヨネーズ	600	2,043.00	1,225,800	
わらべや日洋ホールディングス	700	1,866.00	1,306,200	

なとり	600	1,649.00	989,400	
イフジ産業	200	651.00	130,200	
ピックルスコーポレーション	300	2,077.00	623,100	
北の達人コーポレーション	4,300	412.00	1,771,600	
ユーグレナ	4,600	606.00	2,787,600	
ミヨシ油脂	400	1,076.00	430,400	
理研ビタミン	500	3,450.00	1,725,000	
片倉工業	1,300	1,178.00	1,531,400	
グンゼ	700	4,735.00	3,314,500	
東洋紡	4,500	1,605.00	7,222,500	
ユニチカ	3,100	516.00	1,599,600	
富士紡ホールディングス	600	2,580.00	1,548,000	
倉敷紡績	1,000	2,400.00	2,400,000	
シキボウ	600	1,049.00	629,400	
日本毛織	3,500	863.00	3,020,500	
ダイトウボウ	1,700	83.00	141,100	
トーア紡コーポレーション	500	464.00	232,000	
ダイドーリミテッド	1,300	341.00	443,300	
帝国繊維	1,200	2,274.00	2,728,800	
帝人	8,700	1,869.00	16,260,300	
東レ	82,600	805.00	66,493,000	
サカイオーベックス	300	1,926.00	577,800	
住江織物	300	2,577.00	773,100	
日本フエルト	600	448.00	268,800	
イチカワ	100	1,402.00	140,200	
日東製網	100	1,274.00	127,400	
アツギ	900	996.00	896,400	
ダイニック	400	775.00	310,000	
セーレン	2,600	1,783.00	4,635,800	
ソトー	400	965.00	386,000	
東海染工	100	997.00	99,700	
小松マテーレ	1,700	763.00	1,297,100	
ワコールホールディングス	3,100	2,903.00	8,999,300	
ホギメディカル	1,300	3,675.00	4,777,500	
レナウン	3,100	100.00	310,000	
クラウディアホールディングス	200	472.00	94,400	

ＴＳＩホールディングス	3,900	706.00	2,753,400	
マツオカコーポレーション	300	2,801.00	840,300	
ワールド	1,000	1,540.00	1,540,000	
三陽商会	600	1,819.00	1,091,400	
ナイガイ	400	511.00	204,400	
オンワードホールディングス	6,400	627.00	4,012,800	
ルックホールディングス	400	1,102.00	440,800	
キムラタン	5,200	24.00	124,800	
ゴールドウイン	900	10,400.00	9,360,000	
デサント	2,600	1,890.00	4,914,000	
キング	600	510.00	306,000	
ヤマトインターナショナル	700	420.00	294,000	
特種東海製紙	700	3,995.00	2,796,500	
王子ホールディングス	47,900	618.00	29,602,200	
日本製紙	5,100	2,142.00	10,924,200	
三菱製紙	1,700	586.00	996,200	
北越コーポレーション	7,100	586.00	4,160,600	
中越パルプ工業	500	1,356.00	678,000	
巴川製紙所	300	1,098.00	329,400	
大王製紙	5,200	1,382.00	7,186,400	
阿波製紙	300	463.00	138,900	
レンゴー	11,000	953.00	10,483,000	
トーモク	700	1,678.00	1,174,600	
ザ・パック	800	3,000.00	2,400,000	
クラレ	18,000	1,695.00	30,510,000	
旭化成	75,700	1,209.00	91,521,300	
共和レザー	700	783.00	548,100	
昭和電工	7,100	3,710.00	26,341,000	
住友化学	83,800	587.00	49,190,600	
住友精化	500	4,415.00	2,207,500	
日産化学	6,500	5,770.00	37,505,000	
ラサ工業	500	1,376.00	688,000	
クレハ	1,000	6,710.00	6,710,000	
多木化学	300	5,270.00	1,581,000	
テイカ	900	1,808.00	1,627,200	
石原産業	2,000	1,147.00	2,294,000	

片倉コープアグリ	300	1,186.00	355,800	
日東エフシー	700	732.00	512,400	
日本曹達	1,700	2,858.00	4,858,600	
東ソー	16,500	1,542.00	25,443,000	
トクヤマ	3,100	2,690.00	8,339,000	
セントラル硝子	2,300	2,398.00	5,515,400	
東亞合成	6,700	1,245.00	8,341,500	
大阪ソーダ	1,100	2,484.00	2,732,400	
関東電化工業	2,500	878.00	2,195,000	
デンカ	4,200	3,435.00	14,427,000	
信越化学工業	18,800	9,060.00	170,328,000	
日本カーバイド工業	400	1,651.00	660,400	
堺化学工業	800	2,157.00	1,725,600	
第一稀元素化学工業	1,000	883.00	883,000	
エア・ウォーター	8,700	1,830.00	15,921,000	
大陽日酸	8,800	1,736.00	15,276,800	
日本化学工業	400	2,312.00	924,800	
東邦アセチレン	100	1,378.00	137,800	
日本パーカライジング	5,800	1,268.00	7,354,400	
高圧ガス工業	1,700	767.00	1,303,900	
チタン工業	100	2,509.00	250,900	
四国化成工業	1,900	1,064.00	2,021,600	
戸田工業	200	2,294.00	458,800	
ステラ　ケミファ	600	2,869.00	1,721,400	
保土谷化学工業	500	2,130.00	1,065,000	
日本触媒	1,800	7,280.00	13,104,000	
大日精化工業	900	2,862.00	2,575,800	
カネカ	2,800	4,300.00	12,040,000	
三菱瓦斯化学	11,000	1,716.00	18,876,000	
三井化学	9,700	2,735.00	26,529,500	
ＪＳＲ	10,700	1,746.00	18,682,200	
東京応化工業	1,800	3,170.00	5,706,000	
大阪有機化学工業	1,100	1,174.00	1,291,400	
三菱ケミカルホールディングス	71,200	939.00	66,856,800	
ＫＨネオケム	1,600	2,557.00	4,091,200	
ダイセル	16,500	1,143.00	18,859,500	

住友ベークライト	1,800	4,080.00	7,344,000	
積水化学工業	23,300	1,622.00	37,792,600	
日本ゼオン	9,600	1,102.00	10,579,200	
アイカ工業	3,200	3,675.00	11,760,000	
宇部興産	5,400	2,444.00	13,197,600	
積水樹脂	1,800	1,963.00	3,533,400	
タキロンシーアイ	2,300	573.00	1,317,900	
旭有機材	700	1,531.00	1,071,700	
日立化成	4,900	1,788.00	8,761,200	
ニチバン	600	2,009.00	1,205,400	
リケンテクノス	2,900	440.00	1,276,000	
大倉工業	500	1,726.00	863,000	
積水化成品工業	1,600	945.00	1,512,000	
群栄化学工業	300	2,793.00	837,900	
タイガースポリマー	600	609.00	365,400	
ミライアル	300	1,131.00	339,300	
ダイキアクシス	400	911.00	364,400	
ダイキョーニシカワ	2,200	1,156.00	2,543,200	
竹本容器	400	1,493.00	597,200	
森六ホールディングス	600	2,587.00	1,552,200	
日本化薬	6,800	1,392.00	9,465,600	
カーリットホールディングス	1,100	794.00	873,400	
日本精化	900	1,079.00	971,100	
扶桑化学工業	1,100	2,137.00	2,350,700	
トリケミカル研究所	300	4,470.00	1,341,000	
ＡＤＥＫＡ	5,200	1,736.00	9,027,200	
日油	4,100	3,535.00	14,493,500	
新日本理化	1,900	148.00	281,200	
ハリマ化成グループ	900	976.00	878,400	
花王	26,400	7,612.00	200,956,800	
第一工業製薬	400	2,480.00	992,000	
石原ケミカル	200	1,655.00	331,000	
日華化学	400	948.00	379,200	
ニイタカ	200	1,504.00	300,800	
三洋化成工業	700	5,130.00	3,591,000	
有機合成薬品工業	800	210.00	168,000	

大日本塗料	1,200	1,012.00	1,214,400	
日本ペイントホールディングス	8,800	3,550.00	31,240,000	
関西ペイント	12,000	1,922.00	23,064,000	
神東塗料	800	168.00	134,400	
中国塗料	3,500	934.00	3,269,000	
日本特殊塗料	800	1,329.00	1,063,200	
藤倉化成	1,400	584.00	817,600	
太陽ホールディングス	900	3,335.00	3,001,500	
ＤＩＣ	4,800	3,505.00	16,824,000	
サカタインクス	2,300	1,204.00	2,769,200	
東洋インキＳＣホールディングス	2,300	2,523.00	5,802,900	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	800	986.00	788,800	
富士フイルムホールディングス	22,600	4,630.00	104,638,000	
資生堂	21,600	6,310.00	136,296,000	
ライオン	15,100	2,189.00	33,053,900	
高砂香料工業	700	3,445.00	2,411,500	
マンダム	2,400	2,929.00	7,029,600	
ミルボン	1,300	4,340.00	5,642,000	
ファンケル	4,800	2,372.00	11,385,600	
コーセー	1,800	15,320.00	27,576,000	
コタ	500	1,412.00	706,000	
シーズ・ホールディングス	1,300	5,880.00	7,644,000	
シーボン	100	2,682.00	268,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	4,600	2,967.00	13,648,200	
ノエビアホールディングス	700	4,600.00	3,220,000	
アジュバンコスメジャパン	200	937.00	187,400	
エステー	800	1,769.00	1,415,200	
アグロ　カネショウ	400	2,040.00	816,000	
コニシ	1,900	1,648.00	3,131,200	
長谷川香料	1,300	1,603.00	2,083,900	
星光ＰＭＣ	700	804.00	562,800	
小林製薬	3,000	6,870.00	20,610,000	
荒川化学工業	1,000	1,344.00	1,344,000	
メック	700	1,105.00	773,500	
日本高純度化学	300	2,279.00	683,700	
タカラバイオ	2,800	2,548.00	7,134,400	

ＪＣＵ	1,400	1,606.00	2,248,400	
新田ゼラチン	700	685.00	479,500	
ＯＡＴアグリオ	100	2,065.00	206,500	
デクセリアルズ	2,800	858.00	2,402,400	
アース製薬	800	5,120.00	4,096,000	
北興化学工業	1,100	562.00	618,200	
大成ラミック	300	2,862.00	858,600	
クミアイ化学工業	4,500	667.00	3,001,500	
日本農薬	2,600	505.00	1,313,000	
アキレス	800	1,981.00	1,584,800	
有沢製作所	1,700	814.00	1,383,800	
日東電工	8,200	6,032.00	49,462,400	
レック	1,200	1,547.00	1,856,400	
三光合成	800	354.00	283,200	
きもと	1,800	187.00	336,600	
藤森工業	1,000	2,872.00	2,872,000	
前澤化成工業	700	1,050.00	735,000	
ウェーブロックホールディングス	200	743.00	148,600	
ＪＳＰ	600	2,199.00	1,319,400	
エフピコ	900	6,250.00	5,625,000	
天馬	800	1,725.00	1,380,000	
信越ポリマー	2,000	722.00	1,444,000	
東リ	2,700	253.00	683,100	
ニフコ	4,400	2,650.00	11,660,000	
バルカー	900	2,321.00	2,088,900	
ユニ・チャーム	23,000	3,226.00	74,198,000	
協和発酵キリン	13,600	2,066.00	28,097,600	
武田薬品工業	43,000	4,500.00	193,500,000	
アステラス製薬	100,400	1,533.00	153,913,200	
大日本住友製薬	8,100	3,805.00	30,820,500	
塩野義製薬	14,300	6,450.00	92,235,000	
田辺三菱製薬	11,400	1,669.00	19,026,600	
わかもと製薬	1,300	282.00	366,600	
あすか製薬	1,300	1,148.00	1,492,400	
日本新薬	2,800	6,630.00	18,564,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,418.00	483,600	

中外製薬	11,300	6,330.00	71,529,000	
科研製薬	2,000	5,170.00	10,340,000	
エーザイ	13,000	8,602.00	111,826,000	
ロート製薬	5,600	2,889.00	16,178,400	
小野薬品工業	25,700	2,336.00	60,035,200	
久光製薬	3,200	5,480.00	17,536,000	
持田製薬	800	9,700.00	7,760,000	
参天製薬	20,600	1,507.00	31,044,200	
扶桑薬品工業	400	2,694.00	1,077,600	
日本ケミファ	100	3,355.00	335,500	
ツムラ	3,400	3,140.00	10,676,000	
日医工	2,800	1,665.00	4,662,000	
キッセイ薬品工業	1,900	2,903.00	5,515,700	
生化学工業	2,100	1,264.00	2,654,400	
栄研化学	1,900	2,230.00	4,237,000	
日水製薬	500	1,180.00	590,000	
鳥居薬品	600	2,442.00	1,465,200	
ＪＣＲファーマ	800	6,130.00	4,904,000	
東和薬品	500	7,650.00	3,825,000	
富士製薬工業	700	1,776.00	1,243,200	
沢井製薬	2,200	5,570.00	12,254,000	
ゼリア新薬工業	2,200	1,846.00	4,061,200	
第一三共	31,100	3,784.00	117,682,400	
キョーリン製薬ホールディングス	2,400	2,330.00	5,592,000	
大幸薬品	500	1,783.00	891,500	
ダイト	600	2,961.00	1,776,600	
大塚ホールディングス	20,700	4,457.00	92,259,900	
大正製薬ホールディングス	2,400	11,380.00	27,312,000	
ペプチドリーム	5,000	4,520.00	22,600,000	
日本コークス工業	10,200	96.00	979,200	
昭和シェル石油	10,100	1,630.00	16,463,000	
ニチレキ	1,400	985.00	1,379,000	
ユシロ化学工業	600	1,201.00	720,600	
ビーピー・カストロール	400	1,243.00	497,200	
富士石油	2,900	307.00	890,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	400	1,548.00	619,200	

出光興産	8,400	3,860.00	32,424,000	
ＪＸＴＧホールディングス	182,900	584.80	106,959,920	
コスモエネルギーホールディングス	3,100	2,418.00	7,495,800	
横浜ゴム	6,300	2,298.00	14,477,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	5,600	1,499.00	8,394,400	
ブリヂストン	33,400	4,235.00	141,449,000	
住友ゴム工業	9,800	1,485.00	14,553,000	
藤倉ゴム工業	900	461.00	414,900	
オカモト	800	5,680.00	4,544,000	
フコク	500	898.00	449,000	
ニッタ	1,200	3,530.00	4,236,000	
住友理工	2,100	1,073.00	2,253,300	
三ツ星ベルト	1,400	2,105.00	2,947,000	
バンドー化学	2,100	1,100.00	2,310,000	
日東紡績	1,600	1,946.00	3,113,600	
ＡＧＣ	10,700	3,685.00	39,429,500	
日本板硝子	5,200	977.00	5,080,400	
石塚硝子	100	2,011.00	201,100	
日本山村硝子	500	1,538.00	769,000	
日本電気硝子	4,700	3,090.00	14,523,000	
オハラ	400	1,722.00	688,800	
住友大阪セメント	2,200	4,830.00	10,626,000	
太平洋セメント	6,900	3,600.00	24,840,000	
日本ヒューム	1,100	779.00	856,900	
日本コンクリート工業	2,300	256.00	588,800	
三谷セキサン	500	2,568.00	1,284,000	
アジアパイルホールディングス	1,500	588.00	882,000	
東海カーボン	9,900	1,557.00	15,414,300	
日本カーボン	500	4,495.00	2,247,500	
東洋炭素	600	2,310.00	1,386,000	
ノリタケカンパニーリミテド	700	5,110.00	3,577,000	
ＴＯＴＯ	8,400	4,065.00	34,146,000	
日本碍子	13,300	1,652.00	21,971,600	
日本特殊陶業	9,200	2,247.00	20,672,400	
ダントーホールディングス	900	104.00	93,600	
ＭＡＲＵＷＡ	400	6,430.00	2,572,000	

品川リフラクトリーズ	300	3,645.00	1,093,500	
黒崎播磨	200	5,920.00	1,184,000	
ヨータイ	900	671.00	603,900	
イソライト工業	600	615.00	369,000	
東京窯業	1,400	384.00	537,600	
ニッカトー	500	931.00	465,500	
フジミインコーポレーテッド	1,000	2,247.00	2,247,000	
クニミネ工業	400	821.00	328,400	
エーアンドエーマテリアル	200	1,002.00	200,400	
ニチアス	3,000	1,928.00	5,784,000	
ニチハ	1,500	2,633.00	3,949,500	
新日鐵住金	49,900	2,004.00	99,999,600	
神戸製鋼所	20,100	856.00	17,205,600	
中山製鋼所	1,500	515.00	772,500	
合同製鐵	500	1,753.00	876,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	29,200	1,902.50	55,553,000	
東京製鐵	5,700	902.00	5,141,400	
共英製鋼	1,200	1,807.00	2,168,400	
大和工業	2,300	2,661.00	6,120,300	
東京鐵鋼	400	1,172.00	468,800	
大阪製鐵	700	1,859.00	1,301,300	
淀川製鋼所	1,400	2,175.00	3,045,000	
丸一鋼管	3,900	3,370.00	13,143,000	
モリ工業	300	2,332.00	699,600	
大同特殊鋼	1,800	4,545.00	8,181,000	
日本高周波鋼業	400	548.00	219,200	
日本冶金工業	8,800	256.00	2,252,800	
山陽特殊製鋼	1,400	2,252.00	3,152,800	
愛知製鋼	600	3,475.00	2,085,000	
日立金属	11,600	1,207.00	14,001,200	
日本金属	200	1,183.00	236,600	
大平洋金属	700	2,836.00	1,985,200	
新日本電工	6,300	223.00	1,404,900	
栗本鐵工所	500	1,406.00	703,000	
虹技	100	1,390.00	139,000	
日本鋳鉄管	100	1,021.00	102,100	

三菱製鋼	800	1,697.00	1,357,600	
日亜鋼業	1,500	291.00	436,500	
日本精線	200	3,550.00	710,000	
エンビプロ・ホールディングス	200	524.00	104,800	
シンニッタン	1,600	324.00	518,400	
新家工業	200	1,579.00	315,800	
大紀アルミニウム工業所	1,800	587.00	1,056,600	
日本軽金属ホールディングス	29,300	228.00	6,680,400	
三井金属鉱業	2,900	2,561.00	7,426,900	
東邦亜鉛	600	3,465.00	2,079,000	
三菱マテリアル	7,100	3,085.00	21,903,500	
住友金属鉱山	14,700	3,107.00	45,672,900	
ＤＯＷＡホールディングス	2,500	3,370.00	8,425,000	
古河機械金属	1,800	1,352.00	2,433,600	
エス・サイエンス	4,800	57.00	273,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	1,628.00	1,953,600	
東邦チタニウム	1,900	974.00	1,850,600	
ＵＡＣＪ	1,600	2,362.00	3,779,200	
ＣＫサンエツ	200	2,386.00	477,200	
古河電気工業	3,100	3,245.00	10,059,500	
住友電気工業	40,200	1,553.00	62,430,600	
フジクラ	13,000	473.00	6,149,000	
昭和電線ホールディングス	1,200	613.00	735,600	
東京特殊電線	100	1,962.00	196,200	
タツタ電線	2,100	504.00	1,058,400	
カナレ電気	200	1,828.00	365,600	
平河ヒューテック	400	1,170.00	468,000	
リョービ	1,300	2,785.00	3,620,500	
アーレスティ	1,300	669.00	869,700	
アサヒホールディングス	2,000	2,293.00	4,586,000	
稲葉製作所	600	1,274.00	764,400	
宮地エンジニアリンググループ	300	1,983.00	594,900	
トーカロ	2,800	928.00	2,598,400	
アルファＣｏ	400	1,274.00	509,600	
ＳＵＭＣＯ	11,900	1,472.00	17,516,800	
川田テクノロジーズ	200	6,790.00	1,358,000	

ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	200	2,744.00	548,800	
東洋製罐グループホールディングス	6,800	2,534.00	17,231,200	
ホッカンホールディングス	500	1,670.00	835,000	
コロナ	600	1,065.00	639,000	
横河ブリッジホールディングス	2,000	1,691.00	3,382,000	
駒井ハルテック	200	1,902.00	380,400	
高田機工	100	2,714.00	271,400	
三和ホールディングス	11,100	1,191.00	13,220,100	
文化シヤッター	3,200	710.00	2,272,000	
三協立山	1,500	1,383.00	2,074,500	
アルインコ	900	961.00	864,900	
東洋シヤッター	200	636.00	127,200	
ＬＩＸＩＬグループ	15,900	1,550.00	24,645,000	
日本フイルコン	800	542.00	433,600	
ノーリツ	2,400	1,526.00	3,662,400	
長府製作所	1,100	2,101.00	2,311,100	
リンナイ	1,900	7,140.00	13,566,000	
ダイニチ工業	600	749.00	449,400	
日東精工	1,500	486.00	729,000	
三洋工業	100	1,902.00	190,200	
岡部	2,200	876.00	1,927,200	
ジーテクト	1,200	1,561.00	1,873,200	
中国工業	200	567.00	113,400	
東プレ	2,000	2,382.00	4,764,000	
高周波熱錬	2,100	858.00	1,801,800	
東京製綱	700	997.00	697,900	
サンコール	600	633.00	379,800	
モリテック　スチール	800	419.00	335,200	
パイオラックス	1,700	2,279.00	3,874,300	
エイチワン	1,100	1,055.00	1,160,500	
日本発條	10,700	1,022.00	10,935,400	
中央発條	100	3,145.00	314,500	
アドバネクス	100	1,575.00	157,500	
立川ブラインド工業	500	1,013.00	506,500	
三益半導体工業	800	1,364.00	1,091,200	
日本ドライケミカル	300	1,157.00	347,100	

日本製鋼所	3,200	2,021.00	6,467,200	
三浦工業	4,600	2,643.00	12,157,800	
タクマ	3,900	1,382.00	5,389,800	
ツガミ	2,400	713.00	1,711,200	
オークマ	1,400	5,630.00	7,882,000	
東芝機械	1,200	2,204.00	2,644,800	
アマダホールディングス	16,600	1,105.00	18,343,000	
アイダエンジニアリング	3,000	772.00	2,316,000	
滝澤鉄工所	300	1,556.00	466,800	
ＦＵＪＩ	3,200	1,410.00	4,512,000	
牧野フライス製作所	1,300	4,505.00	5,856,500	
オーエスジー	5,200	2,217.00	11,528,400	
ダイジェット工業	100	1,872.00	187,200	
旭ダイヤモンド工業	2,800	695.00	1,946,000	
DMG森精機	6,700	1,472.00	9,862,400	
ソディック	2,300	826.00	1,899,800	
ディスコ	1,400	15,930.00	22,302,000	
日東工器	600	2,107.00	1,264,200	
日進工具	300	2,500.00	750,000	
パンチ工業	700	551.00	385,700	
冨士ダイス	500	640.00	320,000	
豊和工業	600	791.00	474,600	
ＯＫＫ	400	818.00	327,200	
石川製作所	300	1,281.00	384,300	
東洋機械金属	800	590.00	472,000	
津田駒工業	200	1,957.00	391,400	
エンシュウ	300	1,042.00	312,600	
島精機製作所	1,500	3,570.00	5,355,000	
オプトラン	1,000	1,883.00	1,883,000	
ＮＣホールディングス	300	514.00	154,200	
フリュー	900	1,012.00	910,800	
ヤマシンフィルタ	1,900	665.00	1,263,500	
日阪製作所	1,300	829.00	1,077,700	
やまびこ	2,100	1,118.00	2,347,800	
平田機工	500	6,520.00	3,260,000	
ペガサスミシン製造	1,000	734.00	734,000	

マルマエ	300	723.00	216,900	
タツモ	300	785.00	235,500	
ナブテスコ	5,900	2,849.00	16,809,100	
三井海洋開発	1,100	2,448.00	2,692,800	
レオン自動機	1,100	1,385.00	1,523,500	
ＳＭＣ	3,200	36,470.00	116,704,000	
新川	800	409.00	327,200	
ホソカワミクロン	400	4,340.00	1,736,000	
ユニオンツール	500	3,040.00	1,520,000	
オイレス工業	1,500	1,855.00	2,782,500	
日精エー・エス・ビー機械	300	3,820.00	1,146,000	
サトーホールディングス	1,300	2,601.00	3,381,300	
技研製作所	700	3,225.00	2,257,500	
日本エアーテック	300	590.00	177,000	
カワタ	200	1,436.00	287,200	
日精樹脂工業	900	938.00	844,200	
オカダアイヨン	400	1,525.00	610,000	
ワイエイシイホールディングス	400	665.00	266,000	
小松製作所	49,200	2,843.00	139,875,600	
住友重機械工業	6,200	3,700.00	22,940,000	
日立建機	4,400	2,772.00	12,196,800	
日工	300	2,312.00	693,600	
巴工業	500	2,502.00	1,251,000	
井関農機	1,100	1,657.00	1,822,700	
ＴＯＷＡ	900	700.00	630,000	
丸山製作所	200	1,366.00	273,200	
北川鉄工所	500	2,347.00	1,173,500	
ローツェ	500	1,636.00	818,000	
タカキタ	400	645.00	258,000	
クボタ	58,300	1,705.00	99,401,500	
荏原実業	300	2,241.00	672,300	
三菱化工機	400	1,506.00	602,400	
月島機械	2,200	1,400.00	3,080,000	
帝国電機製作所	800	1,215.00	972,000	
東京機械製作所	400	409.00	163,600	
新東工業	2,600	946.00	2,459,600	

澁谷工業	1,000	3,650.00	3,650,000	
アイチ　コーポレーション	1,900	615.00	1,168,500	
小森コーポレーション	2,900	1,199.00	3,477,100	
鶴見製作所	800	1,981.00	1,584,800	
住友精密工業	200	3,235.00	647,000	
酒井重工業	200	2,316.00	463,200	
荏原製作所	4,800	3,005.00	14,424,000	
石井鐵工所	200	1,818.00	363,600	
西島製作所	1,100	943.00	1,037,300	
北越工業	1,100	1,088.00	1,196,800	
ダイキン工業	14,800	11,975.00	177,230,000	
オルガノ	400	2,595.00	1,038,000	
トーヨーカネツ	400	2,383.00	953,200	
栗田工業	5,900	2,762.00	16,295,800	
椿本チエイン	1,400	4,055.00	5,677,000	
大同工業	500	963.00	481,500	
木村化工機	900	360.00	324,000	
アネスト岩田	1,700	945.00	1,606,500	
ダイフク	6,000	5,420.00	32,520,000	
サムコ	300	982.00	294,600	
加藤製作所	600	2,747.00	1,648,200	
油研工業	200	1,943.00	388,600	
タダノ	5,200	1,266.00	6,583,200	
フジテック	4,000	1,184.00	4,736,000	
ＣＫＤ	3,000	1,066.00	3,198,000	
キトー	800	1,673.00	1,338,400	
平和	3,000	2,299.00	6,897,000	
理想科学工業	1,000	1,628.00	1,628,000	
ＳＡＮＫＹＯ	2,700	4,225.00	11,407,500	
日本金銭機械	1,200	1,010.00	1,212,000	
マースグループホールディングス	700	2,215.00	1,550,500	
福島工業	700	3,795.00	2,656,500	
オーイズミ	500	371.00	185,500	
ダイコク電機	500	1,542.00	771,000	
竹内製作所	1,800	1,944.00	3,499,200	
アマノ	3,100	2,234.00	6,925,400	

ＪＵＫＩ	1,500	1,214.00	1,821,000	
サンデンホールディングス	1,300	843.00	1,095,900	
蛇の目ミシン工業	1,000	505.00	505,000	
マックス	1,700	1,397.00	2,374,900	
グローリー	3,000	2,718.00	8,154,000	
新晃工業	1,000	1,469.00	1,469,000	
大和冷機工業	1,600	1,103.00	1,764,800	
セガサミーホールディングス	10,800	1,539.00	16,621,200	
日本ピストンリング	400	1,796.00	718,400	
リケン	500	4,905.00	2,452,500	
ＴＰＲ	1,500	2,344.00	3,516,000	
ツバキ・ナカシマ	1,600	1,784.00	2,854,400	
ホシザキ	3,200	8,110.00	25,952,000	
大豊工業	900	1,008.00	907,200	
日本精工	22,300	1,059.00	23,615,700	
ＮＴＮ	23,400	364.00	8,517,600	
ジェイテクト	10,400	1,409.00	14,653,600	
不二越	1,000	4,340.00	4,340,000	
日本トムソン	3,200	555.00	1,776,000	
ＴＨＫ	6,800	2,542.00	17,285,600	
ユーシン精機	800	947.00	757,600	
前澤給装工業	400	1,839.00	735,600	
イーグル工業	1,300	1,304.00	1,695,200	
前澤工業	800	359.00	287,200	
日本ピラー工業	1,100	1,378.00	1,515,800	
キッツ	4,400	886.00	3,898,400	
マキタ	13,200	3,860.00	50,952,000	
日立造船	8,600	367.00	3,156,200	
三菱重工業	18,200	4,195.00	76,349,000	
ＩＨＩ	8,400	3,305.00	27,762,000	
スター精密	1,900	1,609.00	3,057,100	
日清紡ホールディングス	6,000	949.00	5,694,000	
イビデン	6,700	1,590.00	10,653,000	
コニカミノルタ	23,800	1,069.00	25,442,200	
ブラザー工業	14,200	1,838.00	26,099,600	
ミネベアミツミ	20,200	1,775.00	35,855,000	

日立製作所	48,900	3,381.00	165,330,900	
三菱電機	108,700	1,373.00	149,245,100	
富士電機	7,100	3,420.00	24,282,000	
東洋電機製造	400	1,342.00	536,800	
安川電機	12,600	3,100.00	39,060,000	
シンフォニアテクノロジー	1,500	1,363.00	2,044,500	
明電舎	2,100	1,456.00	3,057,600	
オリジン電気	300	1,761.00	528,300	
山洋電気	500	4,230.00	2,115,000	
デンヨー	1,000	1,437.00	1,437,000	
東芝テック	1,300	2,614.00	3,398,200	
芝浦メカトロニクス	200	3,710.00	742,000	
マブチモーター	3,000	3,800.00	11,400,000	
日本電産	13,100	13,055.00	171,020,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	1,731.00	1,038,600	
トレックス・セミコンダクター	400	1,249.00	499,600	
東光高岳	500	1,403.00	701,500	
ダブル・スコープ	1,600	1,195.00	1,912,000	
宮越ホールディングス	400	1,041.00	416,400	
ダイヘン	1,200	2,500.00	3,000,000	
田淵電機	1,500	131.00	196,500	
ヤーマン	1,600	1,327.00	2,123,200	
ＪＶＣケンウッド	8,200	255.00	2,091,000	
ミマキエンジニアリング	1,000	771.00	771,000	
第一精工	500	1,253.00	626,500	
日新電機	2,500	925.00	2,312,500	
大崎電気工業	2,100	725.00	1,522,500	
オムロン	11,600	4,465.00	51,794,000	
日東工業	1,700	1,969.00	3,347,300	
ＩＤＥＣ	1,500	2,013.00	3,019,500	
不二電機工業	100	1,317.00	131,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	3,900	2,282.00	8,899,800	
サクサホールディングス	300	1,805.00	541,500	
メルコホールディングス	500	3,485.00	1,742,500	
テクノメディカ	200	2,092.00	418,400	
日本電気	14,100	3,465.00	48,856,500	

富士通	10,500	7,423.00	77,941,500	
沖電気工業	4,700	1,406.00	6,608,200	
岩崎通信機	500	773.00	386,500	
電気興業	600	2,400.00	1,440,000	
サンケン電気	1,300	2,313.00	3,006,900	
ナカヨ	200	1,497.00	299,400	
アイホン	600	1,653.00	991,800	
ルネサスエレクトロニクス	11,300	647.00	7,311,100	
セイコーエプソン	13,500	1,679.00	22,666,500	
ワコム	7,900	457.00	3,610,300	
アルバック	2,500	3,605.00	9,012,500	
アクセル	500	513.00	256,500	
ＥＩＺＯ	1,000	4,155.00	4,155,000	
ジャパンディスプレイ	25,700	83.00	2,133,100	
日本信号	2,800	915.00	2,562,000	
京三製作所	2,300	449.00	1,032,700	
能美防災	1,400	1,909.00	2,672,600	
ホーチキ	700	1,088.00	761,600	
星和電機	400	394.00	157,600	
エレコム	1,000	2,844.00	2,844,000	
パナソニック	124,200	1,071.50	133,080,300	
シャープ	10,800	1,265.00	13,662,000	
アンリツ	7,000	1,646.00	11,522,000	
富士通ゼネラル	3,300	1,466.00	4,837,800	
ソニー	72,900	5,324.00	388,119,600	
ＴＤＫ	5,700	8,120.00	46,284,000	
帝国通信工業	500	1,216.00	608,000	
タムラ製作所	4,200	576.00	2,419,200	
アルプスアルパイン	11,300	2,309.00	26,091,700	
池上通信機	300	1,187.00	356,100	
パイオニア	16,500	66.00	1,089,000	
日本電波工業	1,000	400.00	400,000	
鈴木	500	635.00	317,500	
日本トリム	200	5,780.00	1,156,000	
ローランド　ディー．ジー．	600	2,115.00	1,269,000	
フォスター電機	1,300	1,513.00	1,966,900	

