

【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12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】	Smart-i 8資産バランス 安定型 Smart-i 8資産バランス 安定成長型 Smart-i 8資産バランス 成長型
【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】	Smart-i 8資産バランス 安定型 1兆円を上限とします。 Smart-i 8資産バランス 安定成長型 1兆円を上限とします。 Smart-i 8資産バランス 成長型 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】

Smart-i 8資産バランス 安定型
 Smart-i 8資産バランス 安定成長型
 Smart-i 8資産バランス 成長型

- ・以下、上記を総称して「ファンド」または「当ファンド」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称
Smart-i 8資産バランス 安定型	安定型
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	安定成長型
Smart-i 8資産バランス 成長型	成長型

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2019年12月26日から2020年6月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ アドレス：<https://www.resona-am.co.jp/>**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（ 1 2 ） 【 その他 】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

< Smart - i 8資産バランス 安定型 >

< Smart - i 8資産バランス 安定成長型 >

< Smart - i 8資産バランス 成長型 >

信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

る資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

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

4. 独立した区分

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

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

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

< 補足として使用する商品分類 >

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

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1 国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)を実質的な投資対象資産とします。

- 以下のマザーファンドを通じて投資対象資産への分散投資を行います。
- 各マザーファンドは、以下の対象指数(インデックス)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

投資対象資産	マザーファンド	インデックス*
国内債券	RAM国内債券マザーファンド	NOMURA-BPI総合
先進国債券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
	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)
新興国債券	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)
国内株式	RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)
先進国株式	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)
新興国株式	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)
国内リート	RAM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
先進国リート	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)

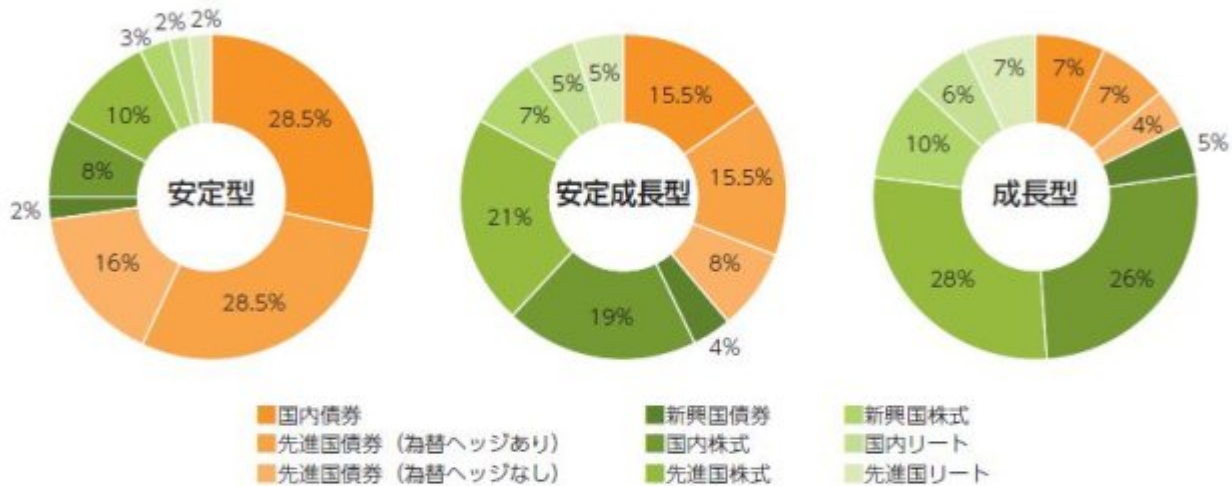
- 上記マザーファンドの運用において、インデックスへの連動性を高めるため、債券先物取引、株価指数先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF(上場投資信託証券)を活用することがあります。

*各インデックスについては、「インデックスの著作権等について」をご参照ください。

2 運用目的やリスク許容度にあわせて、 3つのファンドからお好みの運用タイプをお選びいただけます。

- 安定型：債券への投資割合を高め、資産の安定性を重視した運用を行います。
- 安定成長型：債券、株式およびリートに対する投資割合の分散をはかり、安定性と成長性のバランスを目指した運用を行います。
- 成長型：株式およびリートへの投資割合を高め、資産の成長性を重視した運用を行います。

◆各ファンドの投資割合(基本的資産配分)*は以下の通りです。



投資対象資産	安定型	安定成長型	成長型
国内債券	28.5%	15.5%	7%
先進国債券 (為替ヘッジあり)	28.5%	15.5%	7%
先進国債券 (為替ヘッジなし)	16%	8%	4%
新興国債券	2%	4%	5%
国内株式	8%	19%	26%
先進国株式	10%	21%	28%
新興国株式	3%	7%	10%
国内リート	2%	5%	6%
先進国リート	2%	5%	7%

* 上記の基本的資産配分は、2019年3月時点のものです。

※ 上記の基本的資産配分は、四捨五入の都合により合計が100%とならない場合があります。

※ 保有する有価証券等の価格変動の影響を受けることなどにより、実際の投資割合は上記の数値から乖離する場合があります。

3 基本的資産配分は、原則として年1回見直します。

- 基本的資産配分は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性(標準偏差)等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

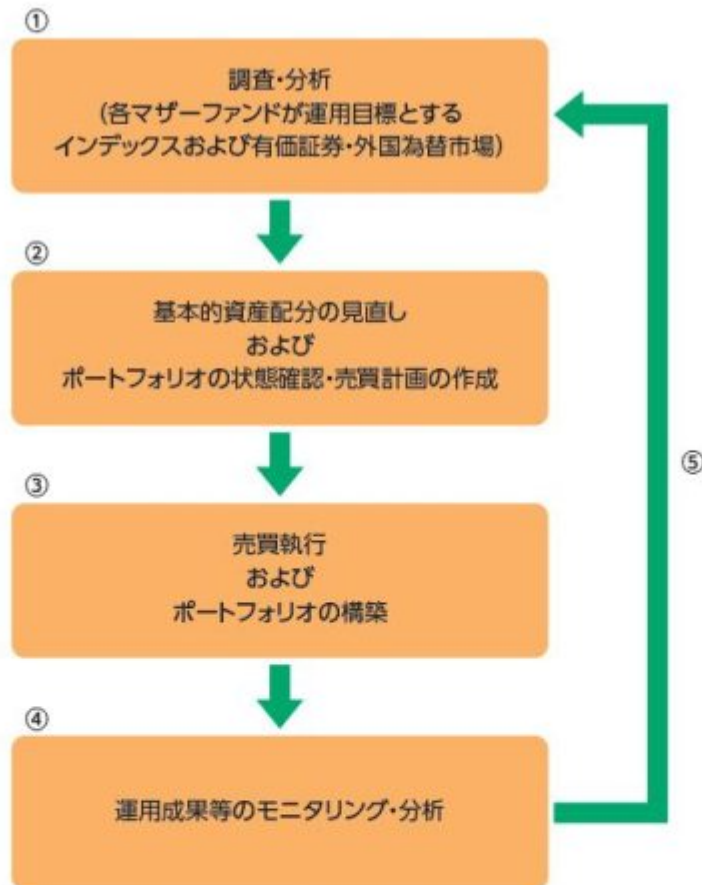
4 実質組入外貨建資産の一部について、 対円での為替ヘッジを行います。

- 各ファンドが外貨建資産として組み入れるRAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)において為替ヘッジを行います。

5 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

運用プロセスのイメージ



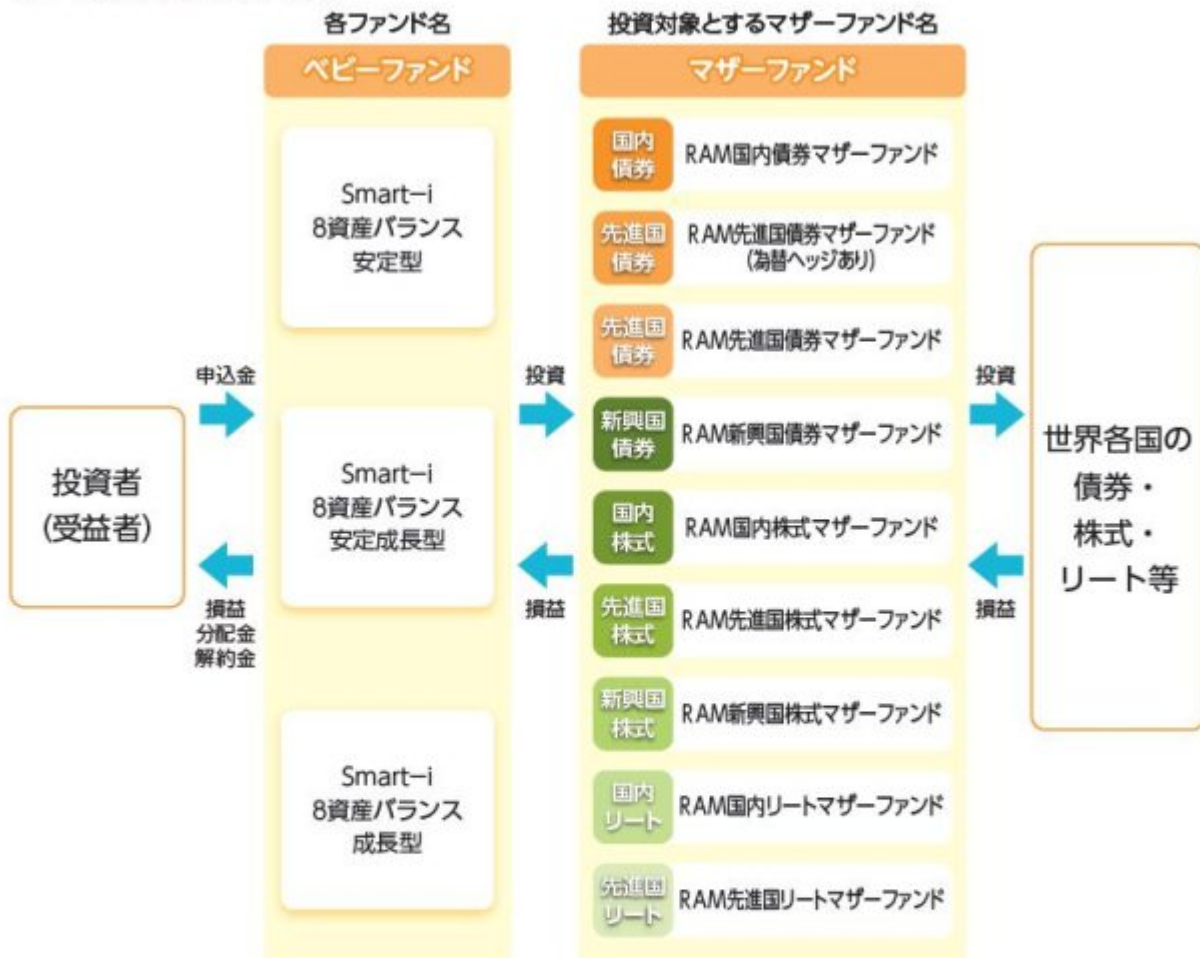
- ①各マザーファンドが運用目標とするインデックスおよび投資対象となる有価証券・外国為替市場に関する調査・分析を行います。
- ②各種情報を基に、原則として年1回基本的資産配分の見直しを行い、また日常的にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
- ③売買執行(マザーファンドの売買)により、ポートフォリオを構築します。
- ④運用成果や基準価額の騰落要因等について、モニタリング・分析を行います。
- ⑤上記④の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

ファンドの仕組み

各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3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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

インデックス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(為替ヘッジあり)

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

●RAM先進国債券マザーファンド

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

●RAM新興国債券マザーファンド

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

●RAM国内株式マザーファンド

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

●RAM先進国株式マザーファンド

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

●RAM新興国株式マザーファンド

「MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RAM国内リートマザーファンド

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

●RAM先進国リートマザーファンド

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

信託金限度額

- ・各ファンド、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。

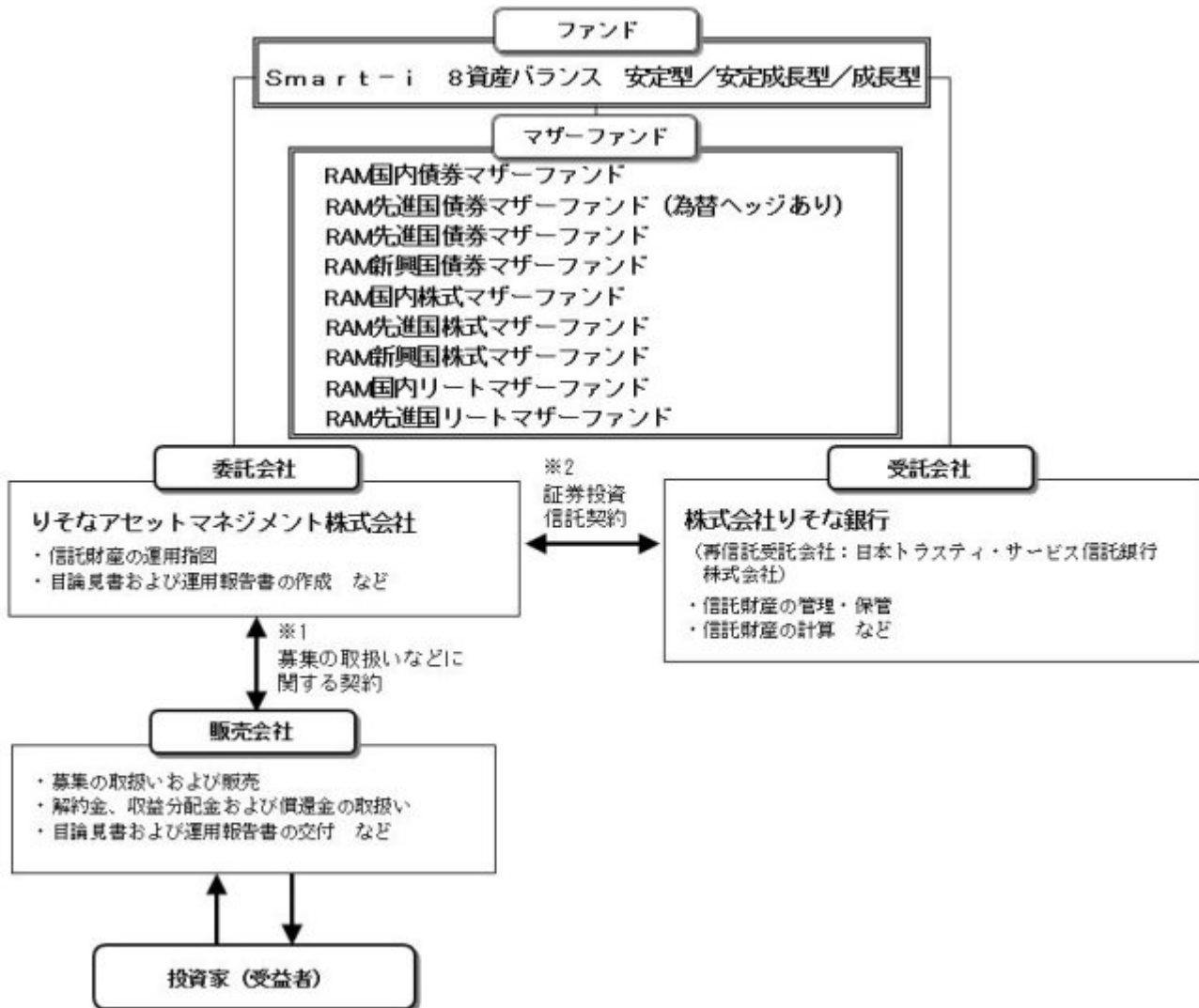
(2)【ファンドの沿革】

2018年3月27日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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。

委託会社の概況（2019年9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】

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(為替ヘッジあり)、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(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

< Smart-i 8資産バランス 安定型 >

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・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

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

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしたがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
RAM国内債券マザーファンド	NOMURA - BPI総合	28.5%
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	28.5%
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)	16.0%
RAM新興国債券マザーファンド	JPMORGANGBI - EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)	2.0%
RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	8.0%
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)	10.0%
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)	3.0%
RAM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	2.0%
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)	2.0%

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性(標準偏差)等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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。

< Smart-i 8資産バランス 安定成長型 >

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・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

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

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしたがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
RAM国内債券マザーファンド	NOMURA - BPI総合	15.5%
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	15.5%
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)	8.0%
RAM新興国債券マザーファンド	JPMORGANGBI - EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)	4.0%
RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	19.0%
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)	21.0%
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)	7.0%
RAM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	5.0%

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)	5.0%
------------------	----------------------------------	------

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性(標準偏差)等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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。

<Smart-i 8資産バランス 成長型>

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・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

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

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしたがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
RAM国内債券マザーファンド	NOMURA - BPI総合	7.0%
RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	7.0%
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)	4.0%
RAM新興国債券マザーファンド	JPMORGANGBI - EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)	5.0%
RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	26.0%
RAM先進国株式マザーファンド	MSCI - KOKUSA I 指数(配当込み、円換算ベース)	28.0%
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)	10.0%
RAM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	6.0%
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)	7.0%

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性(標準偏差)等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ)有価証券

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

ハ)約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ)金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ)為替手形

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引

法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡

取引の運用指図、直物為替先渡取引の運用指図、有価証券の貸付けの指図、外国為替予約取引の指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RAM国内債券マザーファンド >

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

< R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

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

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
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

< R A M新興国債券マザーファンド >

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

収益分配	収益分配は行いません。
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

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

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

< R A M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 - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・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	主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態を高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

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

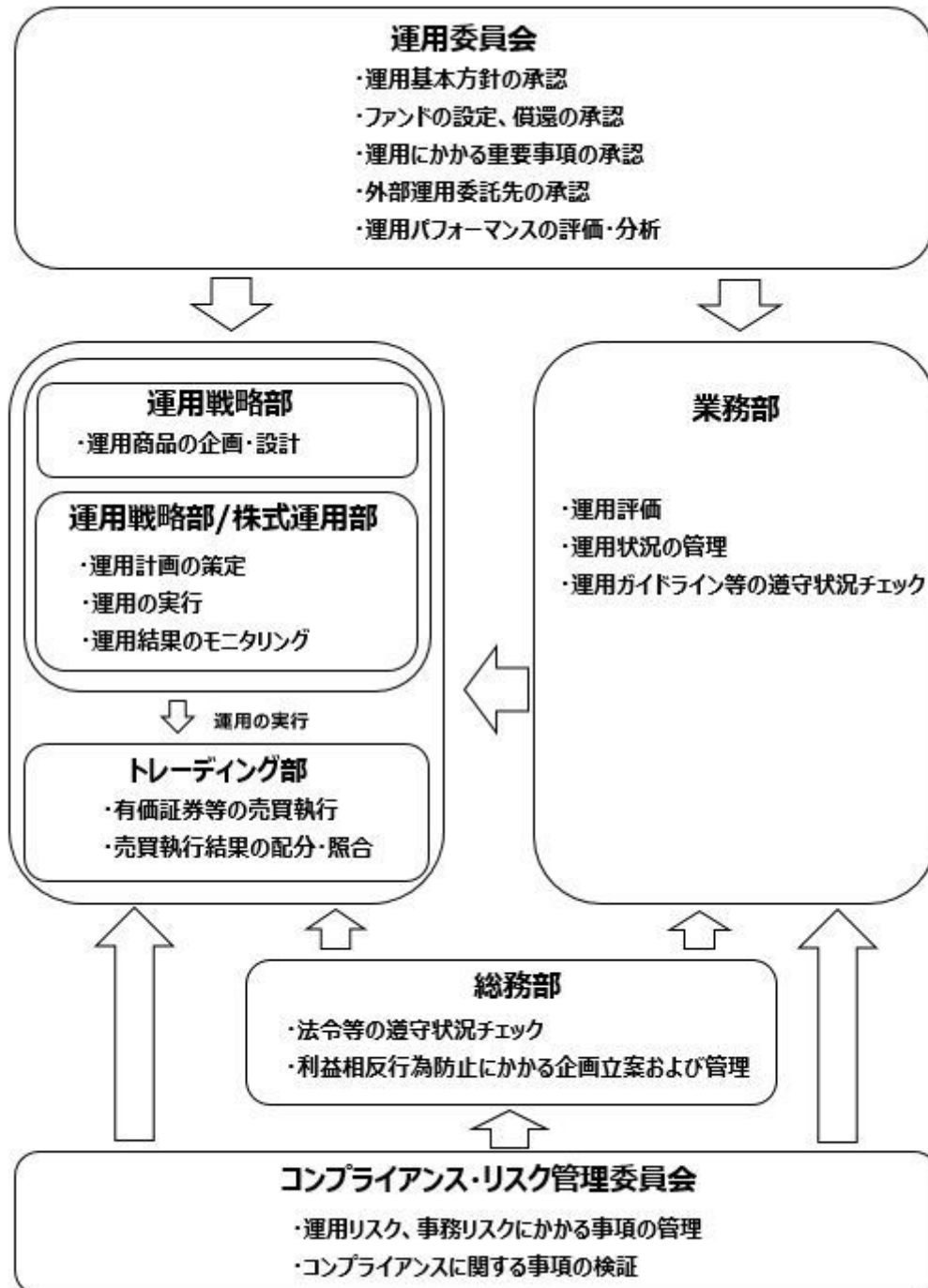
運用の基本方針

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

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

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



コンプライアンス・リスク管理委員会は7名程度、運用委員会は7名程度で構成されています。

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2019年9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) 【配分方針】

収益配分方針

原則として毎決算時に以下の収益配分方針に基づいて分配を行います。

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)>

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

<分配金受取りコース(一般コース)>

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

二) 売出しにより取得する株券

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

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

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

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

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

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

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

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

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

ものとしします。

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します。
7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

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します。
6. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

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します。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に

相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

17) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

（２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。また、運用ガイドライン等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

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

上記体制は2019年9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】

Smart-i 8資産バランス 安定型

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2019年3月から2019年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	3.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	1.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.8	8.4	9.6	5.9	2.1	2.3	1.2

- * 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10月から2019年9月の5年間（当ファンドは2019年3月から2019年9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。

Smart-i 8資産バランス 安定成長型

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2019年3月から2019年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	3.1	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△0.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.5	8.4	9.6	5.9	2.1	2.3	1.2

- * 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10月から2019年9月の5年間（当ファンドは2019年3月から2019年9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。

Smart-i 8資産バランス 成長型

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
* 年間騰落率は、2019年3月から2019年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	3.2	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△2.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.5	8.4	9.6	5.9	2.1	2.3	1.2

* 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10月から2019年9月の5年間(当ファンドは2019年3月から2019年9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、信頼性、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により算出され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

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

< Smart-i 8資産バランス 安定型 >

年率0.176%（税抜0.16%）

< Smart-i 8資産バランス 安定成長型 >

年率0.198%（税抜0.18%）

< Smart-i 8資産バランス 成長型 >

年率0.220%（税抜0.20%）

ただし、RAM新興国債券マザーファンドがETF（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は以下のとおりです。

各ファンド〔安定型：0.1688%程度、安定成長型：0.1976%程度、成長型：0.2220%程度〕（年率、税抜）

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

ファンド	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
Smart-i 8資産バランス 安定型	0.16%	0.07%	0.07%	0.02%
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	0.18%	0.08%	0.08%	
Smart-i 8資産バランス 成長型	0.20%	0.09%	0.09%	

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度（つみたてNISA）をご利用の場合、毎年、年間40万円

の範囲で販売会社との契約に基づいて定期的かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年において両方の適用を受けることはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

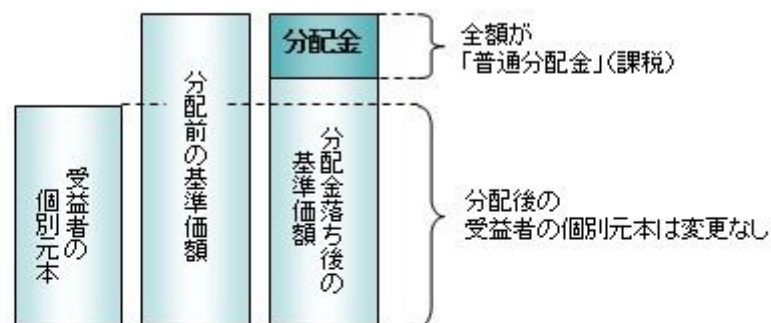
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

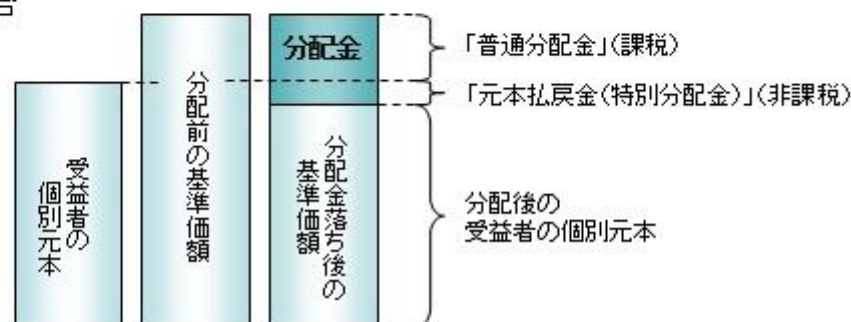
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2019年9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】

【Smart-i 8資産バランス 安定型】

以下の運用状況は2019年 9月30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	370,697,343	99.21
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,941,977	0.79
合計(純資産総額)		373,639,320	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	101,853,154	1.0047	102,341,809	1.0419	106,120,801	28.40
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	98,735,939	1.0644	105,104,187	1.0719	105,835,053	28.33
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	59,382,345	0.9828	58,366,289	1.0020	59,501,109	15.92
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	29,238,448	1.2298	35,957,465	1.2624	36,910,616	9.88
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	26,414,784	1.0700	28,265,680	1.1093	29,301,919	7.84
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	8,899,307	1.2501	11,125,545	1.2223	10,877,622	2.91
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	5,128,502	1.2888	6,609,911	1.4613	7,494,279	2.01
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	6,352,199	1.1146	7,080,254	1.1638	7,392,689	1.98
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	6,794,439	1.0747	7,302,078	1.0690	7,263,255	1.94

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.21
合計	99.21

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2019年 3月25日)	123	123	1.0230	1.0230
2018年 9月末日	18		1.0212	
10月末日	26		0.9970	
11月末日	42		1.0075	
12月末日	51		0.9891	
2019年 1月末日	93		1.0057	
2月末日	109		1.0181	
3月末日	143		1.0290	
4月末日	167		1.0326	
5月末日	205		1.0214	
6月末日	267		1.0387	
7月末日	286		1.0458	
8月末日	339		1.0487	
9月末日	373		1.0559	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.30
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	3.28

(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	2018年 3月27日～2019年 3月25日	124,139,157	3,062,288
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	254,812,229	27,086,952

(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。

【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

以下の運用状況は2019年 9月30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	533,079,297	99.60
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,130,533	0.40
合計（純資産総額）		535,209,830	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	89,301,844	1.2311	109,946,890	1.2624	112,734,647	21.06
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	90,477,509	1.0760	97,356,551	1.1093	100,366,700	18.75
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	79,260,721	0.9996	79,229,338	1.0419	82,581,745	15.43
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	77,009,327	1.0618	81,770,920	1.0719	82,546,297	15.42
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	42,620,715	0.9824	41,874,539	1.0020	42,705,956	7.98
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	30,357,707	1.2636	38,360,796	1.2223	37,106,225	6.93
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	23,178,980	1.1164	25,878,665	1.1638	26,975,696	5.04
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	18,397,184	1.2784	23,520,175	1.4613	26,883,804	5.02
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	19,811,251	1.0766	21,329,975	1.0690	21,178,227	3.96

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.60
合 計	99.60

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2019年 3月25日)	260	260	1.0267	1.0267
2018年 9月末日	32		1.0524	
10月末日	75		1.0019	
11月末日	107		1.0201	
12月末日	132		0.9693	
2019年 1月末日	194		1.0044	
2月末日	224		1.0278	
3月末日	307		1.0365	
4月末日	331		1.0501	
5月末日	370		1.0168	
6月末日	397		1.0407	
7月末日	445		1.0533	
8月末日	486		1.0361	
9月末日	535		1.0606	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.67
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	3.33

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	261,794,625	7,945,303
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	279,198,271	31,850,719

(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。

【Smart-i 8資産バランス 成長型】

以下の運用状況は2019年 9月30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	546,166,673	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,627,558	0.30
合計（純資産総額）		547,794,231	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	121,998,015	1.2285	149,875,639	1.2624	154,010,294	28.11
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	126,853,133	1.0754	136,422,808	1.1093	140,718,180	25.69
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	44,463,061	1.2666	56,318,637	1.2223	54,347,199	9.92
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	33,275,099	1.1140	37,071,586	1.1638	38,725,560	7.07

日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	36,574,259	0.9985	36,522,870	1.0419	38,106,720	6.96
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	35,494,094	1.0617	37,684,380	1.0719	38,046,119	6.95
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	22,819,560	1.2685	28,948,527	1.4613	33,346,223	6.09
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	25,372,303	1.0772	27,333,046	1.0690	27,122,991	4.95
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	21,699,988	0.9820	21,310,723	1.0020	21,743,387	3.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.70
合 計	99.70

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2019年 3月25日)	297	297	1.0266	1.0266
2018年 9月末日	34		1.0722	
10月末日	110		1.0039	
11月末日	160		1.0268	
12月末日	179		0.9551	
2019年 1月末日	250		1.0014	
2月末日	278		1.0320	
3月末日	331		1.0387	
4月末日	373		1.0590	
5月末日	379		1.0108	
6月末日	426		1.0389	
7月末日	460		1.0546	
8月末日	492		1.0238	
9月末日	547		1.0587	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.66
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	3.13

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	298,802,333	8,522,699
当中間期	2019年 3月26日～2019年 9月25日	264,971,883	47,026,109

(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 9月30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	60,064,580,250	83.79
地方債証券	日本	3,830,328,500	5.34
特殊債券	日本	4,320,054,175	6.03
社債券	日本	2,840,486,000	3.96
	フランス	101,000,000	0.14
	オーストラリア	100,891,000	0.14
	小計	3,042,377,000	4.24
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		429,541,506	0.60
合計（純資産総額）		71,686,881,431	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134回利付国債(5年)	780,000,000	101.09	788,518,200	101.49	791,684,400	0.100	2022/12/20	1.10
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	740,000,000	101.02	747,596,800	101.36	750,101,000	0.100	2022/9/20	1.05
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	730,000,000	101.37	740,027,300	101.94	744,220,400	0.100	2023/12/20	1.04
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	660,000,000	100.76	665,067,000	100.96	666,342,600	0.100	2021/12/20	0.93
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	630,000,000	101.97	642,464,200	103.52	652,232,700	0.100	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	630,000,000	101.62	640,259,600	102.08	643,148,100	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	610,000,000	102.44	624,943,400	103.65	632,289,400	0.100	2028/3/20	0.88
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	594,000,000	103.79	616,554,800	104.63	621,537,840	0.400	2025/9/20	0.87
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	591,000,000	103.67	612,703,500	104.23	616,040,670	0.400	2025/3/20	0.86
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	510,000,000	102.44	522,475,200	103.20	526,330,200	0.100	2026/6/20	0.73
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	500,000,000	102.08	510,402,300	103.44	517,245,000	0.100	2028/12/20	0.72
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	500,000,000	101.27	506,392,300	101.85	509,260,000	0.100	2023/9/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	490,000,000	102.58	502,643,400	103.40	506,704,100	0.100	2026/12/20	0.71
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	490,000,000	101.78	498,765,000	102.20	500,814,300	0.100	2024/6/20	0.70
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	490,000,000	101.39	496,833,600	101.79	498,771,000	0.100	2023/6/20	0.70
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	477,000,000	104.26	497,320,200	104.39	497,940,300	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	103.45	486,219,700	0.800	2022/9/20	0.68
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	470,000,000	102.60	482,220,000	101.84	478,652,700	1.200	2020/12/20	0.67
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	461,000,000	103.18	475,696,680	103.36	476,531,090	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	100.71	473,365,200	0.100	2021/6/20	0.66
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	450,000,000	102.37	460,695,600	103.34	465,043,500	0.100	2029/3/20	0.65
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	445,000,000	103.93	462,524,100	104.33	464,281,850	0.600	2024/3/20	0.65
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	440,000,000	101.78	447,859,000	103.54	455,589,200	0.100	2028/9/20	0.64
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	450,000,000	100.69	453,109,400	100.84	453,789,000	0.100	2021/9/20	0.63
日本	国債証券	第402回利付国債(2年)	450,000,000	100.61	452,757,000	100.72	453,280,500	0.100	2021/7/1	0.63

日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	421,000,000	104.08	438,176,800	104.60	440,395,470	0.600	2024/6/20	0.61
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	355,000,000	122.60	435,254,900	123.82	439,592,950	1.700	2033/6/20	0.61
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	430,000,000	101.27	435,496,900	101.63	437,017,600	0.100	2023/3/20	0.61
日本	国債証券	第132回利付国債（5年）	430,000,000	100.92	433,977,500	101.22	435,246,000	0.100	2022/6/20	0.61
日本	国債証券	第65回利付国債（20年）	380,000,000	110.15	418,604,200	109.61	416,521,800	1.900	2023/12/20	0.58

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.79
地方債証券	5.34
特殊債券	6.03
社債券	4.24
合計	99.40

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

該当事項はありません。

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2019年9月30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	68,611,351,663	47.76
	カナダ	2,735,877,411	1.90
	メキシコ	1,095,577,319	0.76
	ドイツ	9,238,100,812	6.43
	イタリア	13,082,331,878	9.11
	フランス	14,242,854,454	9.91
	オランダ	2,626,869,489	1.83
	スペイン	8,084,250,313	5.63
	ベルギー	3,575,310,392	2.49
	オーストリア	1,946,448,044	1.35
	フィンランド	822,833,046	0.57

	アイルランド	1,031,615,192	0.72
	イギリス	9,200,867,966	6.40
	スウェーデン	482,798,094	0.34
	ノルウェー	340,849,230	0.24
	デンマーク	743,877,174	0.52
	ポーランド	775,793,240	0.54
	オーストラリア	2,831,057,304	1.97
	シンガポール	596,225,882	0.42
	マレーシア	667,418,946	0.46
	南アフリカ	761,590,000	0.53
	小計	143,493,897,849	99.88
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	170,525,875	0.12
	合計(純資産総額)	143,664,423,724	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		145,405,891,060	101.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,380,000	10,712.98	1,433,397,777	10,746.26	1,437,849,624	1.375	2020/9/30	1.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,650,000	10,873.49	831,822,367	10,881.37	832,424,860	2.125	2021/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,920,000	10,772.98	745,490,492	10,785.88	746,383,334	1.750	2020/10/31	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,140,000	11,357.42	697,345,852	11,867.19	728,645,777	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,609.58	677,999,613	12,373.70	722,624,225	2.875	2043/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,610,000	10,595.10	700,336,159	10,687.03	706,412,718	1.125	2021/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,920,000	11,659.19	690,224,526	11,845.48	701,252,636	2.875	2028/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,080,000	11,442.08	695,678,695	11,463.33	696,970,947	2.375	2029/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,310,000	10,833.88	683,618,371	10,928.58	689,593,757	2.000	2022/10/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,160.56	661,821,450	11,266.25	668,089,079	2.250	2027/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	11,900.06	618,803,459	12,831.09	667,217,079	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,130,000	10,257.48	628,784,124	10,711.48	656,614,108	1.500	2026/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,917.66	655,059,906	10,920.15	655,209,300	2.000	2022/7/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,960,000	10,899.91	649,635,227	10,897.17	649,471,859	2.375	2021/4/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,280,000	11,492.26	606,791,603	12,117.39	639,798,323	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	10,618.28	627,540,787	10,699.46	632,338,449	1.125	2021/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,660,000	11,159.61	631,634,391	11,170.14	632,229,974	2.375	2024/2/29	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,160,000	10,763.61	555,402,633	11,612.78	599,219,511	2.500	2045/2/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,510,000	10,839.72	597,268,625	10,855.02	598,111,773	1.875	2022/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	11,202.13	582,511,151	11,376.49	591,577,782	2.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,819.83	578,861,232	11,056.10	591,501,795	2.125	2024/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,460,000	10,582.05	577,780,239	10,716.54	585,123,093	1.375	2023/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	11,584.26	538,668,114	12,485.83	580,591,460	2.875	2046/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,680.67	571,415,895	10,765.44	575,951,087	1.500	2022/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	10,928.60	566,101,533	11,094.68	574,704,479	2.250	2023/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,130,000	11,221.40	575,658,123	11,197.96	574,455,540	2.250	2025/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,210,000	10,842.47	564,892,779	11,005.94	573,409,618	2.000	2024/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,270,000	10,756.93	566,890,701	10,866.61	572,670,657	1.875	2022/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,360,000	10,640.27	570,318,889	10,678.60	572,373,181	1.125	2021/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,890,000	11,746.63	574,410,459	11,622.05	568,318,533	2.500	2046/5/15	0.40