クラリオン	800	2,491.00	1,992,800	
ＳＭＫ	300	2,418.00	725,400	
ヨコオ	800	1,431.00	1,144,800	
ティアック	800	221.00	176,800	
ホシデン	3,200	829.00	2,652,800	
ヒロセ電機	1,600	11,590.00	18,544,000	
日本航空電子工業	2,500	1,436.00	3,590,000	
ＴＯＡ	1,200	1,014.00	1,216,800	
マクセルホールディングス	2,300	1,545.00	3,553,500	
古野電気	1,400	906.00	1,268,400	
ユニデンホールディングス	300	2,150.00	645,000	
スミダコーポレーション	900	1,201.00	1,080,900	
アイコム	600	2,150.00	1,290,000	
リオン	500	1,739.00	869,500	
本多通信工業	900	517.00	465,300	
船井電機	1,100	587.00	645,700	
横河電機	10,900	1,998.00	21,778,200	
新電元工業	400	4,300.00	1,720,000	
アズビル	7,000	2,153.00	15,071,000	
東亜ディーケーケー	500	758.00	379,000	
日本光電工業	4,800	3,310.00	15,888,000	
チノー	400	1,248.00	499,200	
共和電業	1,100	367.00	403,700	
日本電子材料	400	728.00	291,200	
堀場製作所	2,200	5,360.00	11,792,000	
アドバンテスト	7,400	2,407.00	17,811,800	
小野測器	500	591.00	295,500	
エスペック	1,000	1,973.00	1,973,000	
キーエンス	5,300	53,980.00	286,094,000	
日置電機	600	3,770.00	2,262,000	
シスメックス	8,500	6,062.00	51,527,000	
日本マイクロニクス	1,800	778.00	1,400,400	
メガチップス	900	2,817.00	2,535,300	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	600	3,580.00	2,148,000	
澤藤電機	100	1,627.00	162,700	
原田工業	300	881.00	264,300	

コーセル	1,500	1,050.00	1,575,000	
イリソ電子工業	1,000	4,500.00	4,500,000	
オプテックスグループ	1,900	1,892.00	3,594,800	
千代田インテグレ	500	1,960.00	980,000	
アイ・オー・データ機器	500	1,122.00	561,000	
レーザーテック	2,200	3,430.00	7,546,000	
スタンレー電気	7,700	3,195.00	24,601,500	
岩崎電気	400	1,340.00	536,000	
ウシオ電機	6,600	1,260.00	8,316,000	
岡谷電機産業	800	392.00	313,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,000	698.00	698,000	
エノモト	200	839.00	167,800	
日本セラミック	1,100	2,516.00	2,767,600	
遠藤照明	500	726.00	363,000	
古河電池	800	679.00	543,200	
双信電機	500	375.00	187,500	
山一電機	800	1,269.00	1,015,200	
図研	700	1,518.00	1,062,600	
日本電子	2,100	1,911.00	4,013,100	
カシオ計算機	9,600	1,420.00	13,632,000	
ファナック	10,300	18,645.00	192,043,500	
日本シイエムケイ	2,800	683.00	1,912,400	
エンプラス	500	3,100.00	1,550,000	
大真空	400	996.00	398,400	
ローム	5,300	7,790.00	41,287,000	
浜松ホトニクス	7,800	3,745.00	29,211,000	
三井ハイテック	1,200	947.00	1,136,400	
新光電気工業	3,600	744.00	2,678,400	
京セラ	16,600	6,103.00	101,309,800	
太陽誘電	4,800	1,817.00	8,721,600	
村田製作所	11,400	14,970.00	170,658,000	
ユーシン	1,500	981.00	1,471,500	
双葉電子工業	1,800	1,707.00	3,072,600	
北陸電気工業	400	994.00	397,600	
ニチコン	3,400	918.00	3,121,200	
日本ケミコン	800	2,235.00	1,788,000	

ＫＯＡ	1,600	1,480.00	2,368,000	
市光工業	1,600	605.00	968,000	
小糸製作所	6,500	6,030.00	39,195,000	
ミツバ	2,000	704.00	1,408,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	1,900	5,590.00	10,621,000	
キヤノン電子	1,000	1,907.00	1,907,000	
キヤノン	58,500	3,130.00	183,105,000	
リコー	32,700	1,141.00	37,310,700	
象印マホービン	2,000	1,137.00	2,274,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	100	1,891.00	189,100	
東京エレクトロン	7,200	15,420.00	111,024,000	
トヨタ紡織	3,800	1,750.00	6,650,000	
芦森工業	200	1,475.00	295,000	
ユニプレス	2,100	2,067.00	4,340,700	
豊田自動織機	8,800	5,370.00	47,256,000	
モリタホールディングス	1,900	1,844.00	3,503,600	
三櫻工業	1,400	610.00	854,000	
デンソー	23,900	5,114.00	122,224,600	
東海理化電機製作所	2,900	1,987.00	5,762,300	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	3,900	1,214.00	4,734,600	
川崎重工業	8,500	2,654.00	22,559,000	
名村造船所	3,300	464.00	1,531,200	
サノヤスホールディングス	1,400	189.00	264,600	
日本車輌製造	400	2,335.00	934,000	
三菱ロジスネクスト	1,300	1,107.00	1,439,100	
近畿車輛	200	1,996.00	399,200	
日産自動車	128,200	927.70	118,931,140	
いすゞ自動車	34,400	1,642.00	56,484,800	
トヨタ自動車	121,100	6,764.00	819,120,400	
日野自動車	13,600	1,133.00	15,408,800	
三菱自動車工業	40,200	675.00	27,135,000	
エフテック	800	987.00	789,600	
レシップホールディングス	400	716.00	286,400	
ＧＭＢ	200	956.00	191,200	
ファルテック	200	783.00	156,600	
武蔵精密工業	2,600	1,590.00	4,134,000	

日産車体	2,100	1,014.00	2,129,400	
新明和工業	5,100	1,473.00	7,512,300	
極東開発工業	2,200	1,548.00	3,405,600	
日信工業	2,000	1,515.00	3,030,000	
トピー工業	900	2,373.00	2,135,700	
ティラド	400	2,361.00	944,400	
曙ブレーキ工業	6,000	213.00	1,278,000	
タチエス	1,800	1,527.00	2,748,600	
ＮＯＫ	5,800	1,717.00	9,958,600	
フタバ産業	3,000	580.00	1,740,000	
ＫＹＢ	1,100	2,993.00	3,292,300	
大同メタル工業	1,800	816.00	1,468,800	
プレス工業	5,400	586.00	3,164,400	
ミクニ	1,400	542.00	758,800	
太平洋工業	2,300	1,536.00	3,532,800	
ケーヒン	2,500	1,982.00	4,955,000	
河西工業	1,300	888.00	1,154,400	
アイシン精機	9,000	4,365.00	39,285,000	
マツダ	34,100	1,216.00	41,465,600	
今仙電機製作所	1,000	1,019.00	1,019,000	
本田技研工業	91,700	3,283.00	301,051,100	
スズキ	19,900	5,893.00	117,270,700	
ＳＵＢＡＲＵ	33,700	2,503.50	84,367,950	
安永	500	1,449.00	724,500	
ヤマハ発動機	15,400	2,343.00	36,082,200	
ショーワ	2,600	1,425.00	3,705,000	
ＴＢＫ	1,300	417.00	542,100	
エクセディ	1,500	2,723.00	4,084,500	
豊田合成	3,500	2,414.00	8,449,000	
愛三工業	1,700	773.00	1,314,100	
盟和産業	100	1,048.00	104,800	
日本プラスト	900	780.00	702,000	
ヨロズ	1,000	1,524.00	1,524,000	
エフ・シー・シー	2,000	2,813.00	5,626,000	
シマノ	4,400	15,160.00	66,704,000	
テイ・エス　テック	2,500	3,300.00	8,250,000	

ジャムコ	500	2,522.00	1,261,000	
テルモ	15,400	6,231.00	95,957,400	
クリエートメディック	400	985.00	394,000	
日機装	3,600	1,008.00	3,628,800	
島津製作所	14,000	2,509.00	35,126,000	
ＪＭＳ	1,000	587.00	587,000	
クボテック	200	442.00	88,400	
長野計器	900	832.00	748,800	
ブイ・テクノロジー	200	15,220.00	3,044,000	
東京計器	800	936.00	748,800	
愛知時計電機	100	3,870.00	387,000	
インターアクション	600	2,032.00	1,219,200	
オーバル	1,100	237.00	260,700	
東京精密	2,000	3,050.00	6,100,000	
マニー	1,300	5,080.00	6,604,000	
ニコン	18,900	1,860.00	35,154,000	
トプコン	5,800	1,559.00	9,042,200	
オリンパス	16,200	4,475.00	72,495,000	
理研計器	1,000	1,967.00	1,967,000	
タムロン	1,000	1,700.00	1,700,000	
ＨＯＹＡ	21,900	6,202.00	135,823,800	
シード	500	1,363.00	681,500	
ノーリツ鋼機	900	1,713.00	1,541,700	
エー・アンド・デイ	1,100	696.00	765,600	
朝日インテック	3,900	4,765.00	18,583,500	
シチズン時計	11,900	579.00	6,890,100	
リズム時計工業	300	1,794.00	538,200	
大研医器	900	605.00	544,500	
メニコン	1,500	2,720.00	4,080,000	
シンシア	200	496.00	99,200	
松風	500	1,113.00	556,500	
セイコーホールディングス	1,700	2,339.00	3,976,300	
ニプロ	7,500	1,434.00	10,755,000	
中本パックス	300	1,656.00	496,800	
スノーピーク	400	1,233.00	493,200	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,565.00	5,934,500	

トランザクション	600	700.00	420,000	
ＳＨＯ－ＢＩ	300	355.00	106,500	
ニホンフラッシュ	500	1,632.00	816,000	
前田工繊	1,200	2,459.00	2,950,800	
永大産業	1,400	429.00	600,600	
アートネイチャー	1,200	618.00	741,600	
バンダイナムコホールディングス	11,200	4,825.00	54,040,000	
アイフィスジャパン	200	628.00	125,600	
共立印刷	1,800	204.00	367,200	
ＳＨＯＥＩ	500	3,725.00	1,862,500	
フランスベッドホールディングス	1,500	905.00	1,357,500	
パイロットコーポレーション	1,900	5,160.00	9,804,000	
萩原工業	600	1,519.00	911,400	
トッパン・フォームズ	2,400	914.00	2,193,600	
フジシールインターナショナル	2,500	3,770.00	9,425,000	
タカラトミー	4,600	1,135.00	5,221,000	
廣済堂	300	608.00	182,400	
エステールホールディングス	300	654.00	196,200	
アーク	4,100	90.00	369,000	
タカノ	400	823.00	329,200	
プロネクサス	900	1,002.00	901,800	
ホクシン	700	148.00	103,600	
ウッドワン	300	1,083.00	324,900	
大建工業	800	1,896.00	1,516,800	
凸版印刷	15,300	1,793.00	27,432,900	
大日本印刷	15,300	2,549.00	38,999,700	
図書印刷	1,000	949.00	949,000	
共同印刷	300	2,378.00	713,400	
ＮＩＳＳＨＡ	2,300	1,399.00	3,217,700	
光村印刷	100	2,100.00	210,000	
宝印刷	600	1,631.00	978,600	
アシックス	10,800	1,546.00	16,696,800	
ツツミ	300	1,894.00	568,200	
小松ウオール工業	300	1,930.00	579,000	
ヤマハ	6,500	4,645.00	30,192,500	
河合楽器製作所	300	3,100.00	930,000	

クリナップ	1,000	609.00	609,000	
ピジョン	6,600	4,015.00	26,499,000	
兼松サステック	100	1,583.00	158,300	
キングジム	900	827.00	744,300	
リンテック	2,600	2,430.00	6,318,000	
イトーキ	2,000	571.00	1,142,000	
任天堂	6,700	33,890.00	227,063,000	
三菱鉛筆	1,900	2,238.00	4,252,200	
タカラスタンダード	2,200	1,620.00	3,564,000	
コクヨ	5,200	1,589.00	8,262,800	
ナカバヤシ	1,100	541.00	595,100	
グローブライド	500	2,494.00	1,247,000	
オカムラ	3,800	1,414.00	5,373,200	
美津濃	1,200	2,567.00	3,080,400	
東京電力ホールディングス	86,800	751.00	65,186,800	
中部電力	33,300	1,746.00	58,141,800	
関西電力	44,400	1,674.50	74,347,800	
中国電力	15,000	1,504.00	22,560,000	
北陸電力	10,600	992.00	10,515,200	
東北電力	25,500	1,510.00	38,505,000	
四国電力	9,800	1,395.00	13,671,000	
九州電力	22,400	1,366.00	30,598,400	
北海道電力	10,200	775.00	7,905,000	
沖縄電力	2,000	2,089.00	4,178,000	
電源開発	8,600	2,808.00	24,148,800	
エフオン	700	841.00	588,700	
イーレックス	1,900	634.00	1,204,600	
レノバ	1,100	1,085.00	1,193,500	
東京瓦斯	21,300	2,865.50	61,035,150	
大阪瓦斯	21,100	2,191.00	46,230,100	
東邦瓦斯	5,400	4,830.00	26,082,000	
北海道瓦斯	600	1,496.00	897,600	
広島ガス	2,200	342.00	752,400	
西部瓦斯	1,200	2,545.00	3,054,000	
静岡ガス	3,300	937.00	3,092,100	
メタウォーター	500	2,939.00	1,469,500	

ＳＢＳホールディングス	1,200	1,572.00	1,886,400	
東武鉄道	11,500	3,050.00	35,075,000	
相鉄ホールディングス	3,700	3,265.00	12,080,500	
東京急行電鉄	29,500	1,842.00	54,339,000	
京浜急行電鉄	14,900	1,800.00	26,820,000	
小田急電鉄	17,400	2,438.00	42,421,200	
京王電鉄	6,100	6,220.00	37,942,000	
京成電鉄	8,100	3,410.00	27,621,000	
富士急行	1,500	3,290.00	4,935,000	
新京成電鉄	300	2,125.00	637,500	
東日本旅客鉄道	19,400	9,999.00	193,980,600	
西日本旅客鉄道	9,800	7,850.00	76,930,000	
東海旅客鉄道	9,700	23,285.00	225,864,500	
西武ホールディングス	13,900	1,896.00	26,354,400	
鴻池運輸	1,800	1,659.00	2,986,200	
西日本鉄道	3,000	2,768.00	8,304,000	
ハマキョウレックス	800	3,590.00	2,872,000	
サカイ引越センター	600	5,810.00	3,486,000	
近鉄グループホールディングス	10,300	4,780.00	49,234,000	
阪急阪神ホールディングス	13,700	3,845.00	52,676,500	
南海電気鉄道	4,600	2,911.00	13,390,600	
京阪ホールディングス	4,600	4,425.00	20,355,000	
神戸電鉄	200	3,890.00	778,000	
名古屋鉄道	8,200	2,841.00	23,296,200	
山陽電気鉄道	800	2,096.00	1,676,800	
日本通運	4,000	6,550.00	26,200,000	
ヤマトホールディングス	18,100	2,928.50	53,005,850	
山九	2,900	5,240.00	15,196,000	
丸運	600	299.00	179,400	
丸全昭和運輸	800	2,676.00	2,140,800	
センコーグループホールディングス	5,700	853.00	4,862,100	
トナミホールディングス	200	5,650.00	1,130,000	
ニッコンホールディングス	3,900	2,739.00	10,682,100	
日本石油輸送	100	2,894.00	289,400	
福山通運	1,300	4,385.00	5,700,500	
セイノーホールディングス	7,700	1,494.00	11,503,800	

エスライン	300	1,033.00	309,900	
神奈川中央交通	200	3,725.00	745,000	
日立物流	2,300	3,000.00	6,900,000	
丸和運輸機関	500	3,530.00	1,765,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,100	1,183.00	1,301,300	
九州旅客鉄道	8,600	3,705.00	31,863,000	
ＳＧホールディングス	9,700	2,901.00	28,139,700	
日本郵船	8,600	1,829.00	15,729,400	
商船三井	6,100	2,661.00	16,232,100	
川崎汽船	3,200	1,486.00	4,755,200	
ＮＳユナイテッド海運	600	2,921.00	1,752,600	
明治海運	1,100	349.00	383,900	
飯野海運	4,900	405.00	1,984,500	
共栄タンカー	100	1,553.00	155,300	
乾汽船	900	735.00	661,500	
日本航空	18,800	3,970.00	74,636,000	
ＡＮＡホールディングス	18,800	3,966.00	74,560,800	
パスコ	200	791.00	158,200	
トランコム	300	5,750.00	1,725,000	
日新	900	1,828.00	1,645,200	
三菱倉庫	3,600	2,771.00	9,975,600	
三井倉庫ホールディングス	1,300	1,901.00	2,471,300	
住友倉庫	3,900	1,369.00	5,339,100	
澁澤倉庫	600	1,550.00	930,000	
東陽倉庫	1,900	288.00	547,200	
日本トランスシティ	2,300	440.00	1,012,000	
ケイヒン	200	1,299.00	259,800	
中央倉庫	600	1,002.00	601,200	
川西倉庫	200	1,188.00	237,600	
安田倉庫	800	820.00	656,000	
東洋埠頭	300	1,464.00	439,200	
宇徳	900	537.00	483,300	
上組	6,400	2,416.00	15,462,400	
サンリツ	200	673.00	134,600	
キムラユニティー	300	1,011.00	303,300	
キユーソー流通システム	300	2,055.00	616,500	

近鉄エクスプレス	1,900	1,605.00	3,049,500	
東海運	600	288.00	172,800	
エーアイテイー	700	1,046.00	732,200	
内外トランスライン	300	1,364.00	409,200	
日本コンセプト	300	975.00	292,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,200	2,306.00	2,767,200	
システナ	3,800	1,199.00	4,556,200	
デジタルアーツ	600	6,310.00	3,786,000	
新日鉄住金ソリューションズ	1,600	2,818.00	4,508,800	
キューブシステム	700	648.00	453,600	
エイジア	300	1,125.00	337,500	
コア	500	1,204.00	602,000	
ソリトンシステムズ	600	800.00	480,000	
ソフトクリエイトホールディングス	500	1,339.00	669,500	
ＴＩＳ	3,500	4,825.00	16,887,500	
ネオス	400	1,144.00	457,600	
電算システム	400	2,376.00	950,400	
グリー	5,700	492.00	2,804,400	
コーエーテクモホールディングス	2,200	1,865.00	4,103,000	
三菱総合研究所	400	3,210.00	1,284,000	
ボルテージ	200	595.00	119,000	
電算	100	2,231.00	223,100	
ＡＧＳ	600	679.00	407,400	
ファインデックス	900	566.00	509,400	
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,488.00	297,600	
ブレインパッド	200	6,220.00	1,244,000	
ＫＬａｂ	1,900	965.00	1,833,500	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	875.00	1,225,000	
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,813.00	362,600	
ネクソン	27,000	1,679.00	45,333,000	
アイスタイル	2,700	843.00	2,276,100	
エムアップ	400	1,724.00	689,600	
エイチーム	700	1,702.00	1,191,400	
テクノスジャパン	900	789.00	710,100	
ｅｎｉｓｈ	400	521.00	208,400	

コロプラ	3,000	783.00	2,349,000	
オルトプラス	700	356.00	249,200	
ブロードリーフ	5,300	554.00	2,936,200	
クロス・マーケティンググループ	300	355.00	106,500	
デジタルハーツホールディングス	500	1,418.00	709,000	
メディアドゥホールディングス	300	2,180.00	654,000	
じげん	1,100	563.00	619,300	
ブイキューブ	600	376.00	225,600	
サイバーリンクス	200	929.00	185,800	
ディー・エル・イー	700	149.00	104,300	
フィックスターズ	1,000	1,406.00	1,406,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,090.00	654,000	
オプティム	200	4,495.00	899,000	
セレス	300	1,444.00	433,200	
ベリサーブ	100	4,905.00	490,500	
ティーガイア	1,100	2,120.00	2,332,000	
セック	200	3,545.00	709,000	
日本アジアグループ	1,100	346.00	380,600	
豆蔵ホールディングス	700	1,038.00	726,600	
テクマトリックス	800	1,858.00	1,486,400	
プロシップ	100	2,703.00	270,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,600	253.00	6,476,800	
GMOペイメントゲートウェイ	1,700	5,280.00	8,976,000	
ザッパラス	500	372.00	186,000	
システムリサーチ	100	2,675.00	267,500	
インターネットイニシアティブ	1,700	2,522.00	4,287,400	
さくらインターネット	1,300	481.00	625,300	
ヴィンクス	400	1,263.00	505,200	
GMOクラウド	200	3,125.00	625,000	
ＳＲＡホールディングス	600	2,467.00	1,480,200	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	200	1,733.00	346,600	
システムインテグレータ	300	712.00	213,600	
朝日ネット	900	513.00	461,700	
ｅＢＡＳＥ	300	1,761.00	528,300	
アバント	300	1,167.00	350,100	
アドソル日進	400	1,508.00	603,200	

フリービット	700	831.00	581,700	
コムチュア	600	2,950.00	1,770,000	
サイバーコム	200	2,147.00	429,400	
アステリア	500	819.00	409,500	
マークラインズ	400	1,298.00	519,200	
メディカル・データ・ビジョン	900	985.00	886,500	
ｇｕｍｉ	1,200	674.00	808,800	
ショーケース・ティービー	200	656.00	131,200	
モバイルファクトリー	300	1,454.00	436,200	
テラスカイ	100	3,665.00	366,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,296.00	648,000	
ＰＣＩホールディングス	200	2,332.00	466,400	
パイプドＨＤ	200	937.00	187,400	
アイビーシー	200	1,044.00	208,800	
ネオジャパン	200	853.00	170,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	100	2,335.00	233,500	
ランドコンピュータ	100	1,005.00	100,500	
ダブルスタンダード	100	3,690.00	369,000	
オープンドア	500	2,871.00	1,435,500	
マイネット	300	1,829.00	548,700	
アカツキ	400	6,220.00	2,488,000	
ベネフィットジャパン	100	773.00	77,300	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	200	1,198.00	239,600	
ＬＩＮＥ	3,200	3,840.00	12,288,000	
カナミックネットワーク	200	1,789.00	357,800	
ノムラシステムコーポレーション	100	760.00	76,000	
チェンジ	100	4,455.00	445,500	
シンクロ・フード	500	623.00	311,500	
オークネット	600	934.00	560,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,200	805.00	966,000	
マクロミル	1,300	1,638.00	2,129,400	
ビーグリー	200	936.00	187,200	
オロ	100	4,195.00	419,500	
ソルクシーズ	500	657.00	328,500	
フェイス	400	866.00	346,400	

ハイマックス	100	1,813.00	181,300	
野村総合研究所	6,700	4,595.00	30,786,500	
サイバネットシステム	900	588.00	529,200	
ＣＥホールディングス	300	690.00	207,000	
日本システム技術	200	1,445.00	289,000	
インテージホールディングス	1,400	891.00	1,247,400	
東邦システムサイエンス	300	915.00	274,500	
ソースネクスト	4,100	578.00	2,369,800	
インフォコム	400	3,840.00	1,536,000	
ＦＩＧ	900	309.00	278,100	
フォーカスシステムズ	700	998.00	698,600	
クレスコ	300	3,070.00	921,000	
フジ・メディア・ホールディングス	11,100	1,620.00	17,982,000	
オービック	3,700	9,000.00	33,300,000	
ジャストシステム	1,500	2,213.00	3,319,500	
ＴＤＣソフト	900	800.00	720,000	
ヤフー	69,500	302.00	20,989,000	
トレンドマイクロ	5,700	6,410.00	36,537,000	
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,368.00	410,400	
日本オラクル	1,700	7,800.00	13,260,000	
アルファシステムズ	300	2,519.00	755,700	
フューチャー	1,400	1,516.00	2,122,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	953.00	762,400	
ソフトバンク・テクノロジー	500	1,862.00	931,000	
トーセ	300	819.00	245,700	
オービックビジネスコンサルタント	1,100	4,055.00	4,460,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	4,900	2,251.00	11,029,900	
アイティフォー	1,300	737.00	958,100	
東計電算	200	2,935.00	587,000	
エックスネット	200	832.00	166,400	
大塚商会	5,800	3,405.00	19,749,000	
サイボウズ	1,200	651.00	781,200	
ソフトブレーン	800	440.00	352,000	
電通国際情報サービス	700	3,015.00	2,110,500	
デジタルガレージ	2,100	2,567.00	5,390,700	
ＥＭシステムズ	900	1,158.00	1,042,200	

ウェザーニューズ	400	3,025.00	1,210,000	
ＣＩＪ	800	775.00	620,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,902.00	190,200	
日本エンタープライズ	1,100	183.00	201,300	
WOWOW	500	2,952.00	1,476,000	
スカラ	900	709.00	638,100	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	900	524.00	471,600	
ネットワンシステムズ	3,800	2,152.00	8,177,600	
システムソフト	2,500	101.00	252,500	
アルゴグラフィックス	500	3,910.00	1,955,000	
マーベラス	1,600	885.00	1,416,000	
エイベックス	1,800	1,459.00	2,626,200	
日本ユニシス	3,300	2,547.00	8,405,100	
兼松エレクトロニクス	600	3,160.00	1,896,000	
東京放送ホールディングス	7,100	1,929.00	13,695,900	
日本テレビホールディングス	9,800	1,722.00	16,875,600	
朝日放送グループホールディングス	1,100	715.00	786,500	
テレビ朝日ホールディングス	2,900	2,015.00	5,843,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	8,100	478.00	3,871,800	
テレビ東京ホールディングス	900	2,320.00	2,088,000	
日本ＢＳ放送	400	1,061.00	424,400	
ビジョン	300	4,050.00	1,215,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	400	995.00	398,000	
ワイヤレスゲート	500	508.00	254,000	
コネクシオ	800	1,346.00	1,076,800	
日本通信	9,100	140.00	1,274,000	
クロップス	200	641.00	128,200	
日本電信電話	73,000	4,706.00	343,538,000	
ＫＤＤＩ	94,000	2,703.00	254,082,000	
光通信	1,300	17,120.00	22,256,000	
ＮＴＴドコモ	76,600	2,602.50	199,351,500	
エムティーアイ	1,200	627.00	752,400	
GMOインターネット	3,900	1,402.00	5,467,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	200	522.00	104,400	
カドカワ	3,100	1,166.00	3,614,600	
学研ホールディングス	400	4,075.00	1,630,000	

ゼンリン	2,100	2,483.00	5,214,300	
昭文社	500	482.00	241,000	
インプレスホールディングス	900	147.00	132,300	
アイネット	600	1,389.00	833,400	
松竹	700	10,760.00	7,532,000	
東宝	7,000	3,980.00	27,860,000	
東映	400	13,370.00	5,348,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	28,400	1,294.00	36,749,600	
ピー・シー・エー	100	1,908.00	190,800	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,860.00	372,000	
ＤＴＳ	1,200	3,805.00	4,566,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,000	3,495.00	17,475,000	
シーイーシー	1,100	1,919.00	2,110,900	
カプコン	4,600	2,273.00	10,455,800	
アイ・エス・ビー	200	1,831.00	366,200	
ジャステック	600	938.00	562,800	
ＳＣＳＫ	2,800	4,410.00	12,348,000	
日本システムウエア	400	1,688.00	675,200	
アイネス	1,400	1,165.00	1,631,000	
ＴＫＣ	900	3,775.00	3,397,500	
富士ソフト	1,600	4,440.00	7,104,000	
ＮＳＤ	1,800	2,177.00	3,918,600	
コナミホールディングス	4,400	5,100.00	22,440,000	
福井コンピュータホールディングス	300	1,570.00	471,000	
ＪＢＣＣホールディングス	800	1,549.00	1,239,200	
ミロク情報サービス	1,100	2,421.00	2,663,100	
ソフトバンクグループ	44,600	8,172.00	364,471,200	
ホウスイ	100	891.00	89,100	
高千穂交易	400	968.00	387,200	
伊藤忠食品	200	4,710.00	942,000	
エレマテック	500	1,888.00	944,000	
ＪＡＬＵＸ	300	2,497.00	749,100	
あらた	600	4,185.00	2,511,000	
トーメンデバイス	100	2,336.00	233,600	
東京エレクトロン　デバイス	400	1,825.00	730,000	
フィールズ	1,000	757.00	757,000	

双日	59,100	414.00	24,467,400	
アルフレッサ　ホールディングス	11,900	2,970.00	35,343,000	
横浜冷凍	2,800	935.00	2,618,000	
神栄	100	920.00	92,000	
ラサ商事	600	841.00	504,600	
ラクーンホールディングス	700	646.00	452,200	
アルコニックス	1,200	1,109.00	1,330,800	
神戸物産	1,600	3,345.00	5,352,000	
あい　ホールディングス	1,700	1,953.00	3,320,100	
ディーブイエックス	400	1,166.00	466,400	
ダイワボウホールディングス	1,000	5,280.00	5,280,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,000	1,490.00	4,470,000	
ラクト・ジャパン	200	7,380.00	1,476,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,124.00	2,248,000	
八洲電機	800	836.00	668,800	
メディアスホールディングス	600	707.00	424,200	
ＵＫＣホールディングス	700	1,993.00	1,395,100	
ジューテックホールディングス	200	981.00	196,200	
大光	300	531.00	159,300	
ＯＣＨＩホールディングス	300	1,123.00	336,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	5,700	870.00	4,959,000	
黒谷	200	466.00	93,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	815.00	163,000	
三洋貿易	500	1,819.00	909,500	
ビューティガレージ	200	1,518.00	303,600	
ウイン・パートナーズ	700	1,034.00	723,800	
ミタチ産業	300	709.00	212,700	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,125.00	9,075,000	
明治電機工業	300	1,697.00	509,100	
デリカフーズホールディングス	200	1,350.00	270,000	
スターティアホールディングス	200	611.00	122,200	
コメダホールディングス	2,500	2,077.00	5,192,500	
富士興産	400	627.00	250,800	
協栄産業	100	1,502.00	150,200	
小野建	900	1,677.00	1,509,300	
佐鳥電機	800	890.00	712,000	

エコートレーディング	200	597.00	119,400	
伯東	700	1,179.00	825,300	
コンドーテック	800	950.00	760,000	
中山福	600	539.00	323,400	
ナガイレーベン	1,500	2,326.00	3,489,000	
三菱食品	1,200	2,950.00	3,540,000	
松田産業	800	1,415.00	1,132,000	
第一興商	1,600	5,240.00	8,384,000	
メディパルホールディングス	11,600	2,399.00	27,828,400	
ＳＰＫ	200	2,269.00	453,800	
萩原電気ホールディングス	400	2,847.00	1,138,800	
アズワン	800	7,510.00	6,008,000	
スズデン	300	1,515.00	454,500	
尾家産業	300	1,219.00	365,700	
シモジマ	700	1,085.00	759,500	
ドウシシャ	1,000	1,700.00	1,700,000	
小津産業	200	1,882.00	376,400	
高速	600	1,064.00	638,400	
たけびし	400	1,403.00	561,200	
リックス	200	1,468.00	293,600	
丸文	900	715.00	643,500	
ハピネット	900	1,607.00	1,446,300	
橋本総業ホールディングス	200	1,420.00	284,000	
日本ライフライン	3,400	1,627.00	5,531,800	
タカショー	500	427.00	213,500	
エクセル	400	1,996.00	798,400	
マルカキカイ	300	2,100.00	630,000	
ＩＤＯＭ	3,600	406.00	1,461,600	
日本エム・ディ・エム	600	998.00	598,800	
進和	600	2,187.00	1,312,200	
エスケイジャパン	300	720.00	216,000	
ダイトロン	500	1,280.00	640,000	
シークス	1,400	1,515.00	2,121,000	
田中商事	400	553.00	221,200	
オーハシテクニカ	600	1,236.00	741,600	
白銅	300	1,630.00	489,000	

伊藤忠商事	74,900	1,987.00	148,826,300	
丸紅	105,600	831.60	87,816,960	
高島	200	1,812.00	362,400	
長瀬産業	6,000	1,579.00	9,474,000	
蝶理	700	1,661.00	1,162,700	
豊田通商	11,900	3,500.00	41,650,000	
三共生興	1,800	406.00	730,800	
兼松	4,300	1,316.00	5,658,800	
ツカモトコーポレーション	200	1,041.00	208,200	
三井物産	88,200	1,789.00	157,789,800	
日本紙パルプ商事	600	4,025.00	2,415,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,300	4,035.00	13,315,500	
カメイ	1,400	1,199.00	1,678,600	
東都水産	100	2,340.00	234,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,462.00	492,400	
スターゼン	400	3,970.00	1,588,000	
山善	4,200	1,100.00	4,620,000	
椿本興業	200	3,280.00	656,000	
住友商事	63,300	1,673.00	105,900,900	
内田洋行	500	2,355.00	1,177,500	
三菱商事	75,100	3,124.00	234,612,400	
第一実業	500	3,540.00	1,770,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,100	1,990.00	6,169,000	
西華産業	600	1,504.00	902,400	
佐藤商事	1,000	910.00	910,000	
菱洋エレクトロ	1,100	1,561.00	1,717,100	
東京産業	1,100	548.00	602,800	
ユアサ商事	1,100	3,225.00	3,547,500	
神鋼商事	200	2,511.00	502,200	
小林産業	600	274.00	164,400	
阪和興業	1,900	3,055.00	5,804,500	
正栄食品工業	600	2,602.00	1,561,200	
カナデン	1,000	1,225.00	1,225,000	
菱電商事	800	1,406.00	1,124,800	
フルサト工業	600	1,605.00	963,000	
岩谷産業	2,400	3,720.00	8,928,000	

すてきナイスグループ	500	892.00	446,000	
昭光通商	400	646.00	258,400	
ニチモウ	200	1,763.00	352,600	
極東貿易	300	1,607.00	482,100	
イワキ	1,300	413.00	536,900	
三愛石油	2,900	961.00	2,786,900	
稲畑産業	2,600	1,458.00	3,790,800	
ＧＳＩクレオス	300	1,279.00	383,700	
明和産業	1,000	416.00	416,000	
ワキタ	2,300	1,146.00	2,635,800	
東邦ホールディングス	3,200	2,669.00	8,540,800	
サンゲツ	3,200	2,000.00	6,400,000	
ミツウロコグループホールディングス	1,600	782.00	1,251,200	
シナネンホールディングス	400	2,232.00	892,800	
伊藤忠エネクス	2,400	966.00	2,318,400	
サンリオ	3,300	2,247.00	7,415,100	
サンワテクノス	600	1,021.00	612,600	
リョーサン	1,200	3,000.00	3,600,000	
新光商事	1,000	1,706.00	1,706,000	
トーホー	500	2,078.00	1,039,000	
三信電気	900	1,768.00	1,591,200	
東陽テクニカ	1,200	806.00	967,200	
モスフードサービス	1,400	2,802.00	3,922,800	
加賀電子	1,100	2,069.00	2,275,900	
ソーダニッカ	1,100	526.00	578,600	
立花エレテック	800	1,589.00	1,271,200	
フォーバル	500	812.00	406,000	
ＰＡＬＴＡＣ	1,900	4,930.00	9,367,000	
三谷産業	1,300	290.00	377,000	
太平洋興発	400	764.00	305,600	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	200	4,365.00	873,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,157.00	115,700	
国際紙パルプ商事	1,900	268.00	509,200	
ヤマタネ	500	1,628.00	814,000	
丸紅建材リース	100	1,853.00	185,300	
日鉄住金物産	800	4,670.00	3,736,000	

泉州電業	400	2,617.00	1,046,800	
トラスコ中山	2,200	2,881.00	6,338,200	
オートバックスセブン	4,300	1,852.00	7,963,600	
モリト	800	747.00	597,600	
加藤産業	1,700	3,200.00	5,440,000	
北恵	200	972.00	194,400	
イノテック	700	999.00	699,300	
イエローハット	1,000	2,614.00	2,614,000	
ＪＫホールディングス	1,000	561.00	561,000	
日伝	900	1,600.00	1,440,000	
北沢産業	800	260.00	208,000	
杉本商事	600	1,843.00	1,105,800	
因幡電機産業	1,500	4,080.00	6,120,000	
バイテックホールディングス	500	1,974.00	987,000	
東テク	400	2,147.00	858,800	
ミスミグループ本社	13,400	2,493.00	33,406,200	
アルテック	800	223.00	178,400	
タキヒヨー	300	1,803.00	540,900	
蔵王産業	200	1,316.00	263,200	
スズケン	4,900	5,780.00	28,322,000	
ジェコス	700	1,028.00	719,600	
ルネサスイーストン	1,000	419.00	419,000	
ローソン	2,700	6,620.00	17,874,000	
サンエー	800	4,300.00	3,440,000	
カワチ薬品	800	2,106.00	1,684,800	
エービーシー・マート	1,700	6,190.00	10,523,000	
ハードオフコーポレーション	400	832.00	332,800	
アスクル	900	2,299.00	2,069,100	
ゲオホールディングス	1,600	1,641.00	2,625,600	
アダストリア	1,500	1,969.00	2,953,500	
ジーフット	700	668.00	467,600	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	100	755.00	75,500	
くらコーポレーション	600	5,410.00	3,246,000	
キャンドゥ	500	1,566.00	783,000	
パルグループホールディングス	500	3,105.00	1,552,500	
エディオン	4,500	1,120.00	5,040,000	

サーラコーポレーション	2,300	587.00	1,350,100	
ワッツ	400	717.00	286,800	
ハローズ	400	2,080.00	832,000	
あみやき亭	200	3,625.00	725,000	
ひらまつ	2,300	356.00	818,800	
大黒天物産	200	4,170.00	834,000	
ハニーズホールディングス	1,200	902.00	1,082,400	
ファーマライズホールディングス	200	590.00	118,000	
アルペン	800	1,718.00	1,374,400	
ハブ	300	886.00	265,800	
クオールホールディングス	1,600	1,709.00	2,734,400	
ジンズ	700	5,450.00	3,815,000	
ビックカメラ	5,700	1,256.00	7,159,200	
ＤＣＭホールディングス	5,800	1,107.00	6,420,600	
ペッパーフードサービス	800	2,652.00	2,121,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,800	2,364.00	16,075,200	
東京一番フーズ	200	586.00	117,200	
ＤＤホールディングス	200	2,155.00	431,000	
きちりホールディングス	400	677.00	270,800	
アークランドサービスホールディングス	800	2,000.00	1,600,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	13,700	1,239.00	16,974,300	
ドトール・日レスホールディングス	1,900	2,100.00	3,990,000	
マツモトキヨシホールディングス	4,500	3,320.00	14,940,000	
ブロンコビリー	600	2,573.00	1,543,800	
ＺＯＺＯ	11,600	2,133.00	24,742,800	
トレジャー・ファクトリー	300	796.00	238,800	
物語コーポレーション	300	9,150.00	2,745,000	
ココカラファイン	1,200	4,940.00	5,928,000	
三越伊勢丹ホールディングス	20,000	1,154.00	23,080,000	
Ｈａｍｅｅ	400	909.00	363,600	
ウエルシアホールディングス	2,800	3,960.00	11,088,000	
クリエイトＳＤホールディングス	1,600	2,699.00	4,318,400	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,300	328.00	426,400	
ミサワ	400	452.00	180,800	
ティーライフ	100	911.00	91,100	
エー・ピーカンパニー	200	467.00	93,400	

チムニー	300	2,535.00	760,500	
シュッピン	900	694.00	624,600	
ネクステージ	1,800	1,281.00	2,305,800	
ジョイフル本田	3,100	1,416.00	4,389,600	
鳥貴族	500	1,836.00	918,000	
キリン堂ホールディングス	500	1,345.00	672,500	
ホットランド	700	1,264.00	884,800	
すかいらーくホールディングス	10,000	1,824.00	18,240,000	
綿半ホールディングス	400	2,132.00	852,800	
ヨシックス	200	2,832.00	566,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,100	1,155.00	3,580,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	663.00	397,800	
ＢＥＥＮＯＳ	300	1,365.00	409,500	
あさひ	1,000	1,373.00	1,373,000	
日本調剤	400	3,425.00	1,370,000	
コスモス薬品	500	20,020.00	10,010,000	
トーエル	500	708.00	354,000	
一六堂	200	512.00	102,400	
オンリー	200	996.00	199,200	
セブン&アイ・ホールディングス	44,900	4,744.00	213,005,600	
薬王堂	500	2,595.00	1,297,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,900	1,223.00	3,546,700	
ツルハホールディングス	2,300	9,840.00	22,632,000	
サンマルクホールディングス	800	2,497.00	1,997,600	
フェリシモ	200	1,121.00	224,200	
トリドールホールディングス	1,300	1,969.00	2,559,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,000	684.00	684,000	
ウイルプラスホールディングス	100	825.00	82,500	
ジャパンミート	500	1,720.00	860,000	
サツドラホールディングス	200	1,915.00	383,000	
デファクトスタンダード	100	512.00	51,200	
ダイユー・リックホールディングス	600	996.00	597,600	
バロックジャパンリミテッド	1,000	905.00	905,000	
クスリのアオキホールディングス	800	7,090.00	5,672,000	
力の源ホールディングス	400	808.00	323,200	

スシローグローバルホールディングス	1,200	6,130.00	7,356,000	
ＬＩＸＩＬビバ	900	1,597.00	1,437,300	
メディカルシステムネットワーク	1,200	432.00	518,400	
はるやまホールディングス	500	861.00	430,500	
ノジマ	1,900	2,168.00	4,119,200	
カッパ・クリエイト	1,600	1,395.00	2,232,000	
ライトオン	1,000	849.00	849,000	
ジーンズメイト	400	362.00	144,800	
良品計画	1,500	23,440.00	35,160,000	
三城ホールディングス	1,400	415.00	581,000	
アドヴァン	1,700	897.00	1,524,900	
アルビス	400	2,520.00	1,008,000	
コナカ	1,500	452.00	678,000	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,858.00	185,800	
Ｇ－７ホールディングス	300	2,111.00	633,300	
イオン北海道	1,100	788.00	866,800	
コジマ	1,700	545.00	926,500	
ヒマラヤ	300	935.00	280,500	
コーナン商事	1,400	2,718.00	3,805,200	
エコス	500	1,656.00	828,000	
ワタミ	1,400	1,390.00	1,946,000	
マルシェ	300	763.00	228,900	
ドンキホーテホールディングス	6,900	6,120.00	42,228,000	
西松屋チェーン	2,300	905.00	2,081,500	
ゼンショーホールディングス	5,100	2,529.00	12,897,900	
幸楽苑ホールディングス	800	2,188.00	1,750,400	
ハークスレイ	200	1,115.00	223,000	
サイゼリヤ	1,800	2,046.00	3,682,800	
ＶＴホールディングス	3,600	430.00	1,548,000	
魚力	300	1,420.00	426,000	
ポプラ	300	626.00	187,800	
フジ・コーポレーション	200	2,051.00	410,200	
ユナイテッドアローズ	1,200	3,670.00	4,404,000	
ハイデイ日高	1,400	2,168.00	3,035,200	
京都きもの友禅	800	436.00	348,800	
コロワイド	3,600	2,377.00	8,557,200	

ピーシーデポコーポレーション	1,500	438.00	657,000	
壱番屋	800	4,535.00	3,628,000	
トップカルチャー	400	289.00	115,600	
ＰＬＡＮＴ	200	1,004.00	200,800	
スギホールディングス	2,400	4,560.00	10,944,000	
ヴィア・ホールディングス	1,400	661.00	925,400	
スクロール	1,700	424.00	720,800	
ヨンドシーホールディングス	1,200	2,136.00	2,563,200	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,000	12,520.00	37,560,000	
木曽路	1,400	2,519.00	3,526,600	
ＳＲＳホールディングス	1,300	975.00	1,267,500	
千趣会	2,000	258.00	516,000	
タカキュー	900	187.00	168,300	
ケーヨー	2,100	540.00	1,134,000	
上新電機	1,300	2,402.00	3,122,600	
日本瓦斯	1,700	3,985.00	6,774,500	
ロイヤルホールディングス	1,900	2,652.00	5,038,800	
東天紅	100	1,308.00	130,800	
いなげや	1,200	1,359.00	1,630,800	
島忠	2,400	3,160.00	7,584,000	
チヨダ	1,100	1,857.00	2,042,700	
ライフコーポレーション	800	2,424.00	1,939,200	
リンガーハット	1,300	2,350.00	3,055,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	1,600	506.00	809,600	
テンアライド	1,000	393.00	393,000	
ＡＯＫＩホールディングス	2,100	1,263.00	2,652,300	
オークワ	1,500	1,040.00	1,560,000	
コメリ	1,700	2,445.00	4,156,500	
青山商事	1,900	2,717.00	5,162,300	
しまむら	1,200	9,340.00	11,208,000	
はせがわ	500	401.00	200,500	
高島屋	8,400	1,455.00	12,222,000	
松屋	2,200	1,004.00	2,208,800	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	5,500	1,570.00	8,635,000	
近鉄百貨店	400	3,405.00	1,362,000	
パルコ	1,000	1,064.00	1,064,000	

丸井グループ	9,100	2,191.00	19,938,100	
アクシアル　リテイリング	900	3,500.00	3,150,000	
井筒屋	500	201.00	100,500	
イオン	41,200	2,170.00	89,404,000	
イズミ	2,200	5,470.00	12,034,000	
平和堂	2,200	2,520.00	5,544,000	
フジ	1,300	1,903.00	2,473,900	
ヤオコー	1,200	5,680.00	6,816,000	
ゼビオホールディングス	1,300	1,265.00	1,644,500	
ケーズホールディングス	11,100	1,080.00	11,988,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	600	666.00	399,600	
日産東京販売ホールディングス	1,600	327.00	523,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	400	2,682.00	1,072,800	
総合メディカルホールディングス	900	1,954.00	1,758,600	
ブックオフグループホールディングス	600	760.00	456,000	
アインホールディングス	1,400	7,960.00	11,144,000	
元気寿司	300	4,550.00	1,365,000	
ヤマダ電機	32,600	535.00	17,441,000	
アークランドサカモト	1,800	1,343.00	2,417,400	
ニトリホールディングス	4,600	14,080.00	64,768,000	
グルメ杵屋	800	1,163.00	930,400	
愛眼	900	297.00	267,300	
ケーユーホールディングス	600	806.00	483,600	
吉野家ホールディングス	3,700	1,726.00	6,386,200	
松屋フーズホールディングス	500	3,630.00	1,815,000	
サガミホールディングス	1,400	1,349.00	1,888,600	
関西スーパーマーケット	800	1,012.00	809,600	
王将フードサービス	800	7,030.00	5,624,000	
プレナス	1,200	1,895.00	2,274,000	
ミニストップ	800	1,997.00	1,597,600	
アークス	2,000	2,450.00	4,900,000	
バローホールディングス	2,300	2,631.00	6,051,300	
藤久	100	760.00	76,000	
ベルク	500	4,820.00	2,410,000	
大庄	600	1,577.00	946,200	
ファーストリテイリング	1,400	49,850.00	69,790,000	

サンドラッグ	4,000	3,510.00	14,040,000	
サックスバー　ホールディングス	900	1,095.00	985,500	
ヤマザワ	200	1,775.00	355,000	
やまや	200	2,214.00	442,800	
ベルーナ	2,600	1,023.00	2,659,800	
島根銀行	200	717.00	143,400	
じもとホールディングス	7,200	124.00	892,800	
めぶきフィナンシャルグループ	55,700	313.00	17,434,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,400	1,611.00	2,255,400	
九州フィナンシャルグループ	17,600	441.00	7,761,600	
ゆうちょ銀行	30,400	1,251.00	38,030,400	
富山第一銀行	2,600	395.00	1,027,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,300	450.00	30,735,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	6,900	992.00	6,844,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,000	839.00	4,195,000	
三十三フィナンシャルグループ	900	1,709.00	1,538,100	
第四北越フィナンシャルグループ	1,900	3,180.00	6,042,000	
新生銀行	7,900	1,468.00	11,597,200	
あおぞら銀行	6,000	3,360.00	20,160,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	746,700	583.90	435,998,130	
りそなホールディングス	117,500	556.20	65,353,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	21,100	4,267.00	90,033,700	
三井住友フィナンシャルグループ	75,600	4,013.00	303,382,800	
千葉銀行	38,000	667.00	25,346,000	
群馬銀行	21,400	486.00	10,400,400	
武蔵野銀行	1,600	2,539.00	4,062,400	
千葉興業銀行	2,900	361.00	1,046,900	
筑波銀行	4,500	227.00	1,021,500	
七十七銀行	3,400	1,975.00	6,715,000	
青森銀行	800	2,849.00	2,279,200	
秋田銀行	700	2,200.00	1,540,000	
山形銀行	1,200	2,016.00	2,419,200	
岩手銀行	700	3,480.00	2,436,000	
東邦銀行	9,700	320.00	3,104,000	
東北銀行	500	1,121.00	560,500	
みちのく銀行	700	1,727.00	1,208,900	

ふくおかフィナンシャルグループ	8,700	2,466.00	21,454,200	
静岡銀行	27,000	917.00	24,759,000	
十六銀行	1,400	2,394.00	3,351,600	
スルガ銀行	10,800	469.00	5,065,200	
八十二銀行	19,400	470.00	9,118,000	
山梨中央銀行	1,300	1,500.00	1,950,000	
大垣共立銀行	1,700	2,293.00	3,898,100	
福井銀行	900	1,636.00	1,472,400	
北國銀行	1,100	3,510.00	3,861,000	
清水銀行	400	1,650.00	660,000	
富山銀行	200	3,155.00	631,000	
滋賀銀行	2,200	2,622.00	5,768,400	
南都銀行	1,300	2,261.00	2,939,300	
百五銀行	9,600	400.00	3,840,000	
京都銀行	3,800	4,680.00	17,784,000	
紀陽銀行	3,800	1,574.00	5,981,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,100	1,283.00	9,109,300	
広島銀行	15,800	638.00	10,080,400	
山陰合同銀行	6,400	805.00	5,152,000	
中国銀行	6,900	975.00	6,727,500	
鳥取銀行	300	1,418.00	425,400	
伊予銀行	14,200	606.00	8,605,200	
百十四銀行	1,100	2,602.00	2,862,200	
四国銀行	1,500	1,082.00	1,623,000	
阿波銀行	1,700	2,930.00	4,981,000	
大分銀行	700	3,435.00	2,404,500	
宮崎銀行	700	2,779.00	1,945,300	
佐賀銀行	700	1,785.00	1,249,500	
十八銀行	700	2,723.00	1,906,100	
沖縄銀行	1,000	3,160.00	3,160,000	
琉球銀行	2,500	1,156.00	2,890,000	
セブン銀行	36,200	327.00	11,837,400	
みずほフィナンシャルグループ	1,457,000	179.10	260,948,700	
高知銀行	400	782.00	312,800	
山口フィナンシャルグループ	13,400	1,103.00	14,780,200	
長野銀行	400	1,619.00	647,600	

名古屋銀行	900	3,300.00	2,970,000	
北洋銀行	16,200	296.00	4,795,200	
愛知銀行	400	3,810.00	1,524,000	
中京銀行	400	2,139.00	855,600	
大光銀行	300	1,715.00	514,500	
愛媛銀行	1,500	1,056.00	1,584,000	
トマト銀行	400	1,097.00	438,800	
京葉銀行	4,700	722.00	3,393,400	
栃木銀行	5,500	241.00	1,325,500	
北日本銀行	300	2,205.00	661,500	
東和銀行	1,900	747.00	1,419,300	
福島銀行	900	398.00	358,200	
大東銀行	500	609.00	304,500	
トモニホールディングス	8,300	417.00	3,461,100	
フィデアホールディングス	10,400	139.00	1,445,600	
池田泉州ホールディングス	11,400	305.00	3,477,000	
ＦＰＧ	3,400	1,156.00	3,930,400	
マーキュリアインベストメント	400	721.00	288,400	
ＳＢＩホールディングス	12,800	2,341.00	29,964,800	
日本アジア投資	900	201.00	180,900	
ジャフコ	1,800	3,775.00	6,795,000	
大和証券グループ本社	86,000	592.80	50,980,800	
野村ホールディングス	196,800	455.30	89,603,040	
岡三証券グループ	9,100	529.00	4,813,900	
丸三証券	3,200	819.00	2,620,800	
東洋証券	3,800	178.00	676,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,800	510.00	6,528,000	
光世証券	300	768.00	230,400	
水戸証券	3,100	273.00	846,300	
いちよし証券	2,200	856.00	1,883,200	
松井証券	5,300	1,200.00	6,360,000	
だいこう証券ビジネス	400	414.00	165,600	
マネックスグループ	10,000	403.00	4,030,000	
カブドットコム証券	8,000	541.00	4,328,000	
極東証券	1,400	1,176.00	1,646,400	
岩井コスモホールディングス	1,100	1,298.00	1,427,800	

藍澤證券	2,000	660.00	1,320,000	
マネーパートナーズグループ	1,300	299.00	388,700	
小林洋行	300	256.00	76,800	
かんぽ生命保険	4,100	2,482.00	10,176,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	18,900	4,068.00	76,885,200	
アニコム　ホールディングス	900	3,150.00	2,835,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	28,000	3,228.00	90,384,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,800	2,083.00	18,330,400	
第一生命ホールディングス	60,700	1,772.00	107,560,400	
東京海上ホールディングス	38,900	5,369.00	208,854,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	33,200	1,366.50	45,367,800	
アドバンスクリエイト	200	1,711.00	342,200	
全国保証	3,000	3,895.00	11,685,000	
ジェイリース	200	350.00	70,000	
イントラスト	300	393.00	117,900	
日本モーゲージサービス	100	1,350.00	135,000	
Ｃａｓａ	400	1,166.00	466,400	
アルヒ	1,000	2,434.00	2,434,000	
クレディセゾン	7,500	1,455.00	10,912,500	
芙蓉総合リース	1,200	5,510.00	6,612,000	
興銀リース	2,000	2,506.00	5,012,000	
東京センチュリー	2,200	4,900.00	10,780,000	
日本証券金融	4,700	621.00	2,918,700	
アイフル	16,400	268.00	4,395,200	
リコーリース	800	3,290.00	2,632,000	
イオンフィナンシャルサービス	6,900	2,140.00	14,766,000	
アコム	21,600	385.00	8,316,000	
ジャックス	1,200	1,891.00	2,269,200	
オリエントコーポレーション	29,000	130.00	3,770,000	
日立キャピタル	2,500	2,477.00	6,192,500	
アプラスフィナンシャル	5,100	84.00	428,400	
オリックス	71,500	1,709.00	122,193,500	
三菱ＵＦＪリース	24,200	561.00	13,576,200	
九州リースサービス	500	698.00	349,000	
日本取引所グループ	29,000	1,991.00	57,739,000	

イー・ギャランティ	1,000	1,016.00	1,016,000	
アサックス	400	553.00	221,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	400	1,625.00	650,000	
いちご	13,600	365.00	4,964,000	
日本駐車場開発	12,900	149.00	1,922,100	
ヒューリック	22,400	989.00	22,153,600	
三栄建築設計	400	1,688.00	675,200	
スター・マイカ	500	1,518.00	759,000	
野村不動産ホールディングス	7,100	2,107.00	14,959,700	
三重交通グループホールディングス	2,200	598.00	1,315,600	
サムティ	1,500	1,527.00	2,290,500	
ディア・ライフ	1,400	454.00	635,600	
コーセーアールイー	300	905.00	271,500	
エー・ディー・ワークス	16,500	38.00	627,000	
日本商業開発	700	1,527.00	1,068,900	
プレサンスコーポレーション	1,700	1,517.00	2,578,900	
ユニゾホールディングス	1,600	2,107.00	3,371,200	
ＴＨＥグローバル社	500	550.00	275,000	
日本管理センター	700	821.00	574,700	
サンセイランディック	300	791.00	237,300	
エストラスト	100	766.00	76,600	
フージャースホールディングス	2,400	629.00	1,509,600	
オープンハウス	1,700	4,440.00	7,548,000	
東急不動産ホールディングス	28,800	588.00	16,934,400	
飯田グループホールディングス	8,900	1,975.00	17,577,500	
イーグランド	200	673.00	134,600	
ムゲンエステート	700	562.00	393,400	
ビーロット	200	1,336.00	267,200	
ファーストブラザーズ	300	1,041.00	312,300	
ハウスドゥ	400	1,319.00	527,600	
シーアールイー	400	952.00	380,800	
プロパティエージェント	100	1,009.00	100,900	
ケイアイスター不動産	300	1,810.00	543,000	
アグレ都市デザイン	100	623.00	62,300	
グッドコムアセット	200	1,459.00	291,800	
ジェイ・エス・ビー	100	3,565.00	356,500	

テンポイノベーション	100	1,536.00	153,600	
パーク２４	6,300	2,631.00	16,575,300	
パラカ	300	1,645.00	493,500	
三井不動産	56,900	2,597.50	147,797,750	
三菱地所	75,100	1,883.50	141,450,850	
平和不動産	2,000	1,893.00	3,786,000	
東京建物	11,700	1,325.00	15,502,500	
ダイビル	3,200	1,093.00	3,497,600	
京阪神ビルディング	1,900	930.00	1,767,000	
住友不動産	24,100	4,132.00	99,581,200	
テーオーシー	2,500	828.00	2,070,000	
東京楽天地	100	4,730.00	473,000	
レオパレス２１	13,200	527.00	6,956,400	
スターツコーポレーション	1,500	2,431.00	3,646,500	
フジ住宅	1,400	855.00	1,197,000	
空港施設	1,300	529.00	687,700	
明和地所	600	598.00	358,800	
ゴールドクレスト	800	1,604.00	1,283,200	
日本エスリード	400	1,562.00	624,800	
日神不動産	1,600	448.00	716,800	
日本エスコン	1,900	846.00	1,607,400	
タカラレーベン	5,000	350.00	1,750,000	
サンヨーハウジング名古屋	600	926.00	555,600	
イオンモール	5,400	1,794.00	9,687,600	
毎日コムネット	200	735.00	147,000	
ファースト住建	400	1,166.00	466,400	
ランド	43,800	8.00	350,400	
カチタス	1,200	2,948.00	3,537,600	
トーセイ	1,500	1,003.00	1,504,500	
穴吹興産	100	2,869.00	286,900	
サンフロンティア不動産	1,500	1,181.00	1,771,500	
エフ・ジェー・ネクスト	900	947.00	852,300	
インテリックス	300	673.00	201,900	
ランドビジネス	500	781.00	390,500	
グランディハウス	900	417.00	375,300	
日本空港ビルデング	3,400	3,980.00	13,532,000	

日本工営	700	2,594.00	1,815,800	
ＬＩＦＵＬＬ	3,600	729.00	2,624,400	
ジェイエイシーリクルートメント	800	2,128.00	1,702,400	
日本M&Aセンター	7,700	2,590.00	19,943,000	
メンバーズ	400	1,114.00	445,600	
中広	100	609.00	60,900	
タケエイ	1,200	677.00	812,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	100	1,011.00	101,100	
トラスト・テック	500	3,210.00	1,605,000	
コシダカホールディングス	2,800	1,417.00	3,967,600	
アルトナー	300	683.00	204,900	
パソナグループ	1,000	1,324.00	1,324,000	
ＣＤＳ	300	1,144.00	343,200	
リンクアンドモチベーション	1,900	878.00	1,668,200	
ＧＣＡ	1,100	724.00	796,400	
エス・エム・エス	3,800	1,680.00	6,384,000	
パーソルホールディングス	10,400	1,891.00	19,666,400	
リニカル	600	1,384.00	830,400	
クックパッド	3,200	307.00	982,400	
エスクリ	400	603.00	241,200	
アイ・ケイ・ケイ	600	745.00	447,000	
学情	500	1,241.00	620,500	
スタジオアリス	500	2,425.00	1,212,500	
シミックホールディングス	600	1,608.00	964,800	
ＮＪＳ	200	1,561.00	312,200	
綜合警備保障	4,200	4,885.00	20,517,000	
カカクコム	7,800	1,829.00	14,266,200	
アイロムグループ	400	1,608.00	643,200	
セントケア・ホールディング	600	544.00	326,400	
サイネックス	200	686.00	137,200	
ルネサンス	600	2,074.00	1,244,400	
ディップ	1,700	1,994.00	3,389,800	
オプトホールディング	600	1,427.00	856,200	
新日本科学	1,400	777.00	1,087,800	
ツクイ	2,400	798.00	1,915,200	
キャリアデザインセンター	300	1,162.00	348,600	

ベネフィット・ワン	1,400	3,390.00	4,746,000	
エムスリー	21,900	1,528.00	33,463,200	
ツカダ・グローバルホールディング	700	617.00	431,900	
ブラス	100	573.00	57,300	
アウトソーシング	5,400	1,187.00	6,409,800	
ウェルネット	1,100	979.00	1,076,900	
ワールドホールディングス	300	2,558.00	767,400	
ディー・エヌ・エー	5,600	1,950.00	10,920,000	
博報堂ＤＹホールディングス	14,400	1,651.00	23,774,400	
ぐるなび	1,500	718.00	1,077,000	
エスアールジータカミヤ	1,100	709.00	779,900	
ジャパンベストレスキューシステム	800	1,253.00	1,002,400	
ファンコミュニケーションズ	2,800	545.00	1,526,000	
ライク	400	1,134.00	453,600	
ビジネス・ブレークスルー	400	331.00	132,400	
ＷＤＢホールディングス	500	2,597.00	1,298,500	
ティア	500	614.00	307,000	
ＣＤＧ	100	1,392.00	139,200	
バリューコマース	700	1,427.00	998,900	
インフォマート	5,700	1,110.00	6,327,000	
ＪＰホールディングス	3,000	279.00	837,000	
エコナックホールディングス	1,900	115.00	218,500	
ＥＰＳホールディングス	1,600	1,704.00	2,726,400	
レッグス	300	928.00	278,400	
プレステージ・インターナショナル	1,900	1,171.00	2,224,900	
アミューズ	600	2,445.00	1,467,000	
ドリームインキュベータ	300	1,534.00	460,200	
クイック	600	1,382.00	829,200	
ＴＡＣ	600	229.00	137,400	
ケネディクス	9,700	558.00	5,412,600	
電通	12,700	5,200.00	66,040,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	1,800.00	720,000	
ぴあ	300	3,755.00	1,126,500	
イオンファンタジー	300	2,642.00	792,600	
シーティーエス	1,200	733.00	879,600	
ネクシィーズグループ	300	1,870.00	561,000	

みらかホールディングス	2,900	2,770.00	8,033,000	
アルプス技研	900	1,770.00	1,593,000	
サニックス	1,800	211.00	379,800	
ダイオーズ	200	1,287.00	257,400	
日本空調サービス	1,200	655.00	786,000	
オリエンタルランド	12,300	10,895.00	134,008,500	
ダスキン	2,800	2,517.00	7,047,600	
明光ネットワークジャパン	1,300	982.00	1,276,600	
ファルコホールディングス	600	1,537.00	922,200	
秀英予備校	200	489.00	97,800	
田谷	200	627.00	125,400	
ラウンドワン	3,200	1,194.00	3,820,800	
リゾートトラスト	4,400	1,620.00	7,128,000	
ビー・エム・エル	1,300	3,000.00	3,900,000	
ワタベウェディング	200	737.00	147,400	
りらいあコミュニケーションズ	1,900	976.00	1,854,400	
リソー教育	5,200	434.00	2,256,800	
早稲田アカデミー	100	1,878.00	187,800	
ユー・エス・エス	12,700	1,867.00	23,710,900	
東京個別指導学院	400	1,296.00	518,400	
サイバーエージェント	6,400	4,285.00	27,424,000	
楽天	48,400	855.00	41,382,000	
クリーク・アンド・リバー社	600	1,159.00	695,400	
テー・オー・ダブリュー	1,000	727.00	727,000	
セントラルスポーツ	400	3,410.00	1,364,000	
フルキャストホールディングス	1,000	1,811.00	1,811,000	
エン・ジャパン	1,100	3,775.00	4,152,500	
リソルホールディングス	100	4,010.00	401,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,000	5,500.00	11,000,000	
アトラ	200	432.00	86,400	
インターワークス	200	724.00	144,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	300	1,328.00	398,400	
ＫｅｅＰｅｒ技研	300	962.00	288,600	
ファーストロジック	200	642.00	128,400	
三機サービス	200	1,392.00	278,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	600	2,596.00	1,557,600	