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.88
合計	99.88

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	売建	645,799,000.00	68,742,824,787	69,675,254,110	48.50
	カナダドル	売建	34,506,000.00	2,767,688,381	2,811,203,820	1.96
	メキシコペソ	売建	202,086,000.00	1,069,689,549	1,105,410,420	0.77
	ユーロ	売建	468,978,000.00	55,190,344,393	55,348,783,560	38.53
	英ポンド	売建	69,270,000.00	9,025,723,854	9,190,050,900	6.40
	スウェーデンクローナ	売建	44,651,000.00	487,155,504	492,054,020	0.34
	ノルウェークローネ	売建	29,177,000.00	343,047,132	346,330,990	0.24
	デンマーククローネ	売建	48,141,000.00	758,808,840	761,109,210	0.53
	ポーランドズロチ	売建	29,403,000.00	790,486,061	791,822,790	0.55
	オーストラリアドル	売建	39,392,000.00	2,836,080,577	2,870,495,040	2.00
	シンガポールドル	売建	7,675,000.00	589,358,697	599,110,500	0.42
	マレーシアリングット	売建	24,720,000.00	624,247,168	636,787,200	0.44
	南アフリカランド	売建	109,350,000.00	764,102,792	777,478,500	0.54

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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	11,861,453,983	47.12
	カナダ	484,653,837	1.93
	メキシコ	196,430,597	0.78
	ドイツ	1,600,031,950	6.36
	イタリア	2,268,508,835	9.01
	フランス	2,464,725,299	9.79
	オランダ	465,087,227	1.85
	スペイン	1,402,108,041	5.57
	ベルギー	621,280,583	2.47
	オーストリア	338,455,041	1.34
	フィンランド	142,636,179	0.57
	アイルランド	175,741,512	0.70
	イギリス	1,592,902,650	6.33
	スウェーデン	83,442,463	0.33
	ノルウェー	58,538,926	0.23
	デンマーク	130,962,693	0.52
	ポーランド	138,686,941	0.55
	オーストラリア	490,872,428	1.95
	シンガポール	99,575,793	0.40
	マレーシア	112,652,385	0.45
南アフリカ	136,440,084	0.54	
	小計	24,865,187,447	98.78
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		307,893,188	1.22
合計（純資産総額）		25,173,080,635	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		133,272,219	0.53

(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	1,290,000	10,876.86	140,311,594	11,682.76	150,707,615	2.625	2029/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,834.08	127,842,248	11,719.85	138,294,329	2.750	2028/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,568.53	126,822,477	11,378.18	136,538,191	2.375	2027/5/15	0.54
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	580,000	19,349.93	112,229,603	20,982.12	121,696,335	5.750	2032/10/25	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	10,776.90	111,002,108	11,241.38	115,786,268	2.500	2024/5/15	0.46
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	17,677.76	109,602,129	18,479.61	114,573,636	5.500	2029/4/25	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	830,000	10,970.95	91,058,910	13,111.85	108,828,421	3.125	2048/5/15	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	710,000	14,232.96	101,054,047	15,280.16	108,489,189	2.500	2030/5/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	10,594.50	102,766,712	11,149.06	108,145,911	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,036.18	92,703,960	12,860.60	108,029,092	3.000	2049/2/15	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	710,000	14,299.00	101,522,966	14,900.02	105,790,177	2.750	2027/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	10,475.74	97,424,456	11,293.44	105,029,067	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	10,450.34	101,368,330	10,687.24	103,666,237	1.125	2021/7/31	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	800,000	13,093.09	104,744,721	12,942.89	103,543,195	3.000	2022/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	740,000	11,940.96	88,363,162	13,951.40	103,240,360	3.625	2044/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	10,765.45	102,271,791	10,808.86	102,684,193	1.750	2021/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	10,884.32	96,870,458	11,474.93	102,126,882	2.750	2025/6/30	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	450,000	19,345.70	87,055,670	22,455.28	101,048,794	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	760,000	10,996.24	83,571,469	12,930.16	98,269,254	3.125	2044/8/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	480,000	17,778.06	85,334,727	20,396.83	97,904,784	4.000	2038/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,199.28	94,074,014	11,463.33	96,292,038	2.375	2029/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,844.41	92,177,547	11,219.67	95,367,237	2.250	2026/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	9,945.92	88,518,766	10,711.48	95,332,227	1.500	2026/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	10,487.66	88,096,391	11,266.25	94,636,564	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	830,000	10,808.01	89,706,553	11,380.07	94,454,653	2.625	2025/3/31	0.38
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	630,000	14,660.02	92,358,172	14,982.08	94,387,131	3.500	2026/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,836.13	92,107,184	10,904.34	92,686,939	2.500	2021/2/28	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,654.02	90,559,172	10,834.99	92,097,487	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	11,015.53	84,819,595	11,867.19	91,377,402	2.875	2028/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	640,000	14,302.65	91,536,992	14,214.24	90,971,176	4.250	2023/10/25	0.36

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.78
合計	98.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

為替予約取引	米ドル	買建	566,900.00	61,050,027	61,174,179	0.24
	カナダドル	買建	122,100.00	9,917,572	9,948,708	0.04
	ユーロ	買建	526,600.00	62,133,534	62,149,332	0.25

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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	4,065,391,481	99.78
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		8,914,874	0.22
合計(純資産総額)		4,074,306,355	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		3,075,435	0.08

(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	1,140,491	3,634.59	4,145,220,645	3,564.59	4,065,391,481	99.78

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.78
合計	99.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	28,500.00	3,070,248	3,075,435	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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	31,605,838,490	97.87
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		688,595,909	2.13
合計(純資産総額)		32,294,434,399	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	666,960,000	2.07

(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	155,000	6,839.76	1,060,163,240	7,216.00	1,118,480,000	3.46
日本	株式	ソニー	電気機器	93,400	5,506.56	514,313,194	6,347.00	592,809,800	1.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	944,400	571.12	539,372,287	548.40	517,908,960	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	93,400	4,820.35	450,220,838	5,156.00	481,570,400	1.49
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	108,300	4,413.43	477,975,386	4,240.00	459,192,000	1.42
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,800	58,048.26	394,728,208	66,900.00	454,920,000	1.41
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	121,400	4,294.22	521,318,592	3,690.00	447,966,000	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	96,700	3,930.24	380,054,976	3,695.00	357,306,500	1.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	117,300	3,124.88	366,548,780	2,798.50	328,264,050	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	8,000	35,483.40	283,867,200	40,020.00	320,160,000	0.99

日本	株式	KDDI	情報・通信業	111,900	2,723.98	304,814,460	2,825.00	316,117,500	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	95,200	2,950.09	280,849,355	3,286.00	312,827,200	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,864,100	173.67	323,752,032	165.60	308,694,960	0.96
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	49,100	5,452.85	267,734,961	5,779.00	283,748,900	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	12,500	22,890.26	286,128,312	22,220.00	277,750,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	24,000	9,561.20	229,468,992	11,560.00	277,440,000	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	39,800	4,560.48	181,507,172	6,804.00	270,799,200	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,000	12,492.78	237,362,845	14,180.00	269,420,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	13,200	18,912.86	249,649,796	20,340.00	268,488,000	0.83
日本	株式	花王	化学	33,300	7,767.63	258,662,156	7,984.00	265,867,200	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	15,700	12,113.68	190,184,912	16,440.00	258,108,000	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	96,100	3,034.79	291,643,962	2,651.00	254,761,100	0.79
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,500	10,075.24	246,843,380	10,310.00	252,595,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	62,600	3,557.80	222,718,348	4,023.00	251,839,800	0.78
日本	株式	HOYA	精密機器	28,000	6,922.24	193,822,878	8,819.00	246,932,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	16,700	13,480.28	225,120,808	14,520.00	242,484,000	0.75
日本	株式	資生堂	化学	27,600	6,992.31	192,987,760	8,629.00	238,160,400	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	86,400	2,617.75	226,174,163	2,753.00	237,859,200	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,400	4,499.07	258,246,860	4,132.00	237,176,800	0.73
日本	株式	村田製作所	電気機器	43,800	5,033.40	220,462,968	5,185.00	227,103,000	0.70

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	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.83
		食料品	3.98
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.11
		医薬品	5.41
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.55
		機械	4.95
		電気機器	13.74
輸送用機器	7.69		
精密機器	2.20		

	その他製品	2.21
	電気・ガス業	1.61
	陸運業	4.63
	海運業	0.16
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	8.36
	卸売業	4.75
	小売業	4.69
	銀行業	5.75
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.27
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.49
	サービス業	5.08
合 計		97.87

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	42	日本円	662,342,680	666,960,000	2.07

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

R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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	21,159,302,102	53.70
	カナダ	1,299,935,934	3.30
	モーリシャス	102,363	0.00
	パナマ	17,420,481	0.04
	ドイツ	1,030,796,936	2.62
	イタリア	233,083,613	0.59
	フランス	1,253,786,221	3.18

	オランダ	640,607,852	1.63
	スペイン	353,391,405	0.90
	ベルギー	124,022,714	0.31
	オーストリア	28,322,832	0.07
	ルクセンブルク	24,531,846	0.06
	フィンランド	143,058,561	0.36
	アイルランド	616,173,561	1.56
	ポルトガル	19,243,455	0.05
	イギリス	1,957,514,499	4.97
	スイス	1,262,270,058	3.20
	スウェーデン	296,160,475	0.75
	ノルウェー	79,072,541	0.20
	デンマーク	219,103,411	0.56
	ケイマン	75,288,435	0.19
	リベリア	18,111,462	0.05
	オーストラリア	788,214,999	2.00
	バミューダ	133,208,171	0.34
	ニュージーランド	30,549,471	0.08
	パプアニューギニア	7,875,391	0.02
	香港	301,538,024	0.77
	シンガポール	145,979,922	0.37
	イスラエル	65,584,981	0.17
	キュラソー	43,213,879	0.11
	ジャージー	119,439,024	0.30
	英ヴァージン諸島	2,883,167	0.01
	マン島	6,842,691	0.02
	小計	32,496,630,477	82.47
投資証券	アメリカ	792,488,282	2.01
	カナダ	635,080	0.00
	フランス	34,053,626	0.09
	イギリス	20,406,797	0.05
	オーストラリア	62,667,859	0.16
	香港	20,612,480	0.05
	シンガポール	14,504,765	0.04
	小計	945,368,889	2.40
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,961,524,885	15.13
合計（純資産総額）		39,403,524,251	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	4,653,865,454	11.81
	買建	ドイツ	1,394,284,735	3.54

(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		296,752,800	0.75

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	37,832	19,027.83	719,860,910	23,615.05	893,404,738	2.27
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	59,843	12,786.03	765,154,753	14,863.82	889,495,676	2.26
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	3,444	186,258.55	641,474,464	186,210.56	641,309,182	1.63
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	19,795	17,533.76	347,080,889	19,112.63	378,334,550	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	2,584	120,897.16	312,398,270	132,211.71	341,635,066	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	26,688	11,602.63	309,651,008	12,704.34	339,053,490	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	2,469	121,620.50	300,281,030	132,304.52	326,659,870	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	21,873	13,962.78	305,407,926	13,878.51	303,564,693	0.77
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	25,285	10,168.62	257,113,758	11,726.37	296,501,417	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	20,645	11,220.77	231,652,888	13,443.59	277,543,006	0.70
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	34,899	7,799.38	272,190,896	7,714.12	269,215,130	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	14,330	16,532.67	236,913,227	18,778.07	269,089,886	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	60,332	3,523.32	212,569,115	4,039.44	243,707,832	0.62
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	10,730	21,963.10	235,664,168	22,388.00	240,223,283	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	74,368	3,130.44	232,804,802	3,167.45	235,557,070	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	9,091	21,121.61	192,016,569	24,806.49	225,515,812	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	34,214	6,240.52	213,513,273	6,507.57	222,650,205	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	7,496	24,829.11	186,119,078	29,044.50	217,717,644	0.55
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	14,869	13,065.35	194,268,698	14,025.28	208,541,936	0.53

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	36,872	5,358.87	197,592,387	5,480.17	202,065,108	0.51
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	15,734	12,645.82	198,969,394	12,799.31	201,384,375	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	33,472	5,396.28	180,624,398	5,861.13	196,183,917	0.50
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	35,180	5,296.47	186,330,083	5,472.62	192,526,884	0.49
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	21,254	8,342.65	177,314,859	8,947.64	190,173,294	0.48
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	35,368	5,150.42	182,160,077	5,270.81	186,418,107	0.47
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	5,816	28,716.42	167,014,724	31,422.76	182,754,819	0.46
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	4,418	39,259.99	173,450,679	41,318.25	182,544,034	0.46
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	7,839	27,420.38	214,948,380	23,230.85	182,106,705	0.46
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	37,460	4,303.97	161,226,844	4,835.89	181,152,634	0.46
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,839	4,305.50	197,360,201	3,908.86	179,178,344	0.45

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.77
		素材	3.66
		資本財	5.97
		商業・専門サービス	1.08
		運輸	1.63
		自動車・自動車部品	0.92
		耐久消費財・アパレル	1.63
		消費者サービス	1.61
		メディア・娯楽	5.00
		小売	4.15
		食品・生活必需品小売り	1.35
		食品・飲料・タバコ	4.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.90
		ヘルスケア機器・サービス	3.99
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.77
		銀行	6.70
		各種金融	3.66
		保険	3.36
		不動産	0.45

	ソフトウェア・サービス	8.00
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.68
	電気通信サービス	2.13
	公益事業	3.19
	半導体・半導体製造装置	2.60
投資証券		2.40
合計		84.87

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	SP500MIN1912	買建	291	米ドル	43,677,630	4,713,689,830	43,123,290	4,653,865,454	11.81
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6001912	買建	606	ユーロ	11,774,601	1,389,638,409	11,813,970	1,394,284,735	3.54

(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	1,802,000.00	194,225,897	194,437,000	0.49
	カナダドル	買建	170,000.00	13,826,535	13,850,800	0.04
	ユーロ	買建	320,000.00	37,715,347	37,766,400	0.10
	英ポンド	買建	200,000.00	26,563,050	26,535,000	0.07
	スイスフラン	買建	130,000.00	14,131,590	14,154,400	0.04
	デンマーククローネ	買建	80,000.00	1,262,260	1,264,800	0.00
	オーストラリアドル	買建	120,000.00	8,734,272	8,744,400	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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	18,052,426	0.25
	アルゼンチン	7,136,210	0.10

	メキシコ	120,312,620	1.65
	ブラジル	378,171,789	5.19
	チリ	48,037,796	0.66
	コロンビア	21,690,613	0.30
	ペルー	3,204,350	0.04
	オランダ	4,315,235	0.06
	ルクセンブルク	5,217,111	0.07
	ギリシャ	14,844,962	0.20
	トルコ	28,780,061	0.40
	チェコ	7,154,458	0.10
	ハンガリー	13,622,168	0.19
	ポーランド	49,525,748	0.68
	ロシア	195,718,773	2.69
	ケイマン	809,950,252	11.12
	バミューダ	48,526,337	0.67
	香港	157,397,669	2.16
	シンガポール	2,168,989	0.03
	マレーシア	101,280,844	1.39
	タイ	145,358,102	2.00
	フィリピン	55,462,517	0.76
	インドネシア	102,452,822	1.41
	韓国	595,633,437	8.18
	台湾	560,120,021	7.69
	中国	567,447,136	7.79
	インド	446,718,627	6.13
	カタール	59,296,461	0.81
	エジプト	6,172,591	0.08
	南アフリカ	221,985,965	3.05
	アラブ首長国連邦	41,873,295	0.58
	マン島	3,443,295	0.05
	サウジアラビア	120,602,143	1.66
	小計	4,961,674,823	68.13
投資証券	メキシコ	3,831,128	0.05
	南アフリカ	8,672,860	0.12
	小計	12,503,988	0.17
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,308,102,941	31.69
合計（純資産総額）		7,282,281,752	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,350,977,844	32.28

(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		72,029,021	0.99
	売建		3,710	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	49,000	4,544.24	222,667,760	4,532.54	222,094,656	3.05
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	12,230	16,889.47	206,558,340	17,912.56	219,070,628	3.01
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	211,000	778.26	164,214,379	946.56	199,724,160	2.74
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	42,370	3,873.11	164,104,033	4,351.15	184,358,649	2.53
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	824,000	91.77	75,626,061	81.45	67,122,381	0.92
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	3,749	15,295.18	57,341,645	16,515.05	61,914,936	0.85
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	48,000	1,024.98	49,199,155	1,236.33	59,344,128	0.81
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	24,400	1,929.92	47,090,243	2,015.93	49,188,863	0.68
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	52,500	1,120.47	58,825,032	880.64	46,233,600	0.63
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	62,700	666.65	41,799,300	717.77	45,004,618	0.62
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	13,947	3,042.17	42,429,251	3,135.28	43,727,834	0.60
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	558,000	80.49	44,916,768	71.41	39,849,235	0.55
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	43,000	933.94	40,159,442	895.27	38,496,825	0.53
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	銀行	40,600	964.04	39,140,125	922.00	37,433,342	0.51
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	47,612	525.57	25,023,458	764.07	36,379,072	0.50
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	29,427	1,127.61	33,182,438	1,204.58	35,447,411	0.49
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	22,697	1,429.94	32,455,349	1,548.11	35,137,507	0.48
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	4,656	6,354.18	29,585,085	7,317.85	34,071,956	0.47
ブラジル	株式	VALE SA	素材	26,400	1,435.81	37,905,477	1,236.77	32,650,913	0.45
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	3,516	8,540.78	30,029,414	9,119.24	32,063,248	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	680,000	47.88	32,561,664	41.96	28,538,240	0.39

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	107,800	244.22	26,327,606	254.73	27,460,541	0.38
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	46,300	579.11	26,813,246	566.97	26,250,989	0.36
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,350	17,175.46	40,362,350	10,922.58	25,668,071	0.35
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	151,000	176.81	26,699,216	164.56	24,850,010	0.34
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	7,649	2,956.92	22,617,506	3,166.47	24,220,337	0.33
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	283,400	80.93	22,938,283	79.13	22,425,782	0.31
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	39,900	445.56	17,777,904	504.72	20,138,627	0.28
ブラジル	株式	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	各種金融	17,300	837.40	14,487,132	1,151.66	19,923,735	0.27
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	83,900	208.78	17,516,991	230.66	19,352,374	0.27

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.30
		素材	5.04
		資本財	2.23
		商業・専門サービス	0.14
		運輸	1.29
		自動車・自動車部品	1.59
		耐久消費財・アパレル	0.93
		消費者サービス	0.95
		メディア・娯楽	4.69
		小売	5.37
		食品・生活必需品小売り	1.22
		食品・飲料・タバコ	2.70
		家庭用品・パーソナル用品	0.79
		ヘルスケア機器・サービス	0.52
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.31
		銀行	12.40
		各種金融	1.76
		保険	2.83
		不動産	1.77
		ソフトウェア・サービス	1.31
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.91		
電気通信サービス	3.13		
公益事業	1.94		
半導体・半導体製造装置	3.99		
投資証券			0.17
合計			68.31

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 1912	買建	437	米ドル	22,458,895	2,423,763,956	21,784,450	2,350,977,844	32.28

(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	536,034.39	57,803,768	57,835,771	0.79
	メキシコペソ	買建	150,000.00	821,850	820,500	0.01
	香港ドル	買建	895,000.00	12,315,755	12,306,250	0.17
	南アフリカランド	買建	150,000.00	1,073,250	1,066,500	0.01
	チリペソ	売建	24,987.00	3,703	3,710	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 9月30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	18,928,366,800	97.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		569,100,702	2.92
合計(純資産総額)		19,497,467,502	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(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	561,512,000	2.88

(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	1,660	730,474.95	1,212,588,427	830,000	1,377,800,000	7.07
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,714	654,298.47	1,121,467,587	725,000	1,242,650,000	6.37
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,345	163,839.2	875,720,546	195,200	1,043,344,000	5.35
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,415	196,385.17	670,655,380	236,000	805,940,000	4.13
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,848	178,983.47	688,728,425	207,000	796,536,000	4.09
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,239	219,078.57	709,595,500	228,600	740,435,400	3.80
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,462	245,081.53	603,390,729	296,100	728,998,200	3.74
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,310	258,941.68	598,155,284	304,000	702,240,000	3.60
日本	投資証券	G L P 投資法人	4,268	119,086.27	508,260,226	143,400	612,031,200	3.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,625	324,864.1	527,904,165	355,000	576,875,000	2.96
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,085	453,800.14	492,373,152	513,000	556,605,000	2.85
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	7,517	54,446.59	409,275,060	66,700	501,383,900	2.57
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,011	79,788.19	399,818,656	96,900	485,565,900	2.49
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	859	480,670.89	412,896,299	552,000	474,168,000	2.43
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	530	761,187.2	403,429,216	854,000	452,620,000	2.32
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,521	83,851.99	462,946,868	80,600	444,992,600	2.28
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	569	588,778.09	335,014,735	673,000	382,937,000	1.96
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,972	150,310.52	296,412,350	171,600	338,395,200	1.74
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	396	756,189.71	299,451,129	839,000	332,244,000	1.70
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,109	127,288.23	268,450,893	155,200	327,316,800	1.68
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,120	240,699.57	269,583,523	267,400	299,488,000	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,458	182,080.68	265,473,640	198,600	289,558,800	1.49
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	609	453,593.64	276,238,527	460,500	280,444,500	1.44
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,850	132,977	246,007,454	148,900	275,465,000	1.41
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,535	158,628.14	243,494,202	176,400	270,774,000	1.39
日本	投資証券	日本リート投資法人	557	400,337.92	222,988,222	451,500	251,485,500	1.29
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	714	303,583.52	216,758,636	347,000	247,758,000	1.27
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,593	124,027.13	197,575,223	154,800	246,596,400	1.26
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,548	138,083.91	213,753,901	158,600	245,512,800	1.26
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,033	99,097.99	201,466,222	118,700	241,317,100	1.24

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.08
合計	97.08

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	259	日本円	552,769,572	561,512,000	2.88

(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9月30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	12,947,611,518	74.62
	カナダ	332,548,689	1.92
	ドイツ	44,586,456	0.26
	イタリア	3,162,842	0.02
	フランス	563,930,882	3.25
	オランダ	44,743,668	0.26
	スペイン	110,817,721	0.64
	ベルギー	172,465,984	0.99
	アイルランド	40,715,250	0.23
	イギリス	785,547,256	4.53
	オーストラリア	1,110,552,957	6.40
	ニュージーランド	71,818,285	0.41
	香港	340,243,657	1.96
	シンガポール	659,662,700	3.80
	韓国	2,945,034	0.02
	イスラエル	15,038,110	0.09
	ガーンジー	28,673,551	0.17
マン島	3,776,798	0.02	
	小計	17,278,841,358	99.58
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		73,492,991	0.42
合計（純資産総額）		17,352,334,349	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		49,905,560	0.29

(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	75,825	7,593.25	575,758,273	9,257.37	701,940,657	4.05
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	10,225	63,147.56	645,683,900	62,228.83	636,289,791	3.67
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,131	18,383.99	682,616,097	17,047.04	632,973,761	3.65
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	18,121	23,396.14	423,961,540	26,441.47	479,146,045	2.76
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	48,629	8,455.53	411,184,065	9,744.09	473,845,683	2.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	41,850	7,983.92	334,127,119	9,308.10	389,543,985	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,775	20,826.40	349,362,887	23,124.01	387,905,409	2.24
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	44,668	6,984.58	311,987,327	7,948.30	355,035,022	2.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,181	11,928.73	300,377,441	13,905.49	350,154,194	2.02
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	38,129	7,278.12	277,507,621	8,323.86	317,380,824	1.83
香港	投資証券	LINK REIT	252,900	1,165.05	294,643,471	1,177.85	297,879,782	1.72
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,893	29,954.27	236,429,094	35,219.69	277,989,029	1.60
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,481	17,012.58	280,384,381	15,531.43	255,973,531	1.48
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	17,227	13,497.55	232,522,370	14,042.55	241,911,016	1.39
アメリカ	投資証券	HCP INC	58,840	3,347.67	196,977,397	3,833.31	225,552,455	1.30
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,588	14,252.99	193,669,688	16,523.63	224,523,101	1.29
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	194,113	909.76	176,597,975	1,023.96	198,764,724	1.15
アメリカ	投資証券	WIP CAREY INC	20,453	8,225.66	168,239,473	9,717.11	198,744,190	1.15
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,363	10,730.48	164,852,450	12,593.18	193,469,098	1.11
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,712	11,596.00	159,004,407	14,065.21	192,862,209	1.11
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	58,013	2,685.03	155,766,919	3,195.51	185,381,191	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	35,158	4,716.10	165,808,784	5,215.77	183,376,168	1.06
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	636,852	284.23	181,013,718	287.14	182,870,269	1.05
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	10,895	12,576.99	137,026,380	16,002.37	174,345,904	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	87,117	1,873.49	163,212,933	1,846.51	160,862,516	0.93
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	43,485	3,209.54	139,566,882	3,673.59	159,746,357	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,930	11,875.51	129,799,398	14,398.68	157,377,642	0.91
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	20,115	6,842.12	137,629,405	7,455.11	149,959,610	0.86
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	130,225	899.63	117,155,384	1,070.01	139,342,333	0.80
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	11,632	10,521.12	122,381,677	11,961.85	139,140,272	0.80

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.58
合計	99.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	385,000.00	41,535,036	41,541,820	0.24
	カナダドル	買建	33,500.00	2,719,496	2,729,580	0.02
	ユーロ	買建	32,000.00	3,776,352	3,776,640	0.02
	英ポンド	買建	14,000.00	1,857,296	1,857,520	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

Smart-i 8資産バランス 安定型

2019年9月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3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	28.3
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	28.4
RAM新興国債券マザーファンド	15.9
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内株式マザーファンド	7.8
RAM先進国株式マザーファンド	9.9
RAM新興国株式マザーファンド	2.9
RAM国内リートマザーファンド	2.0
RAM先進国リートマザーファンド	2.0
現金等	0.8
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	67.5
米ドル	17.1
ユーロ	7.4
英ポンド	1.6
カナダドル	0.7
その他	5.2
合計	100.0

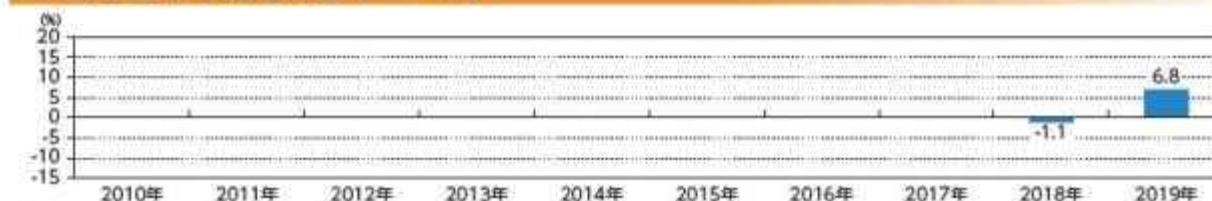
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
 ※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	国・地域	銘柄名	買付日	比率(%)
国内債券	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.10
	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.05
	日本	第138回利付国債(5年)	2023/12/20	1.04
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/9/30	1.00
	アメリカ	US TREASURY N/B	2021/8/15	0.58
	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/10/31	0.52
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2029/2/15	0.60
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/2/15	0.55
	アメリカ	US TREASURY N/B	2027/5/15	0.54
新興国債券	アメリカ	VANECK VECTORS JP, MORGAN E	—	99.78
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.46
	日本	ソニー	—	1.84
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	1.60
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	2.27
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	2.26
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	1.63
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.05
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	3.01
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	2.74
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	7.07
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	6.37
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.35
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	4.05
	アメリカ	EQUINIX INC	—	3.67
	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	3.65

※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)



※ファン内にベンチマークはありません。
 ※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2019年は9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。

Smart-i 8資産バランス 安定成長型

2019年9月30日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3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	15.4
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	15.4
RAM先進国債券マザーファンド	8.0
RAM新興国債券マザーファンド	4.0
RAM国内株式マザーファンド	18.8
RAM先進国株式マザーファンド	21.1
RAM新興国株式マザーファンド	6.9
RAM国内リートマザーファンド	5.0
RAM先進国リートマザーファンド	5.0
現金等	0.4
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	55.1
米ドル	25.2
ユーロ	6.1
英ポンド	1.8
香港ドル	1.4
その他	10.5
合計	100.0

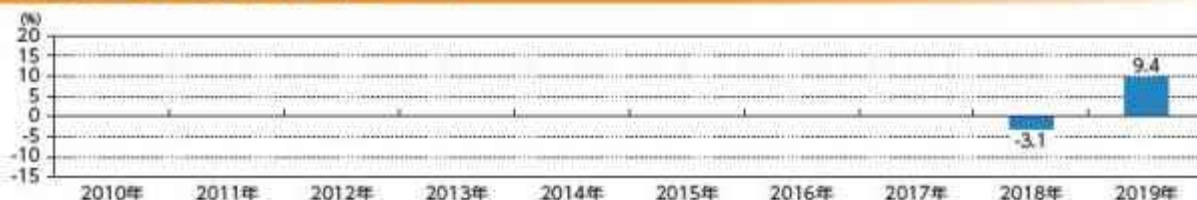
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	国・地域	銘柄名	最新決算日	比率(%)
国内債券	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.10
	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.05
	日本	第138回利付国債(5年)	2023/12/20	1.04
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/9/30	1.00
	アメリカ	US TREASURY N/B	2021/8/15	0.58
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/10/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2029/2/15	0.60
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/2/15	0.55
新興国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2027/5/15	0.54
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	—	99.78
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.46
	日本	ソニー	—	1.84
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	1.60
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	2.27
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	2.26
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	1.63
新興国株式	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.05
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	3.01
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	2.74
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	7.07
	日本	ジャパニリアルエステイト投資法人	—	6.37
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	—	5.35
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	4.05
	アメリカ	EQUINIX INC	—	3.67
	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	3.65

※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)



※ファンド内にベンチマークはありません。
※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2019年は9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。

Smart-i 8資産バランス 成長型

2019年9月30日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3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	6.9
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	7.0
RAM先進国債券マザーファンド	4.0
RAM新興国債券マザーファンド	5.0
RAM国内株式マザーファンド	25.7
RAM先進国株式マザーファンド	28.1
RAM新興国株式マザーファンド	9.9
RAM国内リートマザーファンド	6.1
RAM先進国リートマザーファンド	7.1
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。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	45.9
米ドル	31.0
ユーロ	5.7
英ポンド	2.0
香港ドル	1.9
その他	13.5
合計	100.0

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

※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

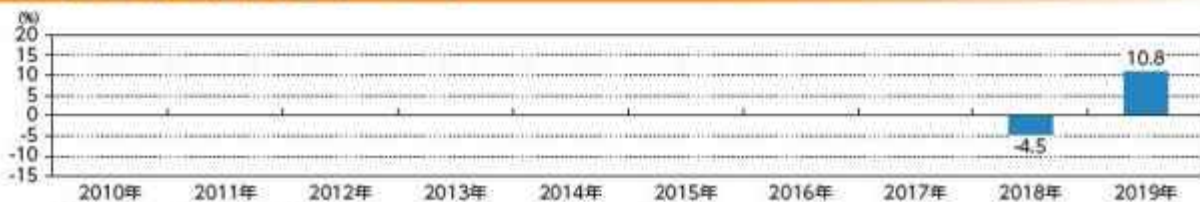
※為替ヘッジをかけている外貨建て資産については、日本円に含めています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	銘柄	銘柄名	最終取得日	比率(%)
国内債券	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.10
	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.05
	日本	第136回利付国債(5年)	2023/12/20	1.04
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/9/30	1.00
	アメリカ	US TREASURY N/B	2021/8/15	0.58
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2020/10/31	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2029/2/15	0.60
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/2/15	0.55
	アメリカ	US TREASURY N/B	2027/5/15	0.54
新興国債券	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	-	99.78
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	3.46
	日本	ソニー	-	1.84
	日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	-	1.60
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	-	2.27
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	2.26
新興国株式	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	1.63
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	3.05
国内リート	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	3.01
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	2.74
	日本	日本ビルファンド投資法人	-	7.07
先進国リート	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	6.37
	日本	野村不動産マスターファンド投資法人	-	5.35
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	-	4.05
	アメリカ	EQUINIX INC	-	3.67
	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	-	3.65

※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)



※ファンド内にベンチマークはありません。

※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2019年は9月末までの騰落率です。

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(7) 申込単位

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

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（6）手取額

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

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。

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。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（7）解約単位

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

（8）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（9）受付の中止および取消

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

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

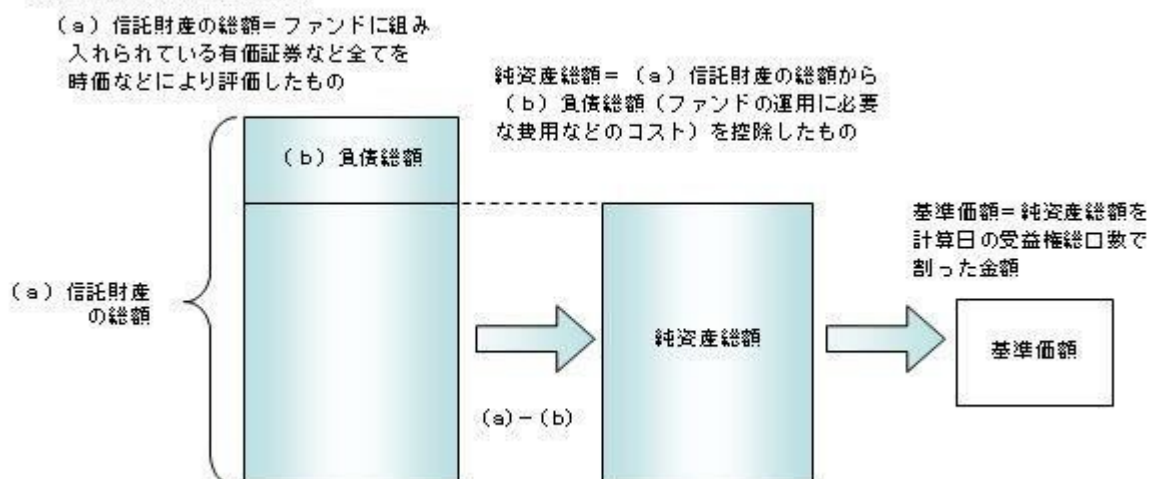
3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（2018年3月27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3月26日から翌年3月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更など

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

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

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

書面決議

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

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

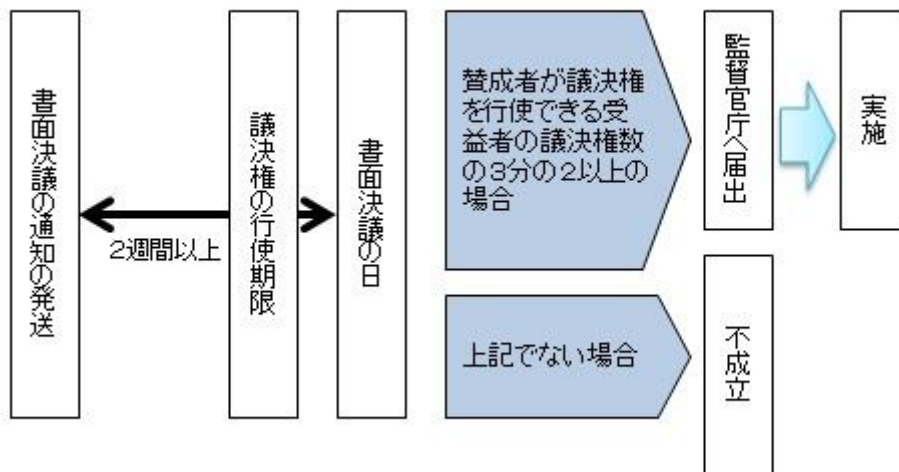
3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