デザインワン・ジャパン	200	337.00	67,400	
イー・ガーディアン	500	2,113.00	1,056,500	
リブセンス	600	285.00	171,000	
ジャパンマテリアル	2,800	1,203.00	3,368,400	
ベクトル	1,300	1,349.00	1,753,700	
ウチヤマホールディングス	500	444.00	222,000	
ライクキッズネクスト	200	797.00	159,400	
キャリアリンク	400	342.00	136,800	
ＩＢＪ	700	901.00	630,700	
アサンテ	400	2,072.00	828,800	
Ｎ・フィールド	700	956.00	669,200	
バリューＨＲ	200	1,767.00	353,400	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	300	4,930.00	1,479,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	400	1,195.00	478,000	
ＥＲＩホールディングス	300	760.00	228,000	
アビスト	200	3,370.00	674,000	
シグマクシス	500	814.00	407,000	
ウィルグループ	700	918.00	642,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,400	253.00	354,200	
日本ビューホテル	300	1,097.00	329,100	
リクルートホールディングス	74,400	2,777.50	206,646,000	
エラン	700	1,369.00	958,300	
土木管理総合試験所	400	506.00	202,400	
日本郵政	85,100	1,328.00	113,012,800	
ベルシステム２４ホールディングス	1,700	1,431.00	2,432,700	
鎌倉新書	700	1,303.00	912,100	
一蔵	100	596.00	59,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	200	1,969.00	393,800	
グローバルグループ	100	956.00	95,600	
エボラブルアジア	300	2,101.00	630,300	
アトラエ	200	2,123.00	424,600	
ストライク	300	1,859.00	557,700	
ソラスト	2,500	987.00	2,467,500	
セラク	200	561.00	112,200	
インソース	300	1,919.00	575,700	
アイモバイル	200	767.00	153,400	

キャリアインデックス	300	1,268.00	380,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	400	1,379.00	551,600	
船場	200	841.00	168,200	
グレイステクノロジー	300	1,890.00	567,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	600	1,647.00	988,200	
フルテック	100	1,118.00	111,800	
グリーンズ	200	1,329.00	265,800	
ツナグ・ソリューションズ	100	663.00	66,300	
日総工産	300	2,032.00	609,600	
キュービーネットホールディングス	500	1,835.00	917,500	
スプリックス	300	2,262.00	678,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	909.00	363,600	
リログループ	5,700	2,793.00	15,920,100	
東祥	600	3,225.00	1,935,000	
エイチ・アイ・エス	1,900	4,090.00	7,771,000	
ラックランド	200	2,037.00	407,400	
共立メンテナンス	1,600	4,855.00	7,768,000	
イチネンホールディングス	1,100	1,197.00	1,316,700	
建設技術研究所	700	1,394.00	975,800	
スペース	700	1,240.00	868,000	
長大	400	700.00	280,000	
燦ホールディングス	200	2,400.00	480,000	
スバル興業	100	5,770.00	577,000	
東京テアトル	400	1,242.00	496,800	
タナベ経営	200	1,304.00	260,800	
ナガワ	300	5,220.00	1,566,000	
よみうりランド	200	3,840.00	768,000	
東京都競馬	700	2,902.00	2,031,400	
常磐興産	400	1,601.00	640,400	
カナモト	1,600	3,025.00	4,840,000	
東京ドーム	3,900	928.00	3,619,200	
西尾レントオール	1,100	3,425.00	3,767,500	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	5,700	27.00	153,900	
トランス・コスモス	1,200	2,225.00	2,670,000	
乃村工藝社	2,400	2,885.00	6,924,000	

藤田観光	400	2,758.00	1,103,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	500	1,340.00	670,000	
日本管財	1,100	1,900.00	2,090,000	
トーカイ	1,000	2,779.00	2,779,000	
白洋舎	100	2,812.00	281,200	
セコム	11,000	9,167.00	100,837,000	
セントラル警備保障	500	4,360.00	2,180,000	
丹青社	2,000	1,135.00	2,270,000	
メイテック	1,300	4,660.00	6,058,000	
応用地質	1,100	1,149.00	1,263,900	
船井総研ホールディングス	2,200	1,749.00	3,847,800	
進学会ホールディングス	500	583.00	291,500	
オオバ	800	611.00	488,800	
いであ	200	965.00	193,000	
学究社	300	1,379.00	413,700	
ベネッセホールディングス	3,800	2,845.00	10,811,000	
イオンディライト	1,300	4,035.00	5,245,500	
ナック	600	1,034.00	620,400	
ニチイ学館	1,500	999.00	1,498,500	
ダイセキ	1,700	2,343.00	3,983,100	
ステップ	400	1,226.00	490,400	
合　計	12,530,600		24,079,864,040	

(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先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	532,100,723
コール・ローン	5,855,123
株式	17,232,044,110
投資証券	454,721,986
派生商品評価勘定	11,739,301
未収入金	1,036,079
未収配当金	12,237,517
差入委託証拠金	102,224,278
流動資産合計	18,351,959,117
資産合計	18,351,959,117
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	324,758
未払解約金	3,750,000
未払利息	15
その他未払費用	7,215
流動負債合計	4,081,988
負債合計	4,081,988
純資産の部	
元本等	
元本	16,003,677,154
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,344,199,975
元本等合計	18,347,877,129
純資産合計	18,347,877,129
負債純資産合計	18,351,959,117

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	先物取引

法	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 1月25日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	9,300,090,859円
期中追加設定元本額	14,178,577,653円
期中一部解約元本額	7,474,991,358円
期末元本額	16,003,677,154円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,036,694,425円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	935,591,722円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,228,933,505円
ＤＣりそな　グローバルバランス	10,986,879円
つみたてバランスファンド	289,786,605円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	80,870,067円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	27,475,464円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	19,919,822円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	10,702,581,663円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	507,842,658円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	6,864,237円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	34,087,216円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	58,257,086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）	2,556,761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）	61,229,044円

2．　計算日における受益権の総数	
	16,003,677,154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	1.1465円
(10,000口当たり純資産額)	(11,465円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△607,518,847
投資証券	6,362,459
合計	△601,156,388

(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)

（2019年 1月25日現在）　　**（単位：円）**

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	631,240,162	－	642,654,705	11,414,543
合計		631,240,162	－	642,654,705	11,414,543

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	2,551	46.25	117,983.75	
	ANTERO RESOURCES CORP	124	10.00	1,240.00	
	APACHE CORP	1,606	31.84	51,135.04	
	BAKER HUGHES A GE CO	2,628	23.04	60,549.12	
	CABOT OIL & GAS CORP	1,553	25.48	39,570.44	
	CHENIERE ENERGY INC	885	63.22	55,949.70	
	CHEVRON CORP	9,036	113.51	1,025,676.36	
	CIMAREX ENERGY CO	258	73.27	18,903.66	
	CONCHO RESOURCES INC	997	116.08	115,731.76	
	CONOCOPHILLIPS	5,551	66.12	367,032.12	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	46.34	17,655.54	
	DEVON ENERGY CORP	2,137	26.60	56,844.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	649	101.56	65,912.44	
	EOG RESOURCES INC	2,786	97.24	270,910.64	
	EXXON MOBIL CORP	19,923	71.40	1,422,502.20	
	HALLIBURTON CO	4,360	31.21	136,075.60	
	HELMERICH & PAYNE	441	52.57	23,183.37	
	HESS CORP	1,131	51.00	57,681.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	873	53.85	47,011.05	
	KINDER MORGAN INC	9,720	17.48	169,905.60	
	MARATHON OIL CORP	3,583	15.80	56,611.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	3,348	63.11	211,292.28	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,607	29.38	47,213.66	
	NOBLE ENERGY INC	2,029	21.29	43,197.41	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,692	64.98	239,906.16	
	ONEOK INC	2,045	62.65	128,119.25	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	640	18.14	11,609.60	
	PHILLIPS 66	2,144	91.33	195,811.52	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	849	138.31	117,425.19	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	200	23.09	4,618.00	
	SCHLUMBERGER LTD	6,655	43.56	289,891.80	
	TARGA RESOURCES CORP	947	41.26	39,073.22	
	TECHNIPFMC PLC	1,813	22.86	41,445.18	

VALERO ENERGY CORP	2,094	78.95	165,321.30	
WILLIAMS COS INC	5,954	26.50	157,781.00	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,084	156.50	169,646.00	
ALBEMARLE CORP	319	74.02	23,612.38	
AVERY DENNISON CORP	466	95.98	44,726.68	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	486	25.38	12,334.68	
BALL CORP	1,367	50.86	69,525.62	
CELANESE CORP	568	95.68	54,346.24	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	983	41.26	40,558.58	
CHEMOURS CO/THE	410	33.92	13,907.20	
CROWN HOLDINGS INC	569	48.81	27,772.89	
DOWDUPONT INC	10,963	56.33	617,545.79	
EASTMAN CHEMICAL CO	753	78.06	58,779.18	
ECOLAB INC	1,276	151.92	193,849.92	
FMC CORP	567	77.80	44,112.60	
FREEPORT-MCMORAN INC	5,755	10.70	61,578.50	
INTERNATIONAL PAPER CO	1,618	46.27	74,864.86	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	359	137.21	49,258.39	
LINDE PLC	2,635	157.37	414,669.95	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,654	83.96	138,869.84	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	265	176.04	46,650.60	
MOSAIC CO/THE	1,542	31.01	47,817.42	
NEWMONT MINING CORP	2,216	32.18	71,310.88	
NUCOR CORP	1,316	56.87	74,840.92	
PACKAGING CORP OF AMERICA	504	92.32	46,529.28	
PPG INDUSTRIES INC	1,221	102.22	124,810.62	
SEALED AIR CORP	504	37.53	18,915.12	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	417	390.26	162,738.42	
STEEL DYNAMICS INC	1,252	34.71	43,456.92	
VULCAN MATERIALS CO	705	100.04	70,528.20	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	72.74	11,929.36	
WESTROCK CO	1,074	41.83	44,925.42	
3M CO	2,796	192.52	538,285.92	
ACUITY BRANDS INC	165	117.35	19,362.75	
AERCAP HOLDINGS NV	312	45.69	14,255.28	
ALLEGION PLC	510	83.00	42,330.00	
AMETEK INC	979	71.20	69,704.80	
ARCONIC INC	1,855	18.40	34,132.00	
BOEING CO/THE	2,582	358.27	925,053.14	
CATERPILLAR INC	2,854	132.73	378,811.42	
CUMMINS INC	794	143.89	114,248.66	
DEERE & CO	1,491	158.43	236,219.13	

DOVER CORP	630	79.18	49,883.40	
EATON CORP PLC	2,163	70.16	151,756.08	
EMERSON ELECTRIC CO	3,095	63.04	195,108.80	
FASTENAL CO	1,215	58.81	71,454.15	
FLOWSERVE CORP	456	41.71	19,019.76	
FLUOR CORP	326	36.82	12,003.32	
FORTIVE CORP	1,540	70.99	109,324.60	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	586	42.00	24,612.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	1,237	170.82	211,304.34	
GENERAL ELECTRIC CO	41,767	8.78	366,714.26	
HARRIS CORP	496	141.93	70,397.28	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	708	39.99	28,312.92	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,545	141.18	500,483.10	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	233	199.05	46,378.65	
IDEX CORP	327	136.76	44,720.52	
ILLINOIS TOOL WORKS	1,485	130.93	194,431.05	
INGERSOLL-RAND PLC	1,248	93.90	117,187.20	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	686	62.18	42,655.48	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,000	66.82	66,820.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	1,100	37.73	41,503.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	4,627	32.27	149,313.29	
L3 TECHNOLOGIES INC	334	182.48	60,948.32	
LENNOX INTERNATIONAL INC	195	225.57	43,986.15	
LOCKHEED MARTIN CORP	1,234	285.25	351,998.50	
MASCO CORP	1,312	31.47	41,288.64	
MIDDLEBY CORP	299	115.57	34,555.43	
NORTHROP GRUMMAN CORP	811	269.82	218,824.02	
OWENS CORNING	260	47.40	12,324.00	
PACCAR INC	1,799	61.79	111,160.21	
PARKER HANNIFIN CORP	681	158.07	107,645.67	
PENTAIR PLC	504	40.46	20,391.84	
RAYTHEON COMPANY	1,394	166.32	231,850.08	
ROCKWELL AUTOMATION INC	516	162.74	83,973.84	
ROPER TECHNOLOGIES INC	519	278.70	144,645.30	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	912	46.35	42,271.20	
SMITH (A.O.) CORP	414	46.40	19,209.60	
SNAP-ON INC	241	163.37	39,372.17	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	572	79.22	45,313.84	
STANLEY BLACK & DECKER INC	789	118.24	93,291.36	
TEXTRON INC	1,060	51.92	55,035.20	
TRANSDIGM GROUP INC	200	348.76	69,752.00	
UNITED RENTALS INC	353	123.32	43,531.96	

UNITED TECHNOLOGIES CORP	3,918	115.56	452,764.08	
WABCO HOLDINGS INC	114	110.12	12,553.68	
WABTEC CORP	201	71.03	14,277.03	
WW GRAINGER INC	204	286.22	58,388.88	
XYLEM INC	767	68.63	52,639.21	
CINTAS CORP	388	182.52	70,817.76	
COPART INC	910	49.51	45,054.10	
COSTAR GROUP INC	158	375.12	59,268.96	
EQUIFAX INC	524	103.82	54,401.68	
IHS MARKIT LTD	2,053	51.01	104,723.53	
MANPOWERGROUP INC	288	72.63	20,917.44	
NIELSEN HOLDINGS PLC	1,233	25.28	31,170.24	
REPUBLIC SERVICES INC	975	75.84	73,944.00	
ROBERT HALF INTL INC	673	60.34	40,608.82	
ROLLINS INC	337	37.78	12,731.86	
TRANSUNION	804	58.91	47,363.64	
VERISK ANALYTICS INC	831	116.15	96,520.65	
WASTE CONNECTIONS INC	1,374	80.26	110,277.24	
WASTE MANAGEMENT INC	2,125	94.41	200,621.25	
AMERCO	6	344.85	2,069.10	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	33.66	6,664.68	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	608	86.54	52,616.32	
CSX CORP	3,957	65.05	257,402.85	
DELTA AIR LINES INC	759	47.52	36,067.68	
EXPEDITORS INTL WASH INC	765	68.61	52,486.65	
FEDEX CORP	1,229	174.10	213,968.90	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	384	102.71	39,440.64	
KANSAS CITY SOUTHERN	449	107.34	48,195.66	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	250	29.81	7,452.50	
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,366	165.94	226,674.04	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	328	131.58	43,158.24	
SOUTHWEST AIRLINES CO	380	54.21	20,599.80	
UNION PACIFIC CORP	3,521	160.34	564,557.14	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	364	84.03	30,586.92	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,338	99.70	332,798.60	
XPO LOGISTICS INC	557	60.88	33,910.16	
APTIV PLC	1,375	71.82	98,752.50	
AUTOLIV INC	349	78.31	27,330.19	
BORGWARNER INC	1,123	40.11	45,043.53	
FORD MOTOR CO	18,481	8.60	158,936.60	
GENERAL MOTORS CO	6,196	38.16	236,439.36	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	537	20.20	10,847.40	

HARLEY-DAVIDSON INC	382	36.50	13,943.00	
LEAR CORP	352	149.00	52,448.00	
TESLA INC	626	291.51	182,485.26	
CAPRI HOLDINGS LTD	819	41.07	33,636.33	
DR HORTON INC	1,583	38.30	60,628.90	
GARMIN LTD	502	68.02	34,146.04	
HANESBRANDS INC	1,521	14.71	22,373.91	
HASBRO INC	534	89.40	47,739.60	
LEGGETT & PLATT INC	366	39.61	14,497.26	
LENNAR CORP-A	1,293	44.87	58,016.91	
LULULEMON ATHLETICA INC	440	148.43	65,309.20	
MATTEL INC	1,378	12.27	16,908.06	
MOHAWK INDUSTRIES INC	281	127.15	35,729.15	
NEWELL RUBBERMAID INC	2,593	20.98	54,401.14	
NIKE INC -CL B	6,136	80.44	493,579.84	
NVR INC	15	2,521.30	37,819.50	
POLARIS INDUSTRIES INC	141	86.47	12,192.27	
PULTEGROUP INC	1,087	26.70	29,022.90	
PVH CORP	342	105.99	36,248.58	
RALPH LAUREN CORP	168	110.94	18,637.92	
TAPESTRY INC	1,276	36.12	46,089.12	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	20.74	8,482.66	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	152	18.86	2,866.72	
VF CORP	1,730	83.34	144,178.20	
WHIRLPOOL CORP	201	122.90	24,702.90	
ARAMARK	1,317	31.99	42,130.83	
CARNIVAL CORP	2,158	55.02	118,733.16	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	107	533.39	57,072.73	
DARDEN RESTAURANTS INC	531	107.42	57,040.02	
DOMINO'S PIZZA INC	170	276.88	47,069.60	
H&R BLOCK INC	571	25.70	14,674.70	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,451	71.06	103,108.06	
LAS VEGAS SANDS CORP	2,004	56.37	112,965.48	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,463	108.24	158,355.12	
MCDONALD'S CORP	3,682	187.37	689,896.34	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	21.27	23,397.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,180	27.89	60,800.20	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	941	46.99	44,217.59	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	705	109.75	77,373.75	
STARBUCKS CORP	6,457	64.74	418,026.18	
VAIL RESORTS INC	173	187.27	32,397.71	
WYNN RESORTS LTD	419	114.41	47,937.79	

YUM! BRANDS INC	1,586	92.91	147,355.26	
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,586	47.27	169,510.22	
ALPHABET INC-CL A	1,408	1,084.00	1,526,272.00	
ALPHABET INC-CL C	1,483	1,073.90	1,592,593.70	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	1,468	48.98	71,902.64	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	791	287.58	227,475.78	
COMCAST CORP-CLASS A	21,661	36.24	784,994.64	
DISCOVERY INC - A	622	27.32	16,993.04	
DISCOVERY INC-C	1,636	25.46	41,652.56	
DISH NETWORK CORP-A	555	30.12	16,716.60	
ELECTRONIC ARTS INC	1,529	91.48	139,872.92	
FACEBOOK INC-A	11,352	145.83	1,655,462.16	
IAC/INTERACTIVECORP	339	205.00	69,495.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,689	22.24	37,563.36	
LIBERTY BROADBAND-C	470	74.40	34,968.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	356	22.72	8,088.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	2,308	22.02	50,822.16	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,085	30.51	33,103.35	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	933	38.11	35,556.63	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	206	37.84	7,795.04	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	644	52.88	34,054.72	
NETFLIX INC	2,064	326.67	674,246.88	
NEWS CORP - CLASS A	910	12.44	11,320.40	
OMNICOM GROUP	969	76.69	74,312.61	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	8,406	5.75	48,334.50	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	501	101.49	50,846.49	
TRIPADVISOR INC	467	56.69	26,474.23	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	1,869	48.66	90,945.54	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	5,122	48.90	250,465.80	
TWITTER INC	2,892	31.61	91,416.12	
VIACOM INC-CLASS B	1,555	29.14	45,312.70	
WALT DISNEY CO/THE	7,044	110.55	778,714.20	
ZILLOW GROUP INC - C	458	31.13	14,257.54	
ADVANCE AUTO PARTS INC	317	156.31	49,550.27	
AMAZON.COM INC	1,946	1,654.93	3,220,493.78	
AUTOZONE INC	135	814.79	109,996.65	
BEST BUY CO INC	1,071	57.60	61,689.60	
BOOKING HOLDINGS INC	228	1,795.67	409,412.76	
BURLINGTON STORES INC	360	167.22	60,199.20	
CARMAX INC	755	59.44	44,877.20	
DOLLAR GENERAL CORP	1,323	113.75	150,491.25	
DOLLAR TREE INC	1,207	94.56	114,133.92	

EBAY INC	4,692	32.65	153,193.80	
EXPEDIA GROUP INC	524	117.42	61,528.08	
GAP INC/THE	696	25.25	17,574.00	
GENUINE PARTS CO	625	95.54	59,712.50	
GRUBHUB INC	288	77.24	22,245.12	
HOME DEPOT INC	5,407	177.29	958,607.03	
KOHLS CORP	714	68.34	48,794.76	
L BRANDS INC	683	27.76	18,960.08	
LKQ CORP	1,698	26.24	44,555.52	
LOWE'S COS INC	3,891	91.80	357,193.80	
MACY'S INC	1,638	24.51	40,147.38	
MERCADOLIBRE INC	179	339.15	60,707.85	
NORDSTROM INC	281	46.72	13,128.32	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	403	339.94	136,995.82	
QURATE RETAIL INC	1,842	21.26	39,160.92	
ROSS STORES INC	1,861	91.20	169,723.20	
TARGET CORP	2,472	70.61	174,547.92	
TIFFANY & CO	471	87.52	41,221.92	
TJX COMPANIES INC	6,001	48.68	292,128.68	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	521	87.59	45,634.39	
ULTA BEAUTY INC	241	287.99	69,405.59	
WAYFAIR INC- CLASS A	181	99.86	18,074.66	
COSTCO WHOLESALE CORP	2,086	210.31	438,706.66	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	9.48	948.00	
KROGER CO	3,318	28.71	95,259.78	
SYSCO CORP	2,423	62.53	151,510.19	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	4,047	71.32	288,632.04	
WALMART INC	6,980	98.36	686,552.80	
ALTRIA GROUP INC	8,975	43.33	388,886.75	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,785	43.67	121,620.95	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,119	45.61	51,037.59	
BUNGE LTD	734	53.09	38,968.06	
CAMPBELL SOUP CO	939	34.72	32,602.08	
COCA-COLA CO/THE	19,065	47.69	909,209.85	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	756	46.26	34,972.56	
CONAGRA BRANDS INC	2,528	21.15	53,467.20	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	830	164.79	136,775.70	
GENERAL MILLS INC	2,961	43.52	128,862.72	
HERSHEY CO/THE	593	105.37	62,484.41	
HORMEL FOODS CORP	1,231	41.58	51,184.98	
INGREDION INC	294	97.46	28,653.24	
JM SMUCKER CO/THE	480	101.77	48,849.60	

KELLOGG CO	1,091	57.66	62,907.06	
KRAFT HEINZ CO/THE	3,006	46.54	139,899.24	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	762	71.36	54,376.32	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	506	124.35	62,921.10	
MOLSON COORS BREWING CO -B	798	63.39	50,585.22	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	7,032	43.03	302,586.96	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,070	55.36	114,595.20	
PEPSICO INC	6,687	109.50	732,226.50	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	7,379	71.55	527,967.45	
TYSON FOODS INC-CL A	1,235	60.09	74,211.15	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,230	64.30	79,089.00	
CLOROX COMPANY	518	149.17	77,270.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,947	62.20	245,503.40	
COTY INC-CL A	785	7.00	5,495.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,093	125.23	136,876.39	
KIMBERLY-CLARK CORP	1,674	111.44	186,550.56	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	11,713	94.30	1,104,535.90	
ABBOTT LABORATORIES	8,317	70.86	589,342.62	
ABIOMED INC	178	348.50	62,033.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	317	220.67	69,952.39	
AMERISOURCEBERGEN CORP	678	78.70	53,358.60	
ANTHEM INC	1,245	265.60	330,672.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC	2,484	69.95	173,755.80	
BECTON DICKINSON AND CO	1,284	240.72	309,084.48	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	6,673	37.23	248,435.79	
CARDINAL HEALTH INC	1,286	48.52	62,396.72	
CENTENE CORP	1,019	126.73	129,137.87	
CERNER CORP	1,229	54.46	66,931.34	
CIGNA CORP	1,817	193.07	350,808.19	
COOPER COS INC/THE	205	271.97	55,753.85	
CVS HEALTH CORP	6,165	64.98	400,601.70	
DANAHER CORP	3,018	106.05	320,058.90	
DAVITA INC	412	56.39	23,232.68	
DENTSPLY SIRONA INC	928	40.59	37,667.52	
DEXCOM INC	461	144.08	66,420.88	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,025	169.20	173,430.00	
HCA HEALTHCARE INC	1,352	132.69	179,396.88	
HENRY SCHEIN INC	799	76.60	61,203.40	
HOLOGIC INC	1,136	44.58	50,642.88	
HUMANA INC	670	300.53	201,355.10	
IDEXX LABORATORIES INC	359	206.16	74,011.44	
INTUITIVE SURGICAL INC	547	536.12	293,257.64	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	426	136.36	58,089.36	
MCKESSON CORP	995	125.47	124,842.65	
MEDTRONIC PLC	6,408	87.23	558,969.84	
QUEST DIAGNOSTICS INC	571	85.60	48,877.60	
RESMED INC	591	117.30	69,324.30	
STRYKER CORP	1,621	167.30	271,193.30	
TELEFLEX INC	191	266.00	50,806.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,534	266.13	1,206,633.42	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	449	129.83	58,293.67	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	478	128.82	61,575.96	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	504	105.49	53,166.96	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	261	271.70	70,913.70	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,023	105.24	107,660.52	
ABBVIE INC	7,145	85.88	613,612.60	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,298	72.18	93,689.64	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,086	117.91	128,050.26	
ALKERMES PLC	613	33.08	20,278.04	
ALLERGAN PLC	1,620	157.57	255,263.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	358	80.79	28,922.82	
AMGEN INC	3,054	200.97	613,762.38	
BEIGENE LTD-ADR	100	125.12	12,512.00	
BIOGEN INC	957	332.87	318,556.59	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	728	92.68	67,471.04	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	7,735	49.02	379,169.70	
CELGENE CORP	3,347	86.46	289,381.62	
ELI LILLY & CO	4,566	114.99	525,044.34	
GILEAD SCIENCES INC	6,138	67.86	416,524.68	
ILLUMINA INC	704	301.06	211,946.24	
INCYTE CORP	744	77.01	57,295.44	
IQVIA HOLDINGS INC	661	125.11	82,697.71	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	304	125.73	38,221.92	
JOHNSON & JOHNSON	12,597	127.03	1,600,196.91	
MERCK & CO. INC.	12,515	73.17	915,722.55	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	104	605.65	62,987.60	
MYLAN NV	2,118	28.21	59,748.78	
NEKTAR THERAPEUTICS	868	43.23	37,523.64	
PERRIGO CO PLC	394	44.87	17,678.78	
PFIZER INC	27,556	40.95	1,128,418.20	
REGENERON PHARMACEUTICALS	384	407.93	156,645.12	
SEATTLE GENETICS INC	559	71.04	39,711.36	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	5,249	19.34	101,515.66	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,906	240.58	458,545.48	

UNITED THERAPEUTICS CORP	172	114.30	19,659.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,222	186.58	228,000.76	
WATERS CORP	385	223.71	86,128.35	
ZOETIS INC	2,312	83.66	193,421.92	
BANK OF AMERICA CORP	44,639	29.08	1,298,102.12	
BB&T CORP	3,749	49.25	184,638.25	
CIT GROUP INC	280	43.44	12,163.20	
CITIGROUP INC	11,875	62.71	744,681.25	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,927	35.15	67,734.05	
COMERICA INC	695	81.69	56,774.55	
EAST WEST BANCORP INC	349	51.92	18,120.08	
FIFTH THIRD BANCORP	2,703	27.65	74,737.95	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	659	95.34	62,829.06	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,477	13.45	60,215.65	
JPMORGAN CHASE & CO	15,791	102.74	1,622,367.34	
KEYCORP	4,256	16.88	71,841.28	
M & T BANK CORP	551	168.42	92,799.42	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	1,365	16.40	22,386.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,221	123.81	274,982.01	
REGIONS FINANCIAL CORP	4,461	15.51	69,190.11	
SIGNATURE BANK	161	124.39	20,026.79	
SUNTRUST BANKS INC	2,259	61.22	138,295.98	
SVB FINANCIAL GROUP	216	228.36	49,325.76	
US BANCORP	7,364	50.89	374,753.96	
WELLS FARGO & CO	21,540	49.98	1,076,569.20	
ZIONS BANCORPORATION	992	48.60	48,211.20	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	216	107.75	23,274.00	
ALLY FINANCIAL INC	2,221	25.41	56,435.61	
AMERICAN EXPRESS CO	3,507	99.72	349,718.04	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	593	119.78	71,029.54	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	743	18.44	13,700.92	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	4,841	53.71	260,010.11	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	6,115	201.02	1,229,237.30	
BLACKROCK INC	580	406.56	235,804.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,337	80.18	187,380.66	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	471	96.09	45,258.39	
CME GROUP INC	1,717	186.32	319,911.44	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,730	66.18	114,491.40	
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,093	49.48	54,081.64	
EATON VANCE CORP	362	39.36	14,248.32	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,664	31.33	52,133.12	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,723	197.80	340,809.40	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,792	75.21	209,986.32	
INVESCO LTD	1,112	18.78	20,883.36	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	716	20.03	14,341.48	
MOODY'S CORP	860	154.12	132,543.20	
MORGAN STANLEY	6,311	42.05	265,377.55	
MSCI INC	374	161.74	60,490.76	
NASDAQ INC	606	84.99	51,503.94	
NORTHERN TRUST CORP	882	89.37	78,824.34	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	553	80.42	44,472.26	
S&P GLOBAL INC	1,221	188.57	230,243.97	
SCHWAB (CHARLES) CORP	5,871	47.38	278,167.98	
SEI INVESTMENTS COMPANY	534	48.83	26,075.22	
STATE STREET CORP	1,891	71.32	134,866.12	
SYNCHRONY FINANCIAL	2,926	29.81	87,224.06	
T ROWE PRICE GROUP INC	1,224	93.86	114,884.64	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,191	55.33	65,898.03	
VOYA FINANCIAL INC	845	45.60	38,532.00	
AFLAC INC	3,751	47.33	177,534.83	
ALLEGHANY CORP	63	617.25	38,886.75	
ALLSTATE CORP	1,707	86.25	147,228.75	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	395	95.02	37,532.90	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	4,331	42.94	185,973.14	
AON PLC	1,185	153.91	182,383.35	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,718	28.80	49,478.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	774	73.51	56,896.74	
ASSURANT INC	206	96.35	19,848.10	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	570	42.41	24,173.70	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	121	36.43	4,408.03	
CHUBB LTD	2,224	132.41	294,479.84	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	655	79.12	51,823.60	
EVEREST RE GROUP LTD	173	215.72	37,319.56	
FNF GROUP	1,165	34.76	40,495.40	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,507	46.67	70,331.69	
LINCOLN NATIONAL CORP	919	58.44	53,706.36	
LOEWS CORP	1,139	47.42	54,011.38	
MARKEL CORP	72	1,038.88	74,799.36	
MARSH & MCLENNAN COS	2,453	83.00	203,599.00	
METLIFE INC	4,124	45.02	185,662.48	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,207	49.10	59,263.70	
PROGRESSIVE CORP	2,847	65.24	185,738.28	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,034	91.38	185,866.92	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	270	147.40	39,798.00	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	157	133.37	20,939.09	
TORCHMARK CORP	558	82.51	46,040.58	
TRAVELERS COS INC/THE	1,313	124.38	163,310.94	
UNUM GROUP	1,141	34.19	39,010.79	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	544	157.79	85,837.76	
WR BERKLEY CORP	280	74.67	20,907.60	
CBRE GROUP INC - A	1,394	44.06	61,419.64	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	7,400	6.99	51,726.00	
JONES LANG LASALLE INC	107	141.05	15,092.35	
ACCENTURE PLC-CL A	3,051	150.15	458,107.65	
ADOBE INC	2,324	242.56	563,709.44	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	701	64.57	45,263.57	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	174.63	45,229.17	
ANSYS INC	348	158.10	55,018.80	
AUTODESK INC	1,079	136.05	146,797.95	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,108	134.75	284,053.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	481	100.80	48,484.80	
CADENCE DESIGN SYS INC	1,169	45.94	53,703.86	
CDK GLOBAL INC	509	51.70	26,315.30	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	740	107.35	79,439.00	
CITRIX SYSTEMS INC	560	101.86	57,041.60	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	2,831	68.12	192,847.72	
DXC TECHNOLOGY CO	1,155	62.12	71,748.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,612	105.16	169,517.92	
FIRST DATA CORP- CLASS A	2,215	24.43	54,112.45	
FISERV INC	1,997	82.79	165,331.63	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	363	196.58	71,358.54	
FORTINET INC	594	72.52	43,076.88	
GARTNER INC	375	130.37	48,888.75	
GLOBAL PAYMENTS INC	649	112.23	72,837.27	
GODADDY INC - CLASS A	684	64.94	44,418.96	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4,335	132.53	574,517.55	
INTUIT INC	1,177	212.16	249,712.32	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	319	131.15	41,836.85	
LEIDOS HOLDINGS INC	749	56.37	42,221.13	
MASTERCARD INC-CLASS A	4,358	199.79	870,684.82	
MICROSOFT CORP	34,177	106.20	3,629,597.40	
ORACLE CORP	14,135	49.20	695,442.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	381	210.47	80,189.07	
PAYCHEX INC	1,624	69.62	113,062.88	
PAYPAL HOLDINGS INC	5,347	92.20	492,993.40	
PTC INC	586	79.75	46,733.50	