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

＜書面決議の主な流れ＞



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

Smart-i 8資産バランス 安定型
Smart-i 8資産バランス 安定成長型
Smart-i 8資産バランス 成長型

- (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1期計算期間(2018年 3月27日から2019年 3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】

【Smart-i 8資産バランス 安定型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	714,297
親投資信託受益証券	123,491,010
流動資産合計	124,205,307
資産合計	124,205,307
負債の部	
流動負債	
未払解約金	286,817
未払受託者報酬	6,581
未払委託者報酬	45,997
未払利息	1
その他未払費用	3,198
流動負債合計	342,594
負債合計	342,594
純資産の部	
元本等	
元本	121,076,869
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,785,844
（分配準備積立金）	2,100,887
元本等合計	123,862,713
純資産合計	123,862,713
負債純資産合計	124,205,307

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
営業収益	
有価証券売買等損益	2,166,010
営業収益合計	2,166,010
営業費用	
支払利息	82
受託者報酬	6,828
委託者報酬	47,694
その他費用	3,444
営業費用合計	58,048
営業利益又は営業損失（ ）	2,107,962
経常利益又は経常損失（ ）	2,107,962
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,107,962
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（ ）	7,075
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	697,334
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	697,334
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,377
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,377
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,785,844

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2018年 3月27日）から2019年 3月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	124,039,157円
期中一部解約元本額	3,062,288円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	121,076,869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口当たり純資産額	1.0230円
(10,000口当たり純資産額)	(10,230円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	654,195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	1,446,692円
C 収益調整金額	684,957円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	2,785,844円
F 当ファンドの期末残存口数	121,076,869口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	230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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日</p>
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 2019年 3月25日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日</p>
<p>該当事項はありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
	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	2,168,602
合計	2,168,602

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	33,569,724	35,513,411	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	36,107,704	35,667,190	
	R A M先進国債券マザーファンド	20,181,268	19,715,080	
	R A M新興国債券マザーファンド	2,220,095	2,391,708	
	R A M国内株式マザーファンド	8,992,540	9,687,663	
	R A M先進国株式マザーファンド	9,881,646	12,056,596	

R A M新興国株式マザーファンド	2,774,907	3,599,054	
R A M国内リートマザーファンド	1,958,841	2,434,447	
R A M先進国リートマザーファンド	2,192,770	2,425,861	
合計	117,879,495	123,491,010	

(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。

【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 2019年 3月25日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,943,061
親投資信託受益証券	258,844,318
流動資産合計	260,787,379
資産合計	260,787,379
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,928
未払受託者報酬	15,133
未払委託者報酬	121,022
未払利息	5
その他未払費用	7,473
流動負債合計	148,561
負債合計	148,561
純資産の部	
元本等	
元本	253,849,322
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,789,496
（分配準備積立金）	3,670,270
元本等合計	260,638,818
純資産合計	260,638,818
負債純資産合計	260,787,379

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,784,818
営業収益合計	3,784,818
営業費用	
支払利息	279
受託者報酬	15,577
委託者報酬	124,536
その他費用	7,798
営業費用合計	148,190
営業利益又は営業損失（ ）	3,636,628
経常利益又は経常損失（ ）	3,636,628
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,636,628
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（ ）	33,642
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,230,877
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,230,877
剰余金減少額又は欠損金増加額	111,651
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	111,651
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,789,496

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2018年 3月27日）から2019年 3月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	261,694,625円
期中一部解約元本額	7,945,303円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	253,849,322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口当たり純資産額	1.0267円
(10,000口当たり純資産額)	(10,267円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	1,504,950円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	2,165,320円
C 収益調整金額	3,119,226円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	6,789,496円
F 当ファンドの期末残存口数	253,849,322口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	267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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2019年 3月25日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
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	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
	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	3,728,592
合計	3,728,592

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	38,514,488	40,744,476	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	41,440,178	40,934,607	
	R A M先進国債券マザーファンド	21,233,038	20,742,554	
	R A M新興国債券マザーファンド	9,466,221	10,197,959	
	R A M国内株式マザーファンド	45,116,409	48,603,907	
	R A M先進国株式マザーファンド	43,990,855	53,673,242	

R A M新興国株式マザーファンド	13,871,277	17,991,046	
R A M国内リートマザーファンド	10,523,451	13,078,544	
R A M先進国リートマザーファンド	11,640,589	12,877,983	
合計	235,796,506	258,844,318	

(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。

【Smart-i 8資産バランス 成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,168,519
親投資信託受益証券	297,236,299
流動資産合計	298,404,818
資産合計	298,404,818
負債の部	
流動負債	
未払解約金	208,966
未払受託者報酬	18,978
未払委託者報酬	170,752
未払利息	3
その他未払費用	9,407
流動負債合計	408,106
負債合計	408,106
純資産の部	
元本等	
元本	290,279,634
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,717,078
（分配準備積立金）	5,893,078
元本等合計	297,996,712
純資産合計	297,996,712
負債純資産合計	298,404,818

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
営業収益	
有価証券売買等損益	6,172,199
営業収益合計	6,172,199
営業費用	
支払利息	382
受託者報酬	19,639
委託者報酬	176,756
その他費用	9,853
営業費用合計	206,630
営業利益又は営業損失（ ）	5,965,569
経常利益又は経常損失（ ）	5,965,569
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,965,569
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（ ）	72,491
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,898,691
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,898,691
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,691
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	74,691
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,717,078

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2018年 3月27日）から2019年 3月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	298,702,333円
期中一部解約元本額	8,522,699円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	290,279,634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口当たり純資産額	1.0266円
(10,000口当たり純資産額)	(10,266円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	1,982,760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	3,910,318円
C 収益調整金額	1,824,000円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	7,717,078円
F 当ファンドの期末残存口数	290,279,634口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	265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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2019年 3月25日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
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	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日
	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	6,092,077
合計	6,092,077

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	20,022,630	21,181,940	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	21,537,386	21,274,629	
	R A M先進国債券マザーファンド	12,192,688	11,911,036	
	R A M新興国債券マザーファンド	13,663,022	14,719,173	
	R A M国内株式マザーファンド	71,322,664	76,835,905	
	R A M先進国株式マザーファンド	67,712,740	82,616,314	
	R A M新興国株式マザーファンド	22,914,983	29,720,732	

	R A M国内リートマザーファンド	14,580,384	18,120,501	
	R A M先進国リ - トマザーファンド	18,852,092	20,856,069	
	合計	262,798,589	297,236,299	

(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)

「Smart-i 8資産バランス」の各ファンドは「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(為替ヘッジあり)」、「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 - トマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	603,502
コール・ローン	381,914,244
国債証券	56,374,554,270
地方債証券	3,637,449,200
特殊債券	4,422,341,918
社債券	2,632,959,000
未収入金	247,902,600
未収利息	75,745,562
前払費用	2,229,348
流動資産合計	67,775,699,644
資産合計	67,775,699,644
負債の部	

2019年 3月25日現在

流動負債	
未払解約金	378,989,000
未払利息	1,035
流動負債合計	378,990,035
負債合計	378,990,035
純資産の部	
元本等	
元本	63,710,013,442
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,686,696,167
元本等合計	67,396,709,609
純資産合計	67,396,709,609
負債純資産合計	67,775,699,644

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	48,360,481,663円
期中追加設定元本額	28,339,710,653円
期中一部解約元本額	12,990,178,874円
期末元本額	63,710,013,442円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	15,774,776,540円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	309,147,527円
りそなラップ型ファンド(成長型)	152,753,819円
DCりそな グローバルバランス	173,465,108円
つみたてバランスファンド	417,634,016円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	166,672,678円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	24,758,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	6,182,121円
FWりそな国内債券インデックスファンド	44,498,579,435円
Smart-i 国内債券インデックス	115,720,245円
Smart-i 8資産バランス 安定型	33,569,724円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	38,514,488円
Smart-i 8資産バランス 成長型	20,022,630円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,443,459,126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)	3,695,593円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	531,061,521円
2. 計算日における受益権の総数	63,710,013,442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	1.0579円
(10,000口当たり純資産額)	(10,579円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3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	<p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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 3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 3月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	487,877,230
地方債証券	5,840,600
特殊債券	6,222,326
社債券	6,945,000
合計	506,885,156

(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387回利付国債(2年)	300,000,000	300,933,000
	第388回利付国債(2年)	300,000,000	300,990,000
	第389回利付国債(2年)	320,000,000	321,100,800
	第390回利付国債(2年)	350,000,000	351,284,500
	第391回利付国債(2年)	320,000,000	321,254,400
	第392回利付国債(2年)	300,000,000	301,230,000
	第393回利付国債(2年)	150,000,000	150,649,500
	第394回利付国債(2年)	160,000,000	160,732,800
	第395回利付国債(2年)	150,000,000	150,721,500
	第396回利付国債(2年)	140,000,000	140,708,400
	第397回利付国債(2年)	200,000,000	201,060,000
	第124回利付国債(5年)	305,000,000	306,094,950
	第125回利付国債(5年)	271,000,000	272,151,750
	第126回利付国債(5年)	380,000,000	381,884,800
	第127回利付国債(5年)	350,000,000	351,984,500
	第128回利付国債(5年)	470,000,000	473,059,700
	第129回利付国債(5年)	480,000,000	483,475,200
	第130回利付国債(5年)	120,000,000	120,956,400
	第131回利付国債(5年)	470,000,000	474,159,500
	第132回利付国債(5年)	410,000,000	413,936,000
	第133回利付国債(5年)	460,000,000	464,843,800
	第134回利付国債(5年)	710,000,000	718,285,700
	第135回利付国債(5年)	490,000,000	495,997,600
	第136回利付国債(5年)	370,000,000	374,821,100
	第137回利付国債(5年)	550,000,000	557,469,000
	第138回利付国債(5年)	520,000,000	527,332,000
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	60,463,600
	第2回利付国債(40年)	70,000,000	102,769,800
	第3回利付国債(40年)	80,000,000	118,390,400
	第4回利付国債(40年)	130,000,000	193,878,100
	第5回利付国債(40年)	130,000,000	187,601,700
	第6回利付国債(40年)	130,000,000	184,744,300
	第7回利付国債(40年)	130,000,000	177,505,900
	第8回利付国債(40年)	180,000,000	229,404,600
	第9回利付国債(40年)	230,000,000	217,062,500
	第10回利付国債(40年)	220,000,000	244,191,200
	第11回利付国債(40年)	150,000,000	161,260,500
	第308回利付国債(10年)	180,000,000	183,321,000
	第309回利付国債(10年)	120,000,000	121,916,400
	第310回利付国債(10年)	130,000,000	132,297,100
	第311回利付国債(10年)	200,000,000	202,938,000
	第312回利付国債(10年)	770,000,000	788,580,100

第313回利付国債(10年)	520,000,000	535,371,200
第314回利付国債(10年)	130,000,000	133,325,400
第315回利付国債(10年)	375,000,000	386,700,000
第316回利付国債(10年)	300,000,000	308,688,000
第317回利付国債(10年)	180,000,000	185,803,200
第318回利付国債(10年)	366,000,000	376,884,840
第319回利付国債(10年)	490,000,000	507,390,100
第320回利付国債(10年)	352,000,000	363,524,480
第321回利付国債(10年)	291,000,000	301,435,260
第322回利付国債(10年)	220,000,000	227,229,200
第323回利付国債(10年)	340,000,000	352,121,000
第324回利付国債(10年)	183,000,000	188,927,370
第325回利付国債(10年)	470,000,000	486,417,100
第326回利付国債(10年)	280,000,000	289,486,400
第327回利付国債(10年)	387,000,000	401,570,550
第328回利付国債(10年)	461,000,000	475,807,320
第329回利付国債(10年)	557,000,000	580,789,470
第330回利付国債(10年)	257,000,000	268,636,960
第331回利付国債(10年)	90,000,000	93,259,800
第332回利付国債(10年)	312,000,000	323,934,000
第333回利付国債(10年)	445,000,000	462,915,700
第334回利付国債(10年)	621,000,000	647,280,720
第335回利付国債(10年)	135,000,000	140,242,050
第336回利付国債(10年)	230,000,000	239,342,600
第337回利付国債(10年)	150,000,000	154,351,500
第338回利付国債(10年)	621,000,000	643,560,930
第339回利付国債(10年)	205,000,000	212,765,400
第340回利付国債(10年)	634,000,000	658,998,620
第341回利付国債(10年)	240,000,000	248,193,600
第342回利付国債(10年)	170,000,000	173,672,000
第343回利付国債(10年)	260,000,000	265,725,200
第344回利付国債(10年)	340,000,000	347,619,400
第345回利付国債(10年)	410,000,000	419,335,700
第346回利付国債(10年)	640,000,000	654,777,600
第347回利付国債(10年)	510,000,000	521,714,700
第348回利付国債(10年)	290,000,000	296,614,900
第349回利付国債(10年)	370,000,000	378,188,100
第350回利付国債(10年)	510,000,000	520,898,700
第351回利付国債(10年)	280,000,000	285,751,200
第352回利付国債(10年)	520,000,000	530,212,800
第353回利付国債(10年)	470,000,000	478,770,200
第1回利付国債(30年)	10,000,000	12,970,500
第11回利付国債(30年)	10,000,000	12,245,700

第12回利付国債(30年)	40,000,000	51,351,200	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	114,501,600	
第14回利付国債(30年)	20,000,000	26,672,400	
第15回利付国債(30年)	100,000,000	135,306,000	
第16回利付国債(30年)	20,000,000	27,134,400	
第17回利付国債(30年)	110,000,000	147,936,800	
第18回利付国債(30年)	120,000,000	159,897,600	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	133,547,000	
第20回利付国債(30年)	60,000,000	82,288,800	
第21回利付国債(30年)	90,000,000	120,705,300	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	68,889,000	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	220,944,000	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	138,394,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	135,276,000	
第26回利付国債(30年)	225,000,000	309,048,750	
第27回利付国債(30年)	105,000,000	146,746,950	
第28回利付国債(30年)	150,000,000	210,594,000	
第29回利付国債(30年)	140,000,000	194,665,800	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	261,641,400	
第31回利付国債(30年)	150,000,000	204,417,000	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	298,705,950	
第33回利付国債(30年)	240,000,000	320,097,600	
第34回利付国債(30年)	195,000,000	269,187,750	
第35回利付国債(30年)	226,000,000	303,420,820	
第36回利付国債(30年)	235,000,000	316,808,200	
第37回利付国債(30年)	260,000,000	345,961,200	
第38回利付国債(30年)	160,000,000	209,939,200	
第39回利付国債(30年)	140,000,000	187,223,400	
第40回利付国債(30年)	165,000,000	217,245,600	
第41回利付国債(30年)	145,000,000	187,853,300	
第42回利付国債(30年)	130,000,000	168,577,500	
第43回利付国債(30年)	140,000,000	181,925,800	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	195,102,000	
第45回利付国債(30年)	150,000,000	188,062,500	
第46回利付国債(30年)	180,000,000	225,806,400	
第47回利付国債(30年)	220,000,000	281,679,200	
第48回利付国債(30年)	183,000,000	225,477,960	
第49回利付国債(30年)	170,000,000	209,542,000	
第50回利付国債(30年)	190,000,000	205,505,900	
第51回利付国債(30年)	180,000,000	171,781,200	
第52回利付国債(30年)	210,000,000	211,018,500	
第53回利付国債(30年)	190,000,000	195,819,700	

第54回利付国債(30年)	190,000,000	205,760,500
第55回利付国債(30年)	80,000,000	86,580,800
第56回利付国債(30年)	180,000,000	194,677,200
第57回利付国債(30年)	170,000,000	183,737,700
第58回利付国債(30年)	270,000,000	291,610,800
第59回利付国債(30年)	180,000,000	189,666,000
第60回利付国債(30年)	140,000,000	154,988,400
第61回利付国債(30年)	150,000,000	157,765,500
第46回利付国債(20年)	10,000,000	10,297,300
第47回利付国債(20年)	210,000,000	217,484,400
第48回利付国債(20年)	60,000,000	62,822,400
第49回利付国債(20年)	30,000,000	31,371,600
第50回利付国債(20年)	150,000,000	156,258,000
第51回利付国債(20年)	90,000,000	94,429,800
第52回利付国債(20年)	190,000,000	200,887,000
第53回利付国債(20年)	20,000,000	21,260,000
第54回利付国債(20年)	180,000,000	191,835,000
第55回利付国債(20年)	100,000,000	106,577,000
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,712,900
第57回利付国債(20年)	110,000,000	117,484,400
第58回利付国債(20年)	100,000,000	107,356,000
第59回利付国債(20年)	40,000,000	42,861,200
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,807,200
第61回利付国債(20年)	50,000,000	52,409,000
第62回利付国債(20年)	80,000,000	83,399,200
第63回利付国債(20年)	60,000,000	65,112,000
第64回利付国債(20年)	120,000,000	131,380,800
第65回利付国債(20年)	380,000,000	418,060,800
第67回利付国債(20年)	20,000,000	22,108,600
第68回利付国債(20年)	90,000,000	100,846,800
第69回利付国債(20年)	60,000,000	66,929,400
第70回利付国債(20年)	110,000,000	125,098,600
第71回利付国債(20年)	100,000,000	112,668,000
第72回利付国債(20年)	150,000,000	169,095,000
第73回利付国債(20年)	180,000,000	202,923,000
第75回利付国債(20年)	100,000,000	113,894,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	112,683,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	22,657,600
第78回利付国債(20年)	50,000,000	56,612,000
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,771,000
第80回利付国債(20年)	180,000,000	206,074,800
第81回利付国債(20年)	30,000,000	34,326,600
第82回利付国債(20年)	170,000,000	195,634,300

第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,562,700	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	137,934,000	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	174,310,500	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	117,622,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	105,223,500	
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	82,243,700	
第90回利付国債(20年)	90,000,000	106,257,600	
第91回利付国債(20年)	10,000,000	11,882,300	
第92回利付国債(20年)	105,000,000	123,783,450	
第93回利付国債(20年)	20,000,000	23,512,400	
第94回利付国債(20年)	90,000,000	106,534,800	
第95回利付国債(20年)	35,000,000	42,203,000	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	83,237,000	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	156,330,200	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	83,575,800	
第99回利付国債(20年)	205,000,000	245,616,650	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	182,895,730	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	24,588,200	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	178,957,550	
第103回利付国債(20年)	20,000,000	24,497,200	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	12,062,000	
第105回利付国債(20年)	132,000,000	159,738,480	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	48,788,800	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	157,887,600	
第108回利付国債(20年)	130,000,000	155,335,700	
第109回利付国債(20年)	130,000,000	155,825,800	
第110回利付国債(20年)	115,000,000	140,159,700	
第111回利付国債(20年)	200,000,000	246,676,000	
第112回利付国債(20年)	55,000,000	67,269,400	
第113回利付国債(20年)	195,000,000	239,200,650	
第114回利付国債(20年)	210,000,000	258,459,600	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	124,154,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	174,403,600	
第117回利付国債(20年)	175,000,000	216,076,000	
第118回利付国債(20年)	261,000,000	320,369,670	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	72,296,400	
第120回利付国債(20年)	40,000,000	47,296,800	
第121回利付国債(20年)	245,000,000	298,816,700	
第122回利付国債(20年)	20,000,000	24,163,200	
第123回利付国債(20年)	275,000,000	342,779,250	
第124回利付国債(20年)	100,000,000	123,473,000	

第125回利付国債(20年)	60,000,000	75,727,200
第126回利付国債(20年)	100,000,000	123,818,000
第127回利付国債(20年)	50,000,000	61,310,500
第128回利付国債(20年)	285,000,000	350,396,100
第129回利付国債(20年)	20,000,000	24,345,200
第130回利付国債(20年)	200,000,000	244,040,000
第131回利付国債(20年)	90,000,000	108,698,400
第132回利付国債(20年)	190,000,000	229,968,400
第133回利付国債(20年)	125,000,000	152,878,750
第134回利付国債(20年)	85,000,000	104,187,900
第135回利付国債(20年)	40,000,000	48,513,600
第136回利付国債(20年)	80,000,000	95,995,200
第137回利付国債(20年)	260,000,000	315,991,000
第138回利付国債(20年)	50,000,000	59,454,500
第139回利付国債(20年)	100,000,000	120,222,000
第140回利付国債(20年)	290,000,000	353,159,100
第141回利付国債(20年)	155,000,000	189,118,600
第142回利付国債(20年)	120,000,000	148,044,000
第143回利付国債(20年)	355,000,000	429,024,600
第145回利付国債(20年)	385,000,000	471,459,450
第146回利付国債(20年)	280,000,000	343,487,200
第147回利付国債(20年)	275,000,000	333,935,250
第148回利付国債(20年)	365,000,000	438,171,550
第149回利付国債(20年)	260,000,000	312,514,800
第150回利付国債(20年)	410,000,000	487,203,000
第151回利付国債(20年)	205,000,000	237,543,750
第152回利付国債(20年)	240,000,000	278,248,800
第153回利付国債(20年)	240,000,000	282,177,600
第154回利付国債(20年)	298,000,000	345,837,940
第155回利付国債(20年)	250,000,000	281,932,500
第156回利付国債(20年)	290,000,000	298,056,200
第157回利付国債(20年)	240,000,000	238,212,000
第158回利付国債(20年)	200,000,000	208,376,000
第159回利付国債(20年)	210,000,000	222,293,400
第160回利付国債(20年)	150,000,000	161,338,500
第161回利付国債(20年)	250,000,000	264,107,500
第162回利付国債(20年)	270,000,000	284,936,400
第163回利付国債(20年)	250,000,000	263,537,500
第164回利付国債(20年)	290,000,000	300,147,100
第165回利付国債(20年)	250,000,000	258,387,500
第166回利付国債(20年)	260,000,000	278,122,000
第167回利付国債(20年)	210,000,000	216,413,400

		国債証券合計	50,904,000,000	56,374,554,270
地方債証券	第705回東京都公募公債		100,000,000	103,113,000
	第723回東京都公募公債		100,000,000	103,368,000
	第729回東京都公募公債		100,000,000	103,386,000
	第746回東京都公募公債		100,000,000	103,048,000
	第761回東京都公募公債		100,000,000	100,485,000
	平成28年度第8回北海道公募公債		100,000,000	100,303,000
	平成29年度第6回北海道公募公債		100,000,000	99,949,000
	第211回神奈川県公募公債		100,000,000	102,454,000
	第220回神奈川県公募公債		100,000,000	100,488,000
	第376回大阪府公募公債		110,000,000	113,966,600
	平成29年度第4回京都府公募公債		100,000,000	101,482,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債		100,000,000	101,359,000
	平成27年度第4回静岡県公募公債		100,000,000	100,175,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債		100,000,000	102,838,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債		100,000,000	100,407,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債		100,000,000	101,888,000
	平成29年度第3回広島県公募公債		100,000,000	101,232,000
	平成30年度第1回広島県公募公債		100,000,000	101,606,000
	第8回埼玉県公募公債		100,000,000	121,756,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債		100,000,000	102,993,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債		100,000,000	103,549,000
	平成29年度第6回千葉県公募公債		100,000,000	102,119,000
	第120回共同発行市場公募地方債		100,000,000	102,677,000
	第123回共同発行市場公募地方債		100,000,000	103,650,000
	第133回共同発行市場公募地方債		100,000,000	103,450,000
	第156回共同発行市場公募地方債		100,000,000	100,629,000
	第169回共同発行市場公募地方債		100,000,000	101,573,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債		100,000,000	103,111,000
	第26回横浜市公募公債		100,000,000	120,663,000
	平成26年度第5回福岡市公募公債		100,000,000	102,957,000
	平成29年度第2回福岡市公募公債		100,000,000	99,983,000
	平成27年度第2回広島市公募公債		100,000,000	103,069,000
	平成29年度第3回千葉市公募公債		120,000,000	122,151,600
平成29年度第1回鹿児島県公募公債		100,000,000	100,026,000	
平成29年度第5回福井県公募公債		100,000,000	101,545,000	
		地方債証券合計	3,530,000,000	3,637,449,200
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		100,000,000	103,027,000
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		100,000,000	102,272,000
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券		100,000,000	116,901,000
	第27回道路債券		100,000,000	111,785,000

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	103,863,350	
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	118,202,040	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	131,208,780	
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	103,009,000	
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	103,387,000	
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	136,434,060	
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	101,339,000	
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	102,287,000	
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	101,509,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	113,294,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	131,371,340	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,914,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,689,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	112,715,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,985,000	
第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,155,000	
第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,230,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	118,073,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,064,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,715,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,741,000	95,352,407	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,149,000	95,525,458	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,063,000	96,297,868	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,116,000	96,496,133	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,881,000	99,051,656	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,417,000	100,198,347	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	88,586,000	89,080,309	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	91,292,000	91,868,052	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	95,865,000	96,349,118	
第52回日本学生支援債券	100,000,000	99,949,000	
第310回信金中金債	100,000,000	100,315,000	
第327回信金中金債	100,000,000	100,043,000	
第340回信金中金債	100,000,000	100,239,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	103,270,000	
第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,987,000	
第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,904,000	
第61回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,234,000	

	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,752,000
	特殊債券合計	4,252,110,000	4,422,341,918
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,324,000
	第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,266,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,046,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,795,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,966,000
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,723,000
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,181,000
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	100,016,000
	第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,993,000
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,407,000
	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	99,722,000
	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	100,297,000
	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	100,457,000
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,015,000
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,444,000
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,471,000
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,250,000
	第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,258,000
	第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,016,000
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,586,000
	第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,654,000
	第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,398,000
	第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,868,000
	第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000
	第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,805,000
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,001,000
	社債券合計	2,600,000,000	2,632,959,000
	合計		67,067,304,388

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（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	112,822,621
コール・ローン	315,189,889
国債証券	63,165,032,432
派生商品評価勘定	774,882,276
未収入金	459,510
未収利息	428,659,314
前払費用	50,386,057
流動資産合計	64,847,432,099
資産合計	
64,847,432,099	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	769,613
未払金	170,454,553
未払解約金	452,000
未払利息	854
流動負債合計	171,677,020
負債合計	
171,677,020	
純資産の部	
元本等	
元本	65,475,061,200
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	799,306,121
元本等合計	64,675,755,079
純資産合計	
64,675,755,079	
負債純資産合計	
64,847,432,099	

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	48,276,505,841円
期中追加設定元本額	23,280,242,568円
期中一部解約元本額	6,081,687,209円
期末元本額	65,475,061,200円
期末元本の内訳	
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	179,249,472円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	26,650,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	6,649,810円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	47,823,047,225円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	73,357,802円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,107,704円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	41,440,178円
Smart-i 8資産バランス 成長型	21,537,386円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	6,210,075,657円
先進国債券インデックスファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	11,052,971,226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）	3,974,739円
2. 計算日における受益権の総数	65,475,061,200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	799,306,121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	0.9878円
(10,000口当たり純資産額)	(9,878円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2019年 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,401,149,620
合計		1,401,149,620

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2019年 3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	114,489,085	-	113,779,590	709,495
	米ドル	61,241,175	-	60,991,900	249,275
	ユーロ	32,227,840	-	31,767,040	460,800
	英ポンド	21,020,070	-	21,020,650	580
	売建	63,378,149,848	-	62,603,327,690	774,822,158
	米ドル	29,192,171,263	-	28,973,039,070	219,132,193
	カナダドル	1,274,817,430	-	1,240,311,000	34,506,430
	メキシコペソ	513,788,449	-	512,714,670	1,073,779
	ユーロ	24,675,154,311	-	24,284,413,000	390,741,311
	英ポンド	4,350,897,762	-	4,280,072,760	70,825,002
	スウェーデンクローナ	230,577,487	-	228,097,600	2,479,887
	ノルウェークローネ	144,716,286	-	143,199,400	1,516,886
	デンマーククローネ	326,391,692	-	321,208,450	5,183,242
	ポーランドズロチ	399,431,550	-	394,704,240	4,727,310
	オーストラリアドル	1,334,419,320	-	1,312,156,980	22,262,340

	シンガポールドル	266,960,462	-	264,111,070	2,849,392
	マレーシアリン ギット	300,793,333	-	297,159,900	3,633,433
	南アフリカランド	368,030,503	-	352,139,550	15,890,953
	合計	63,492,638,933	-	62,717,107,280	774,112,663

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,405,938.59	
		US TREASURY N/B	850,000.00	848,356.44	
		US TREASURY N/B	760,000.00	754,017.96	
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,332,149.35	
		US TREASURY N/B	940,000.00	938,035.49	
		US TREASURY N/B	850,000.00	841,649.34	
		US TREASURY N/B	1,910,000.00	1,887,878.18	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,498,886.70	

US TREASURY N/B	910,000.00	920,628.43
US TREASURY N/B	910,000.00	900,473.39
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,649,516.28
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,400,929.60
US TREASURY N/B	860,000.00	850,543.35
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,118,942.72
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,071,128.42
US TREASURY N/B	700,000.00	691,919.90
US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,444,915.13
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,604,656.16
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,153,616.17
US TREASURY N/B	780,000.00	770,478.46
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,370,208.76
US TREASURY N/B	790,000.00	778,643.75
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,408,661.68
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,307,109.31
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,067,554.62
US TREASURY N/B	920,000.00	910,907.73
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,082,769.49
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,914,917.85
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,546,015.54
US TREASURY N/B	3,350,000.00	3,316,565.32
US TREASURY N/B	980,000.00	974,066.39
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,135,849.59
US TREASURY N/B	900,000.00	905,765.58
US TREASURY N/B	920,000.00	912,471.08
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,325,867.15
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,303,300.70
US TREASURY N/B	930,000.00	924,205.63
US TREASURY N/B	3,560,000.00	3,497,074.15
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,648,143.15
US TREASURY N/B	850,000.00	848,439.40
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,182,302.25
US TREASURY N/B	900,000.00	900,861.30
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,145,823.00

US TREASURY N/B	970,000.00	968,711.64
US TREASURY N/B	960,000.00	960,918.72
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,196,410.08
US TREASURY N/B	880,000.00	878,762.45
US TREASURY N/B	760,000.00	772,706.21
US TREASURY N/B	600,000.00	603,750.00
US TREASURY N/B	910,000.00	903,903.63
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,274,076.05
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,914.00
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,569,089.57
US TREASURY N/B	940,000.00	946,756.25
US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,683,675.09
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,165,155.38
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,515,585.90
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,954,489.42
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,021,875.00
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,224,710.67
US TREASURY N/B	980,000.00	976,056.97
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,318,763.55
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,441,439.04
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,330,656.58
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,319,372.99
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,045,507.78
US TREASURY N/B	830,000.00	821,343.34
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,119,728.45
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,420,280.43
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,609,843.68
US TREASURY N/B	830,000.00	812,297.59
US TREASURY N/B	1,010,000.00	999,071.39
US TREASURY N/B	2,460,000.00	2,442,366.72
US TREASURY N/B	800,000.00	788,406.24
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,107,574.94
US TREASURY N/B	900,000.00	886,570.29
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,256,258.09
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,083,156.25

US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,136,658.16	
US TREASURY N/B	750,000.00	738,486.30	
US TREASURY N/B	990,000.00	978,359.67	
US TREASURY N/B	880,000.00	866,250.00	
US TREASURY N/B	870,000.00	866,499.55	
US TREASURY N/B	900,000.00	885,867.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	991,562.49	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,135,669.85	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,085,777.36	
US TREASURY N/B	840,000.00	829,106.20	
US TREASURY N/B	910,000.00	890,804.64	
US TREASURY N/B	880,000.00	864,771.86	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,184,718.72	
US TREASURY N/B	940,000.00	927,405.41	
US TREASURY N/B	900,000.00	891,878.85	
US TREASURY N/B	980,000.00	958,275.36	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,664,446.72	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,034,759.33	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,315,657.72	
US TREASURY N/B	950,000.00	953,896.42	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,168,591.76	
US TREASURY N/B	850,000.00	825,761.65	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,216,218.72	
US TREASURY N/B	740,000.00	718,435.88	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,110,097.56	
US TREASURY N/B	920,000.00	897,215.55	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,161,553.06	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,567,187.36	
US TREASURY N/B	960,000.00	935,549.95	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,834,804.62	
US TREASURY N/B	990,000.00	954,305.84	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,035,001.14	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,772,892.55	
US TREASURY N/B	990,000.00	1,009,780.59	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,443,992.69	

US TREASURY N/B	920,000.00	885,392.54	
US TREASURY N/B	800,000.00	816,500.00	
US TREASURY N/B	860,000.00	826,944.09	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,231,171.80	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,059,514.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,026,347.60	
US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,715,273.28	
US TREASURY N/B	920,000.00	914,052.29	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,157,298.71	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,178,617.15	
US TREASURY N/B	450,000.00	457,215.79	
US TREASURY N/B	910,000.00	908,791.33	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,841,518.34	
US TREASURY N/B	890,000.00	883,603.12	
US TREASURY N/B	850,000.00	844,123.01	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,104,818.73	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,546,046.94	
US TREASURY N/B	810,000.00	798,767.56	
US TREASURY N/B	900,000.00	887,203.08	
US TREASURY N/B	880,000.00	872,575.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,807,312.50	
US TREASURY N/B	970,000.00	949,425.33	
US TREASURY N/B	820,000.00	812,600.73	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,246.00	
US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,479,229.86	
US TREASURY N/B	800,000.00	792,156.24	
US TREASURY N/B	970,000.00	966,873.98	
US TREASURY N/B	900,000.00	909,210.87	
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,748,571.77	
US TREASURY N/B	900,000.00	921,498.03	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,047,361.06	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,381,691.68	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,828,464.70	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,134,288.98	
US TREASURY N/B	580,000.00	594,160.12	

US TREASURY N/B	900,000.00	928,740.15	
US TREASURY N/B	1,840,000.00	1,803,163.93	
US TREASURY N/B	660,000.00	676,061.69	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,039,687.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,039,882.80	
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,411,125.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,548,925.65	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,017,382.80	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,340,384.55	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,059,509.24	
US TREASURY N/B	1,950,000.00	1,855,394.38	
US TREASURY N/B	3,130,000.00	2,944,524.33	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,615,776.43	
US TREASURY N/B	1,880,000.00	1,860,649.16	
US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,966,613.96	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,827,380.79	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,269,003.82	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,584,525.60	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,257,747.52	
US TREASURY N/B	220,000.00	276,082.79	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,195,897.48	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,791,593.54	
US TREASURY N/B	180,000.00	223,776.55	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,319,525.34	
US TREASURY N/B	280,000.00	381,811.69	
US TREASURY N/B	450,000.00	582,266.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	377,291.01	
US TREASURY N/B	330,000.00	442,722.06	
US TREASURY N/B	190,000.00	238,301.55	
US TREASURY N/B	220,000.00	280,452.72	
US TREASURY N/B	460,000.00	516,358.97	
US TREASURY N/B	340,000.00	421,314.43	
US TREASURY N/B	340,000.00	435,073.82	
US TREASURY N/B	420,000.00	528,798.01	
US TREASURY N/B	680,000.00	884,371.82	

US TREASURY N/B	530,000.00	667,955.23	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,391,501.07	
US TREASURY N/B	470,000.00	583,011.12	
US TREASURY N/B	550,000.00	728,567.34	
US TREASURY N/B	380,000.00	479,994.91	
US TREASURY N/B	480,000.00	555,815.61	
US TREASURY N/B	390,000.00	410,467.35	
US TREASURY N/B	590,000.00	620,202.92	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,531.25	
US TREASURY N/B	740,000.00	728,668.75	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,337,687.43	
US TREASURY N/B	840,000.00	880,014.82	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,344,422.93	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,261,324.19	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,379,098.37	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,409,434.34	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,441,532.79	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,727,923.72	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,260,173.37	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,136,601.53	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,383,591.78	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,291,158.93	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,578,620.27	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,132,979.59	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,057,884.31	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,628,505.79	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,149,640.62	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,167,965.56	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,187,006.19	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,177,575.75	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,255,028.87	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,420,161.88	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,517,968.75	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,328,361.32	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,702,638.57	