RED HAT INC	874	176.35	154,129.90	
SABRE CORP	980	22.73	22,275.40	
SALESFORCE.COM INC	3,416	146.87	501,707.92	
SERVICENOW INC	873	185.70	162,116.10	
SPLUNK INC	596	119.95	71,490.20	
SQUARE INC - A	1,527	73.94	112,906.38	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	892	49.48	44,136.16	
SYMANTEC CORP	2,569	20.03	51,457.07	
SYNOPSYS INC	614	91.42	56,131.88	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	678	87.75	59,494.50	
VERISIGN INC	450	163.48	73,566.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	8,373	137.70	1,152,962.10	
VMWARE INC-CLASS A	312	148.15	46,222.80	
WESTERN UNION CO	2,343	18.18	42,595.74	
WIX.COM LTD	197	103.90	20,468.30	
WORKDAY INC-CLASS A	730	171.20	124,976.00	
WORLDPAY INC-CLASS A	1,507	82.06	123,664.42	
AMPHENOL CORP-CL A	1,526	85.22	130,045.72	
APPLE INC	22,675	152.70	3,462,472.50	
ARISTA NETWORKS INC	224	226.45	50,724.80	
ARROW ELECTRONICS INC	224	74.01	16,578.24	
CDW CORP/DE	646	81.16	52,429.36	
CISCO SYSTEMS INC	22,238	45.61	1,014,275.18	
COGNEX CORP	928	42.22	39,180.16	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	750	18.99	14,242.50	
CORNING INC	4,114	29.86	122,844.04	
DELL TECHNOLOGIES -C	391	44.96	17,579.36	
F5 NETWORKS INC	328	156.09	51,197.52	
FLEX LTD	1,502	8.54	12,827.08	
FLIR SYSTEMS INC	391	45.60	17,829.60	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	7,609	14.76	112,308.84	
HP INC	7,870	21.77	171,329.90	
IPG PHOTONICS CORP	85	130.57	11,098.45	
JUNIPER NETWORKS INC	1,471	28.18	41,452.78	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	800	70.65	56,520.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	680	114.79	78,057.20	
NETAPP INC	1,096	61.97	67,919.12	
SEAGATE TECHNOLOGY	1,164	40.97	47,689.08	
TE CONNECTIVITY LTD	1,757	78.76	138,381.32	
TRIMBLE INC	1,348	36.71	49,485.08	
WESTERN DIGITAL CORP	1,243	40.14	49,894.02	
XEROX CORP	555	23.92	13,275.60	

AT&T INC	34,309	30.60	1,049,855.40	
CENTURYLINK INC	4,178	14.71	61,458.38	
SPRINT CORP	4,378	6.25	27,362.50	
T-MOBILE US INC	1,728	68.66	118,644.48	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	19,508	57.07	1,113,321.56	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	876	26.91	23,573.16	
AES CORP	2,824	15.90	44,901.60	
ALLIANT ENERGY CORP	998	43.92	43,832.16	
AMEREN CORPORATION	1,031	68.75	70,881.25	
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,414	77.75	187,688.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	762	94.64	72,115.68	
ATMOS ENERGY CORP	586	96.67	56,648.62	
CENTERPOINT ENERGY INC	2,092	30.12	63,011.04	
CMS ENERGY CORP	1,206	51.69	62,338.14	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,562	77.66	121,304.92	
DOMINION ENERGY INC	3,624	69.13	250,527.12	
DTE ENERGY COMPANY	760	115.50	87,780.00	
DUKE ENERGY CORP	3,429	86.70	297,294.30	
EDISON INTERNATIONAL	1,364	55.14	75,210.96	
ENTERGY CORP	765	88.63	67,801.95	
EVERGY INC	1,151	57.14	65,768.14	
EVERSOURCE ENERGY	1,322	68.46	90,504.12	
EXELON CORP	4,697	46.96	220,571.12	
FIRSTENERGY CORP	2,038	39.28	80,052.64	
NEXTERA ENERGY INC	2,254	180.28	406,351.12	
NISOURCE INC	1,549	26.85	41,590.65	
NRG ENERGY INC	1,599	41.73	66,726.27	
OGE ENERGY CORP	654	41.11	26,885.94	
PINNACLE WEST CAPITAL	478	87.98	42,054.44	
PPL CORP	2,921	30.78	89,908.38	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	2,521	53.24	134,218.04	
SEMPRA ENERGY	1,351	113.35	153,135.85	
SOUTHERN CO/THE	4,919	47.96	235,915.24	
UGI CORP	916	56.54	51,790.64	
VISTRA ENERGY CORP	1,777	24.64	43,785.28	
WEC ENERGY GROUP INC	1,592	72.22	114,974.24	
XCEL ENERGY INC	2,544	51.39	130,736.16	
ADVANCED MICRO DEVICES	3,740	20.85	77,979.00	
ANALOG DEVICES INC	1,802	94.75	170,739.50	
APPLIED MATERIALS INC	4,764	37.82	180,174.48	
BROADCOM INC	2,042	263.55	538,169.10	
INTEL CORP	21,699	49.76	1,079,742.24	

	KLA-TENCOR CORP	632	98.29	62,119.28	
	LAM RESEARCH CORP	777	161.20	125,252.40	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	2,516	17.50	44,030.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	1,126	54.54	61,412.04	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	951	78.44	74,596.44	
	MICRON TECHNOLOGY INC	5,590	36.59	204,538.10	
	NVIDIA CORP	2,741	157.84	432,639.44	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,674	84.25	141,034.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,652	18.99	31,371.48	
	QORVO INC	422	63.38	26,746.36	
	QUALCOMM INC	6,682	50.81	339,512.42	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	725	70.03	50,771.75	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	4,607	102.09	470,328.63	
	XILINX INC	1,244	106.06	131,938.64	
米ドル 小計		1,405,559		106,325,976.65 (11,671,402,456)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	570	9.59	5,466.30	
	CAMECO CORP	2,464	15.56	38,339.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	6,092	34.96	212,976.32	
	CENOVUS ENERGY INC	6,181	10.17	62,860.77	
	ENBRIDGE INC	9,755	47.55	463,850.25	
	ENCANA CORP	4,607	9.26	42,660.82	
	HUSKY ENERGY INC	1,391	15.79	21,963.89	
	IMPERIAL OIL LTD	1,699	36.65	62,268.35	
	INTER PIPELINE LTD	1,871	20.95	39,197.45	
	KEYERA CORP	888	26.79	23,789.52	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,185	44.21	96,598.85	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	19.20	9,926.40	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	460	10.00	4,600.00	
	SUNCOR ENERGY INC	7,940	42.30	335,862.00	
	TOURMALINE OIL CORP	465	18.49	8,597.85	
	TRANSCANADA CORP	4,501	55.12	248,095.12	
	VERMILION ENERGY INC	590	30.46	17,971.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,078	52.92	57,047.76	
	BARRICK GOLD CORP	9,190	15.82	145,385.80	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	723	54.91	39,699.93	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,487	12.51	31,112.37	
	FRANCO-NEVADA CORP	827	94.95	78,523.65	
	GOLDCORP INC	4,072	13.99	56,967.28	
	KINROSS GOLD CORP	3,281	4.19	13,747.39	
	LUNDIN MINING CORP	1,800	5.50	9,900.00	
	METHANEX CORP	131	73.95	9,687.45	

NUTRIEN LTD	3,121	68.05	212,384.05	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	2,293	29.63	67,941.59	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	828	2.09	1,730.52	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	74.30	24,890.50	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,710	25.18	68,237.80	
BOMBARDIER INC-B	8,071	1.93	15,577.03	
CAE INC	869	27.66	24,036.54	
FINNING INTERNATIONAL INC	736	24.27	17,862.72	
SNC-LAVALIN GROUP INC	871	48.05	41,851.55	
WSP GLOBAL INC	680	63.27	43,023.60	
THOMSON REUTERS CORP	973	68.03	66,193.19	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,580	109.57	392,260.60	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	730	269.65	196,844.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,772	68.12	120,708.64	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,100	43.48	47,828.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,071	84.97	91,002.87	
STARS GROUP INC/THE	623	23.72	14,777.56	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,257	26.40	59,584.80	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	230	147.96	34,030.80	
DOLLARAMA INC	1,497	34.74	52,005.78	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	2,235	71.12	158,953.20	
EMPIRE CO LTD 'A'	864	30.17	26,066.88	
LOBLAW COMPANIES LTD	889	63.27	56,247.03	
METRO INC	1,417	49.14	69,631.38	
WESTON (GEORGE) LTD	297	94.09	27,944.73	
SAPUTO INC	1,126	38.59	43,452.34	
AURORA CANNABIS INC	1,309	8.84	11,571.56	
BAUSCH HEALTH COS INC	1,459	31.17	45,477.03	
CANOPY GROWTH CORP	1,137	59.02	67,105.74	
BANK OF MONTREAL	3,122	96.80	302,209.60	
BANK OF NOVA SCOTIA	5,933	73.49	436,016.17	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,188	109.76	240,154.88	
NATIONAL BANK OF CANADA	1,434	60.72	87,072.48	
ROYAL BANK OF CANADA	6,863	98.99	679,368.37	
TORONTO-DOMINION BANK	8,719	72.66	633,522.54	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	4,218	55.52	234,183.36	
CI FINANCIAL CORP	775	18.49	14,329.75	
IGM FINANCIAL INC	81	32.88	2,663.28	
ONEX CORPORATION	292	75.83	22,142.36	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	153	616.04	94,254.12	
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	27.90	51,503.40	
IA FINANCIAL CORP INC	304	48.05	14,607.20	

	INTACT FINANCIAL CORP	637	103.71	66,063.27	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	9,955	20.87	207,760.85	
	POWER CORP OF CANADA	1,735	25.40	44,069.00	
	POWER FINANCIAL CORP	1,074	26.60	28,568.40	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,601	47.58	123,755.58	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	101	20.33	2,053.33	
	BLACKBERRY LTD	1,407	10.37	14,590.59	
	CGI GROUP INC - CLASS A	1,079	86.03	92,826.37	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	87	961.36	83,638.32	
	OPEN TEXT CORP	1,567	47.06	73,743.02	
	SHOPIFY INC - CLASS A	487	211.50	103,000.50	
	BCE INC	1,000	55.93	55,930.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,591	70.94	112,865.54	
	TELUS CORP	320	46.26	14,803.20	
	ALTAGAS LTD	544	13.55	7,371.20	
	ATCO LTD -CLASS I	63	41.01	2,583.63	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	105	33.92	3,561.60	
	EMERA INC	50	45.33	2,266.50	
	FORTIS INC	1,889	46.45	87,744.05	
	HYDRO ONE LTD	1,625	20.50	33,312.50	
カナダドル 小計		184,690		8,208,854.25 (675,096,173)	
ユーロ	ENAGAS SA	618	25.15	15,542.70	
	ENI SPA	12,457	14.41	179,580.11	
	GALP ENERGIA SGPS SA	2,089	13.97	29,183.33	
	NESTE OYJ	690	81.02	55,903.80	
	OMV AG	1,018	41.79	42,542.22	
	REPSOL SA	5,953	15.05	89,592.65	
	SNAM SPA	12,445	4.07	50,713.37	
	TENARIS SA	1,257	10.67	13,412.19	
	TOTAL SA	11,383	47.01	535,114.83	
	VOPAK	56	43.48	2,434.88	
	AIR LIQUIDE SA	2,089	105.30	219,971.70	
	AKZO NOBEL	951	74.98	71,305.98	
	ARCELORMITTAL	2,858	18.99	54,284.85	
	ARKEMA	423	81.14	34,322.22	
	BASF SE	4,477	63.63	284,871.51	
	COVESTRO AG	1,141	45.47	51,881.27	
	CRH PLC	4,397	24.90	109,485.30	
	EVONIK INDUSTRIES AG	393	23.47	9,223.71	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	40.84	2,287.04	
	HEIDELBERGCEMENT AG	882	60.72	53,555.04	

IMERYS SA	29	45.08	1,307.32	
KONINKLIJKE DSM NV	780	79.88	62,306.40	
LANXESS AG	195	47.51	9,264.45	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,086	24.24	26,324.64	
SOLVAY SA	460	92.94	42,752.40	
STORA ENSO OYJ-R SHS	2,714	11.83	32,120.19	
SYMRISE AG	577	73.18	42,224.86	
THYSSENKRUPP AG	2,040	15.30	31,222.20	
UMICORE	1,263	34.96	44,154.48	
UPM-KYMMENE OYJ	2,370	25.54	60,529.80	
VOESTALPINE AG	712	27.33	19,458.96	
(Right)ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	1,191	0.46	558.81	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	1,191	35.90	42,756.90	
AIRBUS SE	2,825	95.92	270,974.00	
ALSTOM	969	34.28	33,217.32	
ANDRITZ AG	702	42.50	29,835.00	
BOUYGUES SA	1,029	30.55	31,435.95	
BRENNTAG AG	735	42.18	31,002.30	
CNH INDUSTRIAL NV	5,890	8.78	51,714.20	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	2,144	30.19	64,727.36	
DASSAULT AVIATION SA	11	1,287.00	14,157.00	
EIFFAGE	276	79.78	22,019.28	
FERROVIAL SA	2,305	19.65	45,293.25	
GEA GROUP AG	434	24.33	10,559.22	
HOCHTIEF AG	17	127.00	2,159.00	
KINGSPAN GROUP PLC	481	37.80	18,181.80	
KION GROUP AG	150	48.78	7,317.00	
KONE OYJ-B	1,500	42.73	64,095.00	
LEGRAND SA	1,157	51.18	59,215.26	
LEONARDO SPA	873	8.18	7,141.14	
METSO OYJ	90	25.78	2,320.20	
MTU AERO ENGINES AG	247	186.90	46,164.30	
OSRAM LICHT AG	172	38.99	6,706.28	
PRYSMIAN SPA	1,283	18.40	23,607.20	
REXEL SA	790	10.20	8,058.00	
SAFRAN SA	1,647	109.25	179,934.75	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,733	60.18	164,471.94	
SIEMENS AG-REG	3,701	99.21	367,176.21	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	11.53	4,612.00	
THALES SA	469	96.00	45,024.00	
VINCI SA	2,501	75.60	189,075.60	
WARTSILA OYJ ABP	2,705	14.27	38,600.35	

BUREAU VERITAS SA	842	19.16	16,136.93	
EDENRED	1,421	35.80	50,871.80	
RANDSTAD NV	555	42.75	23,726.25	
SOCIETE BIC SA	23	88.00	2,024.00	
TELEPERFORMANCE	270	149.20	40,284.00	
WOLTERS KLUWER	1,271	53.82	68,405.22	
ADP	115	165.50	19,032.50	
AENA SME SA	368	150.60	55,420.80	
ATLANTIA SPA	2,455	20.31	49,861.05	
BOLLORE	3,240	3.50	11,352.96	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	21.88	30,785.16	
DEUTSCHE POST AG-REG	5,082	25.85	131,369.70	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	35	68.52	2,398.20	
GETLINK	2,348	12.75	29,948.74	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	1,317	7.28	9,593.02	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,713	72.87	124,826.31	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	119	64.45	7,669.55	
CONTINENTAL AG	479	137.20	65,718.80	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	4,493	50.91	228,738.63	
FAURECIA	200	37.98	7,596.00	
FERRARI NV	553	99.04	54,769.12	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	4,779	14.55	69,534.45	
MICHELIN (CGDE)	712	94.44	67,241.28	
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	29.39	12,431.97	
PEUGEOT SA	2,496	21.57	53,838.72	
PIRELLI & C SPA	1,734	6.09	10,563.52	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	699	55.98	39,130.02	
RENAULT SA	820	58.30	47,806.00	
VALEO SA	1,068	27.17	29,017.56	
VOLKSWAGEN AG	194	148.20	28,750.80	
VOLKSWAGEN AG-PREF	949	144.96	137,567.04	
ADIDAS AG	947	202.50	191,767.50	
ESSILORLUXOTTICA	1,442	111.85	161,287.70	
HERMES INTERNATIONAL	140	500.60	70,084.00	
HUGO BOSS AG -ORD	184	63.50	11,684.00	
KERING	382	414.70	158,415.40	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	1,343	257.85	346,292.55	
MONCLER SPA	678	30.60	20,746.80	
PUMA SE	20	474.50	9,490.00	
SEB SA	21	131.40	2,759.40	
ACCOR SA	1,120	38.57	43,198.40	
PADDY POWER BETFAIR PLC	501	70.35	35,245.35	

SODEXO	412	93.82	38,653.84	
AXEL SPRINGER SE	35	50.90	1,781.50	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	18.25	7,464.25	
JC DECAUX SA	60	26.00	1,560.00	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	510	15.94	8,129.40	
PUBLICIS GROUPE	1,162	53.78	62,492.36	
RTL GROUP	32	48.20	1,542.40	
SES	2,232	17.19	38,368.08	
TELENET GROUP HOLDING NV	192	38.82	7,453.44	
UBISOFT ENTERTAINMENT	398	76.70	30,526.60	
VIVENDI	5,303	21.53	114,173.59	
DELIVERY HERO SE	416	32.50	13,520.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	5,414	24.45	132,372.30	
ZALANDO SE	220	28.92	6,362.40	
CARREFOUR SA	2,663	17.22	45,856.86	
CASINO GUICHARD PERRACHON	45	39.11	1,759.95	
COLRUYT SA	290	62.36	18,084.40	
JERONIMO MARTINS	703	12.53	8,808.59	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	6,087	23.07	140,457.52	
METRO AG	170	15.32	2,604.40	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	3,706	65.70	243,484.20	
DANONE	3,002	62.80	188,525.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	1,400	7.81	10,941.00	
HEINEKEN HOLDING NV	516	74.30	38,338.80	
HEINEKEN NV	1,091	76.40	83,352.40	
KERRY GROUP PLC-A	713	90.55	64,562.15	
PERNOD RICARD SA	1,046	142.20	148,741.20	
REMY COINTREAU	18	101.00	1,818.00	
BEIERSDORF AG	451	86.12	38,840.12	
HENKEL AG & CO KGAA	464	78.65	36,493.60	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	757	83.58	63,270.06	
L'OREAL	1,209	199.50	241,195.50	
UNILEVER NV-CVA	7,316	46.97	343,632.52	
BIOMERIEUX	110	61.90	6,809.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	959	61.80	59,266.20	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,795	44.32	79,554.40	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	4,640	32.12	149,060.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	166	110.30	18,309.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	400	35.77	14,308.00	
BAYER AG-REG	4,482	66.00	295,812.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	48	359.60	17,260.80	
GRIFOLS SA	1,382	24.31	33,596.42	

IPSEN	158	118.75	18,762.50	
MERCK KGAA	572	90.00	51,480.00	
ORION OYJ-CLASS B	184	31.73	5,838.32	
QIAGEN N.V.	1,252	32.53	40,727.56	
RECORDATI SPA	180	30.17	5,430.60	
SANOFI	5,343	72.97	389,878.71	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	88	89.40	7,867.20	
UCB SA	546	76.38	41,703.48	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	2,182	22.25	48,549.50	
AIB GROUP PLC	2,000	4.05	8,100.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	32,092	5.20	167,038.86	
BANCO DE SABADELL SA	20,523	1.03	21,231.04	
BANCO SANTANDER SA	77,183	4.33	334,626.89	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,800	5.45	20,710.00	
BANKIA SA	1,600	2.53	4,062.40	
BANKINTER SA	2,829	7.27	20,578.14	
BNP PARIBAS	5,409	41.38	223,824.42	
CAIXABANK S.A	18,123	3.31	60,023.37	
COMMERZBANK AG	5,632	6.83	38,517.24	
CREDIT AGRICOLE SA	4,796	10.13	48,593.07	
ERSTE GROUP BANK AG	1,374	29.06	39,928.44	
ING GROEP NV-CVA	18,667	10.33	192,904.77	
INTESA SANPAOLO	72,940	2.02	147,922.32	
KBC GROEP NV	1,038	59.74	62,010.12	
MEDIOBANCA SPA	3,575	7.89	28,221.05	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	23.98	29,159.68	
SOCIETE GENERALE SA	3,799	27.72	105,308.28	
UNICREDIT SPA	8,527	10.66	90,897.82	
AMUNDI SA	140	49.80	6,972.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	8,658	7.82	67,705.56	
DEUTSCHE BOERSE AG	998	114.55	114,320.90	
EURAZEO	34	64.20	2,182.80	
EXOR NV	564	54.58	30,783.12	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	375	81.26	30,472.50	
NATIXIS	3,105	4.52	14,059.44	
WENDEL	24	106.90	2,565.60	
AEGON NV	8,027	4.52	36,346.25	
AGEAS	674	41.23	27,789.02	
ALLIANZ SE-REG	2,067	185.04	382,477.68	
ASSICURAZIONI GENERALI	5,197	15.35	79,773.95	
AXA SA	9,448	20.38	192,550.24	
CNP ASSURANCES	1,015	20.00	20,300.00	

HANNOVER RUECK SE	285	128.50	36,622.50	
MAPFRE SA	942	2.50	2,355.94	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	751	196.80	147,796.80	
NN GROUP NV	1,587	37.42	59,385.54	
POSTE ITALIANE SPA	2,118	7.61	16,130.68	
SAMPO OYJ-A SHS	1,923	41.04	78,919.92	
SCOR SE	756	41.55	31,411.80	
AROUNDTOWN SA	2,775	7.53	20,895.75	
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,604	42.66	68,426.64	
VONOVIA SE	2,593	42.83	111,058.19	
AMADEUS IT GROUP SA	2,151	65.40	140,675.40	
ATOS SE	424	76.26	32,334.24	
CAPGEMINI SA	674	97.20	65,512.80	
DASSAULT SYSTEMES SA	551	110.65	60,968.15	
SAP SE	4,713	92.70	436,895.10	
WIRECARD AG	506	167.80	84,906.80	
INGENICO GROUP	134	46.42	6,220.28	
NOKIA OYJ	28,094	5.43	152,550.42	
1&1 DRILLISCH AG	130	36.60	4,758.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	16,403	14.21	233,168.64	
ELISA OYJ	741	39.37	29,173.17	
ILIAD SA	98	102.50	10,045.00	
KONINKLIJKE KPN NV	18,669	2.47	46,243.11	
ORANGE	10,031	13.36	134,064.31	
PROXIMUS	252	22.77	5,738.04	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.45	32,619.66	
TELECOM ITALIA-RSP	9,717	0.39	3,798.37	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	3.05	1,891.00	
TELEFONICA SA	22,891	7.73	176,993.21	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	260	35.25	9,165.00	
E.ON SE	11,451	9.37	107,376.02	
EDF	2,738	14.30	39,153.40	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	10,894	3.05	33,259.38	
ENDESA SA	1,577	21.56	34,000.12	
ENEL SPA	39,691	5.18	205,599.38	
ENGIE	9,138	13.75	125,693.19	
FORTUM OYJ	2,481	20.21	50,141.01	
IBERDROLA SA	30,008	7.11	213,476.91	
INNOGY SE	500	40.60	20,300.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,916	23.85	45,696.60	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,501	19.91	29,892.41	
RWE AG	2,948	21.39	63,057.72	

	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	11.42	25,637.90	
	TERNA SPA	8,163	5.32	43,459.81	
	UNIPER SE	1,177	25.22	29,683.94	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,392	18.17	43,474.60	
	VERBUND AG	245	44.18	10,824.10	
	ASML HOLDING NV	1,949	148.80	290,011.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	5,770	19.29	111,332.15	
	STMICROELECTRONICS NV	3,664	13.76	50,434.96	
ユーロ 小計		910,678		16,670,933.97 (2,068,362,777)	
英ポンド	BP PLC	94,730	5.11	484,922.87	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	21,779	22.66	493,512.14	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	17,797	22.84	406,483.48	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	1,490	5.22	7,786.74	
	ANGLO AMERICAN PLC	5,350	17.92	95,893.40	
	ANTOFAGASTA PLC	1,120	7.97	8,935.36	
	BHP GROUP PLC	10,352	15.69	162,422.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	597	47.90	28,596.30	
	FRESNILLO PLC	180	8.92	1,605.60	
	GLENCORE PLC	55,987	2.88	161,326.54	
	JOHNSON MATTHEY PLC	877	29.66	26,011.82	
	MONDI PLC	2,064	18.07	37,306.80	
	RIO TINTO PLC	5,686	37.65	214,077.90	
	ASHTEAD GROUP PLC	2,200	18.99	41,778.00	
	BAE SYSTEMS PLC	13,761	5.13	70,593.93	
	BUNZL PLC	1,544	23.81	36,762.64	
	DCC PLC	453	64.45	29,195.85	
	FERGUSON PLC	1,019	50.60	51,561.40	
	MEGGITT PLC	2,323	5.01	11,647.52	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	27,430	1.63	44,793.19	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,294	8.73	63,676.62	
	SMITHS GROUP PLC	1,824	14.15	25,818.72	
	WEIR GROUP PLC/THE	572	14.13	8,085.22	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	204	5.45	1,111.80	
	EXPERIAN PLC	4,774	19.22	91,756.28	
	G4S PLC	2,741	1.98	5,451.84	
	INTERTEK GROUP PLC	759	49.38	37,479.42	
	RELX PLC	9,819	16.41	161,129.79	
	EASYJET PLC	130	12.54	1,630.85	
	ROYAL MAIL PLC	2,932	3.04	8,913.28	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	4,892	5.39	26,367.88	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	728	37.96	27,634.88	

BURBERRY GROUP PLC	1,998	18.22	36,413.55	
PERSIMMON PLC	1,824	23.80	43,411.20	
TAYLOR WIMPEY PLC	19,095	1.66	31,774.08	
CARNIVAL PLC	802	41.00	32,882.00	
COMPASS GROUP PLC	7,875	16.13	127,023.75	
GVC HOLDINGS PLC	1,500	6.71	10,072.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	970	43.83	42,519.95	
MERLIN ENTERTAINMENT	2,373	3.38	8,037.35	
TUI AG-DI	1,248	11.95	14,919.84	
WHITBREAD PLC	835	49.51	41,340.85	
AUTO TRADER GROUP PLC	3,830	4.53	17,349.90	
INFORMA PLC	7,050	6.77	47,742.60	
ITV PLC	10,960	1.33	14,653.52	
PEARSON PLC	3,737	9.09	33,984.27	
WPP PLC	5,757	8.69	50,051.35	
KINGFISHER PLC	6,032	2.22	13,391.04	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	2.91	26,606.13	
NEXT PLC	786	48.18	37,869.48	
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.78	26,670.37	
TESCO PLC	48,600	2.22	108,280.80	
WM MORRISON SUPERMARKETS	9,127	2.30	20,992.10	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,943	23.64	45,932.52	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	10,984	24.25	266,362.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	749	25.34	18,979.66	
DIAGEO PLC	11,747	27.35	321,280.45	
IMPERIAL BRANDS PLC	4,719	24.32	114,789.67	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,221	55.93	180,150.53	
UNILEVER PLC	5,414	40.05	216,857.77	
CONVATEC GROUP PLC	2,000	1.39	2,780.00	
NMC HEALTH PLC	438	26.68	11,685.84	
SMITH & NEPHEW PLC	3,769	14.29	53,859.01	
ASTRAZENECA PLC	6,008	54.80	329,238.40	
GLAXOSMITHKLINE PLC	23,505	14.59	343,078.98	
BARCLAYS PLC	83,275	1.62	135,455.11	
HSBC HOLDINGS PLC	93,981	6.33	594,993.71	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	342,081	0.57	197,312.32	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	24,752	2.41	59,652.32	
STANDARD CHARTERED PLC	11,651	6.19	72,224.54	
3I GROUP PLC	5,362	8.24	44,182.88	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,573	18.24	28,691.52	
INVESTEC PLC	2,302	4.90	11,289.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,352	44.13	59,663.76	

	SCHRODERS PLC	320	26.15	8,368.00	
	ST JAMES'S PLACE PLC	2,926	9.62	28,148.12	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	10,584	2.61	27,703.62	
	ADMIRAL GROUP PLC	445	21.25	9,456.25	
	AVIVA PLC	16,817	4.12	69,302.85	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	3,088	3.34	10,332.44	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	25,718	2.57	66,095.26	
	PRUDENTIAL PLC	12,566	14.97	188,175.85	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	4,693	5.24	24,591.32	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,931	14.96	28,887.76	
	SAGE GROUP PLC/THE	4,159	6.25	26,018.70	
	BT GROUP PLC	42,966	2.36	101,507.17	
	VODAFONE GROUP PLC	130,459	1.44	187,913.14	
	CENTRICA PLC	25,998	1.34	34,941.31	
	NATIONAL GRID PLC	16,767	8.03	134,756.37	
	SEVERN TRENT PLC	1,000	19.76	19,760.00	
	SSE PLC	4,481	11.29	50,612.89	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,011	8.21	16,526.39	
英ポンド 小計		1,404,278		7,801,815.00 (1,122,369,105)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	19.47	11,292.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	23	505.50	11,626.50	
	GIVAUDAN-REG	40	2,452.00	98,080.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	2,103	45.16	94,971.48	
	SIKA AG-REG	572	132.50	75,790.00	
	ABB LTD-REG	9,245	18.99	175,608.77	
	GEBERIT AG-REG	169	385.20	65,098.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	52	202.80	10,545.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	195	206.00	40,170.00	
	ADECCO SA-REG	950	51.36	48,792.00	
	SGS SA-REG	25	2,380.00	59,500.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	313	133.25	41,707.25	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	2,642	69.22	182,879.24	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	154	308.80	47,555.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	60.60	15,210.60	
	DUFRY AG-REG	57	98.00	5,586.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	1,687.00	3,374.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	6,200.00	18,600.00	
	NESTLE SA-REG	14,454	84.74	1,224,831.96	
	SONOVA HOLDING AG-REG	259	181.70	47,060.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	58	724.00	41,992.00	
	LONZA GROUP AG-REG	318	276.60	87,958.80	

	NOVARTIS AG-REG	10,232	86.42	884,249.44	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,317	255.80	848,488.60	
	VIFOR PHARMA AG	107	125.90	13,471.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	12,845	12.29	157,865.05	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,053	40.34	42,478.02	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	77.25	2,240.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	80	680.50	54,440.00	
	UBS GROUP AG-REG	18,838	12.99	244,705.62	
	BALOISE HOLDING AG - REG	158	155.90	24,632.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	184	419.70	77,224.80	
	SWISS RE AG	1,531	96.40	147,588.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	740	313.80	232,212.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	447	83.45	37,302.15	
	TEMENOS GROUP AG-REG	342	136.20	46,580.40	
	SWISSCOM AG-REG	146	485.70	70,912.20	
スイスフラン 小計		82,514		5,292,621.53 (583,141,040)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,099	263.40	289,476.60	
	BOLIDEN AB	1,647	214.55	353,363.85	
	ALFA LAVAL AB	1,784	196.40	350,377.60	
	ASSA ABLOY AB-B	4,422	164.90	729,187.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,979	227.25	676,977.75	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,370	208.90	495,093.00	
	EPIROC AB-A	2,606	87.00	226,722.00	
	EPIROC AB-B	1,290	81.67	105,354.30	
	SANDVIK AB	5,007	140.35	702,732.45	
	SKANSKA AB-B SHS	1,380	159.00	219,420.00	
	SKF AB-B SHARES	1,113	146.15	162,664.95	
	VOLVO AB-B SHS	8,383	120.95	1,013,923.85	
	SECURITAS AB-B SHS	933	145.20	135,471.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	732	207.50	151,890.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	337	69.06	23,273.22	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	3,998	134.16	536,371.68	
	ICA GRUPPEN AB	65	320.00	20,800.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,030	400.40	412,412.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,608	224.30	584,974.40	
	NORDEA BANK ABP	15,400	82.94	1,277,276.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	6,957	91.60	637,261.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	6,509	100.35	653,178.15	
	SWEDBANK AB - A SHARES	4,689	210.20	985,627.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	184.90	117,041.70	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	1,125	224.90	253,012.50	