	US TREASURY N/B	910,000.00	930,226.11
	米ドル 小計	263,980,000.00	265,806,835.69 (29,214,829,310)
カナダドル	GOV OF CANADA	560,000.00	559,412.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	350,584.50
	GOV OF CANADA	460,000.00	470,235.00
	GOV OF CANADA	440,000.00	441,144.00
	GOV OF CANADA	960,000.00	949,180.80
	GOV OF CANADA	380,000.00	382,713.20
	GOV OF CANADA	320,000.00	324,112.00
	GOV OF CANADA	820,000.00	807,757.40
	GOV OF CANADA	50,000.00	50,147.00
	GOV OF CANADA	290,000.00	300,614.00
	GOV OF CANADA	570,000.00	559,380.90
	GOV OF CANADA	800,000.00	776,328.00
	GOV OF CANADA	460,000.00	477,332.80
	GOV OF CANADA	460,000.00	451,890.20
	GOV OF CANADA	480,000.00	484,123.20
	GOV OF CANADA	610,000.00	609,640.10
	GOV OF CANADA	340,000.00	347,133.20
	GOV OF CANADA	360,000.00	372,870.00
	GOV OF CANADA	500,000.00	524,935.00
	GOV OF CANADA	360,000.00	375,300.00
	GOV OF CANADA	460,000.00	457,948.40
	GOV OF CANADA	650,000.00	620,626.50
	GOV OF CANADA	460,000.00	475,433.00
	GOV OF CANADA	340,000.00	470,356.00
	GOV OF CANADA	280,000.00	296,284.80
	GOV OF CANADA	360,000.00	540,500.40
	GOV OF CANADA	390,000.00	579,450.30
	GOV OF CANADA	420,000.00	578,596.20
	GOV OF CANADA	530,000.00	705,186.20
	GOV OF CANADA	540,000.00	642,924.00
	GOV OF CANADA	160,000.00	163,640.00
	GOV OF CANADA	160,000.00	203,076.80

	カナダドル 小計	14,320,000.00	15,348,855.90 (1,255,536,412)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	7,910,000.00	7,931,436.10
	UNITED MEXICAN STATE	8,890,000.00	8,665,527.50
	UNITED MEXICAN STATE	6,100,000.00	6,021,455.18
	UNITED MEXICAN STATE	8,360,000.00	8,061,464.40
	UNITED MEXICAN STATE	8,150,000.00	8,222,535.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,970,000.00	8,775,926.40
	UNITED MEXICAN STATE	4,860,000.00	4,309,799.40
	UNITED MEXICAN STATE	10,190,000.00	9,932,294.90
	UNITED MEXICAN STATE	3,610,000.00	3,740,609.80
	UNITED MEXICAN STATE	3,960,000.00	3,848,209.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,520,000.00	2,406,171.60
	UNITED MEXICAN STATE	2,850,000.00	3,284,710.50
	UNITED MEXICAN STATE	4,370,000.00	4,410,859.50
	UNITED MEXICAN STATE	5,910,000.00	5,503,510.20
	UNITED MEXICAN STATE	3,310,000.00	3,151,262.33
	メキシコペソ 小計	88,960,000.00	88,265,772.01 (507,528,189)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	450,000.00	476,230.95
	GOV OF AUSTRIA	540,000.00	594,440.10
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	270,433.68
	GOV OF AUSTRIA	310,000.00	314,586.45
	GOV OF AUSTRIA	290,000.00	330,982.22
	GOV OF AUSTRIA	250,000.00	253,697.00
	GOV OF AUSTRIA	350,000.00	383,777.80
	GOV OF AUSTRIA	340,000.00	375,946.84
	GOV OF AUSTRIA	390,000.00	424,498.62
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	350,131.93
	GOV OF AUSTRIA	340,000.00	359,414.68
	GOV OF AUSTRIA	400,000.00	414,215.43
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	363,908.88
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	294,928.92
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	184,239.46
	GOV OF AUSTRIA	290,000.00	364,497.52

GOV OF AUSTRIA	410,000.00	648,616.02
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	330,218.90
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	234,299.10
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	207,476.28
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	186,774.33
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	95,692.68
GOV OF BELGIUM	670,000.00	713,832.74
GOV OF BELGIUM	530,000.00	593,708.12
GOV OF BELGIUM	400,000.00	454,139.20
GOV OF BELGIUM	490,000.00	571,100.39
GOV OF BELGIUM	470,000.00	522,264.00
GOV OF BELGIUM	320,000.00	326,907.84
GOV OF BELGIUM	430,000.00	493,006.09
GOV OF BELGIUM	360,000.00	372,733.56
GOV OF BELGIUM	610,000.00	642,347.69
GOV OF BELGIUM	310,000.00	407,340.00
GOV OF BELGIUM	470,000.00	501,334.90
GOV OF BELGIUM	410,000.00	430,259.74
GOV OF BELGIUM	550,000.00	806,030.97
GOV OF BELGIUM	610,000.00	637,135.24
GOV OF BELGIUM	190,000.00	198,988.10
GOV OF BELGIUM	400,000.00	418,451.42
GOV OF BELGIUM	270,000.00	383,535.56
GOV OF BELGIUM	120,000.00	128,058.00
GOV OF BELGIUM	260,000.00	341,549.52
GOV OF BELGIUM	650,000.00	1,050,937.92
GOV OF BELGIUM	130,000.00	139,106.31
GOV OF BELGIUM	230,000.00	262,632.40
GOV OF BELGIUM	570,000.00	911,418.64
GOV OF BELGIUM	320,000.00	497,243.44
GOV OF BELGIUM	360,000.00	381,182.40
GOV OF BELGIUM	180,000.00	191,962.80
GOV OF BELGIUM	140,000.00	165,647.22
GOV OF BELGIUM	130,000.00	149,305.85
GOV OF FINLAND	210,000.00	218,778.42

GOV OF FINLAND	200,000.00	202,676.40	
GOV OF FINLAND	210,000.00	227,445.12	
GOV OF FINLAND	150,000.00	152,064.96	
GOV OF FINLAND	160,000.00	171,498.40	
GOV OF FINLAND	150,000.00	161,505.30	
GOV OF FINLAND	210,000.00	212,965.83	
GOV OF FINLAND	150,000.00	167,290.80	
GOV OF FINLAND	150,000.00	189,546.45	
GOV OF FINLAND	160,000.00	170,473.12	
GOV OF FINLAND	160,000.00	166,295.52	
GOV OF FINLAND	170,000.00	175,920.12	
GOV OF FINLAND	180,000.00	223,312.42	
GOV OF FINLAND	90,000.00	92,582.75	
GOV OF FINLAND	110,000.00	112,669.70	
GOV OF FINLAND	140,000.00	145,732.89	
GOV OF FINLAND	150,000.00	162,353.40	
GOV OF FINLAND	140,000.00	196,427.00	
GOV OF FINLAND	80,000.00	90,199.44	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,117,302.66	
GOV OF FRANCE	1,080,000.00	1,087,128.00	
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	1,069,653.60	
GOV OF FRANCE	740,000.00	749,884.92	
GOV OF FRANCE	990,000.00	999,966.82	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,067,607.10	
GOV OF FRANCE	1,570,000.00	1,587,662.50	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,174,405.25	
GOV OF FRANCE	250,000.00	253,044.85	
GOV OF FRANCE	1,270,000.00	1,405,536.94	
GOV OF FRANCE	800,000.00	810,801.16	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,172,215.49	
GOV OF FRANCE	1,420,000.00	1,439,056.40	
GOV OF FRANCE	990,000.00	1,077,002.19	
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	1,647,561.12	
GOV OF FRANCE	1,750,000.00	1,769,881.38	
GOV OF FRANCE	1,080,000.00	1,220,003.84	

GOV OF FRANCE	1,220,000.00	1,355,145.50	
GOV OF FRANCE	1,280,000.00	1,330,025.19	
GOV OF FRANCE	900,000.00	1,262,637.00	
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,211,334.01	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,291,229.63	
GOV OF FRANCE	1,120,000.00	1,160,933.86	
GOV OF FRANCE	1,280,000.00	1,300,508.16	
GOV OF FRANCE	1,320,000.00	1,417,170.48	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,201,877.88	
GOV OF FRANCE	1,160,000.00	1,215,837.76	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,075,867.96	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,489,110.00	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,400,231.22	
GOV OF FRANCE	1,970,000.00	2,200,117.67	
GOV OF FRANCE	940,000.00	1,578,829.64	
GOV OF FRANCE	570,000.00	612,711.06	
GOV OF FRANCE	810,000.00	1,306,248.12	
GOV OF FRANCE	850,000.00	902,105.00	
GOV OF FRANCE	860,000.00	1,337,035.80	
GOV OF FRANCE	670,000.00	762,942.12	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,926,590.88	
GOV OF FRANCE	770,000.00	1,129,106.44	
GOV OF FRANCE	820,000.00	963,126.08	
GOV OF FRANCE	290,000.00	301,265.63	
GOV OF FRANCE	460,000.00	799,002.06	
GOV OF FRANCE	410,000.00	732,670.00	
GOV OF FRANCE	300,000.00	321,574.80	
GOV OF GERMANY	470,000.00	472,685.24	
GOV OF GERMANY	550,000.00	553,445.75	
GOV OF GERMANY	320,000.00	322,317.12	
GOV OF GERMANY	610,000.00	638,078.42	
GOV OF GERMANY	470,000.00	489,406.77	
GOV OF GERMANY	360,000.00	363,123.00	
GOV OF GERMANY	610,000.00	618,133.19	
GOV OF GERMANY	700,000.00	707,126.00	

GOV OF GERMANY	610,000.00	644,377.33
GOV OF GERMANY	630,000.00	637,589.77
GOV OF GERMANY	550,000.00	598,207.50
GOV OF GERMANY	490,000.00	524,079.79
GOV OF GERMANY	780,000.00	791,331.43
GOV OF GERMANY	650,000.00	696,896.20
GOV OF GERMANY	570,000.00	579,762.11
GOV OF GERMANY	830,000.00	893,286.67
GOV OF GERMANY	520,000.00	556,975.12
GOV OF GERMANY	610,000.00	621,522.29
GOV OF GERMANY	570,000.00	615,108.66
GOV OF GERMANY	770,000.00	785,523.41
GOV OF GERMANY	590,000.00	639,296.97
GOV OF GERMANY	530,000.00	588,309.54
GOV OF GERMANY	550,000.00	561,499.95
GOV OF GERMANY	770,000.00	853,482.78
GOV OF GERMANY	290,000.00	295,992.44
GOV OF GERMANY	600,000.00	659,880.60
GOV OF GERMANY	560,000.00	602,824.09
GOV OF GERMANY	700,000.00	736,323.00
GOV OF GERMANY	660,000.00	717,108.48
GOV OF GERMANY	990,000.00	1,045,083.69
GOV OF GERMANY	820,000.00	835,925.22
GOV OF GERMANY	810,000.00	840,281.85
GOV OF GERMANY	410,000.00	639,850.10
GOV OF GERMANY	1,020,000.00	1,078,563.30
GOV OF GERMANY	430,000.00	650,934.43
GOV OF GERMANY	530,000.00	559,932.28
GOV OF GERMANY	360,000.00	523,984.92
GOV OF GERMANY	670,000.00	690,554.26
GOV OF GERMANY	210,000.00	215,733.42
GOV OF GERMANY	290,000.00	487,821.18
GOV OF GERMANY	510,000.00	839,896.56
GOV OF GERMANY	530,000.00	892,666.28
GOV OF GERMANY	880,000.00	1,441,438.24

GOV OF GERMANY	450,000.00	788,820.75
GOV OF GERMANY	600,000.00	1,132,211.63
GOV OF GERMANY	460,000.00	743,907.26
GOV OF GERMANY	860,000.00	1,263,118.02
GOV OF GERMANY	870,000.00	1,300,018.38
GOV OF GERMANY	400,000.00	471,161.60
GOV OF IRELAND	320,000.00	337,176.32
GOV OF IRELAND	200,000.00	217,309.68
GOV OF IRELAND	290,000.00	299,542.16
GOV OF IRELAND	130,000.00	131,082.90
GOV OF IRELAND	240,000.00	279,607.58
GOV OF IRELAND	310,000.00	363,802.26
GOV OF IRELAND	340,000.00	448,043.94
GOV OF IRELAND	350,000.00	370,122.55
GOV OF IRELAND	220,000.00	229,300.50
GOV OF IRELAND	140,000.00	147,211.40
GOV OF IRELAND	320,000.00	380,103.68
GOV OF IRELAND	130,000.00	138,397.55
GOV OF IRELAND	130,000.00	135,937.42
GOV OF IRELAND	170,000.00	185,333.66
GOV OF IRELAND	290,000.00	330,788.79
GOV OF ITALY	740,000.00	769,318.57
GOV OF ITALY	480,000.00	483,260.64
GOV OF ITALY	470,000.00	471,732.42
GOV OF ITALY	790,000.00	833,074.75
GOV OF ITALY	450,000.00	449,905.50
GOV OF ITALY	760,000.00	764,860.96
GOV OF ITALY	680,000.00	723,411.20
GOV OF ITALY	440,000.00	436,084.00
GOV OF ITALY	610,000.00	651,154.80
GOV OF ITALY	570,000.00	569,531.46
GOV OF ITALY	780,000.00	836,231.76
GOV OF ITALY	770,000.00	844,957.19
GOV OF ITALY	770,000.00	799,885.24
GOV OF ITALY	500,000.00	495,674.30

GOV OF ITALY	590,000.00	611,264.48
GOV OF ITALY	590,000.00	659,325.00
GOV OF ITALY	510,000.00	514,060.67
GOV OF ITALY	550,000.00	556,526.30
GOV OF ITALY	780,000.00	776,217.78
GOV OF ITALY	410,000.00	470,518.46
GOV OF ITALY	690,000.00	698,798.19
GOV OF ITALY	700,000.00	806,600.20
GOV OF ITALY	650,000.00	642,684.90
GOV OF ITALY	450,000.00	444,645.00
GOV OF ITALY	650,000.00	731,400.41
GOV OF ITALY	600,000.00	684,748.80
GOV OF ITALY	760,000.00	792,661.76
GOV OF ITALY	1,200,000.00	1,161,784.80
GOV OF ITALY	610,000.00	692,783.10
GOV OF ITALY	810,000.00	818,516.34
GOV OF ITALY	710,000.00	782,868.72
GOV OF ITALY	390,000.00	383,624.28
GOV OF ITALY	620,000.00	644,674.76
GOV OF ITALY	580,000.00	682,121.76
GOV OF ITALY	650,000.00	635,147.50
GOV OF ITALY	590,000.00	577,116.17
GOV OF ITALY	420,000.00	432,681.90
GOV OF ITALY	470,000.00	471,415.64
GOV OF ITALY	820,000.00	949,456.68
GOV OF ITALY	820,000.00	797,938.72
GOV OF ITALY	890,000.00	841,822.07
GOV OF ITALY	490,000.00	489,948.06
GOV OF ITALY	640,000.00	631,316.48
GOV OF ITALY	760,000.00	1,008,016.88
GOV OF ITALY	830,000.00	813,066.34
GOV OF ITALY	690,000.00	829,286.16
GOV OF ITALY	750,000.00	773,129.25
GOV OF ITALY	790,000.00	983,862.05
GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,166,308.20

GOV OF ITALY	880,000.00	1,173,538.08	
GOV OF ITALY	750,000.00	663,427.50	
GOV OF ITALY	610,000.00	805,590.40	
GOV OF ITALY	540,000.00	513,399.06	
GOV OF ITALY	760,000.00	944,541.68	
GOV OF ITALY	330,000.00	342,123.90	
GOV OF ITALY	670,000.00	601,984.95	
GOV OF ITALY	790,000.00	882,928.49	
GOV OF ITALY	410,000.00	393,755.80	
GOV OF ITALY	780,000.00	972,114.00	
GOV OF ITALY	670,000.00	832,068.51	
GOV OF ITALY	510,000.00	619,332.27	
GOV OF ITALY	620,000.00	605,878.88	
GOV OF ITALY	540,000.00	478,246.95	
GOV OF ITALY	470,000.00	469,978.85	
GOV OF ITALY	230,000.00	241,484.10	
GOV OF ITALY	190,000.00	158,979.84	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	474,105.15	
GOV OF NETHERLANDS	510,000.00	555,339.00	
GOV OF NETHERLANDS	570,000.00	578,162.97	
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	600,334.90	
GOV OF NETHERLANDS	380,000.00	441,832.27	
GOV OF NETHERLANDS	620,000.00	677,722.74	
GOV OF NETHERLANDS	480,000.00	487,545.38	
GOV OF NETHERLANDS	430,000.00	483,093.39	
GOV OF NETHERLANDS	560,000.00	576,566.35	
GOV OF NETHERLANDS	450,000.00	470,893.05	
GOV OF NETHERLANDS	560,000.00	595,827.39	
GOV OF NETHERLANDS	370,000.00	550,615.50	
GOV OF NETHERLANDS	430,000.00	457,310.59	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	221,890.14	
GOV OF NETHERLANDS	410,000.00	530,740.53	
GOV OF NETHERLANDS	510,000.00	821,581.95	
GOV OF NETHERLANDS	510,000.00	859,944.19	
GOV OF NETHERLANDS	460,000.00	707,614.78	

GOV OF SPAIN	640,000.00	670,668.80	
GOV OF SPAIN	860,000.00	877,640.65	
GOV OF SPAIN	530,000.00	574,369.69	
GOV OF SPAIN	610,000.00	613,868.01	
GOV OF SPAIN	670,000.00	751,071.59	
GOV OF SPAIN	690,000.00	706,338.57	
GOV OF SPAIN	580,000.00	583,743.37	
GOV OF SPAIN	670,000.00	785,663.70	
GOV OF SPAIN	640,000.00	651,286.40	
GOV OF SPAIN	690,000.00	703,657.17	
GOV OF SPAIN	670,000.00	810,993.79	
GOV OF SPAIN	710,000.00	719,358.51	
GOV OF SPAIN	640,000.00	766,287.67	
GOV OF SPAIN	510,000.00	624,511.37	
GOV OF SPAIN	580,000.00	685,594.80	
GOV OF SPAIN	830,000.00	943,048.22	
GOV OF SPAIN	930,000.00	998,537.44	
GOV OF SPAIN	640,000.00	808,896.64	
GOV OF SPAIN	670,000.00	741,975.42	
GOV OF SPAIN	810,000.00	886,139.19	
GOV OF SPAIN	560,000.00	771,626.24	
GOV OF SPAIN	750,000.00	785,241.75	
GOV OF SPAIN	710,000.00	750,697.91	
GOV OF SPAIN	660,000.00	693,972.84	
GOV OF SPAIN	900,000.00	940,006.80	
GOV OF SPAIN	600,000.00	623,660.40	
GOV OF SPAIN	570,000.00	788,205.12	
GOV OF SPAIN	740,000.00	1,089,516.50	
GOV OF SPAIN	350,000.00	362,836.25	
GOV OF SPAIN	800,000.00	863,211.20	
GOV OF SPAIN	660,000.00	1,014,334.20	
GOV OF SPAIN	620,000.00	685,926.46	
GOV OF SPAIN	630,000.00	873,009.77	
GOV OF SPAIN	540,000.00	824,514.66	
GOV OF SPAIN	750,000.00	1,123,467.00	

	GOV OF SPAIN	420,000.00	676,222.89	
	GOV OF SPAIN	640,000.00	739,104.00	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	275,555.12	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	375,015.00	
	ユーロ 小計	172,010,000.00	196,859,900.68 (24,428,345,075)	
英債券	UK TREASURY	470,000.00	488,189.00	
	UK TREASURY	1,080,000.00	1,099,354.89	
	UK TREASURY	580,000.00	605,926.00	
	UK TREASURY	770,000.00	781,957.48	
	UK TREASURY	840,000.00	903,420.00	
	UK TREASURY	650,000.00	713,888.50	
	UK TREASURY	830,000.00	825,714.37	
	UK TREASURY	700,000.00	725,659.62	
	UK TREASURY	1,050,000.00	1,051,047.58	
	UK TREASURY	510,000.00	544,272.00	
	UK TREASURY	370,000.00	374,239.01	
	UK TREASURY	600,000.00	663,738.00	
	UK TREASURY	460,000.00	573,026.60	
	UK TREASURY	470,000.00	506,170.26	
	UK TREASURY	600,000.00	628,180.73	
	UK TREASURY	830,000.00	852,522.88	
	UK TREASURY	410,000.00	525,025.50	
	UK TREASURY	710,000.00	749,887.80	
	UK TREASURY	380,000.00	556,274.40	
	UK TREASURY	460,000.00	643,568.98	
	UK TREASURY	530,000.00	727,244.80	
	UK TREASURY	560,000.00	810,941.60	
	UK TREASURY	720,000.00	1,035,351.36	
	UK TREASURY	620,000.00	653,108.00	
	UK TREASURY	490,000.00	772,471.28	
	UK TREASURY	450,000.00	674,929.80	
	UK TREASURY	520,000.00	791,190.40	
	UK TREASURY	570,000.00	915,876.00	
	UK TREASURY	900,000.00	1,226,358.00	

	UK TREASURY	710,000.00	1,013,996.44
	UK TREASURY	540,000.00	877,440.60
	UK TREASURY	860,000.00	863,526.00
	UK TREASURY	130,000.00	138,320.00
	UK TREASURY	430,000.00	725,904.50
	UK TREASURY	500,000.00	808,300.00
	UK TREASURY	520,000.00	945,932.00
	UK TREASURY	750,000.00	831,855.00
	UK TREASURY	440,000.00	800,834.32
	UK TREASURY	730,000.00	1,013,181.60
	UK TREASURY	510,000.00	898,676.10
	UK TREASURY	300,000.00	330,801.00
	英ポンド 小計	24,550,000.00	30,668,302.40 (4,446,290,481)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	2,960,000.00	3,233,029.20
	GOV OF SWEDEN	3,480,000.00	3,907,678.08
	GOV OF SWEDEN	2,510,000.00	2,713,736.95
	GOV OF SWEDEN	2,170,000.00	2,512,334.86
	GOV OF SWEDEN	1,840,000.00	1,967,795.36
	GOV OF SWEDEN	1,550,000.00	1,626,525.05
	GOV OF SWEDEN	960,000.00	1,000,449.60
	GOV OF SWEDEN	1,470,000.00	2,188,109.70
	スウェーデンクローナ 小計	16,940,000.00	19,149,658.80 (226,731,960)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	2,680,000.00	2,822,608.16
	GOV OF NORWAY	1,900,000.00	1,954,271.60
	GOV OF NORWAY	1,430,000.00	1,545,179.06
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,133,887.20
	GOV OF NORWAY	1,290,000.00	1,296,398.40
	GOV OF NORWAY	1,280,000.00	1,305,548.80
	GOV OF NORWAY	900,000.00	934,774.20
	ノルウェークローネ 小計	10,590,000.00	10,992,667.42 (141,035,922)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,710,000.00	1,735,359.30
	GOV OF DENMARK	2,320,000.00	2,542,515.37
	GOV OF DENMARK	1,940,000.00	2,118,020.22

	GOV OF DENMARK	2,110,000.00	2,401,939.60	
	GOV OF DENMARK	2,890,000.00	3,046,713.14	
	GOV OF DENMARK	4,230,000.00	7,687,166.31	
	デンマーククローネ 小計	15,200,000.00	19,531,713.94 (324,812,402)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	960,000.00	961,440.00	
	GOV OF POLAND	1,040,000.00	1,099,696.00	
	GOV OF POLAND	640,000.00	645,824.00	
	GOV OF POLAND	1,380,000.00	1,384,621.62	
	GOV OF POLAND	520,000.00	573,690.00	
	GOV OF POLAND	710,000.00	718,520.00	
	GOV OF POLAND	740,000.00	836,140.80	
	GOV OF POLAND	990,000.00	1,008,601.11	
	GOV OF POLAND	790,000.00	856,478.50	
	GOV OF POLAND	960,000.00	970,560.00	
	GOV OF POLAND	850,000.00	892,542.50	
	GOV OF POLAND	1,340,000.00	1,331,941.24	
	GOV OF POLAND	960,000.00	949,536.00	
	GOV OF POLAND	860,000.00	861,333.00	
	GOV OF POLAND	340,000.00	430,739.20	
	ポーランドズロチ 小計	13,080,000.00	13,521,663.97 (390,235,222)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	525,721.55	
	GOV OF AUSTRALIA	960,000.00	963,572.06	
	GOV OF AUSTRALIA	920,000.00	1,001,992.97	
	GOV OF AUSTRALIA	690,000.00	700,297.62	
	GOV OF AUSTRALIA	640,000.00	728,930.24	
	GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	782,077.44	
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	823,757.75	
	GOV OF AUSTRALIA	900,000.00	954,856.80	
	GOV OF AUSTRALIA	840,000.00	920,631.18	
	GOV OF AUSTRALIA	1,030,000.00	1,207,417.08	
	GOV OF AUSTRALIA	860,000.00	1,055,199.61	
	GOV OF AUSTRALIA	1,020,000.00	1,099,591.20	
	GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	943,606.47	
			840,000.00	908,072.92

	GOV OF AUSTRALIA			
	GOV OF AUSTRALIA	1,040,000.00	1,174,811.45	
	GOV OF AUSTRALIA	650,000.00	706,504.50	
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	298,022.70	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	549,466.26	
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	250,235.00	
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	481,027.75	
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	289,251.79	
	GOV OF AUSTRALIA	120,000.00	127,666.11	
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	476,006.51	
	オーストラリアドル 小計	15,400,000.00	16,968,716.96	(1,318,978,369)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	160,175.52	
	GOV OF SINGAPORE	280,000.00	285,313.00	
	GOV OF SINGAPORE	270,000.00	272,025.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	78,744.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	119,472.00	
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	145,684.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	99,420.00	
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	237,889.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	130,538.75	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	158,175.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	133,120.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	131,144.00	
	GOV OF SINGAPORE	260,000.00	288,158.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	104,900.00	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	64,380.00	
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	203,585.00	
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	181,392.80	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	147,923.25	
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	157,500.00	
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	167,968.00	
	シンガポールドル 小計	3,150,000.00	3,267,507.32	(265,484,969)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	560,617.96	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	171,105.17	

	GOV OF MALAYSIA	370,000.00	371,359.15
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	284,481.37
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	344,931.25
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	271,427.18
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	688,861.14
	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	558,351.75
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	181,681.18
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	338,857.05
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	241,818.55
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	231,756.05
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	153,368.07
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	681,221.02
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	201,261.92
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	333,040.09
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	320,094.37
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	494,045.58
	GOV OF MALAYSIA	360,000.00	360,953.02
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	87,662.63
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	410,222.83
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	316,367.96
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	301,780.17
	GOV OF MALAYSIA	460,000.00	480,740.29
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	414,142.80
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	395,677.34
	GOV OF MALAYSIA	400,000.00	420,491.92
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	268,340.44
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	366,897.65
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	363,619.59
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	199,239.89
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	332,270.00
	マレーシアリングット 小計	11,010,000.00	11,146,685.38 (301,183,438)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	1,360,000.00	1,351,513.60
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,260,000.00	3,249,405.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,940,000.00	7,595,136.00

	GOV OF SOUTH AFRICA	4,330,000.00	3,952,518.39	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,780,000.00	3,131,163.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,200,000.00	2,903,360.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,810,000.00	2,616,723.70	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,440,000.00	2,466,499.26	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,890,000.00	3,470,272.11	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,350,000.00	2,163,654.63	
	GOV OF SOUTH AFRICA	4,010,000.00	2,807,200.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,910,000.00	3,491,404.39	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,990,000.00	6,249,060.00	
	南アフリカランド 小計	50,270,000.00	45,447,910.58	(344,040,683)
	合計		63,165,032,432	(63,165,032,432)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 219銘柄	100.0%	46.3%
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 300銘柄	100.0%	38.7%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	7.0%
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 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2019年 3月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	64,649,072
コール・ローン	59,970,377
国債証券	32,782,625,406
派生商品評価勘定	10,444
未収入金	529,000,000
未収利息	214,463,865
前払費用	30,106,913
流動資産合計	33,680,826,077
資産合計	33,680,826,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,117,007
未払金	576,678,134
未払解約金	3,172,000
未払利息	162
流動負債合計	589,967,303
負債合計	589,967,303
純資産の部	
元本等	
元本	33,874,791,320
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	783,932,546
元本等合計	33,090,858,774
純資産合計	33,090,858,774
負債純資産合計	33,680,826,077

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	22,263,671,982円
期中追加設定元本額	20,272,916,038円
期中一部解約元本額	8,661,796,700円
期末元本額	33,874,791,320円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	4,032,438,388円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	10,391,854,324円
りそなラップ型ファンド(成長型)	162,996,914円
DCりそな グローバルバランス	44,323,891円
つみたてバランスファンド	110,886,327円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	98,379,308円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	14,468,634円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	3,266,020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)	18,870,343,262円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	34,380,193円
Smart-i 8資産バランス 安定型	20,181,268円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	21,233,038円
Smart-i 8資産バランス 成長型	12,192,688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)	367,522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)	57,479,543円
2. 計算日における受益権の総数	33,874,791,320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	783,932,546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	0.9769円

(10,000口当たり純資産額)

(9,769円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2019年 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		471,844,410
合計		471,844,410

(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 3月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	574,944,273	-	564,827,266	10,117,007
	米ドル	269,991,297	-	266,043,614	3,947,683
	カナダドル	14,697,423	-	14,354,145	343,278
	ユーロ	213,799,517	-	209,525,965	4,273,552
	英ポンド	35,462,285	-	34,734,812	727,473
	スウェーデンクローナ	11,528,544	-	11,262,208	266,336
	ポーランドズロチ	12,405,085	-	12,111,230	293,855
	オーストラリアドル	17,060,122	-	16,795,292	264,830
	売建	660,364	-	649,920	10,444

	シンガポールドル	660,364	-	649,920	10,444
	合計	575,604,637	-	565,477,186	10,106,563

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	550,000.00	544,553.68	
		US TREASURY N/B	330,000.00	329,361.91	
		US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,547,721.08	
		US TREASURY N/B	590,000.00	582,198.60	
		US TREASURY N/B	400,000.00	399,164.04	
		US TREASURY N/B	530,000.00	524,793.12	
		US TREASURY N/B	600,000.00	593,050.74	
		US TREASURY N/B	650,000.00	649,517.57	
		US TREASURY N/B	380,000.00	384,438.24	
		US TREASURY N/B	600,000.00	593,718.71	
		US TREASURY N/B	550,000.00	543,253.86	

US TREASURY N/B	500,000.00	500,332.00	
US TREASURY N/B	330,000.00	326,371.28	
US TREASURY N/B	580,000.00	574,324.58	
US TREASURY N/B	600,000.00	600,632.76	
US TREASURY N/B	750,000.00	741,342.75	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,722,022.14	
US TREASURY N/B	380,000.00	381,105.83	
US TREASURY N/B	450,000.00	451,415.02	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,580,468.64	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,636,364.42	
US TREASURY N/B	410,000.00	404,106.25	
US TREASURY N/B	780,000.00	768,360.91	
US TREASURY N/B	360,000.00	361,968.72	
US TREASURY N/B	400,000.00	395,390.60	
US TREASURY N/B	340,000.00	336,639.81	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,309,166.74	
US TREASURY N/B	510,000.00	514,004.26	
US TREASURY N/B	970,000.00	973,789.00	
US TREASURY N/B	650,000.00	643,512.67	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,183.59	
US TREASURY N/B	680,000.00	671,632.79	
US TREASURY N/B	740,000.00	744,740.58	
US TREASURY N/B	400,000.00	396,726.56	
US TREASURY N/B	800,000.00	791,562.48	
US TREASURY N/B	360,000.00	360,914.04	
US TREASURY N/B	440,000.00	437,258.57	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,119,849.58	
US TREASURY N/B	630,000.00	644,925.58	
US TREASURY N/B	460,000.00	459,155.44	
US TREASURY N/B	650,000.00	635,121.04	
US TREASURY N/B	480,000.00	480,459.36	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,126,236.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,601.54	
US TREASURY N/B	300,000.00	300,287.10	
US TREASURY N/B	600,000.00	588,398.40	

US TREASURY N/B	380,000.00	379,465.60	
US TREASURY N/B	580,000.00	589,696.84	
US TREASURY N/B	490,000.00	493,062.50	
US TREASURY N/B	480,000.00	476,784.33	
US TREASURY N/B	560,000.00	548,832.76	
US TREASURY N/B	420,000.00	422,903.88	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,315,696.23	
US TREASURY N/B	490,000.00	493,521.87	
US TREASURY N/B	680,000.00	661,791.36	
US TREASURY N/B	550,000.00	547,722.61	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,303,403.87	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,283,545.29	
US TREASURY N/B	210,000.00	212,296.87	
US TREASURY N/B	500,000.00	485,996.30	
US TREASURY N/B	600,000.00	597,585.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	507,216.75	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,129,776.54	
US TREASURY N/B	810,000.00	804,352.11	
US TREASURY N/B	340,000.00	345,066.77	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,252,636.68	
US TREASURY N/B	500,000.00	494,785.14	
US TREASURY N/B	500,000.00	504,697.25	
US TREASURY N/B	560,000.00	556,193.72	
US TREASURY N/B	600,000.00	603,691.38	
US TREASURY N/B	950,000.00	929,738.21	
US TREASURY N/B	490,000.00	484,698.00	
US TREASURY N/B	970,000.00	963,047.04	
US TREASURY N/B	470,000.00	463,188.66	
US TREASURY N/B	400,000.00	395,562.48	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,073,735.12	
US TREASURY N/B	460,000.00	455,022.61	
US TREASURY N/B	370,000.00	364,334.37	
US TREASURY N/B	700,000.00	691,878.88	
US TREASURY N/B	240,000.00	236,315.61	
US TREASURY N/B	510,000.00	504,003.47	

US TREASURY N/B	450,000.00	442,968.75	
US TREASURY N/B	390,000.00	388,430.83	
US TREASURY N/B	410,000.00	403,561.68	
US TREASURY N/B	360,000.00	356,962.50	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,214,672.97	
US TREASURY N/B	280,000.00	274,186.69	
US TREASURY N/B	390,000.00	384,942.16	
US TREASURY N/B	480,000.00	469,874.97	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,149,753.50	
US TREASURY N/B	350,000.00	345,542.96	
US TREASURY N/B	330,000.00	325,578.49	
US TREASURY N/B	410,000.00	406,300.36	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,104,950.16	
US TREASURY N/B	670,000.00	663,797.20	
US TREASURY N/B	720,000.00	716,371.84	
US TREASURY N/B	400,000.00	392,484.36	
US TREASURY N/B	560,000.00	562,296.84	
US TREASURY N/B	650,000.00	643,715.80	
US TREASURY N/B	610,000.00	592,605.41	
US TREASURY N/B	300,000.00	304,054.68	
US TREASURY N/B	870,000.00	844,647.59	
US TREASURY N/B	990,000.00	999,087.79	
US TREASURY N/B	380,000.00	370,589.03	
US TREASURY N/B	450,000.00	458,507.79	
US TREASURY N/B	580,000.00	568,105.41	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,237,654.62	
US TREASURY N/B	400,000.00	407,734.36	
US TREASURY N/B	470,000.00	453,054.28	
US TREASURY N/B	450,000.00	456,618.15	
US TREASURY N/B	490,000.00	469,576.94	
US TREASURY N/B	500,000.00	509,990.20	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,272,329.22	
US TREASURY N/B	600,000.00	577,429.92	
US TREASURY N/B	360,000.00	367,425.00	
US TREASURY N/B	540,000.00	519,243.96	

US TREASURY N/B	480,000.00	492,468.72
US TREASURY N/B	320,000.00	311,049.98
US TREASURY N/B	500,000.00	513,173.80
US TREASURY N/B	710,000.00	724,907.16
US TREASURY N/B	740,000.00	735,215.97
US TREASURY N/B	600,000.00	616,371.06
US TREASURY N/B	490,000.00	489,425.76
US TREASURY N/B	500,000.00	508,017.55
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,178,432.72
US TREASURY N/B	690,000.00	705,268.94
US TREASURY N/B	490,000.00	486,478.12
US TREASURY N/B	290,000.00	287,994.91
US TREASURY N/B	790,000.00	779,291.78
US TREASURY N/B	900,000.00	909,439.38
US TREASURY N/B	830,000.00	818,490.22
US TREASURY N/B	390,000.00	384,454.66
US TREASURY N/B	380,000.00	376,793.75
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,094,428.12
US TREASURY N/B	400,000.00	391,515.60
US TREASURY N/B	820,000.00	812,600.73
US TREASURY N/B	340,000.00	339,063.64
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,465,463.58
US TREASURY N/B	300,000.00	297,058.59
US TREASURY N/B	400,000.00	398,710.92
US TREASURY N/B	430,000.00	434,400.74
US TREASURY N/B	990,000.00	972,520.26
US TREASURY N/B	400,000.00	409,554.68
US TREASURY N/B	830,000.00	843,989.98
US TREASURY N/B	320,000.00	329,956.22
US TREASURY N/B	910,000.00	899,406.96
US TREASURY N/B	440,000.00	453,715.59
US TREASURY N/B	890,000.00	911,728.46
US TREASURY N/B	850,000.00	877,143.47
US TREASURY N/B	790,000.00	774,184.51
US TREASURY N/B	910,000.00	932,145.66

US TREASURY N/B	430,000.00	447,065.62	
US TREASURY N/B	570,000.00	592,733.19	
US TREASURY N/B	990,000.00	983,812.50	
US TREASURY N/B	480,000.00	495,656.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	508,691.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	305,267.55	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	982,080.79	
US TREASURY N/B	800,000.00	761,187.44	
US TREASURY N/B	890,000.00	837,260.91	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,129,096.78	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,524,148.78	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,197,937.43	
US TREASURY N/B	920,000.00	908,751.52	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,183,828.08	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,210,214.37	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,222,083.52	
US TREASURY N/B	120,000.00	150,590.61	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,242,960.84	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,184,312.41	
US TREASURY N/B	310,000.00	385,392.96	
US TREASURY N/B	480,000.00	487,209.35	
US TREASURY N/B	120,000.00	163,633.58	
US TREASURY N/B	170,000.00	219,967.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	251,527.34	
US TREASURY N/B	130,000.00	163,048.43	
US TREASURY N/B	230,000.00	293,200.57	
US TREASURY N/B	320,000.00	359,206.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,916.01	
US TREASURY N/B	190,000.00	243,129.49	
US TREASURY N/B	200,000.00	251,808.58	
US TREASURY N/B	260,000.00	338,142.16	
US TREASURY N/B	190,000.00	239,455.65	
US TREASURY N/B	550,000.00	648,581.01	
US TREASURY N/B	580,000.00	719,460.53	
US TREASURY N/B	430,000.00	569,607.19	

US TREASURY N/B	190,000.00	239,997.45	
US TREASURY N/B	230,000.00	266,328.31	
US TREASURY N/B	130,000.00	136,822.45	
US TREASURY N/B	180,000.00	189,214.45	
US TREASURY N/B	480,000.00	493,950.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,406.25	
US TREASURY N/B	410,000.00	403,273.41	
US TREASURY N/B	590,000.00	618,105.65	
US TREASURY N/B	630,000.00	632,079.43	
US TREASURY N/B	380,000.00	431,804.67	
US TREASURY N/B	770,000.00	892,357.77	
US TREASURY N/B	740,000.00	841,114.04	
US TREASURY N/B	640,000.00	698,924.99	
US TREASURY N/B	760,000.00	795,892.14	
US TREASURY N/B	640,000.00	655,699.96	
US TREASURY N/B	680,000.00	633,515.60	
US TREASURY N/B	910,000.00	932,643.34	
US TREASURY N/B	630,000.00	630,565.99	
US TREASURY N/B	710,000.00	727,805.44	
US TREASURY N/B	660,000.00	612,923.38	
US TREASURY N/B	660,000.00	612,459.34	
US TREASURY N/B	580,000.00	510,558.57	
US TREASURY N/B	700,000.00	699,781.25	
US TREASURY N/B	670,000.00	686,435.90	
US TREASURY N/B	700,000.00	716,296.83	
US TREASURY N/B	700,000.00	681,242.17	
US TREASURY N/B	670,000.00	651,836.70	
US TREASURY N/B	600,000.00	613,019.52	
US TREASURY N/B	830,000.00	868,906.25	
US TREASURY N/B	800,000.00	817,453.12	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,054,537.42	
US TREASURY N/B	270,000.00	276,001.15	
	米ドル 小計	137,130,000.00	138,092,217.79 (15,177,715,657)
カナダドル	GOV OF CANADA	360,000.00	359,622.00

	GOV OF CANADA	300,000.00	300,501.00
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,782.50
	GOV OF CANADA	140,000.00	140,364.00
	GOV OF CANADA	450,000.00	444,928.50
	GOV OF CANADA	350,000.00	352,499.00
	GOV OF CANADA	500,000.00	492,535.00
	GOV OF CANADA	60,000.00	60,176.40
	GOV OF CANADA	110,000.00	114,026.00
	GOV OF CANADA	340,000.00	333,665.80
	GOV OF CANADA	280,000.00	271,714.80
	GOV OF CANADA	220,000.00	228,289.60
	GOV OF CANADA	260,000.00	255,416.20
	GOV OF CANADA	240,000.00	242,061.60
	GOV OF CANADA	210,000.00	209,876.10
	GOV OF CANADA	230,000.00	234,825.40
	GOV OF CANADA	230,000.00	238,222.50
	GOV OF CANADA	260,000.00	272,966.20
	GOV OF CANADA	250,000.00	260,625.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	199,108.00
	GOV OF CANADA	260,000.00	248,250.60
	GOV OF CANADA	60,000.00	89,290.20
	GOV OF CANADA	260,000.00	268,723.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	166,008.00
	GOV OF CANADA	230,000.00	243,376.80
	GOV OF CANADA	200,000.00	300,278.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	297,154.00
	GOV OF CANADA	250,000.00	344,402.50
	GOV OF CANADA	270,000.00	359,245.80
	GOV OF CANADA	260,000.00	309,556.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	92,047.50
	GOV OF CANADA	70,000.00	88,846.10
	カナダドル 小計	7,430,000.00	7,992,384.10 (653,777,019)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,790,000.00	4,802,980.90
	UNITED MEXICAN STATE	4,550,000.00	4,435,112.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,630,000.00	1,609,011.79

	UNITED MEXICAN STATE	4,890,000.00	4,715,378.10
	UNITED MEXICAN STATE	3,920,000.00	3,954,888.00
	UNITED MEXICAN STATE	4,310,000.00	4,745,827.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,600,000.00	2,305,654.00
	UNITED MEXICAN STATE	4,300,000.00	4,191,253.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,810,000.00	1,875,485.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,750,000.00	2,672,367.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,460,000.00	1,394,051.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,510,000.00	1,740,320.30
	UNITED MEXICAN STATE	1,900,000.00	1,917,765.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,720,000.00	2,532,918.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,100,000.00	1,999,290.30
	メキシコペソ 小計	45,240,000.00	44,892,304.59 (258,130,751)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	243,406.93
	GOV OF AUSTRIA	320,000.00	352,260.80
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	112,680.70
	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	91,331.55
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	216,850.42
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	172,513.96
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	175,441.28
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	176,916.16
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	195,922.44
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	215,465.80
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	200,849.38
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	186,396.94
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	197,117.31
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	136,931.28
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	112,590.78
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	175,964.32
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	332,217.96
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	180,119.40
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	89,256.80
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	113,168.88
	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	93,387.16

GOV OF AUSTRIA	60,000.00	63,795.12
GOV OF BELGIUM	370,000.00	394,206.14
GOV OF BELGIUM	270,000.00	302,455.08
GOV OF BELGIUM	190,000.00	215,716.12
GOV OF BELGIUM	280,000.00	326,343.08
GOV OF BELGIUM	250,000.00	277,800.00
GOV OF BELGIUM	140,000.00	143,022.18
GOV OF BELGIUM	290,000.00	332,492.47
GOV OF BELGIUM	110,000.00	113,890.81
GOV OF BELGIUM	300,000.00	315,908.70
GOV OF BELGIUM	160,000.00	210,240.00
GOV OF BELGIUM	230,000.00	245,334.10
GOV OF BELGIUM	240,000.00	251,859.36
GOV OF BELGIUM	290,000.00	424,998.15
GOV OF BELGIUM	290,000.00	302,900.36
GOV OF BELGIUM	100,000.00	104,730.58
GOV OF BELGIUM	260,000.00	271,993.41
GOV OF BELGIUM	120,000.00	170,460.24
GOV OF BELGIUM	60,000.00	64,029.00
GOV OF BELGIUM	100,000.00	131,365.20
GOV OF BELGIUM	340,000.00	549,721.37
GOV OF BELGIUM	90,000.00	96,304.37
GOV OF BELGIUM	110,000.00	125,606.80
GOV OF BELGIUM	310,000.00	495,683.81
GOV OF BELGIUM	160,000.00	248,621.72
GOV OF BELGIUM	200,000.00	211,768.00
GOV OF BELGIUM	80,000.00	85,316.80
GOV OF BELGIUM	70,000.00	82,823.61
GOV OF BELGIUM	70,000.00	80,395.45
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,508.12
GOV OF FINLAND	150,000.00	152,007.30
GOV OF FINLAND	100,000.00	108,307.20
GOV OF FINLAND	110,000.00	111,514.31
GOV OF FINLAND	100,000.00	107,186.50
GOV OF FINLAND	90,000.00	96,903.18

GOV OF FINLAND	90,000.00	91,271.07	
GOV OF FINLAND	90,000.00	100,374.48	
GOV OF FINLAND	80,000.00	101,091.44	
GOV OF FINLAND	110,000.00	117,200.27	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,360.82	
GOV OF FINLAND	90,000.00	93,134.17	
GOV OF FINLAND	90,000.00	111,656.20	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,721.83	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,213.50	
GOV OF FINLAND	70,000.00	72,866.44	
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,941.36	
GOV OF FINLAND	80,000.00	112,244.00	
GOV OF FINLAND	50,000.00	56,374.65	
GOV OF FRANCE	400,000.00	417,683.24	
GOV OF FRANCE	310,000.00	312,046.00	
GOV OF FRANCE	770,000.00	807,483.60	
GOV OF FRANCE	480,000.00	486,411.84	
GOV OF FRANCE	520,000.00	525,235.10	
GOV OF FRANCE	590,000.00	642,743.05	
GOV OF FRANCE	580,000.00	586,525.00	
GOV OF FRANCE	680,000.00	746,351.00	
GOV OF FRANCE	110,000.00	111,339.73	
GOV OF FRANCE	650,000.00	719,369.30	
GOV OF FRANCE	590,000.00	597,965.87	
GOV OF FRANCE	630,000.00	690,182.95	
GOV OF FRANCE	500,000.00	506,710.00	
GOV OF FRANCE	880,000.00	957,335.28	
GOV OF FRANCE	640,000.00	775,322.88	
GOV OF FRANCE	560,000.00	566,362.02	
GOV OF FRANCE	560,000.00	632,594.59	
GOV OF FRANCE	640,000.00	710,896.00	
GOV OF FRANCE	790,000.00	820,874.93	
GOV OF FRANCE	340,000.00	476,996.20	
GOV OF FRANCE	660,000.00	707,504.82	
GOV OF FRANCE	530,000.00	664,419.13	

GOV OF FRANCE	570,000.00	590,832.40	
GOV OF FRANCE	700,000.00	711,215.40	
GOV OF FRANCE	680,000.00	730,057.52	
GOV OF FRANCE	570,000.00	699,051.42	
GOV OF FRANCE	570,000.00	597,437.52	
GOV OF FRANCE	570,000.00	595,383.24	
GOV OF FRANCE	560,000.00	850,920.00	
GOV OF FRANCE	640,000.00	786,094.72	
GOV OF FRANCE	800,000.00	893,448.80	
GOV OF FRANCE	550,000.00	923,783.30	
GOV OF FRANCE	250,000.00	268,732.91	
GOV OF FRANCE	450,000.00	725,693.40	
GOV OF FRANCE	510,000.00	541,263.00	
GOV OF FRANCE	430,000.00	668,517.90	
GOV OF FRANCE	230,000.00	261,905.49	
GOV OF FRANCE	620,000.00	1,047,795.04	
GOV OF FRANCE	410,000.00	601,212.52	
GOV OF FRANCE	420,000.00	493,308.48	
GOV OF FRANCE	130,000.00	135,050.11	
GOV OF FRANCE	250,000.00	434,240.25	
GOV OF FRANCE	210,000.00	375,270.00	
GOV OF FRANCE	180,000.00	192,944.88	
GOV OF GERMANY	220,000.00	221,256.92	
GOV OF GERMANY	310,000.00	311,942.15	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,086.15	
GOV OF GERMANY	290,000.00	303,348.75	
GOV OF GERMANY	190,000.00	197,845.29	
GOV OF GERMANY	160,000.00	161,388.00	
GOV OF GERMANY	310,000.00	314,133.25	
GOV OF GERMANY	200,000.00	202,036.00	
GOV OF GERMANY	520,000.00	549,305.27	
GOV OF GERMANY	530,000.00	536,385.03	
GOV OF GERMANY	230,000.00	250,159.50	
GOV OF GERMANY	200,000.00	213,910.12	
GOV OF GERMANY	310,000.00	314,503.51	

GOV OF GERMANY	420,000.00	450,302.16	
GOV OF GERMANY	350,000.00	355,994.30	
GOV OF GERMANY	290,000.00	312,112.21	
GOV OF GERMANY	250,000.00	267,776.50	
GOV OF GERMANY	420,000.00	427,933.38	
GOV OF GERMANY	270,000.00	291,367.26	
GOV OF GERMANY	300,000.00	306,048.08	
GOV OF GERMANY	260,000.00	281,724.08	
GOV OF GERMANY	460,000.00	510,608.28	
GOV OF GERMANY	240,000.00	245,018.16	
GOV OF GERMANY	350,000.00	387,946.72	
GOV OF GERMANY	160,000.00	163,306.17	
GOV OF GERMANY	290,000.00	318,942.29	
GOV OF GERMANY	310,000.00	333,706.18	
GOV OF GERMANY	350,000.00	368,161.50	
GOV OF GERMANY	440,000.00	478,072.32	
GOV OF GERMANY	460,000.00	485,594.44	
GOV OF GERMANY	390,000.00	397,574.19	
GOV OF GERMANY	510,000.00	529,066.35	
GOV OF GERMANY	140,000.00	218,485.40	
GOV OF GERMANY	470,000.00	496,985.05	
GOV OF GERMANY	170,000.00	257,346.17	
GOV OF GERMANY	560,000.00	591,626.56	
GOV OF GERMANY	130,000.00	189,216.78	
GOV OF GERMANY	400,000.00	412,271.20	
GOV OF GERMANY	150,000.00	154,095.30	
GOV OF GERMANY	210,000.00	353,249.82	
GOV OF GERMANY	250,000.00	411,714.00	
GOV OF GERMANY	360,000.00	606,339.36	
GOV OF GERMANY	360,000.00	589,679.28	
GOV OF GERMANY	230,000.00	403,175.05	
GOV OF GERMANY	260,000.00	490,625.03	
GOV OF GERMANY	240,000.00	388,125.52	
GOV OF GERMANY	450,000.00	660,933.83	
GOV OF GERMANY	430,000.00	642,537.82	

GOV OF GERMANY	240,000.00	282,696.96
GOV OF IRELAND	170,000.00	179,124.92
GOV OF IRELAND	120,000.00	130,385.80
GOV OF IRELAND	120,000.00	123,948.48
GOV OF IRELAND	80,000.00	80,666.40
GOV OF IRELAND	110,000.00	128,153.47
GOV OF IRELAND	150,000.00	176,033.35
GOV OF IRELAND	170,000.00	224,021.97
GOV OF IRELAND	240,000.00	253,798.32
GOV OF IRELAND	100,000.00	104,227.50
GOV OF IRELAND	190,000.00	225,686.56
GOV OF IRELAND	70,000.00	74,521.76
GOV OF IRELAND	60,000.00	62,740.35
GOV OF IRELAND	90,000.00	98,117.82
GOV OF IRELAND	150,000.00	171,097.65
GOV OF ITALY	370,000.00	384,659.28
GOV OF ITALY	230,000.00	231,562.39
GOV OF ITALY	270,000.00	270,995.22
GOV OF ITALY	550,000.00	579,988.75
GOV OF ITALY	270,000.00	269,943.30
GOV OF ITALY	180,000.00	181,151.28
GOV OF ITALY	390,000.00	414,897.60
GOV OF ITALY	450,000.00	445,995.00
GOV OF ITALY	400,000.00	426,986.76
GOV OF ITALY	230,000.00	229,810.94
GOV OF ITALY	310,000.00	332,348.52
GOV OF ITALY	420,000.00	460,885.74
GOV OF ITALY	230,000.00	238,926.76
GOV OF ITALY	290,000.00	287,491.08
GOV OF ITALY	350,000.00	362,614.52
GOV OF ITALY	210,000.00	234,675.00
GOV OF ITALY	420,000.00	423,344.08
GOV OF ITALY	390,000.00	394,627.74
GOV OF ITALY	290,000.00	288,593.79
GOV OF ITALY	230,000.00	263,949.38

GOV OF ITALY	520,000.00	526,630.52	
GOV OF ITALY	190,000.00	218,934.34	
GOV OF ITALY	380,000.00	375,723.48	
GOV OF ITALY	270,000.00	266,787.00	
GOV OF ITALY	390,000.00	438,840.24	
GOV OF ITALY	280,000.00	319,549.44	
GOV OF ITALY	300,000.00	312,892.80	
GOV OF ITALY	500,000.00	484,077.00	
GOV OF ITALY	460,000.00	522,426.60	
GOV OF ITALY	310,000.00	313,259.34	
GOV OF ITALY	290,000.00	319,763.28	
GOV OF ITALY	280,000.00	275,422.56	
GOV OF ITALY	320,000.00	332,735.36	
GOV OF ITALY	290,000.00	341,060.88	
GOV OF ITALY	210,000.00	205,201.50	
GOV OF ITALY	470,000.00	459,736.61	
GOV OF ITALY	140,000.00	144,227.30	
GOV OF ITALY	370,000.00	371,114.44	
GOV OF ITALY	390,000.00	451,570.86	
GOV OF ITALY	520,000.00	506,009.92	
GOV OF ITALY	400,000.00	378,347.00	
GOV OF ITALY	310,000.00	309,967.14	
GOV OF ITALY	320,000.00	315,658.24	
GOV OF ITALY	290,000.00	384,638.02	
GOV OF ITALY	470,000.00	460,411.06	
GOV OF ITALY	390,000.00	468,726.96	
GOV OF ITALY	340,000.00	350,485.26	
GOV OF ITALY	510,000.00	635,151.45	
GOV OF ITALY	400,000.00	431,966.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	546,762.06	
GOV OF ITALY	520,000.00	459,976.40	
GOV OF ITALY	320,000.00	422,604.80	
GOV OF ITALY	250,000.00	237,684.75	
GOV OF ITALY	350,000.00	434,986.30	
GOV OF ITALY	310,000.00	321,389.12	

GOV OF ITALY	270,000.00	242,590.95	
GOV OF ITALY	410,000.00	458,228.71	
GOV OF ITALY	200,000.00	192,076.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	510,983.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	422,243.72	
GOV OF ITALY	270,000.00	327,881.79	
GOV OF ITALY	260,000.00	254,078.24	
GOV OF ITALY	300,000.00	265,692.75	
GOV OF ITALY	290,000.00	289,986.95	
GOV OF ITALY	150,000.00	157,489.63	
GOV OF ITALY	90,000.00	75,306.24	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	273,927.42	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	315,781.00	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	253,580.25	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	229,218.78	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	290,679.12	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	349,792.38	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	253,929.88	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	269,633.52	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	247,099.87	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	251,142.96	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	287,273.91	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	327,393.00	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	202,067.47	
GOV OF NETHERLANDS	100,000.00	100,859.16	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	284,787.60	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	451,064.60	
GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	472,126.22	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	338,424.46	
GOV OF SPAIN	360,000.00	377,251.20	
GOV OF SPAIN	330,000.00	336,769.07	
GOV OF SPAIN	230,000.00	249,254.77	
GOV OF SPAIN	400,000.00	402,536.40	
GOV OF SPAIN	280,000.00	313,880.67	
GOV OF SPAIN	520,000.00	532,313.12	

GOV OF SPAIN	280,000.00	281,807.14	
GOV OF SPAIN	330,000.00	386,968.69	
GOV OF SPAIN	410,000.00	417,230.35	
GOV OF SPAIN	300,000.00	305,937.90	
GOV OF SPAIN	340,000.00	411,549.09	
GOV OF SPAIN	380,000.00	385,008.78	
GOV OF SPAIN	330,000.00	395,117.08	
GOV OF SPAIN	250,000.00	306,133.02	
GOV OF SPAIN	390,000.00	461,003.40	
GOV OF SPAIN	380,000.00	431,757.01	
GOV OF SPAIN	350,000.00	375,793.66	
GOV OF SPAIN	350,000.00	442,365.35	
GOV OF SPAIN	410,000.00	454,044.66	
GOV OF SPAIN	320,000.00	350,079.68	
GOV OF SPAIN	400,000.00	551,161.60	
GOV OF SPAIN	370,000.00	387,385.93	
GOV OF SPAIN	320,000.00	338,342.72	
GOV OF SPAIN	350,000.00	368,015.90	
GOV OF SPAIN	310,000.00	323,780.12	
GOV OF SPAIN	310,000.00	322,224.54	
GOV OF SPAIN	320,000.00	442,501.12	
GOV OF SPAIN	490,000.00	721,436.60	
GOV OF SPAIN	230,000.00	238,435.25	
GOV OF SPAIN	340,000.00	366,864.76	
GOV OF SPAIN	360,000.00	553,273.20	
GOV OF SPAIN	320,000.00	354,026.56	
GOV OF SPAIN	330,000.00	457,290.83	
GOV OF SPAIN	280,000.00	427,526.12	
GOV OF SPAIN	370,000.00	554,243.72	
GOV OF SPAIN	250,000.00	402,513.62	
GOV OF SPAIN	290,000.00	334,906.50	
GOV OF SPAIN	130,000.00	143,288.66	
GOV OF SPAIN	180,000.00	225,009.00	
ゴロ小計	89,190,000.00	102,144,674.47	(12,675,132,654)

英bond	UK TREASURY	200,000.00	207,740.00
	UK TREASURY	430,000.00	437,706.11
	UK TREASURY	430,000.00	449,221.00
	UK TREASURY	370,000.00	375,745.80
	UK TREASURY	520,000.00	559,260.00
	UK TREASURY	180,000.00	197,692.20
	UK TREASURY	470,000.00	467,573.20
	UK TREASURY	390,000.00	404,296.07
	UK TREASURY	440,000.00	440,438.98
	UK TREASURY	290,000.00	309,488.00
	UK TREASURY	280,000.00	283,207.89
	UK TREASURY	190,000.00	210,183.70
	UK TREASURY	250,000.00	311,427.50
	UK TREASURY	290,000.00	312,317.82
	UK TREASURY	310,000.00	324,560.04
	UK TREASURY	420,000.00	431,397.12
	UK TREASURY	200,000.00	256,110.00
	UK TREASURY	410,000.00	433,033.80
	UK TREASURY	170,000.00	248,859.60
	UK TREASURY	240,000.00	335,775.12
	UK TREASURY	270,000.00	370,483.20
	UK TREASURY	340,000.00	492,357.40
	UK TREASURY	380,000.00	546,435.44
	UK TREASURY	270,000.00	284,418.00
	UK TREASURY	250,000.00	394,118.00
	UK TREASURY	290,000.00	434,954.76
	UK TREASURY	280,000.00	426,025.60
	UK TREASURY	290,000.00	465,972.00
	UK TREASURY	380,000.00	517,795.60
	UK TREASURY	350,000.00	499,857.40
	UK TREASURY	330,000.00	536,213.70
	UK TREASURY	390,000.00	391,599.00
UK TREASURY	70,000.00	74,480.00	
UK TREASURY	240,000.00	405,156.00	
UK TREASURY	270,000.00	436,482.00	

	UK TREASURY	280,000.00	509,348.00
	UK TREASURY	360,000.00	399,290.40
	UK TREASURY	240,000.00	436,818.72
	UK TREASURY	330,000.00	458,013.60
	UK TREASURY	280,000.00	493,390.80
	UK TREASURY	190,000.00	209,507.30
	英ポンド 小計	12,560,000.00	15,778,750.87 (2,287,603,301)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,800,000.00	1,966,031.28
	GOV OF SWEDEN	1,710,000.00	1,920,152.16
	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,427,144.52
	GOV OF SWEDEN	1,030,000.00	1,192,490.74
	GOV OF SWEDEN	1,030,000.00	1,101,537.62
	GOV OF SWEDEN	730,000.00	766,040.83
	GOV OF SWEDEN	550,000.00	573,174.25
	GOV OF SWEDEN	840,000.00	1,250,348.40
	スウェーデンクローナ 小計	9,010,000.00	10,196,919.80 (120,731,530)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,410,000.00	1,485,028.92
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,141,706.04
	GOV OF NORWAY	610,000.00	659,132.32
	GOV OF NORWAY	700,000.00	715,064.00
	GOV OF NORWAY	610,000.00	613,025.60
	GOV OF NORWAY	630,000.00	642,574.80
	GOV OF NORWAY	530,000.00	550,478.14
	ノルウェークローネ 小計	5,600,000.00	5,807,009.82 (74,503,935)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,040,000.00	1,055,423.20
	GOV OF DENMARK	1,180,000.00	1,293,175.92
	GOV OF DENMARK	910,000.00	993,504.33
	GOV OF DENMARK	1,130,000.00	1,286,346.80
	GOV OF DENMARK	1,580,000.00	1,665,677.08
	GOV OF DENMARK	2,260,000.00	4,107,091.22
	デンマーククローネ 小計	8,100,000.00	10,401,218.55 (172,972,264)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	710,000.00	711,065.00

	GOV OF POLAND	170,000.00	166,689.53
	GOV OF POLAND	270,000.00	285,498.00
	GOV OF POLAND	370,000.00	373,367.00
	GOV OF POLAND	620,000.00	622,076.38
	GOV OF POLAND	180,000.00	198,585.00
	GOV OF POLAND	570,000.00	576,840.00
	GOV OF POLAND	310,000.00	350,275.20
	GOV OF POLAND	620,000.00	631,649.18
	GOV OF POLAND	510,000.00	552,916.50
	GOV OF POLAND	360,000.00	363,960.00
	GOV OF POLAND	480,000.00	504,024.00
	GOV OF POLAND	620,000.00	616,271.32
	GOV OF POLAND	530,000.00	524,223.00
	GOV OF POLAND	570,000.00	570,883.50
	GOV OF POLAND	170,000.00	215,369.60
	ポーランドズロチ 小計	7,060,000.00	7,263,693.21 (209,630,186)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	463,871.96
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	281,041.85
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	511,887.71
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	375,521.91
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	466,970.93
	GOV OF AUSTRALIA	300,000.00	308,714.78
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	475,691.10
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	456,209.36
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	515,115.06
	GOV OF AUSTRALIA	560,000.00	656,459.77
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	613,488.15
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	506,674.37
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	518,465.09
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	454,036.46
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	372,776.71
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	369,556.20
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	298,022.70
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	340,145.78
		140,000.00	152,316.96

	GOV OF AUSTRALIA			
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	222,012.81	
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	150,410.93	
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	74,471.90	
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	243,538.21	
	オーストラリアドル 小計	7,990,000.00	8,827,400.70 (686,153,856)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	90,098.73	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	81,518.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	100,750.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	68,901.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	99,560.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,030.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,826.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	134,459.00	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	60,248.65	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	84,360.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,680.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	100,880.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	121,913.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,450.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,920.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	96,435.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	79,359.35	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	59,169.30	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	73,500.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	83,984.00	
	シンガポールドル 小計	1,530,000.00	1,584,042.03 (128,703,414)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	210,231.73	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	130,845.13	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	190,697.94	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	121,920.58	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	223,190.81	
	GOV OF MALAYSIA	300,000.00	301,585.77	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,824.35	

	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	139,587.93	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	282,615.17	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	159,462.14	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	211,591.22	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	120,916.20	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	265,837.98	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,674.78	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	171,072.63	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	252,303.10	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	196,186.87	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	80,660.50	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	280,741.24	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	97,402.93	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	270,146.74	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	257,048.97	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	261,271.89	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	212,121.92	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	328,122.67	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	199,733.65	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	69,569.74	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	188,690.22	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	181,809.79	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	146,808.34	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	151,031.82	
	マレーシアリングット 小計	5,880,000.00	5,946,704.75 (160,679,962)	
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	640,000.00	636,006.40	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,760,000.00	1,754,280.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,939,840.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,442,258.44	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,606,999.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,040,000.00	1,850,892.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,390,000.00	1,294,393.57	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,930,000.00	1,383,820.80	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,775,280.59	

	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,454,712.47	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,290,000.00	903,064.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,300,000.00	2,053,767.29	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,660,000.00	3,272,040.00	
	南アフリカランド 小計	25,700,000.00	23,367,355.06	(176,890,877)
	合計		32,782,625,406	(32,782,625,406)

(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%	46.3%
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 299銘柄	100.0%	38.7%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	7.0%
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 16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 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	534,179
コール・ローン	12,307,347
投資信託受益証券	2,570,425,991
流動資産合計	2,583,267,517
資産合計	2,583,267,517
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,675
未払金	3,969,992
未払解約金	7,070,000
未払利息	33
流動負債合計	11,073,700
負債合計	11,073,700
純資産の部	
元本等	
元本	2,387,673,835
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	184,519,982
元本等合計	2,572,193,817
純資産合計	2,572,193,817
負債純資産合計	2,583,267,517

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	1,547,484,626円
期中追加設定元本額	1,376,460,682円
期中一部解約元本額	536,271,473円
期末元本額	2,387,673,835円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	465,933,093円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	296,195,349円
りそなラップ型ファンド(成長型)	146,364,070円
DCりそな グローバルバランス	5,140,519円
つみたてバランスファンド	99,007,409円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	24,932,324円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	9,704,456円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	6,522,807円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,237,236,657円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,220,095円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	9,466,221円
Smart-i 8資産バランス 成長型	13,663,022円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	70,958,980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)	328,833円
2. 計算日における受益権の総数	2,387,673,835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	1.0773円
(10,000口当たり純資産額)	(10,773円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3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 3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 3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		16,047,064
合計		16,047,064

(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 3月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,418,685	-	4,385,010	33,675
	米ドル	4,418,685	-	4,385,010	33,675
	合計	4,418,685	-	4,385,010	33,675

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	695,617	23,386,643.54	
		米ドル 小計	695,617	23,386,643.54	
合計				2,570,425,991	(2,570,425,991)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,068,532,378
株式	24,588,277,590
未収入金	1,089,070,000
未収配当金	37,079,652
前払金	2,647,200
差入委託証拠金	30,060,000
流動資産合計	26,815,666,820
資産合計	26,815,666,820
負債の部	

2019年 3月25日現在

流動負債	
派生商品評価勘定	29,739,864
未払金	77,726,784
未払解約金	1,068,240,000
未払利息	2,898
流動負債合計	1,175,709,546
負債合計	1,175,709,546
純資産の部	
元本等	
元本	23,799,735,532
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,840,221,742
元本等合計	25,639,957,274
純資産合計	25,639,957,274
負債純資産合計	26,815,666,820

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	14,498,868,509円
期中追加設定元本額	19,795,123,282円
期中一部解約元本額	10,494,256,259円
期末元本額	23,799,735,532円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,305,923,508円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,911,029,755円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,144,979,672円
DCりそな グローバルバランス	25,363,365円

つみたてバランスファンド	600,803,646円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	129,788,276円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	48,110,376円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	31,560,306円
FWりそな国内株式インデックスファンド	16,584,214,004円
Smart-i TOPIXインデックス	220,184,642円
Smart-i 8資産バランス 安定型	8,992,540円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	45,116,409円
Smart-i 8資産バランス 成長型	71,322,664円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	141,025,899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）	2,907,342円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	435,496,302円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	92,916,826円
2. 計算日における受益権の総数	23,799,735,532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	1.0773円
(10,000口当たり純資産額)	(10,773円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		193,465,283
合計		193,465,283

(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 3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	1,069,147,864	-	1,039,408,000	29,739,864
	合計	1,069,147,864	-	1,039,408,000	29,739,864

(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	3,040.00	1,520,000	
日本水産	14,700	797.00	11,715,900	
マルハニチロ	2,100	4,005.00	8,410,500	
カネコ種苗	400	1,344.00	537,600	
サカタのタネ	1,800	3,715.00	6,687,000	
ホクト	1,200	1,969.00	2,362,800	
ホクリヨウ	200	610.00	122,000	
住石ホールディングス	4,500	103.00	463,500	
日鉄鉱業	300	4,560.00	1,368,000	
三井松島ホールディングス	700	1,311.00	917,700	
国際石油開発帝石	59,100	1,035.50	61,198,050	
石油資源開発	2,100	2,231.00	4,685,100	
K&Oエナジーグループ	700	1,537.00	1,075,900	
ヒノキヤグループ	300	2,162.00	648,600	
ショーボンドホールディングス	1,100	7,260.00	7,986,000	
ミライト・ホールディングス	4,100	1,557.00	6,383,700	
タマホーム	900	1,027.00	924,300	
サンヨーホームズ	300	886.00	265,800	

日本アクア	600	535.00	321,000	
ファーストコーポレーション	700	782.00	547,400	
ベストテラ	300	1,368.00	410,400	
TATERU	1,800	255.00	459,000	
スペースバリューホールディングス	1,800	518.00	932,400	
ダイセキ環境ソリューション	300	624.00	187,200	
第一カッター興業	300	1,691.00	507,300	
安藤・間	9,500	760.00	7,220,000	
東急建設	4,300	845.00	3,633,500	
コムシスホールディングス	5,200	2,882.00	14,986,400	
ミサワホーム	1,300	802.00	1,042,600	
ピーアールホールディングス	1,500	338.00	507,000	
高松コンストラクショングループ	900	2,648.00	2,383,200	
東建コーポレーション	500	7,020.00	3,510,000	
ソネック	200	714.00	142,800	
ヤマウラ	600	999.00	599,400	
大成建設	12,100	5,060.00	61,226,000	
大林組	36,500	1,098.00	40,077,000	
清水建設	37,200	957.00	35,600,400	
飛鳥建設	1,100	1,355.00	1,490,500	
長谷工コーポレーション	15,200	1,427.00	21,690,400	
松井建設	1,600	697.00	1,115,200	
銭高組	100	5,250.00	525,000	
鹿島建設	28,500	1,601.00	45,628,500	
不動テトラ	800	1,460.00	1,168,000	
大末建設	400	905.00	362,000	
鉄建建設	700	2,738.00	1,916,600	
西松建設	2,600	2,524.00	6,562,400	
三井住友建設	8,800	763.00	6,714,400	
大豊建設	800	3,185.00	2,548,000	
前田建設工業	8,700	1,125.00	9,787,500	
佐田建設	800	379.00	303,200	
ナカノフドー建設	1,200	487.00	584,400	
奥村組	2,000	3,540.00	7,080,000	
東鉄工業	1,500	3,005.00	4,507,500	
イチケン	200	1,888.00	377,600	