	INVESTOR AB-B SHS	2,422	399.70	968,073.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	279.40	25,146.00	
	ERICSSON LM-B SHS	16,103	78.58	1,265,373.74	
	HEXAGON AB-B SHS	1,193	444.00	529,692.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	144	579.00	83,376.00	
	TELE2 AB-B SHS	2,409	113.80	274,144.20	
	TELIA CO AB	13,001	41.69	542,011.69	
スウェーデンクローナ 小計		114,458		14,801,701.43 (178,952,570)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	242	276.40	66,888.80	
	EQUINOR ASA	5,043	188.35	949,849.05	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	39.08	316,782.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	907	349.50	316,996.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	280.00	154,560.00	
	MOWI ASA	2,062	188.40	388,480.80	
	ORKLA ASA	2,391	70.78	169,234.98	
	DNB ASA	4,848	151.80	735,926.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	143.00	94,666.00	
	TELENOR ASA	3,461	169.00	584,909.00	
ノルウェークローネ 小計		28,274		3,778,294.01 (48,324,380)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	469	624.20	292,749.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,239	274.10	339,609.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	888	522.20	463,713.60	
	ISS A/S	982	190.85	187,414.70	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	10	8,080.00	80,800.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	37	8,652.00	320,124.00	
	DSV A/S	888	529.00	469,752.00	
	PANDORA A/S	432	287.10	124,027.20	
	CARLSBERG AS-B	576	735.20	423,475.20	
	COLOPLAST-B	649	609.80	395,760.20	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	550	207.80	114,290.00	
	GENMAB A/S	283	966.00	273,378.00	
	H LUNDBECK A/S	120	287.10	34,452.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,631	308.90	2,666,115.90	
	DANSKE BANK A/S	3,142	122.55	385,052.10	
	TRYG A/S	94	169.00	15,886.00	
	ORSTED A/S	877	461.90	405,086.30	
デンマーククローネ 小計		19,867		6,991,686.90 (116,201,836)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	829	26.66	22,101.14	
	OIL SEARCH LTD	6,702	7.64	51,203.28	

ORIGIN ENERGY LTD	8,373	7.21	60,369.33	
SANTOS LTD	8,669	6.19	53,661.11	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	25.88	9,239.16	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	4,022	33.85	136,144.70	
WORLEYPARSONS LTD	1,064	13.83	14,715.12	
ALUMINA LTD	7,748	2.35	18,207.80	
AMCOR LIMITED	5,343	13.62	72,771.66	
BHP GROUP LTD	14,199	32.62	463,171.38	
BLUESCOPE STEEL LTD	2,175	12.50	27,187.50	
BORAL LTD	3,791	4.93	18,689.63	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	9,510	4.76	45,267.60	
INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.49	18,643.58	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,601	15.02	24,047.02	
NEWCREST MINING LTD	3,468	22.80	79,070.40	
ORICA LTD	2,316	17.27	39,997.32	
RIO TINTO LTD	1,603	79.60	127,598.80	
SOUTH32 LTD	23,242	3.31	76,931.02	
CIMIC GROUP LTD	82	45.81	3,756.42	
BRAMBLES LTD	7,526	10.69	80,452.94	
SEEK LTD	909	17.55	15,952.95	
AURIZON HOLDINGS LTD	10,676	4.44	47,401.44	
SYDNEY AIRPORT	5,230	6.60	34,518.00	
TRANSURBAN GROUP	11,547	11.99	138,448.53	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,767	24.39	67,487.13	
CROWN RESORTS LTD	773	12.00	9,276.00	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	49	44.81	2,195.69	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	44.89	1,975.16	
TABCORP HOLDINGS LTD	11,731	4.69	55,018.39	
REA GROUP LTD	43	75.81	3,259.83	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	3.50	1,547.00	
WESFARMERS LTD	5,732	32.58	186,748.56	
COLES GROUP LTD	6,235	12.45	77,625.75	
WOOLWORTHS GROUP LTD	6,516	30.52	198,868.32	
COCA-COLA AMATIL LTD	469	8.40	3,939.60	
TREASURY WINE ESTATES LTD	3,550	15.50	55,025.00	
COCHLEAR LTD	279	195.65	54,586.35	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	611	58.00	35,438.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	1,331	22.77	30,306.87	
CSL LTD	2,157	198.86	428,941.02	
AUST AND NZ BANKING GROUP	13,810	25.92	357,955.20	
BANK OF QUEENSLAND LTD	304	10.15	3,085.60	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	368	11.15	4,103.20	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	8,365	72.51	606,546.15	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	13,169	24.58	323,694.02	
	WESTPAC BANKING CORP	16,435	25.72	422,708.20	
	AMP LTD	11,656	2.54	29,606.24	
	ASX LTD	927	64.86	60,125.22	
	CHALLENGER LTD	1,796	7.40	13,290.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,620	117.90	190,998.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	12,407	7.13	88,461.91	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	2.61	42,240.24	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	6,342	10.85	68,810.70	
	SUNCORP GROUP LTD	6,999	12.96	90,707.04	
	LENDLEASE GROUP	3,591	11.91	42,768.81	
	COMPUTERSHARE LTD	2,732	17.91	48,930.12	
	TELSTRA CORP LTD	20,785	2.95	61,315.75	
	TPG TELECOM LTD	287	7.10	2,037.70	
	AGL ENERGY LTD	3,650	21.44	78,256.00	
	APA GROUP	6,885	8.94	61,551.90	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.66	2,385.42	
オーストラリアドル 小計		338,802		5,491,364.32 (427,228,144)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	1,115	5.03	5,608.45	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,787	7.50	28,402.50	
	A2 MILK CO LTD	3,750	12.35	46,312.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,400	13.82	19,348.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	11.11	17,742.67	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	10,150	4.13	41,919.50	
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,074	3.52	3,780.48	
ニュージーランドドル 小計		22,873		163,114.10 (12,101,435)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	14,000	80.00	1,120,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	17.86	178,600.00	
	MTR CORP	8,000	42.60	340,800.00	
	MINTH GROUP LTD	2,000	26.70	53,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	7,500	42.90	321,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	25.80	12,900.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	11,000	49.00	539,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	800	13.50	10,800.00	
	SANDS CHINA LTD	14,200	35.55	504,810.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	2,000	10.04	20,080.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	7.79	15,580.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	17.60	91,520.00	
	WH GROUP LTD	45,000	6.84	307,800.00	

	BANK OF EAST ASIA	3,600	25.95	93,420.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	16,500	30.05	495,825.00	
	HANG SENG BANK LTD	3,300	177.80	586,740.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	5,900	240.20	1,417,180.00	
	AIA GROUP LTD	57,800	68.30	3,947,740.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	11,500	64.15	737,725.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	1,200	21.60	25,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	16.24	211,120.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	9,015	43.85	395,307.75	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	2,300	40.35	92,805.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	30.40	15,200.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	31,000	11.72	363,320.00	
	SINO LAND CO	18,000	14.02	252,360.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	7,200	126.30	909,360.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,700	91.25	155,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	29.05	145,250.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	22.90	45,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	8,000	52.15	417,200.00	
	WHEELOCK & CO LTD	3,400	48.30	164,220.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	16,000	11.74	187,840.00	
	PCCW LTD	4,000	4.73	18,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	62.40	274,560.00	
	CLP HOLDINGS LTD	7,500	92.00	690,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	8.18	4,090.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	40,800	16.98	692,784.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	8,000	53.65	429,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	75.80	121,280.00	
香港ドル 小計		405,915		16,407,331.75 (229,538,571)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	7,500	6.13	45,975.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	800	2.64	2,112.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.67	44,040.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,500	1.36	2,040.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	6,700	2.24	15,008.00	
	SATS LTD	1,200	4.88	5,856.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,700	9.74	26,298.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	28,800	1.06	30,528.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	2.52	33,264.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	36.85	3,685.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,700	0.27	1,539.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,600	3.26	34,556.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	8,900	24.20	215,380.00	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	15,700	11.41	179,137.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,700	25.90	173,530.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	4,500	7.50	33,750.00	
	CAPITALAND LTD	10,200	3.29	33,558.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,600	9.03	14,448.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.63	13,923.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	15.36	19,968.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	36,500	3.06	111,690.00	
シンガポールドル 小計		178,300		1,040,285.00 (83,971,805)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,122	21.25	87,592.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	52	451.90	23,498.80	
	BANK HAPOALIM BM	5,096	24.25	123,578.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	6,884	23.85	164,183.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	110	66.08	7,268.80	
	AZRIELI GROUP	234	188.20	44,038.80	
	NICE SYSTEMS LTD	153	393.30	60,174.90	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,770	3.15	5,586.12	
イスラエルシュケル 小計		18,421		515,921.32 (15,353,818)	
合　計		5,114,629		17,232,044,110 (17,232,044,110)	

(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	32,021.78	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	457	56,325.25	
		AMERICAN TOWER CORP	2,124	351,840.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,848	60,351.36	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	702	129,834.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	654	79,179.78	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	544	9,563.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	401	37,020.32	
		CROWN CASTLE INTL CORP	2,034	227,624.94	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,057	110,023.13	
		DUKE REALTY CORP	1,542	43,854.48	
		EQUINIX INC	398	147,769.44	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,868	131,413.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	282	73,771.20	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	546	50,248.38	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	317	40,160.73	
		HCP INC	2,028	60,474.96	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	4,008	68,897.52	
		INVITATION HOMES INC	800	16,936.00	
		IRON MOUNTAIN INC	1,174	42,158.34	
		KIMCO REALTY CORP	1,097	17,990.80	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	799	35,931.03	
		MACERICH CO/THE	178	8,008.22	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	491	49,085.27	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	848	42,052.32	
		PROLOGIS INC	3,103	200,857.19	
		PUBLIC STORAGE	782	158,456.66	
		REALTY INCOME CORP	1,227	78,847.02	
		REGENCY CENTERS CORP	658	40,427.52	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	485	85,617.05	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,505	263,781.35	
		SL GREEN REALTY CORP	468	40,411.80	
		UDR INC	1,156	48,436.40	
		VENTAS INC	1,831	113,430.45	
		VEREIT INC	3,812	28,933.08	
		VORNADO REALTY TRUST	739	48,574.47	
		WELLTOWER INC	1,878	139,554.18	
		WEYERHAEUSER CO	3,208	80,745.36	
		WP CAREY INC	695	49,129.55	
		米ドル 小計	53,522	3,299,740.15 (362,212,476)	
カナダドル		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,514.84	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	130	3,218.80	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,736.81	
		カナダドル 小計	297	7,470.45 (614,369)	
ユーロ		COVIVIO	222	19,513.80	
		GECINA SA	223	26,849.20	
		ICADE	30	2,176.50	
		KLEPIERRE	1,285	36,648.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	715	107,421.60	
		ユーロ 小計	2,475	192,609.30 (23,897,035)	
英ポンド		BRITISH LAND CO PLC	4,343	24,685.61	
		HAMMERSON PLC	1,987	7,014.11	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	3,465	29,320.83	
		SEGRO PLC	5,784	37,017.60	

			15,579	98,038.15 (14,103,768)	
	英ポンド 小計				
	オーストラリアドル	DEXUS	6,106	69,913.70	
		GOODMAN GROUP	7,561	88,463.70	
		GPT GROUP	9,342	52,034.94	
		MIRVAC GROUP	19,387	44,977.84	
		SCENTRE GROUP	24,098	94,223.18	
		STOCKLAND	15,223	56,934.02	
		VICINITY CENTRES	17,168	43,950.08	
	オーストラリアドル 小計		98,885	450,497.46 (35,048,702)	
	香港ドル	LINK REIT	9,500	775,675.00	
	香港ドル 小計		9,500	775,675.00 (10,851,693)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	18,700	50,116.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,600	14,060.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	8,100	18,792.00	
		SUNTEC REIT	8,500	16,065.00	
	シンガポールドル 小計		42,900	99,033.00 (7,993,943)	
合計				454,721,986 (454,721,986)	

(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	593銘柄	97.0%	—	66.0%
	投資証券	39銘柄	—	3.0%	2.0%
カナダドル	株式	88銘柄	99.9%	—	3.8%
	投資証券	3銘柄	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式	238銘柄	98.9%	—	11.7%
	投資証券	5銘柄	—	1.1%	0.1%
英ポンド	株式	92銘柄	98.8%	—	6.3%
	投資証券	4銘柄	—	1.2%	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	92.4%	—	2.4%

	投資証券	7銘柄	—	7.6%	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	95.5%	—	1.3%
	投資証券	1銘柄	—	4.5%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	91.3%	—	0.5%
	投資証券	4銘柄	—	8.7%	0.0%
イスラエルシュケル	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。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	264,788,025
コール・ローン	3,092,862
株式	4,954,343,712
投資証券	19,334,303
派生商品評価勘定	19,136,818
未収入金	19,456
未収配当金	2,652,029
差入委託証拠金	52,274,011
流動資産合計	5,315,641,216
資産合計	5,315,641,216
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74
未払解約金	500,000
未払利息	8
その他未払費用	54
流動負債合計	500,136
負債合計	500,136
純資産の部	
元本等	
元本	4,259,682,907
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,055,458,173
元本等合計	5,315,141,080
純資産合計	5,315,141,080

	2019年 1月25日現在
負債純資産合計	5,315,641,216

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 1月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	2,079,461,070円
期中追加設定元本額	3,542,233,072円
期中一部解約元本額	1,362,011,235円
期末元本額	4,259,682,907円
期末元本の内訳※	

りそなラップ型ファンド（安定型）	399,760,018円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,645,174,383円
りそなラップ型ファンド（成長型）	486,048,086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	66,863,213円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	27,093,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	9,181,222円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	6,670,061円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,376,661,204円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	205,988,924円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,897,319円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	10,532,584円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	19,311,316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）	468,976円
２．　計算日における受益権の総数	
	4,259,682,907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	1.2478円
(10,000口当たり純資産額)	(12,478円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△291,201,849
投資証券	△2,005,151
合計	△293,207,000

(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)

（2019年 1月25日現在）　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	314,172,717	－	333,309,469	19,136,752
合計		314,172,717	－	333,309,469	19,136,752

（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 1月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	38,429	－	38,355	△74
	米ドル	38,429	－	38,355	△74
	売建	38,429	－	38,363	66
	ブラジルレアル	38,429	－	38,363	66
合計		76,858	－	76,718	△8

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	4.84	229,556.36	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	7,200	1.14	8,236.80	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,342	79.00	343,018.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	812	176.60	143,399.20	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	10,217	6.12	62,528.04	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	15,510	4.08	63,311.82	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,420	70.42	170,416.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	1,190	15.12	17,992.80	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	1,150	8.75	10,062.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	5,669	20.25	114,797.25	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,112	22.13	24,608.56	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	600	13.57	8,142.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	330	40.50	13,365.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	2,000	13.99	27,980.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	885	31.06	27,488.10	
	51JOB INC-ADR	300	68.45	20,535.00	
	DP WORLD LTD	1,270	16.09	20,434.30	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,200	30.97	37,164.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,250	73.98	92,475.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,200	29.81	95,392.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	3,350	35.29	118,221.50	
	58.COM INC-ADR	860	60.48	52,012.80	
	AUTOHOME INC-ADR	520	73.33	38,131.60	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,450	162.70	398,615.00	
	MOMO INC-SPON ADR	1,350	29.53	39,865.50	
	NETEASE INC-ADR	682	240.38	163,939.16	
	SINA CORP	630	54.61	34,404.30	
	WEIBO CORP-SPON ADR	330	54.37	17,942.10	
	YY INC-ADR	420	71.97	30,227.40	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	11,530	155.86	1,797,065.80	
	BAOZUN INC-SPN ADR	200	32.89	6,578.00	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	3,620	31.69	114,717.80	
	JD.COM INC-ADR	6,720	22.10	148,512.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,300	7.19	30,917.00	

	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	3,115	15.81	49,263.72	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,150	27.70	31,855.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	21.86	13,116.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	7,379	4.73	34,902.67	
	CREDICORP LTD	644	234.73	151,166.12	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	23,803	13.19	313,961.57	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	7,102	1.25	8,877.50	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	200	44.12	8,824.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	8,400	1.34	11,281.20	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	400	28.24	11,296.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,500	8.36	37,620.00	
米ドル 小計		202,341		5,194,216.87 (570,169,185)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	132,300	10.00	1,323,000.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	31,800	45.28	1,439,904.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	251.21	345,413.75	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	10,000	48.65	486,500.00	
	ALFA S.A.B.-A	28,900	24.00	693,600.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,000	74.24	148,480.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,400	168.74	573,716.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,970	341.03	671,829.10	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,750	191.23	334,652.50	
	ALSEA SAB DE CV	2,700	50.68	136,836.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	22,300	46.46	1,036,058.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	3,600	88.26	317,736.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	800	123.03	98,424.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	44,400	48.28	2,143,632.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	106.35	457,305.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	3,800	121.40	461,320.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	16,700	174.55	2,914,985.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,415	226.86	321,006.90	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,600	37.63	587,028.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	14,900	30.46	453,854.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	19,300	27.47	530,171.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	25,400	109.13	2,771,902.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	19,200	29.37	563,904.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	300,100	14.92	4,477,492.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	5,300	76.27	404,231.00	
メキシコペソ 小計		713,310		23,692,980.25 (136,708,496)	
ブラジルレアル	COSAN SA	700	43.44	30,408.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	64,200	25.54	1,639,668.00	

ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3,400	57.71	196,214.00	
BRASKEM SA-PREF A	1,600	49.45	79,120.00	
GERDAU SA-PREF	10,100	15.99	161,499.00	
KLABIN SA - UNIT	6,900	18.84	129,996.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	5,407	47.95	259,265.65	
VALE SA	28,100	56.15	1,577,815.00	
EMBRAER SA	5,400	19.67	106,218.00	
WEG SA	6,950	18.82	130,799.00	
CCR SA	11,700	14.28	167,076.00	
LOCALIZA RENT A CAR	4,900	32.22	157,878.00	
RUMO SA	10,800	19.31	208,548.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	12,900	11.44	147,576.00	
B2W CIA DIGITAL	900	45.61	41,049.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	7,300	20.46	149,358.00	
LOJAS RENNER S.A.	7,000	44.44	311,080.00	
MAGAZINE LUIZA SA	700	167.48	117,236.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	3,500	26.66	93,310.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	4,900	20.01	98,049.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1,500	94.78	142,170.00	
RAIA DROGASIL SA	2,300	62.29	143,267.00	
AMBEV SA	43,400	17.16	744,744.00	
BRF SA	5,100	24.19	123,369.00	
JBS SA	9,400	14.47	136,018.00	
M DIAS BRANCO SA	500	47.06	23,530.00	
NATURA COSMETICOS SA	1,600	46.45	74,320.00	
HYPERA SA	2,900	32.47	94,163.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	37,950	43.15	1,637,542.50	
BANCO DO BRASIL S.A.	7,800	48.95	381,810.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,900	49.57	193,323.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	43,000	37.49	1,612,070.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	38,900	13.20	513,480.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	18,100	31.65	572,865.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	6,400	29.99	191,936.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,300	87.93	114,309.00	
PORTO SEGURO SA	700	54.64	38,248.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	2,800	31.01	86,828.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	9,300	14.26	132,618.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,500	25.10	87,850.00	
CIELO SA	11,300	10.68	120,684.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	47.77	195,857.00	
TIM PARTICIPACOES SA	9,600	12.55	120,480.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,900	36.95	144,105.00	

	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,400	14.49	107,226.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,200	43.18	94,996.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	875	42.00	36,750.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,700	83.99	142,783.00	
ブラジルレアル 小計		478,782		13,809,504.15 (401,718,475)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	3,614	9,050.00	32,706,700.00	
	EMPRESAS CMPC SA	11,717	2,380.00	27,886,460.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,121	28,400.00	31,836,400.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	7,860.00	23,273,460.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	6,754	5,255.00	35,492,270.00	
	CENCOSUD SA	13,424	1,325.00	17,786,800.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,479	9,195.10	13,599,552.90	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	2,698.00	7,689,300.00	
	BANCO DE CHILE	230,670	102.98	23,754,396.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	386	46,740.00	18,041,640.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	612,457	53.55	32,797,072.35	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	6.49	12,201,200.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	6,170.00	6,176,170.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	31,578	394.00	12,441,732.00	
	COLBUN SA	83,944	152.00	12,759,488.00	
	ENEL AMERICAS SA	223,858	134.99	30,218,591.42	
	ENEL CHILE SA	188,505	69.89	13,174,614.45	
チリペソ 小計		3,296,319		351,835,847.72 (57,525,161)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	36,116	2,835.00	102,388,860.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	2,000	7,700.00	15,400,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	18,100.00	52,490,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,900	33,840.00	64,296,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,129	34,500.00	142,450,500.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	30,000	1,065.00	31,950,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,568	33,480.00	85,976,640.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	480	31,520.00	15,129,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,406	14,180.00	62,477,080.00	
コロンビアペソ 小計		84,499		572,558,680.00 (19,810,530)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	604	21.55	13,016.20	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	280	20.50	5,740.00	
	OPAP SA	2,215	8.55	18,938.25	
	JUMBO SA	1,110	13.76	15,273.60	
	ALPHA BANK AE	14,218	0.97	13,848.33	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,403	11.10	26,673.30	

ユーロ 小計		20,830		93,489.68 (11,599,264)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,237	138.00	170,706.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	13,819	8.51	117,599.69	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	3,410	5.78	19,709.80	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,600	25.10	90,360.00	
	KOC HOLDING AS	7,765	17.10	132,781.50	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	3,500	5.73	20,055.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	27.04	40,560.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	14.76	81,180.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	57.70	25,965.00	
	ARCELIK AS	1,000	18.20	18,200.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,535	93.15	142,985.25	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	21.20	40,704.00	
	AKBANK T.A.S.	21,716	6.52	141,588.32	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	22,540	9.11	205,339.40	
	TURKIYE HALK BANKASI	6,000	8.09	48,540.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,000	5.45	65,400.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,100	8.67	61,557.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,100	14.48	160,728.00	
トルコリラ 小計		125,692		1,583,958.96 (32,993,865)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	902.00	675,598.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,600	73.70	339,020.00	
	CEZ AS	1,553	548.50	851,820.50	
チェココルナ 小計		6,902		1,866,438.50 (8,996,233)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,230	3,280.00	10,594,400.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,233	5,665.00	6,984,945.00	
	OTP BANK PLC	1,985	11,650.00	23,125,250.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,448		40,704,595.00 (15,842,228)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	1,113	95.66	106,469.58	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,775	107.95	299,561.25	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	12,397	7.54	93,473.38	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	450	66.50	29,925.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,002	91.60	91,783.20	
	CCC SA	371	182.40	67,670.40	
	LPP SA	13	8,615.00	111,995.00	
	CD PROJEKT SA	659	190.00	125,210.00	
	CYFROWY POLSAT SA	3,290	23.38	76,920.20	
	DINO POLSKA SA	350	103.30	36,155.00	

	ALIOR BANK SA	690	55.50	38,295.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	250	70.80	17,700.00	
	BANK MILLENNIUM SA	2,800	9.37	26,236.00	
	BANK PEKAO SA	1,633	113.80	185,835.40	
	MBANK SA	65	469.40	30,511.00	
	PKO BANK POLSKI SA	8,156	41.60	339,289.60	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	345	383.20	132,204.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,892	45.30	221,607.60	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	5.60	23,520.00	
	PGE SA	8,891	10.44	92,822.04	
ポーランドズロチ 小計		54,342		2,147,183.65 (62,139,494)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	7,000	3.28	22,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	18,000	7.67	138,060.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	222,000	6.25	1,387,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	31,000	19.36	600,160.00	
	CNOOC LTD	156,000	12.80	1,996,800.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	30,000	8.28	248,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	182,000	4.95	900,900.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	18,000	7.00	126,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	48,000	2.79	133,920.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	4,000	5.56	22,240.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	12,000	39.40	472,800.00	
	BBMG CORP-H	25,000	2.56	64,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	27,500	5.05	138,875.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	45,000	2.92	131,400.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	38,000	5.87	223,060.00	
	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	16,000	5.16	82,560.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	24,000	7.28	174,720.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	3.81	65,532.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.36	140,400.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	19,000	6.93	131,670.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	24,000	3.57	85,680.00	
	MMG LTD	32,000	2.76	88,320.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	17,000	7.61	129,370.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	3.64	123,760.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,000	7.51	90,120.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	2.76	160,080.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	5.20	135,200.00	
	BOC AVIATION LTD	2,200	63.30	139,260.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	7.67	322,140.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	15,000	24.90	373,500.00	

CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	19,500	10.76	209,820.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	36,000	7.10	255,600.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	14,000	7.05	98,700.00	
CITIC LTD	53,000	11.86	628,580.00	
CRRC CORP LTD - H	40,000	7.68	307,200.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	10.90	267,050.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	67,500	1.87	126,225.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	17.48	139,840.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	2.04	65,280.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	14,000	2.69	37,660.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	16.34	32,680.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	7.53	131,775.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,500	12.60	119,700.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	20,000	9.77	195,400.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	7.86	47,160.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	5,300	43.05	228,165.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	33,000	7.56	249,480.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	4,000	11.60	46,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	6.73	67,300.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	7.56	136,080.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	18,000	7.37	132,660.00	
CAR INC	9,000	6.20	55,800.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	4.76	19,040.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	15.42	215,880.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	5.33	127,920.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	4.27	42,700.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	34,500	3.17	109,365.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	8.35	150,300.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	11.44	137,280.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	9,500	15.28	145,160.00	
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	3.56	53,400.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	8.05	144,900.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,000	4.85	58,200.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	28,000	7.10	198,800.00	
BYD CO LTD-H	6,000	46.20	277,200.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	26,000	3.86	100,360.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	26,000	8.09	210,340.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	26.40	137,280.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	45,000	12.74	573,300.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	20,500	5.34	109,470.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	8.63	241,640.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	11.22	123,420.00	

ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,000	37.45	374,500.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	12,000	21.00	252,000.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	180,000	0.25	45,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	7,000	91.85	642,950.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	12,000	2.28	27,360.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.31	183,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	1,800	39.15	70,470.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	50,700	330.20	16,741,140.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	43,000	0.67	28,810.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	14.42	28,840.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	23,500	7.93	186,355.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	24,000	2.80	67,200.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	25,000	25.20	630,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	14,000	27.90	390,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	7,500	5.15	38,625.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	10.56	190,080.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	33.95	67,900.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	5,000	6.88	34,400.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	47,000	6.10	286,700.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	3,000	22.35	67,050.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	6,500	57.45	373,425.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	32,000	7.05	225,600.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	20,000	6.36	127,200.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,200	16.70	103,540.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,800	35.25	380,700.00	
3SBIO INC	13,000	11.80	153,400.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	10,000	7.86	78,600.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	17,500	11.24	196,700.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	5.08	121,920.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	42,000	13.08	549,360.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	11.60	69,600.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	7,500	5.67	42,525.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	5,500	23.30	128,150.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	17,000	1.60	27,200.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	64,500	6.09	392,805.00	
SSY GROUP LTD	10,000	6.38	63,800.00	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	4,000	10.54	42,160.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,500	63.05	283,725.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	251,000	3.60	903,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	698,000	3.50	2,443,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	81,000	6.43	520,830.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	83,000	4.92	408,360.00	

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	851,000	6.70	5,701,700.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	11,000	3.62	39,820.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	33,500	31.85	1,066,975.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	58,600	5.76	337,536.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	10,000	4.48	44,800.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	612,000	5.84	3,574,080.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	29,000	4.42	128,180.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	98,000	1.95	191,100.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	8,000	26.10	208,800.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	10,000	14.10	141,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	37,000	4.00	148,000.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.49	153,470.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	10,800	15.16	163,728.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	22,000	15.44	339,680.00	
FAR EAST HORIZON LTD	22,000	7.81	171,820.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	10,600	11.60	122,960.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	16.86	128,136.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	8.59	271,444.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,400	13.96	228,944.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	64,000	18.90	1,209,600.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	23,600	26.75	631,300.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	1.70	93,500.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,800	20.40	301,920.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	7,700	29.75	229,075.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	69,000	3.13	215,970.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	62,000	7.89	489,180.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	46,000	72.25	3,323,500.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,700	27.15	46,155.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	9.46	170,280.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	22,000	22.85	502,700.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	52,000	3.67	190,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	32,000	27.45	878,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	26,000	29.65	770,900.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	12,300	28.25	347,475.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	26,000	4.59	119,340.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	64,000	9.74	623,360.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	6,000	6.21	37,260.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	8,000	6.26	50,080.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	14.44	167,504.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	10,000	3.70	37,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	15,000	2.37	35,550.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	7.52	30,080.00	

LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	16,000	10.30	164,800.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	14,500	22.90	332,050.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	10,000	2.71	27,100.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	12,000	20.55	246,600.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.94	54,320.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	13,000	3.65	47,450.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	3.01	36,120.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	20,000	27.05	541,000.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	24,000	1.57	37,680.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	12,000	3.65	43,800.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	16,000	7.53	120,480.00	
KINGSOFT CORP LTD	5,000	14.58	72,900.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	20.05	180,450.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	6,500	46.85	304,525.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,500	9.20	32,200.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	6.14	92,100.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	7,000	27.05	189,350.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	15,500	8.19	126,945.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	21.10	71,740.00	
LENOVO GROUP LTD	70,000	5.68	397,600.00	
MEITU INC	7,000	2.41	16,870.00	
SUNNY OPTICAL TECH	5,800	73.00	423,400.00	
ZTE CORP-H	4,600	15.74	72,404.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	7.19	86,280.00	
CHINA MOBILE LTD	54,000	82.35	4,446,900.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	126,000	4.30	541,800.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	332,000	1.68	557,760.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	9.03	505,680.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	5,000	44.55	222,750.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	56,000	4.43	248,080.00	
CGN POWER CO LTD-H	105,000	2.03	213,150.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	16,200	25.20	408,240.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	6.05	193,600.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.98	116,820.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,000	31.85	254,800.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	18,000	15.94	286,920.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	2.01	64,320.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	7,000	75.55	528,850.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	28,000	15.38	430,640.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	3.74	74,800.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	42,000	5.21	218,820.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	58,000	2.37	137,460.00	

	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	6.29	69,190.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	16.58	49,740.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	19,000	7.37	140,030.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	10,000	3.41	34,100.00	
香港ドル 小計		8,157,700		80,719,233.00 (1,129,262,069)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	37,000	3.05	112,850.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	900	26.08	23,472.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,800	8.52	194,256.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,400	4.20	68,880.00	
	GAMUDA BHD	13,300	2.68	35,644.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,800	9.85	27,580.00	
	IJM CORP BHD	23,600	1.84	43,424.00	
	SIME DARBY BERHAD	17,000	2.29	38,930.00	
	AIRASIA GROUP BHD	7,500	3.08	23,100.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	5,300	8.15	43,195.00	
	MISC BHD	9,000	6.67	60,030.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.85	26,180.00	
	GENTING BHD	20,400	6.72	137,088.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	28,900	3.18	91,902.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	1,800	38.14	68,652.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,700	34.54	58,718.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.02	30,060.00	
	IOI CORP BHD	19,700	4.66	91,802.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,300	24.62	105,866.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	148.30	88,980.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,820	18.00	104,760.00	
	QL RESOURCES BHD	2,400	6.86	16,464.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,600	5.15	121,540.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	13,600	5.62	76,432.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.67	136,647.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	14,600	4.92	71,832.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	6,500	4.23	27,495.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	19,000	4.53	86,070.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	43,700	5.65	246,905.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,500	20.80	135,200.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,500	19.88	29,820.00	
	MALAYAN BANKING BHD	35,200	9.62	338,624.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	25,000	24.82	620,500.00	
	RHB BANK BHD	5,500	5.48	30,140.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	11,000	1.59	17,490.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	11,900	1.16	13,804.00	

	SP SETIA BHD	7,000	2.51	17,570.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,200	4.03	121,706.00	
	DIGI.COM BHD	30,200	4.53	136,806.00	
	MAXIS BHD	22,900	5.76	131,904.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	5,000	2.72	13,600.00	
	PETRONAS GAS BHD	4,900	17.70	86,730.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	28,500	13.62	388,170.00	
	YTL CORP BHD	19,380	1.14	22,093.20	
マレーシアリンギット 小計		640,800		4,362,911.20 (115,486,259)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	13,000	16.90	219,700.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	6,700	46.50	311,550.00	
	IRPC PCL - NVDR	51,600	5.90	304,440.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	12,900	124.50	1,606,050.00	
	PTT PCL-NVDR	94,700	49.00	4,640,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	11,200	71.50	800,800.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	47.75	787,875.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	21,200	69.00	1,462,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,900	450.00	1,305,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	34,800	68.25	2,375,100.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	78,900	10.50	828,450.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	63,000	10.00	630,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	26,100	37.75	985,275.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	42,000	15.10	634,200.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	68.75	226,875.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	12,000	48.00	576,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	45,300	77.00	3,488,100.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	37,900	27.00	1,023,300.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	9,000	18.50	166,500.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	37,200	23.60	877,920.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	2,800	185.00	518,000.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	2,700	216.00	583,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	15,800	192.50	3,041,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	41,400	20.00	828,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	16,800	130.00	2,184,000.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	85,000	2.20	187,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,800	47.50	370,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	9,100	77.00	700,700.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	30,000	10.40	312,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,200	69.25	152,350.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	9,600	177.00	1,699,200.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	102,100	4.82	492,122.00	