富士ピー・エス	400	496.00	198,400
浅沼組	400	2,597.00	1,038,800
戸田建設	14,100	694.00	9,785,400
熊谷組	1,700	3,430.00	5,831,000
青木あすなる建設	600	1,053.00	631,800
北野建設	300	3,105.00	931,500
植木組	100	2,344.00	234,400
矢作建設工業	1,700	786.00	1,336,200
ピーエス三菱	1,500	675.00	1,012,500
日本ハウスホールディングス	2,600	443.00	1,151,800
大東建託	4,300	15,600.00	67,080,000
新日本建設	1,500	971.00	1,456,500
N I P P O	3,200	2,041.00	6,531,200
東亜道路工業	200	2,950.00	590,000
前田道路	3,800	2,121.00	8,059,800
日本道路	300	6,570.00	1,971,000
東亜建設工業	1,100	1,562.00	1,718,200
若築建設	600	1,494.00	896,400
東洋建設	4,600	434.00	1,996,400
五洋建設	14,500	520.00	7,540,000
世紀東急工業	1,900	603.00	1,145,700
福田組	400	4,200.00	1,680,000
住友林業	8,600	1,468.00	12,624,800
日本基礎技術	1,600	379.00	606,400
巴コーポレーション	1,700	344.00	584,800
大和ハウス工業	33,700	3,444.00	116,062,800
ライト工業	2,300	1,402.00	3,224,600
積水ハウス	37,200	1,799.50	66,941,400
日特建設	1,200	609.00	730,800
北陸電気工事	600	883.00	529,800
ユアテック	2,000	802.00	1,604,000
四電工	200	2,693.00	538,600
中電工	1,600	2,275.00	3,640,000
関電工	5,600	960.00	5,376,000
きんでん	8,100	1,796.00	14,547,600
東京エネシス	1,200	948.00	1,137,600

トーエネック	300	3,005.00	901,500	
住友電設	800	1,818.00	1,454,400	
日本電設工業	2,100	2,240.00	4,704,000	
協和エクシオ	4,800	2,931.00	14,068,800	
新日本空調	1,000	1,950.00	1,950,000	
九電工	2,400	3,415.00	8,196,000	
三機工業	2,700	1,216.00	3,283,200	
日揮	10,500	1,463.00	15,361,500	
中外炉工業	300	1,805.00	541,500	
ヤマト	1,100	480.00	528,000	
太平電業	800	2,356.00	1,884,800	
高砂熱学工業	3,000	1,748.00	5,244,000	
三晃金属工業	100	2,920.00	292,000	
朝日工業社	300	2,901.00	870,300	
明星工業	2,200	749.00	1,647,800	
大気社	1,600	3,190.00	5,104,000	
ダイダン	800	2,507.00	2,005,600	
日比谷総合設備	1,200	1,863.00	2,235,600	
東芝プラントシステム	2,600	1,974.00	5,132,400	
OSJBホールディングス	5,600	274.00	1,534,400	
東洋エンジニアリング	1,400	624.00	873,600	
千代田化工建設	8,800	280.00	2,464,000	
新興プランテック	2,200	1,172.00	2,578,400	
日本製粉	3,600	1,892.00	6,811,200	
日清製粉グループ本社	12,300	2,459.00	30,245,700	
日東富士製粉	100	6,200.00	620,000	
昭和産業	1,000	3,005.00	3,005,000	
鳥越製粉	1,100	755.00	830,500	
中部飼料	1,300	1,183.00	1,537,900	
フィード・ワン	7,800	177.00	1,380,600	
東洋精糖	200	1,025.00	205,000	
日本甜菜製糖	600	2,018.00	1,210,800	
三井製糖	900	2,873.00	2,585,700	
塩水港精糖	1,200	235.00	282,000	
日新製糖	500	2,087.00	1,043,500	
森永製菓	2,700	4,830.00	13,041,000	

中村屋	300	4,435.00	1,330,500	
江崎グリコ	3,300	5,750.00	18,975,000	
名糖産業	500	1,467.00	733,500	
井村屋グループ	500	2,478.00	1,239,000	
不二家	600	2,186.00	1,311,600	
山崎製パン	8,900	1,785.00	15,886,500	
第一屋製パン	200	1,022.00	204,400	
モロゾフ	200	4,795.00	959,000	
亀田製菓	700	5,370.00	3,759,000	
寿スピリッツ	1,100	4,180.00	4,598,000	
カルビー	5,000	2,978.00	14,890,000	
森永乳業	2,200	3,600.00	7,920,000	
六甲バター	900	2,107.00	1,896,300	
ヤクルト本社	8,100	7,540.00	61,074,000	
明治ホールディングス	7,700	8,760.00	67,452,000	
雪印メグミルク	2,600	2,674.00	6,952,400	
プリマハム	1,500	2,067.00	3,100,500	
日本ハム	4,700	3,965.00	18,635,500	
林兼産業	400	558.00	223,200	
丸大食品	1,200	1,882.00	2,258,400	
S Foods	1,000	4,000.00	4,000,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	7,000	692.00	4,844,000	
サッポロホールディングス	4,000	2,508.00	10,032,000	
アサヒグループホールディングス	22,800	4,700.00	107,160,000	
キリンホールディングス	49,300	2,554.00	125,912,200	
宝ホールディングス	8,200	1,312.00	10,758,400	
オエノンホールディングス	3,300	400.00	1,320,000	
養命酒製造	300	2,113.00	633,900	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	8,300	2,698.00	22,393,400	
サントリー食品インターナショナル	7,300	4,970.00	36,281,000	
ダイドーグループホールディングス	600	4,985.00	2,991,000	
伊藤園	3,300	5,430.00	17,919,000	
キーコーヒー	1,100	2,129.00	2,341,900	
ユニカフェ	300	990.00	297,000	
ジャパンフーズ	200	1,285.00	257,000	

日清オイリオグループ	1,400	3,345.00	4,683,000
不二製油グループ本社	2,700	3,645.00	9,841,500
かどや製油	100	5,370.00	537,000
J - オイルミルズ	600	4,115.00	2,469,000
キッコーマン	7,200	5,280.00	38,016,000
味の素	24,100	1,754.00	42,271,400
キュービー	6,100	2,604.00	15,884,400
ハウス食品グループ本社	4,200	4,355.00	18,291,000
カゴメ	4,400	3,020.00	13,288,000
焼津水産化学工業	500	1,148.00	574,000
アリアケジャパン	1,000	5,960.00	5,960,000
ピエトロ	100	1,660.00	166,000
エバラ食品工業	300	2,202.00	660,600
ニチレイ	5,700	2,693.00	15,350,100
東洋水産	5,600	4,140.00	23,184,000
イトアンド	400	1,721.00	688,400
大冷	100	1,821.00	182,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	542.00	162,600
日清食品ホールディングス	4,600	7,430.00	34,178,000
永谷園ホールディングス	600	2,556.00	1,533,600
一正蒲鉾	400	1,062.00	424,800
フジッコ	1,200	2,197.00	2,636,400
ロック・フィールド	1,200	1,599.00	1,918,800
日本たばこ産業	62,900	2,702.50	169,987,250
ケンコーマヨネーズ	600	2,175.00	1,305,000
わらべや日洋ホールディングス	700	1,813.00	1,269,100
なとり	600	1,720.00	1,032,000
イフジ産業	200	710.00	142,000
ピククルスコーポレーション	300	1,839.00	551,700
北の達人コーポレーション	4,300	418.00	1,797,400
ユーグレナ	4,600	668.00	3,072,800
ミヨシ油脂	400	1,041.00	416,400
理研ビタミン	500	3,605.00	1,802,500
片倉工業	1,300	1,241.00	1,613,300
ゲンゼ	700	4,620.00	3,234,000
東洋紡	4,600	1,501.00	6,904,600

ユニチカ	3,200	419.00	1,340,800
富士紡ホールディングス	500	2,702.00	1,351,000
倉敷紡績	1,000	2,082.00	2,082,000
シキボウ	600	1,056.00	633,600
日本毛織	3,600	905.00	3,258,000
ダイトウボウ	1,700	80.00	136,000
トーア紡コーポレーション	400	445.00	178,000
ダイドーリミテッド	1,600	334.00	534,400
帝国繊維	1,200	2,682.00	3,218,400
帝人	8,700	1,866.00	16,234,200
東レ	82,500	719.70	59,375,250
サカイオーベックス	300	1,758.00	527,400
住江織物	300	2,634.00	790,200
日本フェルト	600	462.00	277,200
イチカワ	100	1,390.00	139,000
日東製網	100	1,377.00	137,700
アツギ	900	976.00	878,400
ダイニック	400	732.00	292,800
セーレン	2,600	1,681.00	4,370,600
ソトー	400	981.00	392,400
東海染工	100	1,097.00	109,700
小松マテーレ	1,700	779.00	1,324,300
ワコールホールディングス	3,200	2,655.00	8,496,000
ホギメディカル	1,300	3,885.00	5,050,500
レナウン	3,100	100.00	310,000
クラウディアホールディングス	300	474.00	142,200
T S Iホールディングス	4,000	640.00	2,560,000
マツオカコーポレーション	300	3,370.00	1,011,000
ワールド	1,000	2,236.00	2,236,000
三陽商会	600	1,663.00	997,800
ナイガイ	400	502.00	200,800
オンワードホールディングス	6,500	566.00	3,679,000
ルックホールディングス	400	1,485.00	594,000
キムラタン	5,200	26.00	135,200
ゴールドウイン	1,000	14,570.00	14,570,000
デサント	2,600	2,674.00	6,952,400

キング	600	556.00	333,600	
ヤマトインターナショナル	700	411.00	287,700	
特種東海製紙	700	4,150.00	2,905,000	
王子ホールディングス	47,900	694.00	33,242,600	
日本製紙	5,100	2,285.00	11,653,500	
三菱製紙	1,700	522.00	887,400	
北越コーポレーション	7,000	652.00	4,564,000	
中越パルプ工業	500	1,334.00	667,000	
巴川製紙所	300	979.00	293,700	
大王製紙	5,100	1,305.00	6,655,500	
阿波製紙	300	498.00	149,400	
レンゴー	11,000	996.00	10,956,000	
トモク	600	1,652.00	991,200	
ザ・パック	800	3,275.00	2,620,000	
クラレ	17,900	1,402.00	25,095,800	
旭化成	75,700	1,154.50	87,395,650	
共和レザー	700	729.00	510,300	
昭和電工	7,100	3,680.00	26,128,000	
住友化学	83,700	524.00	43,858,800	
住友精化	500	3,950.00	1,975,000	
日産化学	6,500	5,000.00	32,500,000	
ラサ工業	400	1,559.00	623,600	
クレハ	1,000	6,350.00	6,350,000	
多木化学	300	5,940.00	1,782,000	
テイカ	900	2,473.00	2,225,700	
石原産業	2,000	1,133.00	2,266,000	
片倉コープアグリ	300	1,175.00	352,500	
日東エフシー	700	772.00	540,400	
日本曹達	1,700	2,899.00	4,928,300	
東ソー	16,400	1,704.00	27,945,600	
トクヤマ	3,100	2,560.00	7,936,000	
セントラル硝子	2,300	2,495.00	5,738,500	
東亜合成	6,700	1,162.00	7,785,400	
大阪ソーダ	1,100	2,712.00	2,983,200	
関東電化工業	2,500	749.00	1,872,500	
デンカ	4,200	3,140.00	13,188,000	

信越化学工業	18,900	9,109.00	172,160,100	
日本カーバイド工業	400	1,483.00	593,200	
堺化学工業	700	2,390.00	1,673,000	
第一稀元素化学工業	900	868.00	781,200	
エア・ウォーター	8,700	1,603.00	13,946,100	
大陽日酸	8,800	1,608.00	14,150,400	
日本化学工業	400	1,999.00	799,600	
東邦アセチレン	200	1,424.00	284,800	
日本パーカライジング	5,800	1,379.00	7,998,200	
高压ガス工業	1,900	830.00	1,577,000	
チタン工業	100	2,356.00	235,600	
四国化成工業	1,800	1,174.00	2,113,200	
戸田工業	200	2,145.00	429,000	
ステラ ケミファ	600	3,050.00	1,830,000	
保土谷化学工業	400	3,285.00	1,314,000	
日本触媒	1,800	7,260.00	13,068,000	
大日精化工業	900	3,030.00	2,727,000	
カネカ	2,800	4,080.00	11,424,000	
三菱瓦斯化学	10,900	1,600.00	17,440,000	
三井化学	9,600	2,686.00	25,785,600	
J S R	10,700	1,730.00	18,511,000	
東京応化工業	1,800	3,060.00	5,508,000	
大阪有機化学工業	1,000	1,079.00	1,079,000	
三菱ケミカルホールディングス	71,100	805.10	57,242,610	
K Hネオケム	1,600	2,627.00	4,203,200	
ダイセル	16,500	1,167.00	19,255,500	
住友ベークライト	1,900	3,990.00	7,581,000	
積水化学工業	23,200	1,765.00	40,948,000	
日本ゼオン	9,600	1,102.00	10,579,200	
アイカ工業	3,200	3,555.00	11,376,000	
宇部興産	5,400	2,329.00	12,576,600	
積水樹脂	1,700	1,918.00	3,260,600	
タキロンシーアイ	2,300	627.00	1,442,100	
旭有機材	700	1,634.00	1,143,800	
日立化成	4,900	2,455.00	12,029,500	
ニチバン	600	2,288.00	1,372,800	

リケンテクノス	2,900	434.00	1,258,600	
大倉工業	500	1,674.00	837,000	
積水化成成品工業	1,600	921.00	1,473,600	
群栄化学工業	300	2,526.00	757,800	
タイガースポリマー	600	583.00	349,800	
ミライアル	300	1,066.00	319,800	
ダイキアクシス	400	823.00	329,200	
ダイキョーニシカワ	2,200	1,063.00	2,338,600	
竹本容器	400	1,415.00	566,000	
森六ホールディングス	600	2,593.00	1,555,800	
日本化薬	6,800	1,303.00	8,860,400	
カーリットホールディングス	1,100	780.00	858,000	
日本精化	800	1,188.00	950,400	
扶桑化学工業	1,100	1,869.00	2,055,900	
トリケミカル研究所	200	5,310.00	1,062,000	
A D E K A	5,200	1,593.00	8,283,600	
日油	4,100	3,710.00	15,211,000	
新日本理化	1,900	194.00	368,600	
ハリマ化成グループ	900	1,015.00	913,500	
花王	26,500	8,442.00	223,713,000	
第一工業製薬	400	3,355.00	1,342,000	
石原ケミカル	300	1,737.00	521,100	
日華化学	400	960.00	384,000	
ニイタカ	200	1,474.00	294,800	
三洋化成工業	700	5,180.00	3,626,000	
有機合成薬品工業	800	197.00	157,600	
大日本塗料	1,200	1,091.00	1,309,200	
日本ペイントホールディングス	8,800	4,300.00	37,840,000	
関西ペイント	11,900	2,120.00	25,228,000	
神東塗料	800	173.00	138,400	
中国塗料	3,500	947.00	3,314,500	
日本特殊塗料	800	1,149.00	919,200	
藤倉化成	1,400	572.00	800,800	
太陽ホールディングス	900	3,660.00	3,294,000	
D I C	4,800	3,220.00	15,456,000	
サカタインクス	2,300	1,011.00	2,325,300	

東洋インキSCホールディングス	2,200	2,452.00	5,394,400	
T&K TOKA	800	944.00	755,200	
富士フイルムホールディングス	22,600	5,004.00	113,090,400	
資生堂	21,600	7,808.00	168,652,800	
ライオン	15,100	2,320.00	35,032,000	
高砂香料工業	700	3,310.00	2,317,000	
マンダム	2,400	2,801.00	6,722,400	
ミルボン	1,300	4,950.00	6,435,000	
ファンケル	4,800	2,801.00	13,444,800	
コーセー	1,800	18,950.00	34,110,000	
コタ	500	1,495.00	747,500	
シーズ・ホールディングス	300	5,880.00	1,764,000	
シーボン	100	2,654.00	265,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	4,600	3,430.00	15,778,000	
ノエビアホールディングス	700	5,280.00	3,696,000	
アジュバンコスメジャパン	200	946.00	189,200	
エステー	800	1,901.00	1,520,800	
アグロ カネショウ	400	2,102.00	840,800	
コニシ	1,900	1,578.00	2,998,200	
長谷川香料	1,300	1,807.00	2,349,100	
星光PMC	700	778.00	544,600	
小林製薬	3,000	8,940.00	26,820,000	
荒川化学工業	1,100	1,278.00	1,405,800	
メック	700	1,009.00	706,300	
日本高純度化学	300	2,380.00	714,000	
タカラバイオ	2,800	2,541.00	7,114,800	
JCU	1,400	1,767.00	2,473,800	
新田ゼラチン	700	700.00	490,000	
OATアグリオ	100	1,660.00	166,000	
デクセリアルズ	2,800	739.00	2,069,200	
アース製薬	800	5,150.00	4,120,000	
北興化学工業	1,100	529.00	581,900	
大成ラミック	400	2,817.00	1,126,800	
クミアイ化学工業	4,500	761.00	3,424,500	
日本農薬	2,600	452.00	1,175,200	
アキレス	800	1,869.00	1,495,200	

有沢製作所	1,700	810.00	1,377,000
日東電工	8,300	5,771.00	47,899,300
レック	1,200	1,465.00	1,758,000
三光合成	900	336.00	302,400
きもと	1,800	168.00	302,400
藤森工業	1,000	3,010.00	3,010,000
前澤化成工業	700	1,015.00	710,500
未来工業	600	2,549.00	1,529,400
ウェーブロックホールディングス	200	791.00	158,200
J S P	600	2,411.00	1,446,600
エフピコ	900	6,390.00	5,751,000
天馬	700	2,041.00	1,428,700
信越ポリマー	1,900	809.00	1,537,100
東リ	2,700	262.00	707,400
ニフコ	4,300	2,743.00	11,794,900
バルカー	900	2,200.00	1,980,000
ユニ・チャーム	23,100	3,518.00	81,265,800
協和発酵キリン	13,600	2,279.00	30,994,400
武田薬品工業	94,800	4,599.00	435,985,200
アステラス製薬	100,100	1,631.50	163,313,150
大日本住友製薬	8,100	2,657.00	21,521,700
塩野義製薬	14,200	6,448.00	91,561,600
田辺三菱製薬	11,400	1,498.00	17,077,200
わかもと製薬	1,300	275.00	357,500
あすか製薬	1,400	1,179.00	1,650,600
日本新薬	2,900	7,430.00	21,547,000
バイオフェルミン製薬	200	2,315.00	463,000
中外製薬	11,400	7,320.00	83,448,000
科研製薬	2,000	5,070.00	10,140,000
エーザイ	13,000	6,065.00	78,845,000
ロート製薬	5,600	2,743.00	15,360,800
小野薬品工業	25,600	2,162.50	55,360,000
久光製薬	3,200	4,770.00	15,264,000
持田製薬	800	10,970.00	8,776,000
参天製薬	20,600	1,597.00	32,898,200
扶桑薬品工業	400	2,526.00	1,010,400

日本ケミファ	100	2,921.00	292,100	
ツムラ	3,400	3,245.00	11,033,000	
日医工	2,800	1,500.00	4,200,000	
キッセイ薬品工業	1,900	2,794.00	5,308,600	
生化学工業	2,100	1,258.00	2,641,800	
栄研化学	1,900	2,594.00	4,928,600	
日水製薬	500	1,194.00	597,000	
鳥居薬品	600	2,203.00	1,321,800	
J C R ファーマ	800	6,210.00	4,968,000	
東和薬品	500	8,940.00	4,470,000	
富士製薬工業	700	1,691.00	1,183,700	
沢井製薬	2,200	6,400.00	14,080,000	
ゼリア新薬工業	2,200	1,849.00	4,067,800	
第一三共	31,100	4,250.00	132,175,000	
キョーリン製薬ホールディングス	2,400	2,108.00	5,059,200	
大幸薬品	500	1,859.00	929,500	
ダイト	700	2,769.00	1,938,300	
大塚ホールディングス	20,700	4,346.00	89,962,200	
大正製薬ホールディングス	2,400	10,360.00	24,864,000	
ペプチドリーム	5,400	5,270.00	28,458,000	
日本コークス工業	10,000	102.00	1,020,000	
昭和シェル石油	10,000	1,682.00	16,820,000	
ニチレキ	1,400	1,107.00	1,549,800	
ユシロ化学工業	600	1,276.00	765,600	
ビーピー・カストロール	400	1,373.00	549,200	
富士石油	2,600	259.00	673,400	
MORESCO	400	1,433.00	573,200	
出光興産	8,400	3,970.00	33,348,000	
J X T G ホールディングス	182,600	526.80	96,193,680	
コスモエネルギーホールディングス	3,100	2,532.00	7,849,200	
横浜ゴム	6,300	2,020.00	12,726,000	
TOYO TIRE	5,600	1,286.00	7,201,600	
ブリヂストン	33,400	4,210.00	140,614,000	
住友ゴム工業	9,800	1,322.00	12,955,600	
藤倉ゴム工業	900	435.00	391,500	
オカモト	800	5,690.00	4,552,000	

フコク	500	883.00	441,500
ニッタ	1,200	3,550.00	4,260,000
住友理工	2,100	901.00	1,892,100
三ツ星ベルト	1,400	1,950.00	2,730,000
バンドー化学	2,100	1,105.00	2,320,500
日東紡績	1,600	1,971.00	3,153,600
A G C	10,700	3,770.00	40,339,000
日本板硝子	5,200	893.00	4,643,600
石塚硝子	200	1,752.00	350,400
日本山村硝子	400	1,463.00	585,200
日本電気硝子	4,700	2,842.00	13,357,400
オハラ	400	1,220.00	488,000
住友大阪セメント	2,200	4,285.00	9,427,000
太平洋セメント	6,900	3,625.00	25,012,500
日本ヒューム	1,100	747.00	821,700
日本コンクリート工業	2,300	274.00	630,200
三谷セキサン	500	2,922.00	1,461,000
アジアパイルホールディングス	1,500	595.00	892,500
東海カーボン	9,900	1,363.00	13,493,700
日本カーボン	500	4,765.00	2,382,500
東洋炭素	600	2,010.00	1,206,000
ノリタケカンパニーリミテド	600	5,130.00	3,078,000
T O T O	8,300	4,500.00	37,350,000
日本碍子	13,200	1,629.00	21,502,800
日本特殊陶業	9,200	2,080.00	19,136,000
ダントーホールディングス	900	105.00	94,500
M A R U W A	400	5,070.00	2,028,000
品川リフラクトリーズ	300	3,170.00	951,000
黒崎播磨	200	5,780.00	1,156,000
ヨータイ	900	525.00	472,500
イソライト工業	600	509.00	305,400
東京窯業	1,400	363.00	508,200
ニッカトー	500	907.00	453,500
フジミインコーポレーテッド	1,000	2,397.00	2,397,000
クニミネ工業	400	808.00	323,200
エーアンドエーマテリアル	200	1,042.00	208,400

ニチアス	3,000	2,112.00	6,336,000	
ニチハ	1,500	2,906.00	4,359,000	
新日鐵住金	49,900	1,962.00	97,903,800	
神戸製鋼所	19,600	839.00	16,444,400	
中山製鋼所	1,500	493.00	739,500	
合同製鐵	500	1,713.00	856,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	29,000	1,896.00	54,984,000	
東京製鐵	5,700	928.00	5,289,600	
共英製鋼	1,200	1,593.00	1,911,600	
大和工業	2,300	2,993.00	6,883,900	
東京鐵鋼	400	1,278.00	511,200	
大阪製鐵	700	1,950.00	1,365,000	
淀川製鋼所	1,400	2,094.00	2,931,600	
丸一鋼管	3,800	3,255.00	12,369,000	
モリ工業	300	2,396.00	718,800	
大同特殊鋼	1,800	4,405.00	7,929,000	
日本高周波鋼業	400	521.00	208,400	
日本冶金工業	9,100	244.00	2,220,400	
山陽特殊製鋼	1,300	2,309.00	3,001,700	
愛知製鋼	600	3,470.00	2,082,000	
日立金属	11,600	1,300.00	15,080,000	
日本金属	200	1,179.00	235,800	
大太平洋金属	700	2,756.00	1,929,200	
新日本電工	6,400	223.00	1,427,200	
栗本鐵工所	500	1,460.00	730,000	
虹技	200	1,388.00	277,600	
日本鑄鉄管	100	878.00	87,800	
三菱製鋼	800	1,584.00	1,267,200	
日亜鋼業	1,600	355.00	568,000	
日本精線	200	3,345.00	669,000	
エンビプロ・ホールディングス	300	627.00	188,100	
シンニッタン	1,700	351.00	596,700	
新家工業	200	1,632.00	326,400	
大紀アルミニウム工業所	1,800	679.00	1,222,200	
日本軽金属ホールディングス	29,200	247.00	7,212,400	
三井金属鉱業	2,900	2,811.00	8,151,900	

東邦亜鉛	600	3,160.00	1,896,000
三菱マテリアル	7,100	2,912.00	20,675,200
住友金属鉱山	14,700	3,170.00	46,599,000
DOWAホールディングス	2,500	3,670.00	9,175,000
古河機械金属	1,800	1,401.00	2,521,800
エス・サイエンス	4,700	62.00	291,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	1,655.00	1,986,000
東邦チタニウム	1,900	942.00	1,789,800
UACJ	1,600	2,146.00	3,433,600
CKサンエツ	200	3,105.00	621,000
古河電気工業	3,100	2,834.00	8,785,400
住友電気工業	40,100	1,478.00	59,267,800
フジクラ	13,000	416.00	5,408,000
昭和電線ホールディングス	1,200	698.00	837,600
東京特殊電線	100	2,125.00	212,500
タツタ電線	2,100	451.00	947,100
カナレ電気	200	1,919.00	383,800
平河ヒューテック	400	1,497.00	598,800
リョービ	1,300	2,397.00	3,116,100
アーレスティ	1,300	652.00	847,600
アサヒホールディングス	2,000	2,168.00	4,336,000
稲葉製作所	600	1,372.00	823,200
宮地エンジニアリンググループ	300	1,918.00	575,400
トーカロ	2,800	848.00	2,374,400
アルファC o	400	1,327.00	530,800
SUMCO	11,900	1,235.00	14,696,500
川田テクノロジーズ	200	7,700.00	1,540,000
RS Technologies	200	2,896.00	579,200
東洋製罐グループホールディングス	6,800	2,299.00	15,633,200
ホッカンホールディングス	500	1,951.00	975,500
コロナ	600	1,081.00	648,600
横河ブリッジホールディングス	2,000	1,896.00	3,792,000
駒井ハルテック	200	1,894.00	378,800
高田機工	100	2,622.00	262,200
三和ホールディングス	11,100	1,271.00	14,108,100
文化シャッター	3,100	814.00	2,523,400

三協立山	1,500	1,488.00	2,232,000	
アルインコ	800	976.00	780,800	
東洋シャッター	300	716.00	214,800	
LIXILグループ	15,800	1,467.00	23,178,600	
日本フィルコン	800	515.00	412,000	
ノーリツ	2,400	1,672.00	4,012,800	
長府製作所	1,100	2,265.00	2,491,500	
リンナイ	1,900	7,700.00	14,630,000	
ダイニチ工業	600	674.00	404,400	
日東精工	1,500	545.00	817,500	
三洋工業	100	1,897.00	189,700	
岡部	2,200	952.00	2,094,400	
ジーテクト	1,200	1,525.00	1,830,000	
中国工業	200	556.00	111,200	
東プレ	2,000	2,084.00	4,168,000	
高周波熱錬	2,100	890.00	1,869,000	
東京製綱	700	968.00	677,600	
サンコール	600	624.00	374,400	
モリテック スチール	800	408.00	326,400	
パイオラックス	1,700	2,121.00	3,605,700	
エイチワン	1,000	909.00	909,000	
日本発條	10,700	976.00	10,443,200	
中央発條	100	2,901.00	290,100	
アドバネクス	100	1,637.00	163,700	
立川ブラインド工業	500	1,119.00	559,500	
三益半導体工業	1,000	1,498.00	1,498,000	
日本ドライケミカル	300	1,080.00	324,000	
日本製鋼所	3,300	2,023.00	6,675,900	
三浦工業	4,600	2,476.00	11,389,600	
タクマ	3,900	1,308.00	5,101,200	
ツガミ	2,400	796.00	1,910,400	
オークマ	1,400	5,760.00	8,064,000	
東芝機械	1,200	2,156.00	2,587,200	
アマダホールディングス	16,600	1,060.00	17,596,000	
アイダエンジニアリング	3,000	799.00	2,397,000	
滝澤鉄工所	300	1,569.00	470,700	

F U J I	3,200	1,493.00	4,777,600	
牧野フライス製作所	1,300	4,130.00	5,369,000	
オーエスジー	5,300	1,998.00	10,589,400	
ダイジェット工業	100	1,697.00	169,700	
旭ダイヤモンド工業	2,800	745.00	2,086,000	
D M G 森精機	6,800	1,334.00	9,071,200	
ソディック	2,300	806.00	1,853,800	
ディスコ	1,500	15,050.00	22,575,000	
日東工器	600	2,156.00	1,293,600	
日進工具	300	2,489.00	746,700	
パンチ工業	700	596.00	417,200	
富士ダイス	500	655.00	327,500	
豊和工業	600	996.00	597,600	
O K K	400	799.00	319,600	
石川製作所	300	1,725.00	517,500	
東洋機械金属	800	590.00	472,000	
津田駒工業	200	1,788.00	357,600	
エンシュウ	300	1,169.00	350,700	
島精機製作所	1,500	3,470.00	5,205,000	
オプトラン	1,000	2,007.00	2,007,000	
N C ホールディングス	300	503.00	150,900	
フリュー	900	980.00	882,000	
ヤマシンフィルタ	1,900	747.00	1,419,300	
日阪製作所	1,300	894.00	1,162,200	
やまびこ	2,100	1,040.00	2,184,000	
平田機工	500	7,370.00	3,685,000	
ペガサスミシン製造	1,000	626.00	626,000	
マルマエ	300	689.00	206,700	
タツモ	300	724.00	217,200	
ナブテスコ	5,900	3,095.00	18,260,500	
三井海洋開発	1,100	3,245.00	3,569,500	
レオン自動機	1,000	1,532.00	1,532,000	
S M C	3,200	40,050.00	128,160,000	
新川	800	422.00	337,600	
ホソカワミクロン	400	4,920.00	1,968,000	
ユニオンツール	500	2,884.00	1,442,000	

オイレス工業	1,500	1,871.00	2,806,500	
日精エー・エス・ビー機械	300	3,780.00	1,134,000	
サトーホールディングス	1,300	2,481.00	3,225,300	
技研製作所	700	3,320.00	2,324,000	
日本エアータック	300	569.00	170,700	
カワタ	200	1,338.00	267,600	
日精樹脂工業	900	893.00	803,700	
オカダアイヨン	400	1,319.00	527,600	
ワイエイシイホールディングス	400	710.00	284,000	
小松製作所	49,100	2,554.50	125,425,950	
住友重機械工業	6,200	3,530.00	21,886,000	
日立建機	4,300	2,873.00	12,353,900	
日工	300	2,305.00	691,500	
巴工業	500	2,492.00	1,246,000	
井関農機	1,100	1,611.00	1,772,100	
T O W A	900	678.00	610,200	
丸山製作所	200	1,326.00	265,200	
北川鉄工所	500	2,257.00	1,128,500	
ローツェ	500	1,611.00	805,500	
タカキタ	400	578.00	231,200	
クボタ	58,200	1,550.50	90,239,100	
荏原実業	300	1,964.00	589,200	
三菱化工機	400	1,531.00	612,400	
月島機械	2,100	1,404.00	2,948,400	
帝国電機製作所	800	1,123.00	898,400	
東京機械製作所	400	419.00	167,600	
新東工業	2,600	940.00	2,444,000	
澁谷工業	900	3,225.00	2,902,500	
アイチ コーポレーション	1,900	702.00	1,333,800	
小森コーポレーション	2,900	1,158.00	3,358,200	
鶴見製作所	800	1,978.00	1,582,400	
住友精密工業	200	2,987.00	597,400	
酒井重工業	200	2,587.00	517,400	
荏原製作所	4,800	3,000.00	14,400,000	
石井鐵工所	200	1,900.00	380,000	
西島製作所	1,100	912.00	1,003,200	

北越工業	1,100	1,120.00	1,232,000	
ダイキン工業	14,800	12,225.00	180,930,000	
オルガノ	400	3,075.00	1,230,000	
トーヨーカネツ	400	2,086.00	834,400	
栗田工業	5,900	2,710.00	15,989,000	
椿本チエイン	1,400	3,890.00	5,446,000	
大同工業	500	858.00	429,000	
木村化工機	900	374.00	336,600	
アネスト岩田	1,700	936.00	1,591,200	
ダイフク	6,000	5,640.00	33,840,000	
サムコ	300	836.00	250,800	
加藤製作所	600	2,646.00	1,587,600	
油研工業	200	1,756.00	351,200	
タダノ	5,200	1,019.00	5,298,800	
フジテック	3,900	1,217.00	4,746,300	
C K D	3,000	987.00	2,961,000	
キトー	800	1,654.00	1,323,200	
平和	3,000	2,231.00	6,693,000	
理想科学工業	1,000	1,770.00	1,770,000	
S A N K Y O	2,700	4,200.00	11,340,000	
日本金銭機械	1,200	1,085.00	1,302,000	
マースグループホールディングス	700	2,184.00	1,528,800	
福島工業	700	3,640.00	2,548,000	
オーイズミ	500	362.00	181,000	
ダイコク電機	500	1,414.00	707,000	
竹内製作所	1,800	1,871.00	3,367,800	
アマノ	3,100	2,472.00	7,663,200	
J U K I	1,500	1,094.00	1,641,000	
サンデンホールディングス	1,300	745.00	968,500	
蛇の目ミシン工業	1,000	462.00	462,000	
マックス	1,700	1,585.00	2,694,500	
グローリー	3,000	2,624.00	7,872,000	
新晃工業	1,000	1,493.00	1,493,000	
大和冷機工業	1,600	1,093.00	1,748,800	
セガサミーホールディングス	10,800	1,312.00	14,169,600	
日本ピストンリング	400	1,609.00	643,600	

リケン	500	4,980.00	2,490,000	
T P R	1,500	2,138.00	3,207,000	
ツバキ・ナカシマ	1,600	1,847.00	2,955,200	
ホシザキ	3,200	6,800.00	21,760,000	
大豊工業	900	917.00	825,300	
日本精工	22,300	1,010.00	22,523,000	
N T N	23,300	332.00	7,735,600	
ジェイテクト	10,400	1,355.00	14,092,000	
不二越	1,000	4,390.00	4,390,000	
日本トムソン	3,200	500.00	1,600,000	
T H K	6,800	2,701.00	18,366,800	
ユーシン精機	800	1,027.00	821,600	
前澤給装工業	400	1,936.00	774,400	
イーグル工業	1,300	1,224.00	1,591,200	
前澤工業	700	336.00	235,200	
日本ピラー工業	1,100	1,263.00	1,389,300	
キッツ	4,400	781.00	3,436,400	
マキタ	13,200	3,635.00	47,982,000	
日立造船	8,700	337.00	2,931,900	
三菱重工業	18,200	4,601.00	83,738,200	
I H I	8,300	2,595.00	21,538,500	
スター精密	1,800	1,632.00	2,937,600	
日清紡ホールディングス	6,000	925.00	5,550,000	
イビデン	6,600	1,655.00	10,923,000	
コニカミノルタ	23,700	1,074.00	25,453,800	
ブラザー工業	14,100	1,993.00	28,101,300	
ミネベアミツミ	20,100	1,611.00	32,381,100	
日立製作所	49,000	3,519.00	172,431,000	
三菱電機	108,600	1,403.00	152,365,800	
富士電機	7,000	3,210.00	22,470,000	
東洋電機製造	400	1,177.00	470,800	
安川電機	12,600	3,360.00	42,336,000	
シンフォニアテクノロジー	1,500	1,335.00	2,002,500	
明電舎	2,100	1,509.00	3,168,900	
オリジン電気	300	2,000.00	600,000	
山洋電気	500	3,955.00	1,977,500	

デンヨー	1,000	1,345.00	1,345,000	
東芝テック	1,400	3,155.00	4,417,000	
芝浦メカトロニクス	200	3,510.00	702,000	
マブチモーター	3,000	3,790.00	11,370,000	
日本電産	13,100	13,360.00	175,016,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	1,529.00	917,400	
トレックス・セミコンダクター	400	1,169.00	467,600	
東光高岳	500	1,342.00	671,000	
ダブル・スコープ	1,600	1,505.00	2,408,000	
宮越ホールディングス	400	983.00	393,200	
ダイヘン	1,200	2,702.00	3,242,400	
田淵電機	1,500	115.00	172,500	
ヤーマン	1,600	1,177.00	1,883,200	
JVCケンウッド	8,500	262.00	2,227,000	
ミマキエンジニアリング	1,000	641.00	641,000	
第一精工	400	1,029.00	411,600	
日新電機	2,500	978.00	2,445,000	
大崎電気工業	2,100	690.00	1,449,000	
オムロン	11,500	5,090.00	58,535,000	
日東工業	1,700	2,140.00	3,638,000	
I D E C	1,400	1,836.00	2,570,400	
正興電機製作所	200	769.00	153,800	
不二電機工業	100	1,281.00	128,100	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,900	2,146.00	8,369,400	
サクサホールディングス	300	1,698.00	509,400	
メルコホールディングス	400	3,710.00	1,484,000	
テクノメディカ	200	2,092.00	418,400	
日本電気	14,000	3,755.00	52,570,000	
富士通	10,600	7,814.00	82,828,400	
沖電気工業	4,700	1,331.00	6,255,700	
岩崎通信機	500	798.00	399,000	
電気興業	600	3,250.00	1,950,000	
サンケン電気	1,300	2,003.00	2,603,900	
ナカヨ	200	1,495.00	299,000	
アイホン	600	1,805.00	1,083,000	
ルネサスエレクトロニクス	11,200	518.00	5,801,600	

セイコーエプソン	13,500	1,669.00	22,531,500	
ワコム	7,900	451.00	3,562,900	
アルバック	2,200	3,050.00	6,710,000	
アクセル	400	466.00	186,400	
E I Z O	1,000	4,455.00	4,455,000	
ジャパンディスプレイ	26,600	70.00	1,862,000	
日本信号	2,700	983.00	2,654,100	
京三製作所	2,300	367.00	844,100	
能美防災	1,400	1,803.00	2,524,200	
ホーチキ	700	1,097.00	767,900	
星和電機	400	487.00	194,800	
エレコム	1,000	3,315.00	3,315,000	
パナソニック	124,500	940.10	117,042,450	
シャープ	10,800	1,181.00	12,754,800	
アンリツ	7,000	2,049.00	14,343,000	
富士通ゼネラル	3,300	1,463.00	4,827,900	
ソニー	72,900	4,630.00	337,527,000	
T D K	5,700	8,520.00	48,564,000	
帝国通信工業	500	1,207.00	603,500	
タムラ製作所	4,200	585.00	2,457,000	
アルプスアルパイン	11,300	2,247.00	25,391,100	
池上通信機	300	1,122.00	336,600	
日本電波工業	1,000	392.00	392,000	
鈴木	600	635.00	381,000	
日本トリム	200	5,660.00	1,132,000	
ローランド ディー . ジー .	600	2,279.00	1,367,400	
フォスター電機	1,300	1,526.00	1,983,800	
S M K	300	2,583.00	774,900	
ヨコオ	800	1,559.00	1,247,200	
ティアック	800	191.00	152,800	
ホシデン	3,200	904.00	2,892,800	
ヒロセ電機	1,600	11,390.00	18,224,000	
日本航空電子工業	2,500	1,494.00	3,735,000	
T O A	1,200	1,046.00	1,255,200	
マクセルホールディングス	2,300	1,580.00	3,634,000	
古野電気	1,400	1,000.00	1,400,000	

ユニデンホールディングス	300	2,170.00	651,000	
スミダコーポレーション	900	1,504.00	1,353,600	
アイコム	600	2,253.00	1,351,800	
リオン	500	2,096.00	1,048,000	
本多通信工業	900	535.00	481,500	
船井電機	1,100	707.00	777,700	
横河電機	10,900	2,167.00	23,620,300	
新電元工業	400	4,250.00	1,700,000	
アズビル	7,000	2,535.00	17,745,000	
東亜ディーケーケー	500	744.00	372,000	
日本光電工業	4,800	3,450.00	16,560,000	
チノー	400	1,313.00	525,200	
共和電業	1,100	387.00	425,700	
日本電子材料	400	654.00	261,600	
堀場製作所	2,100	5,930.00	12,453,000	
アドバンテスト	7,400	2,498.00	18,485,200	
小野測器	500	603.00	301,500	
エスベック	1,000	2,003.00	2,003,000	
キーエンス	5,300	69,090.00	366,177,000	
日置電機	600	4,595.00	2,757,000	
シスメックス	8,500	6,746.00	57,341,000	
日本マイクロニクス	1,700	731.00	1,242,700	
メガチップス	800	1,596.00	1,276,800	
O B A R A G R O U P	600	3,645.00	2,187,000	
澤藤電機	100	1,600.00	160,000	
原田工業	300	921.00	276,300	
コーセル	1,400	1,157.00	1,619,800	
イリソ電子工業	1,000	4,940.00	4,940,000	
オブテックスグループ	1,900	1,752.00	3,328,800	
千代田インテグレ	500	1,981.00	990,500	
アイ・オー・データ機器	400	1,139.00	455,600	
レーザーテック	2,200	4,785.00	10,527,000	
スタンレー電気	7,700	2,917.00	22,460,900	
岩崎電気	400	1,377.00	550,800	
ウシオ電機	6,600	1,311.00	8,652,600	
岡谷電機産業	800	373.00	298,400	

ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	694.00	694,000	
エノモト	200	877.00	175,400	
日本セラミック	1,100	2,889.00	3,177,900	
遠藤照明	500	752.00	376,000	
古河電池	800	695.00	556,000	
双信電機	500	541.00	270,500	
山一電機	800	1,070.00	856,000	
図研	700	1,447.00	1,012,900	
日本電子	2,100	1,916.00	4,023,600	
カシオ計算機	9,600	1,440.00	13,824,000	
ファナック	10,300	18,800.00	193,640,000	
日本シイエムケイ	2,700	634.00	1,711,800	
エンプラス	500	2,864.00	1,432,000	
大真空	400	1,057.00	422,800	
ローム	5,200	6,880.00	35,776,000	
浜松ホトニクス	7,800	4,165.00	32,487,000	
三井ハイテック	1,200	1,018.00	1,221,600	
新光電気工業	3,600	830.00	2,988,000	
京セラ	16,600	6,305.00	104,663,000	
太陽誘電	4,800	2,061.00	9,892,800	
村田製作所	11,400	16,015.00	182,571,000	
ユーシン	1,500	983.00	1,474,500	
双葉電子工業	1,800	1,800.00	3,240,000	
北陸電気工業	400	1,042.00	416,800	
ニチコン	3,400	973.00	3,308,200	
日本ケミコン	800	1,887.00	1,509,600	
K O A	1,600	1,506.00	2,409,600	
市光工業	1,600	592.00	947,200	
小糸製作所	6,500	6,110.00	39,715,000	
ミツバ	2,000	625.00	1,250,000	
S C R E E Nホールディングス	1,900	4,425.00	8,407,500	
キヤノン電子	1,000	1,711.00	1,711,000	
キヤノン	58,600	3,140.00	184,004,000	
リコー	32,600	1,129.00	36,805,400	
象印マホービン	2,000	1,062.00	2,124,000	
M U T O Hホールディングス	100	1,916.00	191,600	

東京エレクトロン	7,300	16,200.00	118,260,000
トヨタ紡織	3,800	1,685.00	6,403,000
芦森工業	200	1,577.00	315,400
ユニプレス	2,200	1,717.00	3,777,400
豊田自動織機	8,800	5,590.00	49,192,000
モリタホールディングス	1,900	1,740.00	3,306,000
三櫻工業	1,400	511.00	715,400
デンソー	23,900	4,394.00	105,016,600
東海理化電機製作所	2,900	1,872.00	5,428,800
三井E & Sホールディングス	3,900	1,107.00	4,317,300
川崎重工業	8,400	2,652.00	22,276,800
名村造船所	3,300	372.00	1,227,600
サノヤスホールディングス	1,400	177.00	247,800
日本車輛製造	400	2,671.00	1,068,400
三菱ロジスネクスト	1,300	1,165.00	1,514,500
近畿車輛	200	1,984.00	396,800
日産自動車	127,900	945.40	120,916,660
いすゞ自動車	34,300	1,463.00	50,180,900
トヨタ自動車	121,000	6,610.00	799,810,000
日野自動車	13,600	941.00	12,797,600
三菱自動車工業	40,200	590.00	23,718,000
エフテック	800	903.00	722,400
レシップホールディングス	400	770.00	308,000
GMB	200	862.00	172,400
ファルテック	200	914.00	182,800
武蔵精密工業	2,700	1,484.00	4,006,800
日産車体	2,200	951.00	2,092,200
新明和工業	4,900	1,339.00	6,561,100
極東開発工業	2,200	1,497.00	3,293,400
日信工業	2,100	1,430.00	3,003,000
トピー工業	1,000	2,260.00	2,260,000
ティラド	400	2,270.00	908,000
曙ブレーキ工業	5,900	131.00	772,900
タチエス	1,900	1,569.00	2,981,100
NOK	5,800	1,732.00	10,045,600
フタバ産業	3,100	520.00	1,612,000

K Y B	1,200	2,783.00	3,339,600	
大同メタル工業	1,800	723.00	1,301,400	
プレス工業	5,400	587.00	3,169,800	
ミクニ	1,400	430.00	602,000	
太平洋工業	2,400	1,518.00	3,643,200	
ケーヒン	2,600	1,797.00	4,672,200	
河西工業	1,400	867.00	1,213,800	
アイシン精機	8,900	4,045.00	36,000,500	
マツダ	34,000	1,239.50	42,143,000	
今仙電機製作所	1,000	986.00	986,000	
本田技研工業	91,600	2,962.50	271,365,000	
スズキ	19,800	4,978.00	98,564,400	
S U B A R U	33,700	2,680.00	90,316,000	
安永	500	1,352.00	676,000	
ヤマハ発動機	15,300	2,115.00	32,359,500	
ショーワ	2,600	1,414.00	3,676,400	
T B K	1,300	419.00	544,700	
エクセディ	1,600	2,443.00	3,908,800	
豊田合成	3,500	2,345.00	8,207,500	
愛三工業	1,800	677.00	1,218,600	
盟和産業	200	1,081.00	216,200	
日本プラスト	800	770.00	616,000	
ヨロズ	1,100	1,580.00	1,738,000	
エフ・シー・シー	2,000	2,307.00	4,614,000	
シマノ	4,400	16,740.00	73,656,000	
テイ・エス テック	2,500	3,150.00	7,875,000	
ジャムコ	600	2,369.00	1,421,400	
テルモ	15,300	6,775.00	103,657,500	
クリエートメディック	400	936.00	374,400	
日機装	3,500	1,264.00	4,424,000	
島津製作所	14,000	2,999.00	41,986,000	
J M S	1,100	669.00	735,900	
クボテック	600	363.00	217,800	
長野計器	1,000	797.00	797,000	
ブイ・テクノロジー	300	13,660.00	4,098,000	
東京計器	900	1,114.00	1,002,600	

愛知時計電機	100	4,060.00	406,000	
インターアクション	600	1,614.00	968,400	
オーバル	1,100	242.00	266,200	
東京精密	2,000	2,759.00	5,518,000	
マニー	1,300	5,130.00	6,669,000	
ニコン	18,900	1,534.00	28,992,600	
トプコン	5,800	1,344.00	7,795,200	
オリンパス	16,200	4,720.00	76,464,000	
理研計器	1,000	2,123.00	2,123,000	
タムロン	1,000	2,004.00	2,004,000	
H O Y A	21,800	7,296.00	159,052,800	
シード	500	1,198.00	599,000	
ノーリツ鋼機	800	2,376.00	1,900,800	
エー・アンド・デイ	1,200	748.00	897,600	
朝日インテック	4,600	5,020.00	23,092,000	
シチズン時計	11,900	610.00	7,259,000	
リズム時計工業	400	1,377.00	550,800	
大研医器	900	556.00	500,400	
メニコン	1,500	3,145.00	4,717,500	
シンシア	200	622.00	124,400	
松風	500	1,295.00	647,500	
セイコーホールディングス	1,700	2,638.00	4,484,600	
ニプロ	7,500	1,425.00	10,687,500	
中本パックス	300	1,482.00	444,600	
スノーピーク	400	1,407.00	562,800	
パラマウントベッドホールディングス	1,200	4,810.00	5,772,000	
トランザクション	600	714.00	428,400	
S H O - B I	300	341.00	102,300	
ニホンフラッシュ	500	1,856.00	928,000	
前田工織	1,200	2,551.00	3,061,200	
永大産業	1,400	410.00	574,000	
アートネイチャー	1,200	636.00	763,200	
バンダイナムコホールディングス	11,200	5,140.00	57,568,000	
アイフィスジャパン	200	583.00	116,600	
共立印刷	1,800	216.00	388,800	
S H O E I	500	4,605.00	2,302,500	

フランスベッドホールディングス	1,500	910.00	1,365,000	
パイロットコーポレーション	1,900	4,320.00	8,208,000	
萩原工業	600	1,401.00	840,600	
トッパン・フォームズ	2,400	930.00	2,232,000	
フジシールインターナショナル	2,400	3,855.00	9,252,000	
タカラトミー	4,500	1,200.00	5,400,000	
廣済堂	300	821.00	246,300	
エステールホールディングス	300	687.00	206,100	
アーク	4,500	98.00	441,000	
タカノ	400	845.00	338,000	
プロネクサス	900	1,201.00	1,080,900	
ホクシン	700	134.00	93,800	
ウッドワン	400	1,044.00	417,600	
大建工業	800	2,201.00	1,760,800	
凸版印刷	15,400	1,644.00	25,317,600	
大日本印刷	15,300	2,448.00	37,454,400	
図書印刷	1,000	980.00	980,000	
共同印刷	300	2,333.00	699,900	
N I S S H A	2,300	1,140.00	2,622,000	
光村印刷	100	2,359.00	235,900	
宝印刷	500	1,623.00	811,500	
アシックス	10,800	1,396.00	15,076,800	
ツツミ	300	2,112.00	633,600	
小松ウオール工業	300	1,885.00	565,500	
ヤマハ	6,500	5,470.00	35,555,000	
河合楽器製作所	300	3,240.00	972,000	
クリナップ	1,000	572.00	572,000	
ピジョン	6,600	4,545.00	29,997,000	
兼松サステック	100	1,595.00	159,500	
キングジム	900	839.00	755,100	
リンテック	2,600	2,374.00	6,172,400	
イトーキ	2,000	508.00	1,016,000	
任天堂	6,700	30,450.00	204,015,000	
三菱鉛筆	1,800	2,109.00	3,796,200	
タカラスタANDARD	2,200	1,669.00	3,671,800	
コクヨ	5,200	1,582.00	8,226,400	

ナカバヤシ	1,100	539.00	592,900	
グローブライド	500	2,677.00	1,338,500	
オカムラ	3,800	1,126.00	4,278,800	
美津濃	1,100	2,601.00	2,861,100	
東京電力ホールディングス	86,600	703.00	60,879,800	
中部電力	33,200	1,761.00	58,465,200	
関西電力	44,300	1,710.00	75,753,000	
中国電力	15,000	1,454.00	21,810,000	
北陸電力	10,600	888.00	9,412,800	
東北電力	25,400	1,454.00	36,931,600	
四国電力	9,800	1,371.00	13,435,800	
九州電力	22,400	1,322.00	29,612,800	
北海道電力	10,200	649.00	6,619,800	
沖縄電力	2,000	1,983.00	3,966,000	
電源開発	8,600	2,743.00	23,589,800	
エフオン	500	732.00	366,000	
イーレックス	1,900	1,051.00	1,996,900	
レノバ	1,300	928.00	1,206,400	
東京瓦斯	21,300	3,072.00	65,433,600	
大阪瓦斯	21,100	2,295.00	48,424,500	
東邦瓦斯	5,400	5,000.00	27,000,000	
北海道瓦斯	600	1,441.00	864,600	
広島ガス	2,200	350.00	770,000	
西部瓦斯	1,200	2,412.00	2,894,400	
静岡ガス	3,300	883.00	2,913,900	
メタウォーター	500	3,050.00	1,525,000	
SBSホールディングス	1,100	1,719.00	1,890,900	
東武鉄道	11,400	3,165.00	36,081,000	
相鉄ホールディングス	3,700	3,320.00	12,284,000	
東京急行電鉄	29,500	1,905.00	56,197,500	
京浜急行電鉄	14,900	1,814.00	27,028,600	
小田急電鉄	17,400	2,604.00	45,309,600	
京王電鉄	6,100	6,930.00	42,273,000	
京成電鉄	8,100	3,885.00	31,468,500	
富士急行	1,500	4,100.00	6,150,000	
新京成電鉄	300	2,127.00	638,100	

東日本旅客鉄道	19,400	10,530.00	204,282,000	
西日本旅客鉄道	9,800	8,248.00	80,830,400	
東海旅客鉄道	9,700	24,580.00	238,426,000	
西武ホールディングス	13,800	1,842.00	25,419,600	
鴻池運輸	1,700	1,787.00	3,037,900	
西日本鉄道	3,000	2,670.00	8,010,000	
ハマキョウレックス	800	4,225.00	3,380,000	
サカイ引越センター	600	6,930.00	4,158,000	
近鉄グループホールディングス	10,300	5,080.00	52,324,000	
阪急阪神ホールディングス	13,700	4,050.00	55,485,000	
南海電気鉄道	4,600	3,040.00	13,984,000	
京阪ホールディングス	4,600	4,460.00	20,516,000	
神戸電鉄	300	3,995.00	1,198,500	
名古屋鉄道	8,200	3,000.00	24,600,000	
山陽電気鉄道	800	2,248.00	1,798,400	
日本通運	4,000	6,100.00	24,400,000	
ヤマトホールディングス	18,000	2,869.50	51,651,000	
山九	2,900	5,290.00	15,341,000	
丸運	600	287.00	172,200	
丸全昭和運輸	800	2,946.00	2,356,800	
センコーグループホールディングス	5,700	916.00	5,221,200	
トナミホールディングス	200	6,090.00	1,218,000	
ニッコンホールディングス	3,900	2,621.00	10,221,900	
日本石油輸送	100	2,892.00	289,200	
福山通運	1,300	4,150.00	5,395,000	
セイノーホールディングス	7,700	1,509.00	11,619,300	
エスライン	300	1,083.00	324,900	
神奈川中央交通	300	3,920.00	1,176,000	
日立物流	2,200	3,255.00	7,161,000	
丸和運輸機関	500	3,810.00	1,905,000	
C & F ロジホールディングス	1,000	1,278.00	1,278,000	
九州旅客鉄道	8,600	3,645.00	31,347,000	
S Gホールディングス	9,700	3,170.00	30,749,000	
日本郵船	8,600	1,618.00	13,914,800	
商船三井	6,100	2,382.00	14,530,200	
川崎汽船	3,200	1,179.00	3,772,800	

N S ユナイテッド海運	600	2,490.00	1,494,000	
明治海運	1,100	339.00	372,900	
飯野海運	4,800	386.00	1,852,800	
共栄タンカー	100	1,484.00	148,400	
乾汽船	900	816.00	734,400	
日本航空	18,800	3,828.00	71,966,400	
A N A ホールディングス	18,800	3,970.00	74,636,000	
パスコ	200	839.00	167,800	
ランコム	300	6,520.00	1,956,000	
日新	900	1,822.00	1,639,800	
三菱倉庫	3,600	2,973.00	10,702,800	
三井倉庫ホールディングス	1,300	1,783.00	2,317,900	
住友倉庫	3,800	1,394.00	5,297,200	
澁澤倉庫	600	1,694.00	1,016,400	
東陽倉庫	1,800	312.00	561,600	
日本トランスシティ	2,200	475.00	1,045,000	
ケイヒン	200	1,404.00	280,800	
中央倉庫	600	1,024.00	614,400	
川西倉庫	200	1,308.00	261,600	
安田倉庫	800	915.00	732,000	
ファイズ	100	779.00	77,900	
東洋埠頭	300	1,493.00	447,900	
宇徳	900	552.00	496,800	
上組	6,300	2,520.00	15,876,000	
サンリツ	200	706.00	141,200	
キムラユニティー	300	1,107.00	332,100	
キューソー流通システム	300	2,020.00	606,000	
近鉄エクスプレス	1,900	1,740.00	3,306,000	
東海運	600	280.00	168,000	
エーアイティー	700	1,105.00	773,500	
内外トランスライン	300	1,319.00	395,700	
日本コンセプト	300	926.00	277,800	
N E C ネットエスアイ	1,200	2,610.00	3,132,000	
クロスキャット	200	1,019.00	203,800	
システナ	3,800	1,120.00	4,256,000	
デジタルアーツ	600	8,760.00	5,256,000	

新日鉄住金ソリューションズ	1,600	2,906.00	4,649,600	
キューブシステム	600	783.00	469,800	
エイジア	200	1,369.00	273,800	
コア	400	1,166.00	466,400	
ソリトンシステムズ	600	1,076.00	645,600	
ソフトクリエイトホールディングス	500	1,481.00	740,500	
T I S	3,600	4,995.00	17,982,000	
ネオス	400	1,014.00	405,600	
電算システム	400	3,310.00	1,324,000	
グリー	7,500	457.00	3,427,500	
コーエーテクモホールディングス	2,200	2,071.00	4,556,200	
三菱総合研究所	400	3,350.00	1,340,000	
ボルテージ	200	528.00	105,600	
電算	100	2,115.00	211,500	
A G S	600	722.00	433,200	
ファインデックス	900	740.00	666,000	
ブレインパッド	200	6,040.00	1,208,000	
K L a b	2,000	846.00	1,692,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	1,069.00	1,603,500	
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,562.00	312,400	
ネクソン	27,100	1,670.00	45,257,000	
アイスタイル	2,800	822.00	2,301,600	
エムアップ	400	2,781.00	1,112,400	
エイチーム	700	1,754.00	1,227,800	
テクノスジャパン	900	711.00	639,900	
e n i s h	400	412.00	164,800	
コロプラ	3,100	682.00	2,114,200	
オルトプラス	600	291.00	174,600	
ブロードリーフ	5,400	572.00	3,088,800	
クロス・マーケティンググループ	300	395.00	118,500	
デジタルハーツホールディングス	500	1,246.00	623,000	
メディアドゥホールディングス	300	2,808.00	842,400	
じげん	1,100	559.00	614,900	
ブイキューブ	600	458.00	274,800	
サイバーリンクス	200	1,031.00	206,200	

ディー・エル・イー	700	181.00	126,700	
フィックスターズ	1,000	1,314.00	1,314,000	
CARTA HOLDINGS	600	996.00	597,600	
オブティム	200	5,200.00	1,040,000	
セレス	300	2,036.00	610,800	
ベリサーブ	100	6,670.00	667,000	
ティーガイア	1,100	1,878.00	2,065,800	
セック	200	3,215.00	643,000	
日本アジアグループ	1,100	340.00	374,000	
豆蔵ホールディングス	700	988.00	691,600	
テクマトリックス	700	1,790.00	1,253,000	
プロシップ	300	1,256.00	376,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,700	400.00	10,280,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,800	7,430.00	13,374,000	
ザッパラス	500	414.00	207,000	
システムリサーチ	100	2,875.00	287,500	
インターネットイニシアティブ	1,700	2,251.00	3,826,700	
さくらインターネット	1,300	526.00	683,800	
ヴィンクス	400	942.00	376,800	
GMOクラウド	200	3,565.00	713,000	
SRAホールディングス	600	2,496.00	1,497,600	
Minor iソリューションズ	200	1,579.00	315,800	
システムインテグレータ	300	778.00	233,400	
朝日ネット	900	522.00	469,800	
eBASE	300	2,406.00	721,800	
アバント	400	1,467.00	586,800	
アドソル日進	400	1,589.00	635,600	
フリービット	600	933.00	559,800	
コムチュア	600	3,280.00	1,968,000	
サイバーコム	200	2,015.00	403,000	
アステリア	500	949.00	474,500	
マークラインズ	400	1,334.00	533,600	
メディカル・データ・ビジョン	1,000	1,090.00	1,090,000	
gumi	1,400	699.00	978,600	
ショーケース・ティービー	200	704.00	140,800	
モバイルファクトリー	300	1,391.00	417,300	

テラスカイ	100	3,520.00	352,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,415.00	707,500
P C Iホールディングス	200	2,448.00	489,600
パイブドHD	200	859.00	171,800
アイビーシー	200	1,497.00	299,400
ネオジャパン	200	887.00	177,400
P R T I M E S	100	2,010.00	201,000
ランドコンピュータ	100	1,192.00	119,200
ダブルスタンダード	100	5,160.00	516,000
オーブンドア	500	3,285.00	1,642,500
マイネット	300	999.00	299,700
アカツキ	400	5,840.00	2,336,000
ベネフィットジャパン	100	882.00	88,200
U b i c o mホールディングス	200	1,328.00	265,600
L I N E	3,200	3,775.00	12,080,000
カナミックネットワーク	200	1,902.00	380,400
ノムラシステムコーポレーション	100	702.00	70,200
チェンジ	100	3,680.00	368,000
シンクロ・フード	400	560.00	224,000
オークネット	600	1,237.00	742,200
A O I T Y O H o l d i n g s	1,200	763.00	915,600
マクロミル	1,900	1,369.00	2,601,100
ピーグリー	200	931.00	186,200
オロ	100	5,640.00	564,000
ソルクシーズ	400	765.00	306,000
フェイス	400	823.00	329,200
ハイマックス	100	1,826.00	182,600
野村総合研究所	6,800	4,890.00	33,252,000
サイバネットシステム	900	550.00	495,000
C Eホールディングス	300	748.00	224,400
日本システム技術	200	1,394.00	278,800
インタージホールディングス	1,400	847.00	1,185,800
東邦システムサイエンス	300	917.00	275,100
ソースネクスト	4,200	445.00	1,869,000
インフォコム	900	1,795.00	1,615,500

F I G	900	310.00	279,000	
アルテリア・ネットワークス	900	1,234.00	1,110,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	1,585.00	317,000	
フォーカスシステムズ	700	935.00	654,500	
クレスコ	300	3,305.00	991,500	
フジ・メディア・ホールディングス	11,000	1,506.00	16,566,000	
オービック	3,700	10,840.00	40,108,000	
ジャストシステム	1,500	2,757.00	4,135,500	
TDCソフト	900	852.00	766,800	
ヤフー	69,400	270.00	18,738,000	
トレンドマイクロ	5,700	5,050.00	28,785,000	
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,415.00	424,500	
日本オラクル	2,200	7,570.00	16,654,000	
アルファシステムズ	300	2,720.00	816,000	
フューチャー	1,400	1,739.00	2,434,600	
C A C Holdings	800	1,363.00	1,090,400	
ソフトバンク・テクノロジー	400	2,436.00	974,400	
トーセ	300	881.00	264,300	
オービックビジネスコンサルタント	1,100	4,215.00	4,636,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	4,900	2,535.00	12,421,500	
アイティフォー	1,300	917.00	1,192,100	
東計電算	200	3,000.00	600,000	
エクスネット	200	900.00	180,000	
大塚商会	5,800	3,870.00	22,446,000	
サイボウズ	1,200	798.00	957,600	
ソフトブレーン	800	455.00	364,000	
電通国際情報サービス	700	3,675.00	2,572,500	
デジタルガレージ	2,100	3,035.00	6,373,500	
E Mシステムズ	900	1,312.00	1,180,800	
ウェザーニューズ	400	3,095.00	1,238,000	
C I J	800	806.00	644,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,255.00	225,500	
日本エンタープライズ	1,100	170.00	187,000	
WOWOW	500	2,969.00	1,484,500	
スカラ	700	784.00	548,800	

IMAGICA GROUP	900	578.00	520,200
ネットワンシステムズ	3,800	2,623.00	9,967,400
システムソフト	2,500	99.00	247,500
アルゴグラフィックス	400	4,450.00	1,780,000
マーベラス	1,700	877.00	1,490,900
エイベックス	1,800	1,424.00	2,563,200
日本ユニシス	3,300	2,796.00	9,226,800
兼松エレクトロニクス	600	3,265.00	1,959,000
東京放送ホールディングス	7,100	2,029.00	14,405,900
日本テレビホールディングス	9,800	1,661.00	16,277,800
朝日放送グループホールディングス	1,200	798.00	957,600
テレビ朝日ホールディングス	2,900	1,954.00	5,666,600
スカパーJ S A Tホールディングス	8,200	473.00	3,878,600
テレビ東京ホールディングス	900	2,354.00	2,118,600
日本BS放送	400	1,042.00	416,800
ビジョン	300	4,800.00	1,440,000
スマートバリュー	200	809.00	161,800
USEN-NEXT HOLDINGS	400	881.00	352,400
ワイヤレスゲート	500	416.00	208,000
コネクシオ	700	1,407.00	984,900
日本通信	9,400	113.00	1,062,200
クロップス	200	694.00	138,800
日本電信電話	72,800	4,760.00	346,528,000
KDDI	93,900	2,446.50	229,726,350
ソフトバンク	84,600	1,290.50	109,176,300
光通信	1,300	20,510.00	26,663,000
NTTドコモ	76,500	2,433.50	186,162,750
エムティーアイ	1,200	624.00	748,800
GMOインターネット	3,900	1,788.00	6,973,200
アイドママーケティングコミュニケーション	200	498.00	99,600
カドカワ	3,100	1,183.00	3,667,300
学研ホールディングス	400	5,380.00	2,152,000
ゼンリン	2,100	2,515.00	5,281,500
昭文社	500	420.00	210,000
インプレスホールディングス	900	142.00	127,800
アイネット	600	1,286.00	771,600

松竹	700	11,770.00	8,239,000	
東宝	7,000	4,235.00	29,645,000	
東映	400	14,950.00	5,980,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	28,400	1,175.00	33,370,000	
ピー・シー・エー	100	3,010.00	301,000	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,836.00	367,200	
D T S	1,200	4,050.00	4,860,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,000	3,790.00	18,950,000	
シーイーシー	1,100	2,023.00	2,225,300	
カプコン	4,600	2,459.00	11,311,400	
アイ・エス・ピー	200	1,889.00	377,800	
ジャステック	600	945.00	567,000	
S C S K	2,800	4,810.00	13,468,000	
日本システムウエア	300	2,257.00	677,100	
アイネス	1,300	1,279.00	1,662,700	
T K C	900	4,015.00	3,613,500	
富士ソフト	1,600	4,130.00	6,608,000	
N S D	1,700	2,524.00	4,290,800	
コナミホールディングス	4,400	4,850.00	21,340,000	
福井コンピュータホールディングス	300	1,932.00	579,600	
J B C Cホールディングス	800	1,385.00	1,108,000	
ミロク情報サービス	1,000	2,793.00	2,793,000	
ソフトバンクグループ	44,500	10,705.00	476,372,500	
ハウスイ	100	844.00	84,400	
高千穂交易	400	995.00	398,000	
伊藤忠食品	300	4,950.00	1,485,000	
エレマテック	500	1,696.00	848,000	
J A L U X	300	2,595.00	778,500	
あらた	600	3,805.00	2,283,000	
トーメンデバイス	200	2,495.00	499,000	
東京エレクトロン デバイス	400	1,806.00	722,400	
フィールズ	900	702.00	631,800	
双日	59,000	398.00	23,482,000	
アルフレッサ ホールディングス	11,900	3,090.00	36,771,000	
横浜冷凍	2,800	883.00	2,472,400	
神栄	100	767.00	76,700	

ラサ商事	600	859.00	515,400	
ラクーンホールディングス	500	672.00	336,000	
アルコニックス	1,200	1,266.00	1,519,200	
神戸物産	1,600	3,895.00	6,232,000	
あいホールディングス	1,500	1,803.00	2,704,500	
ディーブイエックス	400	998.00	399,200	
ダイワボウホールディングス	1,000	6,250.00	6,250,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,900	1,481.00	4,294,900	
ラクト・ジャパン	200	8,570.00	1,714,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,074.00	2,148,000	
八洲電機	800	827.00	661,600	
メディアスホールディングス	600	629.00	377,400	
U K Cホールディングス	700	1,941.00	1,358,700	
ジューテックホールディングス	200	1,080.00	216,000	
大光	300	652.00	195,600	
O C H Iホールディングス	300	1,306.00	391,800	
T O K A Iホールディングス	5,600	859.00	4,810,400	
黒谷	200	444.00	88,800	
C o m i n i x	200	876.00	175,200	
三洋貿易	500	1,832.00	916,000	
ビューティガレージ	200	1,334.00	266,800	
ウイン・パートナーズ	700	1,199.00	839,300	
ミタチ産業	300	729.00	218,700	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,420.00	9,724,000	
明治電機工業	300	1,677.00	503,100	
デリカフーズホールディングス	200	1,313.00	262,600	
スターティアホールディングス	200	556.00	111,200	
コメダホールディングス	2,500	2,083.00	5,207,500	
富士興産	400	689.00	275,600	
協栄産業	100	1,521.00	152,100	
小野建	1,000	1,604.00	1,604,000	
南陽	200	2,099.00	419,800	
佐島電機	800	921.00	736,800	
エコートレーディング	200	550.00	110,000	
伯東	700	1,208.00	845,600	
コンドーテック	800	997.00	797,600	

中山福	600	565.00	339,000	
ナガイレーベン	1,500	2,349.00	3,523,500	
三菱食品	1,200	2,842.00	3,410,400	
松田産業	800	1,405.00	1,124,000	
第一興商	1,600	5,430.00	8,688,000	
メディバルホールディングス	11,500	2,566.00	29,509,000	
S P K	200	2,361.00	472,200	
萩原電気ホールディングス	400	3,095.00	1,238,000	
アズワン	800	8,670.00	6,936,000	
スズデン	400	1,841.00	736,400	
尾家産業	300	1,283.00	384,900	
シモジマ	600	1,200.00	720,000	
ドウシシャ	1,000	1,730.00	1,730,000	
小津産業	200	1,893.00	378,600	
高速	600	1,218.00	730,800	
たけびし	400	1,460.00	584,000	
リックス	200	1,587.00	317,400	
丸文	900	664.00	597,600	
ハピネット	900	1,520.00	1,368,000	
橋本総業ホールディングス	200	1,590.00	318,000	
日本ライフライン	3,300	1,788.00	5,900,400	
タカショー	500	431.00	215,500	
エクセル	400	2,510.00	1,004,000	
マルカキカイ	300	2,080.00	624,000	
I D O M	3,600	317.00	1,141,200	
日本エム・ディ・エム	600	1,070.00	642,000	
進和	600	2,122.00	1,273,200	
エスケイジャパン	300	767.00	230,100	
ダイトロン	500	1,616.00	808,000	
シークス	1,400	1,596.00	2,234,400	
田中商事	500	600.00	300,000	
オーハシテクニカ	600	1,471.00	882,600	
白銅	300	1,685.00	505,500	
伊藤忠商事	74,800	2,023.50	151,357,800	
丸紅	105,400	785.40	82,781,160	
高島	200	1,845.00	369,000	