	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	900	256.00	230,400.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	2,200	91.50	201,300.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	5,200	85.00	442,000.00	
タイバーツ 小計		953,800		35,192,507.00 (121,766,074)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	14,500	65.00	942,500.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	18,000	14.26	256,680.00	
	DMCI HOLDINGS INC	18,000	12.00	216,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	21,700	66.00	1,432,200.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,940	990.00	1,920,600.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,500	107.40	268,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	315.80	1,421,100.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,510	149.50	1,421,745.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	7,200	92.80	668,160.00	
	BDO UNIBANK INC	19,610	135.00	2,647,350.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,320	84.00	1,118,880.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	176.00	246,400.00	
	AYALA CORPORATION	2,480	912.50	2,263,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	704	1,040.00	732,160.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.99	723,550.00	
	AYALA LAND INC	71,900	44.35	3,188,765.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	5.27	516,460.00	
	ROBINSONS LAND CO	22,000	23.15	509,300.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	100,100	39.70	3,973,970.00	
	GLOBE TELECOM INC	430	2,116.00	909,880.00	
	PLDT INC	870	1,286.00	1,118,820.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	38.10	609,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,400	380.00	532,000.00	
フィリピンペソ 小計		591,064		27,637,620.00 (57,486,249)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,380.00	208,242,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	4,390.00	175,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	16,100	26,625.00	428,662,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	12,725.00	342,302,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,900	19,900.00	276,610,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	13,075.00	196,125,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	30,700	13,200.00	405,240,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	4,870.00	90,095,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	182,800	8,425.00	1,540,090,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	36,000	1,980.00	71,280,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	71,900	8,175.00	587,782,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,700	82,550.00	387,985,000.00	

	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	3,710.00	337,981,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	15,500	10,850.00	168,175,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	30,000	7,775.00	233,250,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	14,300	49,075.00	701,772,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	220,000	1,600.00	352,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	85,600	27,300.00	2,336,880,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	22,000	9,100.00	200,200,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	170,000	7,475.00	1,270,750,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	71,300	9,000.00	641,700,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	478,400	3,790.00	1,813,136,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	2,680.00	69,680,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	1,395.00	92,070,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	705.00	68,385,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	433,400	3,860.00	1,672,924,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	13,000	4,770.00	62,010,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	81,000	2,390.00	193,590,000.00	
インドネシアルピア 小計		2,522,000		14,924,518,000.00 (116,411,240)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	590	52,400.00	30,916,000.00	
	S-OIL CORP	428	97,800.00	41,858,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	588	179,500.00	105,546,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	800	21,050.00	16,840,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	50,900.00	40,058,300.00	
	KOREA ZINC CO LTD	85	421,500.00	35,827,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	110	88,600.00	9,746,000.00	
	LG CHEM LTD	447	367,500.00	164,272,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	166	288,500.00	47,891,000.00	
	OCI CO LTD	198	96,500.00	19,107,000.00	
	POSCO	692	264,500.00	183,034,000.00	
	POSCO CHEMTECH CO LTD	291	56,900.00	16,557,900.00	
	CJ CORP	181	119,000.00	21,539,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	296	105,000.00	31,080,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	582	6,080.00	3,538,560.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	34,100.00	17,527,400.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	33,750.00	19,575,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	531	47,550.00	25,249,050.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	44,350.00	12,373,650.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	760	61,200.00	46,512,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	367	137,500.00	50,462,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	97	362,500.00	35,162,500.00	
	KCC CORP	65	322,500.00	20,962,500.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	777	34,250.00	26,612,250.00	

LG CORP	799	75,300.00	60,164,700.00	
LOTTE CORP	242	50,900.00	12,317,800.00	
POSCO DAEWOO CORP.	500	19,500.00	9,750,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	642	117,500.00	75,435,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	16,750.00	26,867,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	4,450	7,880.00	35,066,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	264	261,500.00	69,036,000.00	
S-1 CORPORATION	210	102,000.00	21,420,000.00	
CJ LOGISTICS	36	168,000.00	6,048,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	133	146,500.00	19,484,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	594	36,350.00	21,591,900.00	
PAN OCEAN CO LTD	950	4,705.00	4,469,750.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	637	42,050.00	26,785,850.00	
HANON SYSTEMS	2,300	12,300.00	28,290,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	617	214,500.00	132,346,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,422	130,000.00	184,860,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	85,000.00	20,400,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,425	36,650.00	88,876,250.00	
COWAY CO LTD	400	81,200.00	32,480,000.00	
FILA KOREA LTD	546	47,950.00	26,180,700.00	
HLB INC	309	71,700.00	22,155,300.00	
LG ELECTRONICS INC	892	65,200.00	58,158,400.00	
KANGWON LAND INC	1,025	33,500.00	34,337,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	320	23,150.00	7,408,000.00	
KAKAO CORP	472	102,000.00	48,144,000.00	
NAVER CORP	1,234	129,500.00	159,803,000.00	
NCSOFT CORP	162	473,500.00	76,707,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	123	106,500.00	13,099,500.00	
PEARL ABYSS CORP	40	191,500.00	7,660,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	208,600.00	23,571,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	254	77,900.00	19,786,600.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	183	93,500.00	17,110,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	83	193,500.00	16,060,500.00	
SHINSEGAE INC	79	265,500.00	20,974,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	99	180,500.00	17,869,500.00	
E-MART INC	200	192,500.00	38,500,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	101	35,750.00	3,610,750.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	85	338,500.00	28,772,500.00	
KT&G CORP	1,063	103,000.00	109,489,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	185	114,500.00	21,182,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	784,000.00	10,192,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	323	178,500.00	57,655,500.00	

AMOREPACIFIC GROUP	205	65,800.00	13,489,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	94	1,140,000.00	107,160,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	533	69,800.00	37,203,400.00	
CELLTRION INC	732	208,000.00	152,256,000.00	
CELLTRION PHARM INC	60	60,800.00	3,648,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	66	432,000.00	28,512,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	77	73,200.00	5,636,400.00	
MEDY-TOX INC	46	521,000.00	23,966,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	154	401,500.00	61,831,000.00	
SILLAJEN INC	564	70,800.00	39,931,200.00	
VIROMED CO LTD	138	261,700.00	36,114,600.00	
YUHAN CORP	99	234,000.00	23,166,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	1,900	7,060.00	13,414,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	750	8,400.00	6,300,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	2,731	38,300.00	104,597,300.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,691	13,850.00	23,420,350.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	3,501	45,900.00	160,695,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,758	41,950.00	157,648,100.00	
WOORI BANK	4,112	14,800.00	60,857,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	434	64,900.00	28,166,600.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,101	7,490.00	30,716,490.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	620	13,800.00	8,556,000.00	
SAMSUNG CARD CO	180	34,600.00	6,228,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	698	34,500.00	24,081,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	68,800.00	33,161,600.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	4,320.00	17,811,360.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	720	37,850.00	27,252,000.00	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	200	30,050.00	6,010,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	282	272,000.00	76,704,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	651	91,500.00	59,566,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	321	213,500.00	68,533,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	2,274	19,850.00	45,138,900.00	
LG INNOTEK CO LTD	160	95,400.00	15,264,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	524	99,000.00	51,876,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	45,000	43,050.00	1,937,250,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	5,200	35,900.00	186,680,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	500	225,500.00	112,750,000.00	
KT CORP	75	29,200.00	2,190,000.00	
LG UPLUS CORP	886	16,850.00	14,929,100.00	
SK TELECOM	190	271,000.00	51,490,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,125	32,800.00	69,700,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	225	52,800.00	11,880,000.00	

	SK HYNIX INC	5,155	70,500.00	363,427,500.00	
韓国ウォン 小計		132,917		7,045,576,710.00 (687,648,286)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	107.50	1,290,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	36.00	792,000.00	
	CHINA STEEL CORP	115,000	25.10	2,886,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	32,000	105.00	3,360,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	38,000	100.00	3,800,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	47,000	74.60	3,506,200.00	
	TAIWAN CEMENT	43,100	36.40	1,568,840.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	339.50	339,500.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	32,000	29.60	947,200.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,050	240.50	493,025.00	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	10.70	181,900.00	
	EVA AIRWAYS CORP	9,733	14.80	144,048.40	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,550	12.00	138,600.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	21,000	30.90	648,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	19,000	42.60	809,400.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	343.00	692,860.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,000	187.50	375,000.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	4,000	35.65	142,600.00	
	GIANT MANUFACTURING	2,000	158.00	316,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	260.00	260,000.00	
	POU CHEN	23,000	36.25	833,750.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	81.70	196,080.00	
	TATUNG CO LTD	21,000	26.65	559,650.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	283.50	567,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	321.00	1,605,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	3,120	49.95	155,844.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	44,000	72.40	3,185,600.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	175.00	175,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	41,348	18.00	744,264.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	107,000	9.92	1,061,440.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	159,000	20.40	3,243,600.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	90,830	21.15	1,921,054.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	92,477	20.20	1,868,035.40	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	72,810	18.30	1,332,423.00	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	100,000	26.60	2,660,000.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	83,995	10.25	860,948.75	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	86,630	13.30	1,152,179.00	
	TAIWAN BUSINESS BANK	22,139	10.85	240,208.15	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	83,754	18.50	1,549,449.00	

CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,200	109.50	1,226,400.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	96,000	16.80	1,612,800.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	70,000	43.55	3,048,500.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	26.60	700,112.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	57,000	44.05	2,510,850.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	99,835	8.57	855,585.95	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	10,000	47.45	474,500.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	4,320	46.35	200,232.00	
ACER INC	31,000	19.05	590,550.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	230.00	690,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	227.50	1,592,500.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	12.45	1,070,700.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	6,000	225.00	1,350,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	9,015	68.50	617,527.50	
COMPAL ELECTRONICS	49,000	17.65	864,850.00	
DELTA ELECTRONICS INC	19,000	152.50	2,897,500.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	10,000	58.40	584,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	115,800	70.00	8,106,000.00	
INNOLUX CORP	91,000	10.35	941,850.00	
INVENTEC CORP	27,000	22.80	615,600.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	500	3,725.00	1,862,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	22,000	44.15	971,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	4,000	75.60	302,400.00	
PEGATRON CORP	19,000	49.00	931,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	26,000	55.50	1,443,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	11,000	37.00	407,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	164.00	492,000.00	
WISTRON CORP	21,951	20.50	449,995.50	
WPG HOLDINGS LTD	11,960	38.45	459,862.00	
YAGEO CORPORATION	2,198	315.00	692,370.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	76.40	458,400.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	33,000	107.00	3,531,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	15,000	72.30	1,084,500.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	15,000	109.00	1,635,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	32,000	58.70	1,878,400.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	264.00	528,000.00	
MEDIATEK INC	14,000	244.50	3,423,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	59.60	715,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	150.00	900,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	247.50	247,500.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	8,000	68.60	548,800.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	156.00	780,000.00	

	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	219,000	222.50	48,727,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	11.70	1,333,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	10,000	61.70	617,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	142.00	284,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	37,000	14.00	518,000.00	
新台湾ドル 小計		2,956,055		152,375,684.15 (540,933,678)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,346	353.95	2,600,116.70	
	COAL INDIA LTD	6,701	223.85	1,500,018.85	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,166	243.10	1,742,054.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	16,201	136.80	2,216,296.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	10,649	141.70	1,508,963.30	
	PETRONET LNG LTD	2,982	226.30	674,826.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	25,124	1,247.45	31,340,933.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,028	211.20	850,713.60	
	ASIAN PAINTS LTD	2,681	1,401.85	3,758,359.85	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,105	785.80	2,439,909.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	11,115	205.05	2,279,130.75	
	JSW STEEL LTD	7,943	283.65	2,253,031.95	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	839	1,109.35	930,744.65	
	SHREE CEMENT LTD	58	16,170.55	937,891.90	
	TATA STEEL LTD	3,407	460.75	1,569,775.25	
	ULTRATECH CEMENT LTD	895	3,790.70	3,392,676.50	
	UPL LTD	3,443	747.35	2,573,126.05	
	VEDANTA LTD	12,337	193.50	2,387,209.50	
	ASHOK LEYLAND LTD	8,200	84.80	695,360.00	
	HAVELLS INDIA LTD	2,526	702.60	1,774,767.60	
	LARSEN & TOUBRO LTD	4,340	1,295.35	5,621,819.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	5,155	380.95	1,963,797.25	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,068	664.05	709,205.40	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	850	1,178.55	1,001,767.50	
	BAJAJ AUTO LTD	800	2,651.65	2,121,320.00	
	BHARAT FORGE LTD	1,306	475.80	621,394.80	
	BOSCH LTD	73	19,155.40	1,398,344.20	
	EICHER MOTORS LTD	124	20,115.60	2,494,334.40	
	HERO MOTOCORP LTD	370	2,790.20	1,032,374.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	6,761	697.30	4,714,445.30	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	950	7,040.60	6,688,570.00	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,741	154.05	1,038,451.05	
	TATA MOTORS LTD	14,842	175.40	2,603,286.80	
	PAGE INDUSTRIES LTD	54	23,172.95	1,251,339.30	
	TITAN CO LTD	2,932	969.65	2,843,013.80	

ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	4,637	433.85	2,011,762.45	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,191	1,391.55	1,657,336.05	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	564	3,216.85	1,814,303.40	
ITC LTD	29,494	278.90	8,225,876.60	
NESTLE INDIA LTD	220	11,433.40	2,515,348.00	
UNITED SPIRITS LTD	2,147	571.75	1,227,547.25	
DABUR INDIA LTD	5,088	430.40	2,189,875.20	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,395	790.60	2,684,087.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	5,625	1,759.50	9,897,187.50	
MARICO LTD	4,549	373.95	1,701,098.55	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,579	788.80	2,034,315.20	
CADILA HEALTHCARE LTD	870	346.10	301,107.00	
CIPLA LTD	3,351	500.70	1,677,845.70	
DIVI'S LABORATORIES LTD	700	1,493.25	1,045,275.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,084	2,668.45	2,892,599.80	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	600	649.75	389,850.00	
LUPIN LTD	1,640	868.40	1,424,176.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	800	2,307.75	1,846,200.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	7,697	423.00	3,255,831.00	
AXIS BANK LTD	16,090	663.65	10,678,128.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	14,363	1,971.10	28,310,909.30	
ICICI BANK LTD	21,463	364.80	7,829,702.40	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	2,636	773.50	2,038,946.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,382	469.60	648,987.20	
STATE BANK OF INDIA	16,376	288.05	4,717,106.80	
YES BANK LTD	15,733	215.40	3,388,888.20	
BAJAJ FINANCE LTD	1,607	2,635.65	4,235,489.55	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,300	422.25	971,175.00	
REC LTD	3,000	122.50	367,500.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,483	1,114.55	1,652,877.65	
BAJAJ FINSERV LTD	358	6,407.30	2,293,813.40	
HCL TECHNOLOGIES LTD	5,023	946.45	4,754,018.35	
INFOSYS LTD	30,685	732.00	22,461,420.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7,869	1,901.55	14,963,296.95	
TECH MAHINDRA LTD	4,321	727.75	3,144,607.75	
WIPRO LTD	10,349	351.75	3,640,260.75	
BHARTI AIRTEL LTD	12,772	301.65	3,852,673.80	
BHARTI INFRATEL LTD	2,400	263.00	631,200.00	
VODAFONE IDEA LTD	14,000	34.05	476,700.00	
GAIL INDIA LTD	7,475	333.60	2,493,660.00	
NTPC LTD	18,566	140.05	2,600,168.30	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	14,819	186.75	2,767,448.25	

	TATA POWER CO LTD	14,068	74.55	1,048,769.40	
インドルピー 小計		498,481		282,288,739.30 (440,370,433)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	1,800	147.70	265,860.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	1,440	42.00	60,480.00	
	MASRAF AL RAYAN	3,700	40.70	150,590.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,201	158.00	189,758.00	
	QATAR NATIONAL BANK	4,180	198.50	829,730.00	
	QATAR INSURANCE CO	1,130	39.90	45,087.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	2,143	40.00	85,720.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	7,870	15.09	118,758.30	
	OOREDOO QPSC	580	75.77	43,946.60	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	500	187.88	93,940.00	
カタールリアル 小計		24,544		1,883,869.90 (56,911,709)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,451	145.92	357,649.92	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	320	593.84	190,028.80	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	3,882	175.92	682,921.44	
	GOLD FIELDS LTD	8,800	51.40	452,320.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	750	288.94	216,705.00	
	MONDI LTD	1,146	330.26	378,477.96	
	SAPPI LIMITED	5,098	74.91	381,891.18	
	SASOL LTD	4,803	410.38	1,971,055.14	
	BIDVEST GROUP LTD	3,162	201.40	636,826.80	
	NASPERS LTD-N SHS	3,912	3,030.00	11,853,360.00	
	MR PRICE GROUP LTD	2,412	210.50	507,726.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	170.66	401,392.32	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	4,631	82.90	383,909.90	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	9,500	50.27	477,565.00	
	BID CORP LTD	3,032	279.33	846,928.56	
	CLICKS GROUP LTD	2,381	191.16	455,151.96	
	PICK N PAY STORES LTD	2,165	72.98	158,001.70	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,022	185.62	746,563.64	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	1,400	207.99	291,186.00	
	TIGER BRANDS LTD	1,537	285.40	438,659.80	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	27.14	346,387.82	
	NETCARE LTD	7,437	25.77	191,651.49	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,629	154.00	558,866.00	
	ABSA GROUP LTD	6,561	175.50	1,151,455.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	391	1,150.00	449,650.00	
	NEDBANK GROUP LTD	3,670	280.14	1,028,113.80	
	STANDARD BANK GROUP LTD	11,461	188.00	2,154,668.00	

	FIRSTRAND LTD	28,707	69.52	1,995,710.64	
	INVESTEC LTD	2,200	88.09	193,798.00	
	PSG GROUP LTD	1,100	248.00	272,800.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,442	202.72	292,322.24	
	REMGRO LTD	4,835	206.62	999,007.70	
	RMB HOLDINGS LTD	6,716	82.71	555,480.36	
	DISCOVERY LTD	3,279	162.03	531,296.37	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	800	109.86	87,888.00	
	MMI HOLDINGS LTD	3,900	17.04	66,456.00	
	OLD MUTUAL LTD	44,402	22.50	999,045.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,300	36.74	194,722.00	
	SANLAM LTD	14,883	84.00	1,250,172.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	3,590	118.41	425,091.90	
	MTN GROUP LTD	15,190	84.01	1,276,111.90	
	TELKOM SA SOC LTD	2,500	65.23	163,075.00	
	VODACOM GROUP LTD	5,505	121.87	670,894.35	
南アフリカランド 小計		258,017		37,682,985.19 (301,840,711)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	21,748	9.15	198,994.20	
	DUBAI ISLAMIC BANK	13,700	5.14	70,418.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	26,833	14.70	394,445.10	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	26,700	1.53	40,851.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	8,000	1.19	9,520.00	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	9,000	3.75	33,750.00	
	EMAAR MALLS PJSC	9,000	1.57	14,130.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	34,480	4.11	141,712.80	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	16,189	16.88	273,270.32	
アラブディルハム 小計		165,650		1,177,091.42 (35,230,346)	
オフショア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	3,200	5.43	17,376.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	500	19.39	9,695.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	5.31	2,655.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	2,100	7.28	15,288.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	700	8.06	5,642.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	7.03	2,109.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	5.44	2,176.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	600	5.16	3,096.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	500	30.74	15,370.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	2,000	6.87	13,740.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.48	3,132.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	800	3.86	3,088.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	8.88	4,440.00	

HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	300	13.07	3,921.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	3.07	4,605.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	3,900	1.51	5,889.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	13.14	3,942.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	22.64	4,528.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.41	2,564.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	3.57	2,499.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	10.45	4,180.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	300	29.56	8,868.00	
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	4.12	2,060.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	5.18	3,108.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	29.48	5,896.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.02	3,030.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	200	29.49	5,898.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	9.45	3,780.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.19	3,276.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,800	2.97	5,346.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	200	22.84	4,568.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	14.10	5,640.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	31.36	3,136.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	13.97	1,397.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	10.60	3,180.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.16	3,080.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	200	11.47	2,294.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.56	2,780.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	1,300	10.00	13,000.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	4,900	4.43	21,707.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	18.41	1,841.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,800	5.89	28,272.00	
CRRC CORP LTD-A	2,200	8.46	18,612.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	8.58	5,148.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	200	19.15	3,830.00	
HAN'S LASER TECHNOLOGY IN-A	100	30.08	3,008.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	600	15.10	9,060.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	3.00	5,400.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	500	19.60	9,800.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,000	5.08	5,080.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	800	8.86	7,088.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	4.97	3,976.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	6.63	1,989.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.15	3,260.00	
TBEA CO LTD-A	400	7.24	2,896.00	

WEICHAI POWER CO LTD-A	800	8.33	6,664.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	3.24	3,564.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	7.35	2,205.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.44	4,576.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	25.66	5,132.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	11.82	2,364.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	3.72	3,348.00	
TUS-SOUND ENVIRONMEN-RES A	200	10.21	2,042.00	
AIR CHINA LTD-A	800	7.95	6,360.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.98	6,474.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	6.96	7,656.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.40	3,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.48	5,376.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	2,100	8.45	17,745.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	3.48	3,480.00	
S F HOLDING CO LTD-A	200	30.95	6,190.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	100	47.33	4,733.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	5.22	5,220.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	32.47	3,247.00	
BYD CO LTD -A	200	48.52	9,704.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	200	22.61	4,522.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	7.34	3,670.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	22.97	4,594.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	10.30	2,060.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	300	20.24	6,072.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	900	25.70	23,130.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	14.37	1,437.00	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	5.55	2,220.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	18.31	1,831.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	400	39.38	15,752.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	24.96	2,496.00	
HEILAN HOME CO LTD -A	200	9.00	1,800.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	900	41.59	37,431.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	86.76	8,676.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	700	15.31	10,717.00	
TCL CORP-A	1,900	2.72	5,168.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.58	3,432.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	300	56.00	16,800.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.17	6,787.00	
CHINA FILM CO LTD-A	200	15.38	3,076.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	13.21	2,642.00	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	13.34	1,334.00	

CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.22	1,610.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	19.93	3,986.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	25.51	2,551.00	
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	300	10.10	3,030.00	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERA-A	200	10.53	2,106.00	
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	4.43	2,215.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	10.47	2,094.00	
SUNING.COM CO LTD-A	1,300	10.77	14,001.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	1,100	8.16	8,976.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	3.34	1,670.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	300	72.45	21,735.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	400	24.50	9,800.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	700	24.34	17,038.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	200	99.06	19,812.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	672.50	134,500.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	200	42.41	8,482.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	200	32.58	6,516.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	500	7.95	3,975.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	100	38.00	3,800.00	
TONGWEI CO LTD-A	400	10.10	4,040.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	36.58	3,658.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	500	55.20	27,600.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	200	27.25	5,450.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.55	2,910.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	400	15.60	6,240.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	16.67	3,334.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	26.69	5,338.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	22.38	2,238.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	40.02	4,002.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	36.55	7,310.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	500	59.38	29,690.00	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A	700	6.85	4,795.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	200	25.09	5,018.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	22.98	4,596.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	20.60	2,060.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	21.35	4,270.00	
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	18.37	3,674.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.24	2,448.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	200	79.62	15,924.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	100	87.99	8,799.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,500	3.61	30,685.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,500	5.82	14,550.00	

BANK OF CHINA LTD-A	5,400	3.59	19,386.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	4,400	5.99	26,356.00	
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	200	10.91	2,182.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	7.57	3,785.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	1,200	6.11	7,332.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	900	6.79	6,111.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	500	17.15	8,575.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	1,200	11.07	13,284.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.47	3,282.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,000	6.68	6,680.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	4,300	3.89	16,727.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	2,500	27.87	69,675.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,900	5.83	22,737.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,400	7.45	10,430.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	6,000	5.46	32,760.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	2,500	15.66	39,150.00	
PING AN BANK CO LTD-A	1,700	10.52	17,884.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,500	10.38	36,330.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	4.46	2,230.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.48	4,032.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	5.53	4,424.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	600	14.22	8,532.00	
CITIC SECURITIES CO-A	1,100	17.89	19,679.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	9.80	1,960.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	9.54	3,816.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.17	3,085.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	800	6.44	5,152.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	800	13.32	10,656.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	8.48	5,088.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	800	16.26	13,008.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.80	3,900.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	800	9.91	7,928.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.12	2,048.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	700	18.57	12,999.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	5.12	3,584.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	600	8.34	5,004.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.37	2,548.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,600	4.38	11,388.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	7.89	2,367.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	7.32	2,196.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.18	4,090.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	300	21.85	6,555.00	

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	700	29.92	20,944.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.62	3,372.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	300	40.03	12,009.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	1,300	60.43	78,559.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	400	25.63	10,252.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	900	18.40	16,560.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	1,400	25.41	35,574.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.79	2,716.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	300	26.74	8,022.00	
GEMDALE CORP-A	600	9.99	5,994.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.44	7,728.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	5.56	3,892.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	1,700	11.94	20,298.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.30	4,980.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	2.88	3,456.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	500	7.41	3,705.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	800	3.75	3,000.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	20.40	6,120.00	
AISINO CORP-A	200	25.05	5,010.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	27.60	2,760.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	6.81	2,724.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	100	59.68	5,968.00	
IFLYTEK CO LTD - A	300	28.78	8,634.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	600	3.83	2,298.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	200	25.54	5,108.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	4,700	2.65	12,455.00	
DONGXU OPTOELECTRONIC TECH-A	800	4.42	3,536.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,700	5.66	9,622.00	
GOERTEK INC -A	500	6.93	3,465.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	8.18	2,454.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	1,300	28.86	37,518.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	18.42	3,684.00	
NINESTAR CORP-A	100	24.68	2,468.00	
O-FILM TECH CO LTD-A	400	9.36	3,744.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	9.97	2,991.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	100	32.89	3,289.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	12.11	4,844.00	
ZTE CORP-A	500	20.37	10,185.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	3,400	5.43	18,462.00	
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	800	3.42	2,736.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,800	5.31	9,558.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	2,200	15.95	35,090.00	

	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.56	7,168.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.51	5,863.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	800	6.94	5,552.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.76	2,256.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.29	9,119.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.09	3,563.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	5.21	2,605.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	8.88	6,216.00	
	ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	1,400	4.46	6,244.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	200	22.20	4,440.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	300	10.26	3,078.00	
オフショア人民元 小計		201,300		2,073,915.00 (33,493,727)	
合　計		22,091,793		4,954,343,712 (4,954,343,712)	

(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	787,111.00	
	メキシコペソ 小計		31,700	787,111.00 (4,541,630)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	230,747.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	8,600	126,850.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	22,964	567,899.72	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	2,850	249,033.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	51,557	515,570.00	
		RESILIENT REIT LTD	2,600	156,676.00	
	南アフリカランド 小計		100,671	1,846,775.72 (14,792,673)	
合計				19,334,303 (19,334,303)	

(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%	—	11.5%

メキシコペソ	株式	25銘柄	96.8%	—	2.7%
	投資証券	1銘柄	—	3.2%	0.1%
ブラジルレアル	株式	48銘柄	100.0%	—	8.1%
チリペソ	株式	17銘柄	100.0%	—	1.2%
コロンビアペソ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.4%
ユーロ	株式	6銘柄	100.0%	—	0.2%
トルコリラ	株式	18銘柄	100.0%	—	0.7%
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%	—	1.2%
香港ドル	株式	202銘柄	100.0%	—	22.7%
マレーシアリンギット	株式	44銘柄	100.0%	—	2.3%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%	—	2.4%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%	—	1.2%
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%	—	13.8%
新台湾ドル	株式	86銘柄	100.0%	—	10.9%
インドルピー	株式	78銘柄	100.0%	—	8.9%
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	95.3%	—	6.1%
	投資証券	6銘柄	—	4.7%	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	234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。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	499,078,750
投資証券	11,822,718,300

	2019年 1月25日現在
派生商品評価勘定	13,985,208
未収配当金	108,542,044
差入委託証拠金	9,269,000
流動資産合計	12,453,593,302
資産合計	12,453,593,302
負債の部	
流動負債	
前受金	8,336,500
未払金	34,774,450
未払解約金	43,120,000
未払利息	1,353
その他未払費用	5,417
流動負債合計	86,237,720
負債合計	86,237,720
純資産の部	
元本等	
元本	10,367,134,330
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,000,221,252
元本等合計	12,367,355,582
純資産合計	12,367,355,582
負債純資産合計	12,453,593,302

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	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 1月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	13,219,196,566円
期中追加設定元本額	12,737,396,322円
期中一部解約元本額	15,589,458,558円

期末元本額	10,367,134,330円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	490,024,986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）	604,302,723円
ＤＣりそな　グローバルバランス	4,805,170円
つみたてバランスファンド	141,223,715円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	17,449,180円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	5,865,569円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	4,131,242円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	3,426,205,794円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	1,665,464,619円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	532,685,843円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,318,896円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	7,884,230円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	12,140,440円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,192,071,956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）	570,474円
２．　計算日における受益権の総数	
	10,367,134,330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	1.1929円
(10,000口当たり純資産額)	(11,929円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	510,676,043
合計	510,676,043

(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)

（2019年 1月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	527,952,292	－	541,937,500	13,985,208
合計		527,952,292	－	541,937,500	13,985,208

（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	438	244,842,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	1,486	134,928,800	
	森ヒルズリート投資法人	1,513	218,779,800	
	産業ファンド投資法人	1,537	179,982,700	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,286	412,806,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	783	141,488,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	693	323,284,500	
	ＧＬＰ投資法人	3,269	362,532,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	503	148,133,500	
	日本プロロジスリート投資法人	1,769	407,754,500	
	星野リゾート・リート投資法人	201	107,334,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	192	52,070,400	
	イオンリート投資法人	1,354	177,780,200	
	ヒューリックリート投資法人	1,066	188,362,200	
	日本リート投資法人	426	159,963,000	

インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	7,818	126,651,600	
日本ヘルスケア投資法人	60	10,212,000	
積水ハウス・リート投資法人	3,403	251,822,000	
トーセイ・リート投資法人	254	28,829,000	
ケネディクス商業リート投資法人	483	125,000,400	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	175	20,562,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	264	24,288,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,910	597,448,000	
いちごホテルリート投資法人	231	32,663,400	
ラサールロジポート投資法人	995	106,664,000	
スターアジア不動産投資法人	410	44,731,000	
マリモ地方創生リート投資法人	113	12,158,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	225	77,512,500	
大江戸温泉リート投資法人	213	17,679,000	
さくら総合リート投資法人	285	24,082,500	
投資法人みらい	355	67,805,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	309	41,344,200	
三菱地所物流リート投資法人	140	34,678,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	132	13,662,000	
ザイマックス・リート投資法人	122	13,993,400	
タカラレーベン不動産投資法人	197	18,064,900	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	204	18,115,200	
日本ビルファンド投資法人	1,277	892,623,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,319	840,203,000	
日本リテールファンド投資法人	2,493	549,706,500	
オリックス不動産投資法人	2,628	484,866,000	
日本プライムリアルティ投資法人	835	363,642,500	
プレミア投資法人	1,254	166,155,000	
東急リアル・エステート投資法人	884	148,070,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	843	104,026,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,909	491,911,900	
森トラスト総合リート投資法人	943	160,310,000	
インヴィンシブル投資法人	4,616	217,413,600	
フロンティア不動産投資法人	449	201,152,000	
平和不動産リート投資法人	821	99,505,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	870	199,839,000	
福岡リート投資法人	682	114,098,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	408	302,328,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,094	109,071,800	
大和証券オフィス投資法人	304	217,664,000	
阪急阪神リート投資法人	594	84,466,800	
スターツプロシード投資法人	208	35,713,600	

	大和ハウスリート投資法人	1,652	416,469,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,246	345,199,800	
	日本賃貸住宅投資法人	1,484	129,108,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,181	181,165,400	
合計		70,808	11,822,718,300	

(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。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 1月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	70,934,035
コール・ローン	7,256,428
投資証券	11,571,469,270
派生商品評価勘定	7,700
未収入金	34,097
未収配当金	10,677,836
流動資産合計	11,660,379,366
資産合計	11,660,379,366
負債の部	
流動負債	
未払金	65,632,959
未払解約金	1,500,000
未払利息	19
その他未払費用	1,300
流動負債合計	67,134,278
負債合計	67,134,278
純資産の部	
元本等	
元本	11,241,072,465
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	352,172,623
元本等合計	11,593,245,088
純資産合計	11,593,245,088
負債純資産合計	11,660,379,366

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 1月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月26日
期首元本額	6,893,342,517円
期中追加設定元本額	10,156,793,079円
期中一部解約元本額	5,809,063,131円
期末元本額	11,241,072,465円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	478,484,308円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,045,927,045円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,028,975,564円
ＤＣりそな　グローバルバランス	5,671,175円
つみたてバランスファンド	80,741,930円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	22,588,757円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	7,371,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	5,479,064円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	5,838,374,636円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	2,412,477,871円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	286,971,740円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	1,516,075円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	9,065,608円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	16,292,058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）	1,134,651円
２． 計算日における受益権の総数	
	11,241,072,465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	1.0313円
(10,000口当たり純資産額)	(10,313円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2019年 1月25日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月25日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	53,849,949
合計	53,849,949

(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)

（2019年 1月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,833,200	－	3,840,900	7,700
	米ドル	3,833,200	－	3,840,900	7,700
合計		3,833,200	－	3,840,900	7,700

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	7,795	207,035.20	
		AGREE REALTY CORP	3,296	203,758.72	
		ALEXANDER'S INC	354	112,083.48	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,153	1,251,357.25	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,623	147,890.86	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,995	572,429.75	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	5,269	67,074.37	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	24,426	515,388.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	5,672	157,511.44	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14,743	700,439.93	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	20,575	315,209.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,194	37,856.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,101	2,423,029.95	

		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,220	23,287.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,574	1,764,474.18	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	2,809	28,202.36	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	17,004	248,598.48	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28,431	460,866.51	
		BRT APARTMENTS CORP	877	11,164.21	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,816	813,893.12	
		CARETRUST REIT INC	8,037	166,687.38	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	12,565	29,150.80	
		CEDAR REALTY TRUST INC	7,920	27,244.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	4,397	85,125.92	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	5,871	157,518.93	
		CITY OFFICE REIT INC	3,175	35,623.50	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	17,712.00	
		COLONY CAPITAL INC	46,665	253,390.95	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	11,236	233,821.16	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,743	55,427.40	
		CORECIVIC INC	11,380	218,382.20	
		CORESITE REALTY CORP	3,499	328,975.98	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10,363	246,121.25	
		COUSINS PROPERTIES INC	39,914	338,470.72	
		CUBESMART	17,620	512,742.00	
		CYRUSONE INC	10,047	504,761.28	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20,078	195,559.72	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	19,568	2,036,833.12	
		DOUGLAS EMMETT INC	15,282	553,208.40	
		DUKE REALTY CORP	33,865	963,120.60	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,800	99,180.00	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	3,425	335,615.75	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13,378	195,853.92	
		EPR PROPERTIES	7,060	500,765.80	
		EQUITY COMMONWEALTH	11,528	358,520.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,493	858,132.72	
		EQUITY RESIDENTIAL	34,922	2,456,762.70	

		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	3,432	52,132.08	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,240	1,632,384.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,942	1,099,022.26	
		FARMLAND PARTNERS INC	1,320	7,233.60	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,984	884,802.96	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11,992	376,308.96	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,530	175,330.50	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	10,254	71,162.76	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	3,875	39,447.50	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,073	684,720.70	
		GEO GROUP INC/THE	11,649	259,190.25	
		GETTY REALTY CORP	3,143	96,521.53	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,864	55,676.16	
		GLADSTONE LAND CORP	1,113	12,743.85	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,216	21,362.24	
		GLOBAL NET LEASE INC	7,295	146,118.85	
		HCP INC	45,087	1,344,494.34	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,890	367,519.90	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	19,601	532,951.19	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,693	65,587.68	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,810	423,792.00	
		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	15,682	406,006.98	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	70,209	1,206,892.71	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,848	456,576.00	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	8,733	88,727.28	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,230	126,469.00	
		INFRAREIT INC	3,911	82,326.55	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	972	56,278.80	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,145	65,448.20	
		INVITATION HOMES INC	28,129	595,490.93	
		IRON MOUNTAIN INC	27,024	970,431.84	
		JBG SMITH PROPERTIES	10,321	386,624.66	
		KILROY REALTY CORP	9,530	644,323.30	
		KIMCO REALTY CORP	39,885	654,114.00	
		KITE REALTY GROUP TRUST	8,070	125,569.20	

		LEXINGTON REALTY TRUST	20,100	183,915.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	13,988	629,040.36	
		LIFE STORAGE INC	4,411	413,222.48	
		LTC PROPERTIES INC	3,797	169,156.35	
		MACERICH CO/THE	10,032	451,339.68	
		MACK-CALI REALTY CORP	8,631	177,280.74	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	120,800	101,472.00	
		MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,150	34,744.50	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	34,548	592,843.68	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,763	1,075,977.11	
		MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	8,718	114,816.06	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,055	746,577.45	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,400	144,126.00	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	4,014	319,554.54	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	6,318	30,642.30	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	2,025	72,960.75	
		NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	4,845	78,198.30	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	4,608	146,119.68	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,983	732,364.14	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,420	38,382.60	
		PARAMOUNT GROUP INC	19,407	264,129.27	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	19,132	537,035.24	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,219	365,225.91	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,885	42,548.55	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	17,339	294,589.61	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,231	225,539.64	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,092	66,003.96	
		PROLOGIS INC	59,659	3,861,727.07	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,900	262,276.00	
		PUBLIC STORAGE	14,233	2,884,032.79	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,903	196,316.12	
		REALTY INCOME CORP	27,856	1,790,026.56	
		REGENCY CENTERS CORP	16,015	983,961.60	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10,912	184,849.28	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	20,546	241,826.42	

RETAIL VALUE INC	1,405	41,883.05	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8,831	287,360.74	
RLJ LODGING TRUST	16,776	299,619.36	
RPT REALTY	7,485	94,011.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,901	367,427.97	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	16,940	332,701.60	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	700	11,739.00	
SAUL CENTERS INC	1,066	55,197.48	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	22,608	298,199.52	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,601	101,360.97	
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,299	5,135,235.73	
SITE CENTERS CORP	13,977	176,249.97	
SL GREEN REALTY CORP	8,063	696,240.05	
SPIRIT MTA REIT	2,853	21,483.09	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	8,155	305,486.30	
STAG INDUSTRIAL INC	10,365	275,812.65	
STORE CAPITAL CORP	17,936	540,052.96	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,908	104,529.40	
SUN COMMUNITIES INC	8,172	856,180.44	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	21,856	300,082.88	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	8,979	202,207.08	
TAUBMAN CENTERS INC	5,812	284,206.80	
TERRENO REALTY CORP	5,646	217,427.46	
TIER REIT INC	5,135	112,456.50	
UDR INC	26,052	1,091,578.80	
UMH PROPERTIES INC	3,342	42,309.72	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,232	82,063.52	
URBAN EDGE PROPERTIES	10,919	216,196.20	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,951	59,580.69	
VENTAS INC	33,798	2,093,786.10	
VEREIT INC	91,504	694,515.36	
VICI PROPERTIES INC	34,126	721,082.38	
VORNADO REALTY TRUST	16,355	1,075,014.15	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	17,374	92,603.42	
WASHINGTON REIT	7,630	182,967.40	

	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11,352	306,844.56	
	WELLTOWER INC	35,611	2,646,253.41	
	WHITESTONE REIT	3,672	51,297.84	
	WP CAREY INC	15,215	1,075,548.35	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	10,874	196,493.18	
米ドル 小計		2,128,211	76,238,153.47 (8,368,662,107)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	1,620	23,068.80	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,984	232,204.56	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,199	62,547.91	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,176	84,711.68	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,932	321,090.24	
	CHOICE PROPERTIES REIT	13,583	168,836.69	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9,139	107,383.25	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,460	47,194.40	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	3,296	41,101.12	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8,225	106,267.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	3,400	36,074.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,242	51,655.68	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,269	132,441.53	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	13,593	299,861.58	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,648	76,304.48	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,549	77,060.06	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	759	14,383.05	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,123	35,496.56	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2,392	63,507.60	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,988	52,822.92	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,543	360,084.68	
	SLATE OFFICE REIT	1,569	10,245.57	
	SLATE RETAIL REIT - U	2,120	26,457.60	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,480	212,349.60	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	3,300	34,221.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,000	12,520.00	
カナダドル 小計		131,589	2,689,891.56 (221,216,681)	

ユーロ	AEDIFICA	1,797	138,548.70	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	15,266	197,389.38	
	ALTAREA	359	63,830.20	
	BEFIMMO	1,968	97,809.60	
	COFINIMMO	2,037	229,162.50	
	COVIVIO	5,934	521,598.60	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	3,966	108,747.72	
	GECINA SA	5,202	626,320.80	
	GREEN REIT PLC	57,508	83,156.56	
	HAMBORNER REIT AG	7,124	64,258.48	
	HIBERNIA REIT PLC	70,710	90,650.22	
	ICADE	4,307	312,472.85	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,320	19,883.48	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	26,436	236,602.20	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,271	47,804.55	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33,867	48,971.68	
	KLEPIERRE	19,709	562,100.68	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,269	51,092.35	
	MERCIALYS	4,526	58,656.96	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34,986	412,834.80	
	MONTEA	476	29,131.20	
	NSI NV	1,662	61,410.90	
	RETAIL ESTATES	782	58,728.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,000	1,953,120.00	
	VASTNED RETAIL NV	1,677	53,328.60	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,668	206,498.40	
	WERELDHAVE NV	3,924	112,265.64	
ユーロ 小計		330,751	6,446,375.25 (799,801,777)	
英ポンド	ASSURA PLC	228,810	126,074.31	
	BIG YELLOW GROUP PLC	14,982	142,179.18	
	BRITISH LAND CO PLC	92,427	525,355.06	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	46,200	12,474.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	61,927	62,546.27	
	DERWENT LONDON PLC	10,527	321,284.04	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	48,126	43,842.78	

		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	26,899	196,389.59	
		HAMMERSON PLC	73,384	259,045.52	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	42,038	37,960.31	
		INTU PROPERTIES PLC	80,655	86,139.54	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	71,100	601,648.20	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	66,698	119,989.70	
		LXI REIT PLC	35,342	42,233.69	
		NEWRIVER REIT PLC	26,624	55,111.68	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	73,192	81,975.04	
		RDI REIT PLC	128,909	36,932.42	
		REGIONAL REIT LTD	21,400	20,950.60	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	20,558	113,994.11	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	39,200	20,972.00	
		SEGRO PLC	95,554	611,545.60	
		SHAFTESBURY PLC	22,057	185,830.22	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	33,121	33,617.81	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	140,851	196,487.14	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	66,619	58,291.62	
		UNITE GROUP PLC	25,175	224,435.12	
		WORKSPACE GROUP PLC	12,504	113,286.24	
	英ポンド 小計		1,604,879	4,330,591.79 (622,998,934)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	32,226	110,857.44	
		ARENA REIT	23,166	58,841.64	
		BWP TRUST	47,352	172,361.28	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	17,600	54,912.00	
		CHARTER HALL GROUP	44,436	353,710.56	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	17,790	76,852.80	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	32,401	147,424.55	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	161,093	169,953.11	
		DEXUS	95,641	1,095,089.45	
		GDI PROPERTY GROUP	52,244	71,313.06	
		GOODMAN GROUP	151,582	1,773,509.40	
		GPT GROUP	170,251	948,298.07	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,685	100,602.45	

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	14,520	45,012.00	
	INDUSTRIA REIT	5,250	14,227.50	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	19,077	56,277.15	
	MIRVAC GROUP	351,866	816,329.12	
	NATIONAL STORAGE REIT	55,757	98,132.32	
	PROPERTYLINK GROUP	37,600	43,428.00	
	RURAL FUNDS GROUP	29,734	66,009.48	
	SCENTRE GROUP	503,368	1,968,168.88	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	85,748	215,227.48	
	STOCKLAND	231,071	864,205.54	
	VICINITY CENTRES	305,333	781,652.48	
	VIVA ENERGY REIT	43,952	97,573.44	
オーストラリアドル 小計		2,555,743	10,199,969.20 (793,557,603)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	90,106	105,874.55	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	91,245	143,710.87	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	145,255	200,451.90	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	105,398	155,989.04	
	STRIDE STAPLED GROUP	22,111	41,568.68	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	26,700	56,070.00	
ニュージーランドドル 小計		480,815	703,665.04 (52,204,909)	
香港ドル	CHAMPION REIT	194,000	1,113,560.00	
	FORTUNE REIT	136,000	1,332,800.00	
	LINK REIT	200,900	16,403,485.00	
	PROSPERITY REIT	96,000	299,520.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	103,000	552,080.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	114,000	606,480.00	
香港ドル 小計		843,900	20,307,925.00 (284,107,870)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	52,800	72,336.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	55,100	45,457.50	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	243,000	651,240.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	121,800	140,070.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	86,400	63,936.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	265,100	490,435.00	

		CAPITALAND MALL TRUST	267,200	619,904.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	56,100	78,540.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	78,300	121,365.00	
		ESR REIT	195,300	103,509.00	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	83,200	52,000.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	44,000	44,880.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	57,700	130,979.00	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	63,300	92,418.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	58,500	42,120.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	149,900	161,892.00	
		KEPPEL DC REIT	95,500	141,340.00	
		KEPPEL REIT	176,100	206,037.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	138,000	28,980.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	181,500	321,255.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	121,200	242,400.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	225,500	308,935.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	206,100	249,381.00	
		OUE HOSPITALITY TRUST	86,700	60,256.50	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,300	108,075.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	38,400	15,744.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	65,900	40,528.50	
		SPH REIT	68,600	69,972.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	138,500	100,412.50	
		SUNTEC REIT	215,300	406,917.00	
	シンガポールドル 小計		3,674,300	5,211,315.00 (420,657,346)	
	韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	22,673,000.00	
	韓国ウォン 小計		4,100	22,673,000.00 (2,212,885)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	14,365	203,264.75	
	イスラエルシュケル 小計		14,365	203,264.75 (6,049,158)	
合計				11,571,469,270 (11,571,469,270)	

(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	157銘柄	100.0%	72.2%
カナダドル	投資証券	26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	27銘柄	100.0%	6.9%
英ポンド	投資証券	27銘柄	100.0%	5.4%
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%	0.5%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	2.5%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
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

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

【中間財務諸表】

（１）　当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2019年 1月26日から2019年 7月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【ＤＣりそな　グローバルバランス】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年 1月25日現在	第4期中間計算期間末 2019年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,952,598	2,291,033
親投資信託受益証券	271,915,873	336,494,405
流動資産合計	273,868,471	338,785,438
資産合計	273,868,471	338,785,438
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	103,811
未払受託者報酬	55,369	65,384
未払委託者報酬	775,079	915,270
未払利息	5	6
その他未払費用	13,773	13,807
流動負債合計	844,226	1,098,278
負債合計	844,226	1,098,278
純資産の部		
元本等		
元本	269,065,576	323,612,226
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,958,669	14,074,934
（分配準備積立金）	3,578,869	3,041,989
元本等合計	273,024,245	337,687,160
純資産合計	273,024,245	337,687,160
負債純資産合計	273,868,471	338,785,438

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自　2018年 1月26日 至　2018年 7月25日	第4期中間計算期間 自　2019年 1月26日 至　2019年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,037,614	9,502,532
営業収益合計	△1,037,614	9,502,532
営業費用		
支払利息	674	926
受託者報酬	38,385	65,384
委託者報酬	537,391	915,270
その他費用	9,519	13,848
営業費用合計	585,969	995,428
営業利益又は営業損失（△）	△1,623,583	8,507,104
経常利益又は経常損失（△）	△1,623,583	8,507,104
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,623,583	8,507,104
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（△）	△236,544	872,542
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,309,037	3,958,669
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,018,814	3,317,488
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,018,814	3,317,488
剰余金減少額又は欠損金増加額	686,616	835,785
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	686,616	835,785
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,254,196	14,074,934

（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3期 2019年 1月25日現在		第4期中間計算期間末 2019年 7月25日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況		１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	112,785,606円	期首元本額	269,065,576円
期中追加設定元本額	234,142,892円	期中追加設定元本額	103,013,910円
期中一部解約元本額	77,862,922円	期中一部解約元本額	48,467,260円
２．　計算期間の末日における受益権の総数	269,065,576口	２．　中間計算期間の末日における受益権の総数	323,612,226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	1.0147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	1.0435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)	(10,147円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,435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3期 2019年 1月25日現在	第4期中間計算期間末 2019年 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	１.中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	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

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。	同左
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。	3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	309,207
コール・ローン	386,430,919
国債証券	60,990,905,220
地方債証券	3,735,847,600
特殊債券	4,438,893,085
社債券	2,940,926,000
未収利息	129,369,105
前払費用	9,149,354

	2019年 7月25日現在
流動資産合計	72,631,830,490
資産合計	72,631,830,490
負債の部	
流動負債	
未払金	198,708,900
未払解約金	350,000
未払利息	1,048
その他未払費用	853
流動負債合計	199,060,801
負債合計	199,060,801
純資産の部	
元本等	
元本	67,774,379,684
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,658,390,005
元本等合計	72,432,769,689
純資産合計	72,432,769,689
負債純資産合計	72,631,830,490

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 7月25日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	61,581,519,887円
期中追加設定元本額	17,607,898,581円
期中一部解約元本額	11,415,038,784円
期末元本額	67,774,379,684円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	16,234,370,951円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	331,748,438円
りそなラップ型ファンド（成長型）	169,717,288円
ＤＣりそな　グローバルバランス	198,536,301円
つみたてバランスファンド	612,411,263円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	337,470,628円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	56,499,398円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	12,975,226円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	560,045円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	113,281円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	34,410円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	2,078円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	38,570,785,174円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	267,619,305円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	76,410,617円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	63,086,797円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	30,210,631円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	1,323,651,841円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	4,137,791,202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）	4,821,229円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	5,345,563,581円
２．　計算日における受益権の総数	
	67,774,379,684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	1.0687円
(10,000口当たり純資産額)	(10,687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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	80,205,424
コール・ローン	57,576,809
国債証券	35,589,035,601
派生商品評価勘定	47,971
未収利息	243,678,736
前払費用	17,974,425
流動資産合計	35,988,518,966
資産合計	35,988,518,966
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,569
未払金	84,726,699
未払利息	156
その他未払費用	316
流動負債合計	84,738,740
負債合計	84,738,740
純資産の部	
元本等	
元本	36,298,086,669
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△394,306,443
元本等合計	35,903,780,226
純資産合計	35,903,780,226
負債純資産合計	35,988,518,966

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 7月25日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	32,538,384,108円
期中追加設定元本額	6,060,388,672円
期中一部解約元本額	2,300,686,111円
期末元本額	36,298,086,669円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	4,196,479,656円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	11,235,469,516円
りそなラップ型ファンド（成長型）	183,408,559円
ＤＣりそな　グローバルバランス	51,363,867円
つみたてバランスファンド	164,089,866円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	197,848,416円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	33,573,365円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	7,349,390円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	328,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	64,345円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	20,233円
ＦＷりそな先進国債券アクティブファンド	50,686,410円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	16,233,769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）	19,893,835,569円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	94,712,605円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	46,289,091円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	35,143,440円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	18,581,513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）	485,981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）	72,122,101円
２． 計算日における受益権の総数	
	36,298,086,669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	394,306,443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	0.9891円
(10,000口当たり純資産額)	(9,891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 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 **貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。** **2 .時価の算定方法** **国債証券** **（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。** **デリバティブ取引** **（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。** **コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務** **これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。** **3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明** **金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。** **また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。**

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2019年 7月25日現在） **（単位：円）**

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	35,990,928	－	36,027,330	36,402
	米ドル	13,620,743	－	13,619,862	△881
	ユーロ	10,396,926	－	10,386,238	△10,688
	英ポンド	11,973,259	－	12,021,230	47,971
合計		35,990,928	－	36,027,330	36,402

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,215,312
コール・ローン	3,163,084
投資信託受益証券	3,268,220,693
流動資産合計	3,276,599,089
資産合計	3,276,599,089
負債の部	
流動負債	
未払金	4,664,516
未払解約金	150,000
未払利息	8
その他未払費用	50
流動負債合計	4,814,574
負債合計	4,814,574
純資産の部	
元本等	
元本	2,904,392,071
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	367,392,444
元本等合計	3,271,784,515
純資産合計	3,271,784,515
負債純資産合計	3,276,599,089

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 7月25日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	2,237,772,471円
期中追加設定元本額	802,731,410円
期中一部解約元本額	136,111,810円
期末元本額	2,904,392,071円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	491,524,979円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	319,611,058円
りそなラップ型ファンド（成長型）	161,652,527円
ＤＣりそな　グローバルバランス	5,886,948円
つみたてバランスファンド	144,016,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	49,368,799円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	20,000,363円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	12,301,475円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	136,219円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	63,328円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	74,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	93,520円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	18,741,566円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	1,316,986,650円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	5,005,497円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	15,369,737円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	20,609,944円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	78,572,571円

りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	243,942,071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）	434,445円
２．　計算日における受益権の総数	
	2,904,392,071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	1.1265円
(10,000口当たり純資産額)	(11,265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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 7月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,060,458	－	1,060,458	0
	米ドル	1,060,458	－	1,060,458	0
合計		1,060,458	－	1,060,458	0

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	791,075,811
株式	28,504,361,590
派生商品評価勘定	12,871,890
未収配当金	40,414,330
差入委託証拠金	24,075,000
流動資産合計	29,372,798,621
資産合計	29,372,798,621
負債の部	
流動負債	
前受金	9,958,550
未払金	250,895,465
未払利息	2,145
その他未払費用	2,561
流動負債合計	260,858,721
負債合計	260,858,721
純資産の部	
元本等	
元本	26,668,234,398
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,443,705,502
元本等合計	29,111,939,900
純資産合計	29,111,939,900

	2019年 7月25日現在
負債純資産合計	29,372,798,621

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 7月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	23,469,138,912円
期中追加設定元本額	8,156,349,228円
期中一部解約元本額	4,957,253,742円
期末元本額	26,668,234,398円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	2,469,778,091円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,113,943,905円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,311,258,299円
ＤＣりそな　グローバルバランス	30,018,381円
つみたてバランスファンド	906,815,895円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	247,130,250円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	100,710,569円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	61,281,164円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	655,824円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	314,248円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	360,318円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	450,096円
ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	67,031,003円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	17,606,428,942円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	327,861,814円

Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	21,188,471円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	76,291,877円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	110,910,128円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	160,201,118円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	497,029,947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）	3,862,149円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	435,065,696円
りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	119,646,213円
２．　計算日における受益権の総数	
	26,668,234,398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	1.0916円
(10,000口当たり純資産額)	(10,916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 7月25日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2019年 7月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	831,358,110	－	844,230,000	12,871,890
合計		831,358,110	－	844,230,000	12,871,890

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,893,402,217
コール・ローン	67,880,719
株式	23,480,618,789
投資証券	634,261,956
派生商品評価勘定	86,207,919
未収入金	233,269
未収配当金	22,959,764
差入委託証拠金	517,105,656
流動資産合計	26,702,670,289
資産合計	26,702,670,289
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	221,574
未払解約金	9,500,000
未払利息	184
その他未払費用	337
流動負債合計	9,722,095
負債合計	9,722,095
純資産の部	
元本等	
元本	20,696,961,350
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,995,986,844
元本等合計	26,692,948,194
純資産合計	26,692,948,194
負債純資産合計	26,702,670,289

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 7月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	16,003,677,154円
期中追加設定元本額	7,537,717,950円
期中一部解約元本額	2,844,433,754円
期末元本額	20,696,961,350円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	855,150,371円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	281,145,247円

りそなラップ型ファンド（成長型）	3,215,347,587円
ＤＣりそな　グローバルバランス	10,267,774円
つみたてバランスファンド	512,835,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	237,433,530円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	97,188,729円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	59,394,260円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	632,364円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	301,008円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	347,387円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	435,377円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	10,777,145,358円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	987,187,492円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	22,426,942円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	71,616,696円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	100,721,101円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	809,530,261円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	2,547,118,386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）	3,755,272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）	106,980,696円
２．　計算日における受益権の総数	
	20,696,961,350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	1.2897円
(10,000口当たり純資産額)	(12,897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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2019年 7月25日現在） （単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,967,876,832	－	4,053,856,453	85,979,621
合計		3,967,876,832	－	4,053,856,453	85,979,621

（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 7月25日現在） （単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,534,963,606	－	1,534,970,330	6,724
	米ドル	1,060,269,302	－	1,060,293,130	23,828
	カナダドル	56,809,865	－	56,808,100	△1,765
	ユーロ	178,346,731	－	178,325,200	△21,531
	英ポンド	93,180,611	－	93,198,500	17,889
	スイスフラン	49,423,725	－	49,423,500	△225
	スウェーデンクローナ	13,885,113	－	13,890,800	5,687

	ノルウェークローネ	3,631,003	—	3,627,900	△3,103
	デンマーククローネ	9,038,008	—	9,038,400	392
	オーストラリアドル	40,016,763	—	40,009,900	△6,863
	ニュージーランドドル	1,450,216	—	1,450,200	△16
	香港ドル	19,936,224	—	19,929,600	△6,624
	シンガポールドル	7,133,517	—	7,134,300	783
	イスラエルシュケル	1,842,528	—	1,840,800	△1,728
合計		1,534,963,606	—	1,534,970,330	6,724

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,171,514,228
コール・ローン	18,026,105
株式	5,855,424,637
投資証券	16,111,090
派生商品評価勘定	23,212,988
未収入金	3,303,836
未収配当金	20,639,040
差入委託証拠金	164,020,072
流動資産合計	7,272,251,996
資産合計	7,272,251,996
負債の部	

	2019年 7月25日現在
流動負債	
派生商品評価勘定	336,673
未払金	2,735,925
未払解約金	248,000
未払利息	48
その他未払費用	97
流動負債合計	3,320,743
負債合計	3,320,743
純資産の部	
元本等	
元本	5,621,258,113
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,647,673,140
元本等合計	7,268,931,253
純資産合計	7,268,931,253
負債純資産合計	7,272,251,996

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 7月25日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	4,259,682,907円
期中追加設定元本額	2,105,980,623円
期中一部解約元本額	744,405,417円
期末元本額	5,621,258,113円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	471,799,171円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,658,082,513円
りそなラップ型ファンド（成長型）	786,187,008円
ＤＣりそな　グローバルバランス	5,664,227円
つみたてバランスファンド	125,985,154円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	82,819,883円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	34,160,626円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	20,911,888円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	223,728円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	105,019円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	122,918円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	150,847円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,424,094,225円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	387,745,828円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	6,582,178円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	23,594,940円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	35,543,434円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	135,265,961円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	421,502,319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）	716,246円
２．　計算日における受益権の総数	
	5,621,258,113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	1.2931円
(10,000口当たり純資産額)	(12,931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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 　貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2 .時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2019年 7月25日現在） **（単位：円）**

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,614,852,888	－	1,637,748,452	22,895,564
合計		1,614,852,888	－	1,637,748,452	22,895,564

（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 7月25日現在） **（単位：円）**

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	254,982,079	－	254,962,838	△19,241
	米ドル	164,631,634	－	164,644,538	12,904
	メキシコペソ	5,893,680	－	5,886,400	△7,280
	トルコリラ	5,667,330	－	5,664,000	△3,330
	チェココルナ	1,275,966	－	1,271,700	△4,266
	ハンガリーフォリント	1,481,600	－	1,480,000	△1,600
	ポーランドズロチ	3,402,228	－	3,399,600	△2,628
	香港ドル	59,390,551	－	59,373,600	△16,951
	南アフリカランド	13,239,090	－	13,243,000	3,910
	売建	6,309	－	6,317	△8
	オフショア人民元	6,309	－	6,317	△8
合計		254,988,388	－	254,969,155	△19,249

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	147,599,968
投資証券	14,935,507,640
派生商品評価勘定	9,040,952
未収入金	252,015,280
未収配当金	98,988,737
差入委託証拠金	3,233,000

	2019年 7月25日現在
流動資産合計	15,446,385,577
資産合計	15,446,385,577
負債の部	
流動負債	
前受金	9,423,400
未払解約金	273,500,000
未払利息	400
その他未払費用	1,904
流動負債合計	282,925,704
負債合計	282,925,704
純資産の部	
元本等	
元本	11,378,192,415
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,785,267,458
元本等合計	15,163,459,873
純資産合計	15,163,459,873
負債純資産合計	15,446,385,577

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 7月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	10,367,134,330円
期中追加設定元本額	5,838,125,239円
期中一部解約元本額	4,827,067,154円
期末元本額	11,378,192,415円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	439,563,504円

りそなラップ型ファンド（安定成長型）	445,216,187円
りそなラップ型ファンド（成長型）	358,653,384円
ＤＣりそな　グローバルバランス	5,214,735円
つみたてバランスファンド	243,310,384円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	51,034,774円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	20,527,519円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	12,258,085円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	130,149円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	63,693円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	73,485円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	91,322円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	3,521,386,629円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	1,697,735,226円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	1,080,155,711円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	4,218,883円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	16,132,413円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	20,547,352円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	66,155,082円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	203,950,839円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,190,683,326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）	1,089,733円
２．　計算日における受益権の総数	
	11,378,192,415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	1.3327円
(10,000口当たり純資産額)	(13,327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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（2019年 7月25日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	201,581,048	－	210,622,000	9,040,952
合計		201,581,048	－	210,622,000	9,040,952

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	9,955,283
コール・ローン	22,243,493
投資証券	14,088,450,905
派生商品評価勘定	12,178
未収入金	123,040
未収配当金	27,195,629
流動資産合計	14,147,980,528

	2019年 7月25日現在
資産合計	14,147,980,528
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,700,000
未払利息	60
その他未払費用	11
流動負債合計	5,700,071
負債合計	5,700,071
純資産の部	
元本等	
元本	12,589,398,578
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,552,881,879
元本等合計	14,142,280,457
純資産合計	14,142,280,457
負債純資産合計	14,147,980,528

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 7月25日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	11,241,072,465円
期中追加設定元本額	2,931,682,782円

期中一部解約元本額	1,583,356,669円
期末元本額	12,589,398,578円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	493,250,695円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	902,265,676円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,508,437,216円
ＤＣりそな　グローバルバランス	5,874,224円
つみたてバランスファンド	144,022,961円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	65,829,583円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	27,180,415円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	16,743,308円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	167,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	86,973円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	97,116円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	119,841円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	5,672,180,587円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	2,510,097,453円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	562,066,504円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	5,057,627円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	19,213,194円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	28,481,011円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	152,585,816円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	473,950,871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）	1,690,431円
２．　計算日における受益権の総数	
	12,589,398,578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	1.1233円
(10,000口当たり純資産額)	(11,233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 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及び差額 　貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２.時価の算定方法 投資証券 　（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 　（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 　これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 ３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2019年 7月25日現在） **（単位：円）**

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	14,053,022	－	14,065,200	12,178
	米ドル	14,053,022	－	14,065,200	12,178
合計		14,053,022	－	14,065,200	12,178

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 7月31日現在です。

【ＤＣりそな　グローバルバランス】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	349,665,042円
Ⅱ　負債総額	69,563円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	349,595,479円
Ⅳ　発行済口数	335,184,688口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0430円

（参考）

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	72,209,732,458円
Ⅱ　負債総額	81,504,603円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	72,128,227,855円
Ⅳ　発行済口数	67,468,295,782口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0691円

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	36,184,353,554円
Ⅱ　負債総額	72,552,709円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,111,800,845円
Ⅳ　発行済口数	36,446,840,574口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9908円

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	3,391,768,479円
Ⅱ　負債総額	10,078,528円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,381,689,951円
Ⅳ　発行済口数	3,016,712,661口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1210円

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	29,361,295,168円
Ⅱ　負債総額	130,574,214円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	29,230,720,954円
Ⅳ　発行済口数	26,992,241,229口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0829円

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	28,190,153,665円
Ⅱ　負債総額	10,559,971円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	28,179,593,694円
Ⅳ　発行済口数	21,900,529,988口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2867円

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	7,479,964,402円
Ⅱ　負債総額	9,607,900円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,470,356,502円
Ⅳ　発行済口数	5,825,561,851口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2823円

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	15,586,965,357円
Ⅱ　負債総額	624,986,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,961,979,357円
Ⅳ　発行済口数	11,125,272,244口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3449円

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	14,562,720,350円
Ⅱ　負債総額	44,153,241円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,518,567,109円
Ⅳ　発行済口数	12,869,662,611口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1281円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行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7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去５年間における主な資本金の増減

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

（２）委託会社の機構（2019年7月末現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。
取締役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。

②　投資運用の意思決定機構

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

○PLAN：計画

・運用戦略部は、運用基本方針や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7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	65	652,688
単位型株式投資信託	2	36,410
合計	67	689,098

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	19,258	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	2,791
器具備品	※１	5,451	9,167
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

（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）
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	※２	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】

（単位：千円）

	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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	△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）

（単位：千円）

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

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年超	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

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がいないため、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

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がいないため、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）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

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

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（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。
① 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。
② 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。
③ 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。
④ 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。

⑤　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。

⑥　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.ＸＢＲＬ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3月２０日

りそなアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

有限責任監査法人　トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣりそな グローバルバランスの２０１８年1月２６日から２０１９年1月２５日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣりそな グローバルバランスの２０１９年1月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬ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9月１７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

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣりそな グローバルバランスの２０１９年1月２６日から２０１９年7月２５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、ＤＣりそな グローバルバランスの２０１９年7月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０１９年1月２６日から２０１９年7月２５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

(注)1.上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。