長瀬産業	6,000	1,591.00	9,546,000	
蝶理	700	1,569.00	1,098,300	
豊田通商	11,900	3,630.00	43,197,000	
三共生興	2,200	479.00	1,053,800	
兼松	4,200	1,300.00	5,460,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,274.00	254,800	
三井物産	88,100	1,763.00	155,320,300	
日本紙パルプ商事	600	4,315.00	2,589,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,200	4,530.00	14,496,000	
カメイ	1,400	1,148.00	1,607,200	
東都水産	100	2,516.00	251,600	
OUGホールディングス	200	2,599.00	519,800	
スターゼン	400	3,925.00	1,570,000	
山善	4,100	1,160.00	4,756,000	
椿本興業	200	3,970.00	794,000	
住友商事	63,200	1,571.00	99,287,200	
内田洋行	500	3,190.00	1,595,000	
三菱商事	75,000	3,182.00	238,650,000	
第一実業	500	3,245.00	1,622,500	
キャノンマーケティングジャパン	3,100	2,160.00	6,696,000	
西華産業	600	1,443.00	865,800	
佐藤商事	900	906.00	815,400	
菱洋エレクトロ	1,100	1,620.00	1,782,000	
東京産業	1,100	512.00	563,200	
ユアサ商事	1,100	3,220.00	3,542,000	
神鋼商事	200	2,640.00	528,000	
小林産業	600	342.00	205,200	
阪和興業	1,900	3,240.00	6,156,000	
正栄食品工業	600	3,020.00	1,812,000	
カナデン	1,000	1,195.00	1,195,000	
菱電商事	800	1,485.00	1,188,000	
フルサト工業	600	1,666.00	999,600	
岩谷産業	2,400	3,640.00	8,736,000	
すてきナイスグループ	500	886.00	443,000	
昭光通商	400	608.00	243,200	
二チモウ	200	1,700.00	340,000	

極東貿易	300	1,619.00	485,700
イワキ	1,300	393.00	510,900
三愛石油	2,900	926.00	2,685,400
稲畑産業	2,600	1,509.00	3,923,400
G S Iクレオス	300	1,168.00	350,400
明和産業	1,000	443.00	443,000
ワキタ	2,300	1,094.00	2,516,200
東邦ホールディングス	3,200	2,719.00	8,700,800
サンゲツ	3,200	2,006.00	6,419,200
ミツウロコグループホールディングス	1,800	838.00	1,508,400
シナネンホールディングス	500	2,149.00	1,074,500
伊藤忠エネクス	2,300	914.00	2,102,200
サンリオ	3,300	2,495.00	8,233,500
サンワテクノス	600	892.00	535,200
リョーサン	1,200	3,000.00	3,600,000
新光商事	1,000	1,851.00	1,851,000
トーヨー	500	2,172.00	1,086,000
三信電気	900	1,808.00	1,627,200
東陽テクニカ	1,200	870.00	1,044,000
モスフードサービス	1,400	2,806.00	3,928,400
加賀電子	1,100	2,063.00	2,269,300
ソーダニッカ	1,100	571.00	628,100
立花エレテック	800	1,677.00	1,341,600
フォーバル	500	803.00	401,500
P A L T A C	1,900	5,960.00	11,324,000
三谷産業	1,600	285.00	456,000
太平洋興発	400	766.00	306,400
西本Wismettacホールディングス	200	4,395.00	879,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,107.00	110,700
国際紙バルブ商事	1,900	302.00	573,800
ヤマタネ	500	1,589.00	794,500
丸紅建材リース	100	1,986.00	198,600
日鉄住金物産	800	4,725.00	3,780,000
泉州電業	400	2,677.00	1,070,800
トラスコ中山	2,200	2,887.00	6,351,400
オートバックスセブン	4,200	1,833.00	7,698,600

モリト	800	807.00	645,600
加藤産業	1,700	3,675.00	6,247,500
北恵	200	901.00	180,200
イノテック	600	973.00	583,800
イエローハット	1,000	2,851.00	2,851,000
J Kホールディングス	1,100	578.00	635,800
日伝	900	1,618.00	1,456,200
北沢産業	800	257.00	205,600
杉本商事	600	1,730.00	1,038,000
因幡電機産業	1,500	4,325.00	6,487,500
バイテックホールディングス	500	1,926.00	963,000
東テク	400	2,275.00	910,000
ミスミグループ本社	13,400	2,615.00	35,041,000
アルテック	800	208.00	166,400
タキヒヨー	300	1,702.00	510,600
蔵王産業	300	1,356.00	406,800
スズケン	4,900	6,150.00	30,135,000
ジェコス	700	1,021.00	714,700
ルネサスイーストン	1,000	424.00	424,000
ローソン	2,800	6,140.00	17,192,000
サンエー	800	4,270.00	3,416,000
カワチ薬品	800	1,781.00	1,424,800
エービーシー・マート	1,700	6,490.00	11,033,000
ハードオフコーポレーション	400	842.00	336,800
アスクル	1,100	2,729.00	3,001,900
ゲオホールディングス	1,600	1,505.00	2,408,000
アダストリア	1,500	2,440.00	3,660,000
ジーフット	700	643.00	450,100
シー・ヴィー・エス・バイエリア	100	719.00	71,900
くらコーポレーション	600	5,080.00	3,048,000
キャンドウ	500	1,663.00	831,500
パルグループホールディングス	500	3,085.00	1,542,500
エディオン	4,500	989.00	4,450,500
サーラコーポレーション	2,300	614.00	1,412,200
ワッツ	400	712.00	284,800
ハローズ	400	2,104.00	841,600

フジオフードシステム	400	2,575.00	1,030,000	
あみやき亭	200	3,730.00	746,000	
ひらまつ	2,200	347.00	763,400	
大黒天物産	300	3,760.00	1,128,000	
ハニーズホールディングス	1,000	1,100.00	1,100,000	
ファーマライズホールディングス	200	535.00	107,000	
アルペン	800	1,713.00	1,370,400	
ハブ	300	985.00	295,500	
クオールホールディングス	1,600	1,450.00	2,320,000	
ジーンズ	700	5,850.00	4,095,000	
ビックカメラ	5,700	1,176.00	6,703,200	
D C Mホールディングス	5,700	1,027.00	5,853,900	
ペッパーフードサービス	800	2,207.00	1,765,600	
Monotaro	6,800	2,368.00	16,102,400	
東京一番フーズ	300	624.00	187,200	
D Dホールディングス	200	1,893.00	378,600	
きちりホールディングス	300	761.00	228,300	
アークランドサービスホールディングス	800	2,038.00	1,630,400	
J . フロント リテイリング	13,800	1,262.00	17,415,600	
ドトール・日レスホールディングス	1,900	2,109.00	4,007,100	
マツモトキヨシホールディングス	4,500	3,590.00	16,155,000	
ブロンコピリー	600	2,658.00	1,594,800	
Z O Z O	11,600	2,085.00	24,186,000	
トレジャー・ファクトリー	400	763.00	305,200	
物語コーポレーション	300	9,030.00	2,709,000	
ココカラファイン	1,200	4,375.00	5,250,000	
三越伊勢丹ホールディングス	20,000	1,120.00	22,400,000	
H a m e e	400	750.00	300,000	
ウエルシアホールディングス	2,800	3,580.00	10,024,000	
クリエイトSDホールディングス	1,600	2,693.00	4,308,800	
丸善C H I ホールディングス	1,200	352.00	422,400	
ミサワ	200	404.00	80,800	
ティーライフ	100	882.00	88,200	
エー・ピーカンパニー	200	548.00	109,600	
チムニー	300	2,689.00	806,700	
シュッピン	800	788.00	630,400	

ネクステージ	1,700	1,182.00	2,009,400	
ジョイフル本田	3,100	1,344.00	4,166,400	
鳥貴族	400	1,692.00	676,800	
キリン堂ホールディングス	400	1,470.00	588,000	
ホットランド	600	1,507.00	904,200	
すかいらーくホールディングス	10,000	1,790.00	17,900,000	
綿半ホールディングス	400	2,102.00	840,800	
ヨシックス	200	3,525.00	705,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,200	1,097.00	3,510,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	612.00	306,000	
B E E N O S	300	1,118.00	335,400	
あさひ	1,000	1,507.00	1,507,000	
日本調剤	400	3,780.00	1,512,000	
コスモス薬品	500	18,730.00	9,365,000	
トーエル	600	787.00	472,200	
オンリー	200	987.00	197,400	
セブン&アイ・ホールディングス	44,800	4,240.00	189,952,000	
薬王堂	500	2,581.00	1,290,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,000	1,338.00	4,014,000	
ツルハホールディングス	2,300	8,960.00	20,608,000	
サンマルクホールディングス	900	2,573.00	2,315,700	
フェリシモ	200	1,086.00	217,200	
トリドールホールディングス	1,400	2,276.00	3,186,400	
T O K Y O B A S E	1,000	979.00	979,000	
ウイルプラスホールディングス	100	816.00	81,600	
ジャパンミート	400	1,894.00	757,600	
サツドラホールディングス	200	1,834.00	366,800	
デファクトスタンダード	100	436.00	43,600	
ダイユー・リックホールディングス	700	832.00	582,400	
パロックジャパンリミテッド	900	847.00	762,300	
クスリのアオキホールディングス	1,100	7,620.00	8,382,000	
力の源ホールディングス	400	780.00	312,000	
スシローグローバルホールディングス	1,200	7,450.00	8,940,000	
L I X I L ビバ	1,000	1,424.00	1,424,000	
メディカルシステムネットワーク	1,200	518.00	621,600	

はるやまホールディングス	500	890.00	445,000	
ノジマ	2,000	1,963.00	3,926,000	
カップ・クリエイト	1,600	1,529.00	2,446,400	
ライトオン	1,000	740.00	740,000	
ジーンズメイト	400	414.00	165,600	
良品計画	1,500	25,570.00	38,355,000	
三城ホールディングス	1,300	392.00	509,600	
アドヴァン	1,700	1,042.00	1,771,400	
アルビス	400	2,333.00	933,200	
コナカ	1,400	444.00	621,600	
ハウス オブ ローゼ	100	1,801.00	180,100	
G - 7ホールディングス	300	2,222.00	666,600	
イオン北海道	1,200	750.00	900,000	
コジマ	1,600	598.00	956,800	
ヒマラヤ	300	919.00	275,700	
コーナン商事	1,400	2,692.00	3,768,800	
エコス	400	1,526.00	610,400	
ワタミ	1,400	1,642.00	2,298,800	
マルシェ	300	800.00	240,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	6,400	7,040.00	45,056,000	
西松屋チェーン	2,300	933.00	2,145,900	
ゼンショーホールディングス	5,000	2,600.00	13,000,000	
幸楽苑ホールディングス	700	2,539.00	1,777,300	
ハークスレイ	200	1,121.00	224,200	
サイゼリヤ	1,800	2,138.00	3,848,400	
V Tホールディングス	3,600	426.00	1,533,600	
魚力	300	1,454.00	436,200	
ポプラ	300	526.00	157,800	
フジ・コーポレーション	200	2,212.00	442,400	
ユナイテッドアローズ	1,200	3,695.00	4,434,000	
ハイデイ日高	1,500	2,078.00	3,117,000	
京都きもの友禅	700	405.00	283,500	
コロワイド	3,600	2,379.00	8,564,400	
ピーシーデポコーポレーション	1,400	444.00	621,600	
壺番屋	700	4,685.00	3,279,500	

トップカルチャー	400	321.00	128,400	
P L A N T	200	990.00	198,000	
スギホールディングス	2,400	4,820.00	11,568,000	
ヴィア・ホールディングス	1,300	689.00	895,700	
スクロール	1,600	379.00	606,400	
ヨンドシーホールディングス	1,200	2,055.00	2,466,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	12,000	2,876.00	34,512,000	
木曽路	1,300	2,712.00	3,525,600	
S R Sホールディングス	1,300	1,033.00	1,342,900	
千趣会	1,900	231.00	438,900	
タカキュー	800	172.00	137,600	
ケーヨー	2,000	489.00	978,000	
上新電機	1,300	2,533.00	3,292,900	
日本瓦斯	1,700	3,275.00	5,567,500	
ロイヤルホールディングス	1,900	2,680.00	5,092,000	
東天紅	100	1,236.00	123,600	
いなげや	1,200	1,299.00	1,558,800	
島忠	2,400	2,832.00	6,796,800	
チヨダ	1,100	1,730.00	1,903,000	
ライフコーポレーション	800	2,304.00	1,843,200	
リンガーハット	1,300	2,343.00	3,045,900	
Mr M a x H D	1,500	431.00	646,500	
テンアライド	1,000	428.00	428,000	
A O K Iホールディングス	2,100	1,186.00	2,490,600	
オークワ	1,500	1,105.00	1,657,500	
コメリ	1,600	2,686.00	4,297,600	
青山商事	1,900	2,546.00	4,837,400	
しまむら	1,200	9,300.00	11,160,000	
はせがわ	600	397.00	238,200	
高島屋	8,400	1,488.00	12,499,200	
松屋	2,100	994.00	2,087,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,500	1,506.00	8,283,000	
近鉄百貨店	400	3,385.00	1,354,000	
パルコ	1,000	1,001.00	1,001,000	
丸井グループ	9,000	2,214.00	19,926,000	
アクシアル リテイリング	900	3,390.00	3,051,000	

井筒屋	500	263.00	131,500	
イオン	41,200	2,248.00	92,617,600	
イズミ	2,200	4,955.00	10,901,000	
平和堂	2,200	2,339.00	5,145,800	
フジ	1,300	1,869.00	2,429,700	
ヤオコー	1,200	5,600.00	6,720,000	
ゼビオホールディングス	1,300	1,240.00	1,612,000	
ケーズホールディングス	11,100	980.00	10,878,000	
Olympicグループ	600	650.00	390,000	
日産東京販売ホールディングス	1,600	313.00	500,800	
Genky DrugStores	500	2,300.00	1,150,000	
総合メディカルホールディングス	900	1,665.00	1,498,500	
ブックオフグループホールディングス	600	830.00	498,000	
アインホールディングス	1,400	8,070.00	11,298,000	
元気寿司	300	5,140.00	1,542,000	
ヤマダ電機	32,600	560.00	18,256,000	
アークランドサカモト	1,800	1,412.00	2,541,600	
ニトリホールディングス	4,700	13,500.00	63,450,000	
グルメ杵屋	800	1,217.00	973,600	
愛眼	800	302.00	241,600	
ケーユーホールディングス	600	861.00	516,600	
吉野家ホールディングス	3,700	1,735.00	6,419,500	
松屋フーズホールディングス	500	3,850.00	1,925,000	
サガミホールディングス	1,400	1,316.00	1,842,400	
関西スーパーマーケット	800	1,062.00	849,600	
王将フードサービス	800	7,320.00	5,856,000	
プレナス	1,200	1,716.00	2,059,200	
ミニストップ	800	1,668.00	1,334,400	
アークス	2,000	2,376.00	4,752,000	
バローホールディングス	2,300	2,668.00	6,136,400	
藤久	100	758.00	75,800	
ベルク	500	5,060.00	2,530,000	
大庄	600	1,509.00	905,400	
ファーストリテイリング	1,400	52,630.00	73,682,000	
サンドラッグ	4,000	3,115.00	12,460,000	
サックスパーホールディングス	900	1,123.00	1,010,700	

ヤマザワ	200	1,657.00	331,400	
やまや	200	2,358.00	471,600	
ペルーナ	2,600	869.00	2,259,400	
島根銀行	200	758.00	151,600	
じもとホールディングス	9,000	113.00	1,017,000	
めぶきフィナンシャルグループ	55,600	287.00	15,957,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,400	1,650.00	2,310,000	
九州フィナンシャルグループ	17,600	468.00	8,236,800	
ゆうちょ銀行	30,300	1,238.00	37,511,400	
富山第一銀行	2,900	378.00	1,096,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,200	423.00	28,848,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	6,900	946.00	6,527,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	4,900	834.00	4,086,600	
三十三フィナンシャルグループ	900	1,599.00	1,439,100	
第四北越フィナンシャルグループ	1,900	3,150.00	5,985,000	
新生銀行	7,900	1,560.00	12,324,000	
あおぞら銀行	6,000	2,892.00	17,352,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	737,300	553.40	408,021,820	
りそなホールディングス	116,700	486.70	56,797,890	
三井住友トラスト・ホールディングス	21,100	4,053.00	85,518,300	
三井住友フィナンシャルグループ	75,400	3,915.00	295,191,000	
千葉銀行	37,900	605.00	22,929,500	
群馬銀行	21,400	466.00	9,972,400	
武蔵野銀行	1,600	2,236.00	3,577,600	
千葉興業銀行	2,900	302.00	875,800	
筑波銀行	5,400	192.00	1,036,800	
七十七銀行	3,400	1,561.00	5,307,400	
青森銀行	800	2,929.00	2,343,200	
秋田銀行	700	2,257.00	1,579,900	
山形銀行	1,200	1,966.00	2,359,200	
岩手銀行	700	3,290.00	2,303,000	
東邦銀行	9,500	299.00	2,840,500	
東北銀行	500	1,087.00	543,500	
みちのく銀行	700	1,649.00	1,154,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	8,700	2,491.00	21,671,700	
静岡銀行	26,900	850.00	22,865,000	

十六銀行	1,400	2,318.00	3,245,200	
スルガ銀行	10,900	514.00	5,602,600	
八十二銀行	19,400	454.00	8,807,600	
山梨中央銀行	1,300	1,380.00	1,794,000	
大垣共立銀行	1,700	2,341.00	3,979,700	
福井銀行	900	1,678.00	1,510,200	
北國銀行	1,100	3,440.00	3,784,000	
清水銀行	400	1,862.00	744,800	
富山銀行	200	3,135.00	627,000	
滋賀銀行	2,100	2,650.00	5,565,000	
南都銀行	1,200	2,147.00	2,576,400	
百五銀行	9,700	364.00	3,530,800	
京都銀行	3,800	4,720.00	17,936,000	
紀陽銀行	3,800	1,539.00	5,848,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,100	1,207.00	8,569,700	
広島銀行	15,800	568.00	8,974,400	
山陰合同銀行	6,300	816.00	5,140,800	
中国銀行	6,900	1,084.00	7,479,600	
鳥取銀行	400	1,423.00	569,200	
伊予銀行	14,200	598.00	8,491,600	
百十四銀行	1,100	2,353.00	2,588,300	
四国銀行	1,500	1,061.00	1,591,500	
阿波銀行	1,700	2,852.00	4,848,400	
大分銀行	700	3,480.00	2,436,000	
宮崎銀行	700	2,706.00	1,894,200	
佐賀銀行	600	1,883.00	1,129,800	
十八銀行	700	2,776.00	1,943,200	
沖縄銀行	1,000	3,575.00	3,575,000	
琉球銀行	2,500	1,197.00	2,992,500	
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	1,454,900	173.60	252,570,640	
高知銀行	400	775.00	310,000	
山口フィナンシャルグループ	13,400	975.00	13,065,000	
長野銀行	300	1,656.00	496,800	
名古屋銀行	900	3,545.00	3,190,500	
北洋銀行	16,100	283.00	4,556,300	

愛知銀行	400	3,535.00	1,414,000	
中京銀行	400	2,260.00	904,000	
大光銀行	400	1,618.00	647,200	
愛媛銀行	1,500	1,141.00	1,711,500	
トマト銀行	400	1,054.00	421,600	
京葉銀行	4,700	693.00	3,257,100	
栃木銀行	5,900	234.00	1,380,600	
北日本銀行	300	2,062.00	618,600	
東和銀行	1,900	736.00	1,398,400	
福島銀行	900	372.00	334,800	
大東銀行	500	638.00	319,000	
トモニホールディングス	8,300	426.00	3,535,800	
フィデアホールディングス	11,000	132.00	1,452,000	
池田泉州ホールディングス	11,400	300.00	3,420,000	
F P G	3,300	922.00	3,042,600	
マーキュリアインベストメント	400	676.00	270,400	
S B Iホールディングス	12,800	2,389.00	30,579,200	
日本アジア投資	900	187.00	168,300	
ジャフコ	1,800	3,990.00	7,182,000	
大和証券グループ本社	85,900	548.70	47,133,330	
野村ホールディングス	188,400	399.00	75,171,600	
岡三証券グループ	9,100	443.00	4,031,300	
丸三証券	3,200	683.00	2,185,600	
東洋証券	3,800	148.00	562,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,800	415.00	5,312,000	
光世証券	300	702.00	210,600	
水戸証券	3,100	209.00	647,900	
いちよし証券	2,200	788.00	1,733,600	
松井証券	5,200	1,187.00	6,172,400	
だいこう証券ビジネス	500	414.00	207,000	
マネックスグループ	10,000	394.00	3,940,000	
カブドットコム証券	8,000	560.00	4,480,000	
極東証券	1,400	1,078.00	1,509,200	
岩井コスモホールディングス	1,100	1,299.00	1,428,900	
藍澤証券	2,000	662.00	1,324,000	
マネーパートナーズグループ	1,200	284.00	340,800	

小林洋行	300	277.00	83,100	
かんぽ生命保険	4,000	2,441.00	9,764,000	
S O M P Oホールディングス	18,900	4,010.00	75,789,000	
アニコム ホールディングス	900	2,777.00	2,499,300	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	28,000	3,353.00	93,884,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,800	2,058.00	18,110,400	
第一生命ホールディングス	60,600	1,556.50	94,323,900	
東京海上ホールディングス	38,900	5,368.00	208,815,200	
T & Dホールディングス	33,100	1,139.50	37,717,450	
アドバンスクリエイト	200	1,729.00	345,800	
全国保証	3,000	4,035.00	12,105,000	
ジェイリース	200	382.00	76,400	
イントラスト	300	457.00	137,100	
日本モーゲージサービス	100	1,328.00	132,800	
C a s a	400	993.00	397,200	
アルヒ	1,000	2,109.00	2,109,000	
プレミアグループ	200	3,385.00	677,000	
クレディセゾン	7,500	1,515.00	11,362,500	
芙蓉総合リース	1,200	5,580.00	6,696,000	
興銀リース	2,000	2,736.00	5,472,000	
東京センチュリー	2,200	4,625.00	10,175,000	
日本証券金融	4,700	620.00	2,914,000	
アイフル	16,300	282.00	4,596,600	
リコーリース	800	3,510.00	2,808,000	
イオンフィナンシャルサービス	6,800	2,267.00	15,415,600	
アコム	21,500	388.00	8,342,000	
ジャックス	1,200	1,867.00	2,240,400	
オリエントコーポレーション	29,200	116.00	3,387,200	
日立キャピタル	2,500	2,622.00	6,555,000	
アプラスフィナンシャル	5,100	84.00	428,400	
オリックス	71,400	1,618.00	115,525,200	
三菱UFJリース	24,200	554.00	13,406,800	
九州リースサービス	500	699.00	349,500	
日本取引所グループ	28,900	1,944.00	56,181,600	
イー・ギャランティ	1,000	1,059.00	1,059,000	

アサックス	400	549.00	219,600	
NECキャピタルソリューション	400	1,786.00	714,400	
いちご	13,600	372.00	5,059,200	
日本駐車場開発	12,800	164.00	2,099,200	
ヒューリック	22,300	1,067.00	23,794,100	
三栄建築設計	400	1,596.00	638,400	
スター・マイカ	500	1,381.00	690,500	
野村不動産ホールディングス	7,100	2,156.00	15,307,600	
三重交通グループホールディングス	2,200	577.00	1,269,400	
サムティ	1,500	1,473.00	2,209,500	
ディア・ライフ	1,400	421.00	589,400	
コーセーアールイー	300	710.00	213,000	
エー・ディー・ワークス	18,000	34.00	612,000	
日本商業開発	700	1,603.00	1,122,100	
プレサンスコーポレーション	1,700	1,388.00	2,359,600	
ユニゾホールディングス	1,600	2,092.00	3,347,200	
THEグローバル社	500	489.00	244,500	
日本管理センター	700	781.00	546,700	
サンセイランディック	300	717.00	215,100	
エストラスト	100	709.00	70,900	
フージャースホールディングス	2,400	677.00	1,624,800	
オープンハウス	1,700	3,825.00	6,502,500	
東急不動産ホールディングス	28,800	653.00	18,806,400	
飯田グループホールディングス	8,900	2,011.00	17,897,900	
イーランド	100	716.00	71,600	
ムゲンエステート	700	600.00	420,000	
ビーロッド	200	1,441.00	288,200	
ファーストブラザーズ	300	1,068.00	320,400	
ハウスドゥ	600	1,384.00	830,400	
シーアールイー	300	955.00	286,500	
プロパティエージェント	100	1,152.00	115,200	
ケイアイスター不動産	300	1,723.00	516,900	
アグレ都市デザイン	100	564.00	56,400	
グッドコムアセット	200	1,521.00	304,200	
ジェイ・エス・ビー	100	3,800.00	380,000	
テンポイノベーション	100	1,530.00	153,000	

グローバル・リンク・マネジメント	100	681.00	68,100	
パーク24	6,300	2,426.00	15,283,800	
バラカ	300	1,946.00	583,800	
三井不動産	56,800	2,770.50	157,364,400	
三菱地所	75,000	1,993.50	149,512,500	
平和不動産	2,000	2,142.00	4,284,000	
東京建物	11,700	1,328.00	15,537,600	
ダイビル	3,100	1,041.00	3,227,100	
京阪神ビルディング	1,900	1,023.00	1,943,700	
住友不動産	24,100	4,654.00	112,161,400	
テーオーシー	2,400	763.00	1,831,200	
東京楽天地	200	4,810.00	962,000	
レオパレス21	13,200	236.00	3,115,200	
スターツコーポレーション	1,400	2,328.00	3,259,200	
フジ住宅	1,400	821.00	1,149,400	
空港施設	1,200	549.00	658,800	
明和地所	600	637.00	382,200	
ゴールドクレスト	800	1,530.00	1,224,000	
日本エスリード	400	1,708.00	683,200	
日神不動産	1,600	462.00	739,200	
日本エスコン	1,900	724.00	1,375,600	
タカラレーベン	5,000	368.00	1,840,000	
サンヨーハウジング名古屋	600	903.00	541,800	
イオンモール	5,400	1,784.00	9,633,600	
毎日コムネット	200	755.00	151,000	
ファースト住建	400	1,198.00	479,200	
ランド	43,800	8.00	350,400	
カチタス	1,200	3,505.00	4,206,000	
トーセイ	1,500	1,005.00	1,507,500	
穴吹興産	100	2,865.00	286,500	
サンフロンティア不動産	1,500	1,175.00	1,762,500	
エフ・ジェー・ネクスト	900	891.00	801,900	
インテリックス	300	681.00	204,300	
ランドビジネス	500	788.00	394,000	
グランディハウス	900	471.00	423,900	
日本空港ビルディング	3,400	4,725.00	16,065,000	

日本工営	700	2,295.00	1,606,500	
L I F U L L	4,100	558.00	2,287,800	
ジェイエイシーリクルートメント	800	2,285.00	1,828,000	
日本M&Aセンター	7,700	3,025.00	23,292,500	
メンバーズ	300	1,793.00	537,900	
中広	100	558.00	55,800	
タケエイ	1,100	729.00	801,900	
E・Jホールディングス	100	1,077.00	107,700	
トラスト・テック	600	3,535.00	2,121,000	
コシダカホールディングス	2,800	1,603.00	4,488,400	
アルトナー	200	869.00	173,800	
パソナグループ	1,300	1,494.00	1,942,200	
C D S	300	1,181.00	354,300	
リンクアンドモチベーション	2,000	780.00	1,560,000	
G C A	1,000	807.00	807,000	
エス・エム・エス	3,800	1,881.00	7,147,800	
サニーサイドアップ	100	1,799.00	179,900	
パーソルホールディングス	10,400	1,781.00	18,522,400	
リニカル	600	1,394.00	836,400	
クックパッド	3,400	269.00	914,600	
エスクリ	300	647.00	194,100	
アイ・ケイ・ケイ	500	795.00	397,500	
学情	400	1,231.00	492,400	
スタジオアリス	500	2,241.00	1,120,500	
シミックホールディングス	600	1,566.00	939,600	
N J S	200	1,418.00	283,600	
総合警備保障	4,100	4,640.00	19,024,000	
カカクコム	7,800	1,989.00	15,514,200	
アイロムグループ	400	1,459.00	583,600	
セントケア・ホールディング	600	545.00	327,000	
サイネックス	200	725.00	145,000	
ルネサンス	600	2,049.00	1,229,400	
ディップ	1,700	1,828.00	3,107,600	
オプトホールディング	600	1,707.00	1,024,200	
新日本科学	1,400	829.00	1,160,600	
ツクイ	2,500	718.00	1,795,000	

キャリアデザインセンター	300	1,271.00	381,300
ベネフィット・ワン	2,900	1,954.00	5,666,600
エムスリー	21,800	1,770.00	38,586,000
ツカダ・グローバルホールディング	700	597.00	417,900
プラス	100	592.00	59,200
アウトソーシング	5,400	1,319.00	7,122,600
ウェルネット	1,000	1,055.00	1,055,000
ワールドホールディングス	300	1,793.00	537,900
ディー・エヌ・エー	5,600	1,697.00	9,503,200
博報堂D Yホールディングス	14,400	1,738.00	25,027,200
ぐるなび	1,500	710.00	1,065,000
エスアールジータカミヤ	1,100	660.00	726,000
ジャパンベストレスキューシステム	800	1,576.00	1,260,800
ファンコミュニケーションズ	2,900	569.00	1,650,100
ライク	400	910.00	364,000
ビジネス・ブレークスルー	400	398.00	159,200
W D Bホールディングス	500	3,020.00	1,510,000
ティア	500	659.00	329,500
C D G	100	1,292.00	129,200
バリューコマース	700	2,228.00	1,559,600
インフォマート	5,600	1,305.00	7,308,000
J Pホールディングス	3,200	290.00	928,000
エコナックホールディングス	1,900	121.00	229,900
E P Sホールディングス	1,600	1,824.00	2,918,400
レグス	300	855.00	256,500
プレステージ・インターナショナル	1,900	1,281.00	2,433,900
アミューズ	600	2,444.00	1,466,400
ドリームインキュベータ	300	1,592.00	477,600
クイック	600	1,776.00	1,065,600
T A C	600	222.00	133,200
ケネディクス	9,100	554.00	5,041,400
電通	12,600	4,575.00	57,645,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	1,414.00	565,600
ぴあ	300	4,525.00	1,357,500
イオンファンタジー	300	2,781.00	834,300
シーティーエス	1,200	619.00	742,800

ネクシィーズグループ	300	2,194.00	658,200	
みらかホールディングス	2,900	2,780.00	8,062,000	
アルプス技研	900	1,781.00	1,602,900	
サニックス	2,300	235.00	540,500	
ダイオーズ	200	1,391.00	278,200	
日本空調サービス	1,200	681.00	817,200	
オリエンタルランド	12,300	12,300.00	151,290,000	
ダスキン	2,800	2,611.00	7,310,800	
明光ネットワークジャパン	1,300	957.00	1,244,100	
ファルコホールディングス	600	1,376.00	825,600	
秀英予備校	200	499.00	99,800	
田谷	200	650.00	130,000	
ラウンドワン	3,200	1,389.00	4,444,800	
リゾートトラスト	4,400	1,526.00	6,714,400	
ビー・エム・エル	1,300	3,175.00	4,127,500	
ワタベウェディング	200	644.00	128,800	
りらいあコミュニケーションズ	1,900	975.00	1,852,500	
リソー教育	5,200	485.00	2,522,000	
早稲田アカデミー	100	1,421.00	142,100	
ユー・エス・エス	12,700	1,988.00	25,247,600	
東京個別指導学院	400	1,069.00	427,600	
サイバーエージェント	6,400	4,175.00	26,720,000	
楽天	48,300	1,033.00	49,893,900	
クリーク・アンド・リバー社	600	1,108.00	664,800	
テー・オー・ダブリュー	900	708.00	637,200	
セントラルスポーツ	400	3,380.00	1,352,000	
フルキャストホールディングス	1,000	2,277.00	2,277,000	
エン・ジャパン	1,100	3,055.00	3,360,500	
リソルホールディングス	100	4,400.00	440,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,100	6,510.00	13,671,000	
アトラ	200	366.00	73,200	
インターワークス	200	758.00	151,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	300	1,715.00	514,500	
Keeper 技研	400	1,184.00	473,600	
ファーストロジック	200	601.00	120,200	
三機サービス	200	1,353.00	270,600	

G u n o s y	700	2,275.00	1,592,500	
デザインワン・ジャパン	200	300.00	60,000	
イー・ガーディアン	500	2,101.00	1,050,500	
リブセンス	600	263.00	157,800	
ジャパンマテリアル	2,800	1,254.00	3,511,200	
ベクトル	1,300	1,355.00	1,761,500	
ウチヤマホールディングス	500	458.00	229,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	200	1,427.00	285,400	
ライクキッズネクスト	200	856.00	171,200	
キャリアリンク	400	398.00	159,200	
I B J	700	913.00	639,100	
アサンテ	400	2,226.00	890,400	
N・フィールド	700	735.00	514,500	
バリューHR	200	2,430.00	486,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	300	5,060.00	1,518,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	400	1,219.00	487,600	
E R Iホールディングス	300	844.00	253,200	
アビスト	200	3,330.00	666,000	
シグマクシス	500	1,010.00	505,000	
ウィルグループ	700	1,295.00	906,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,500	242.00	363,000	
日本ビューホテル	300	1,126.00	337,800	
リクルートホールディングス	74,300	3,015.00	224,014,500	
エラン	700	1,301.00	910,700	
土木管理総合試験所	400	482.00	192,800	
日本郵政	85,000	1,309.00	111,265,000	
ベルシステム24ホールディングス	1,700	1,407.00	2,391,900	
鎌倉新書	800	1,375.00	1,100,000	
一蔵	100	575.00	57,500	
L I T A L I C O	200	1,810.00	362,000	
グローバルグループ	100	984.00	98,400	
エボラブルアジア	300	2,370.00	711,000	
アトラエ	200	3,680.00	736,000	
ストライク	300	2,268.00	680,400	
ソラスト	2,500	1,231.00	3,077,500	
セラク	200	539.00	107,800	

インソース	300	2,416.00	724,800	
バイカレント・コンサルティング	500	3,510.00	1,755,000	
Orchestra Holdings	100	842.00	84,200	
アイモバイル	200	996.00	199,200	
キャリアインデックス	400	876.00	350,400	
MS - Japan	400	1,580.00	632,000	
船場	200	954.00	190,800	
グレイステクノロジー	300	2,077.00	623,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	600	2,364.00	1,418,400	
フルテック	100	1,147.00	114,700	
グリーンズ	300	1,412.00	423,600	
ツナグ・ソリューションズ	100	686.00	68,600	
日総工産	300	2,365.00	709,500	
キュービーネットホールディングス	500	2,001.00	1,000,500	
スプリックス	300	2,582.00	774,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	859.00	343,600	
リログループ	5,700	3,015.00	17,185,500	
東祥	600	3,165.00	1,899,000	
エイチ・アイ・エス	1,900	3,980.00	7,562,000	
ラックランド	200	2,011.00	402,200	
共立メンテナンス	1,600	5,700.00	9,120,000	
イチネンホールディングス	1,100	1,183.00	1,301,300	
建設技術研究所	700	1,460.00	1,022,000	
スペース	700	1,363.00	954,100	
長大	400	711.00	284,400	
燦ホールディングス	200	2,471.00	494,200	
スバル興業	100	5,660.00	566,000	
東京テアトル	400	1,340.00	536,000	
タナベ経営	200	1,260.00	252,000	
ナガワ	300	6,050.00	1,815,000	
よみうりランド	200	4,465.00	893,000	
東京都競馬	700	3,385.00	2,369,500	
常磐興産	400	1,688.00	675,200	
カナモト	1,600	2,575.00	4,120,000	
東京ドーム	3,900	1,072.00	4,180,800	

西尾レントオール	1,100	3,150.00	3,465,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	9,300	33.00	306,900	
トランス・コスモス	1,100	2,195.00	2,414,500	
乃村工藝社	2,400	2,973.00	7,135,200	
藤田観光	400	2,692.00	1,076,800	
KNT - CTホールディングス	500	1,371.00	685,500	
日本管財	1,100	1,927.00	2,119,700	
トーカイ	1,000	2,691.00	2,691,000	
白洋舎	100	2,893.00	289,300	
セコム	11,000	9,337.00	102,707,000	
セントラル警備保障	500	4,640.00	2,320,000	
丹青社	1,900	1,271.00	2,414,900	
メイテック	1,300	4,845.00	6,298,500	
応用地質	1,100	1,096.00	1,205,600	
船井総研ホールディングス	2,100	2,600.00	5,460,000	
進学会ホールディングス	500	565.00	282,500	
オオバ	800	598.00	478,400	
いであ	200	989.00	197,800	
学究社	300	1,357.00	407,100	
ベネッセホールディングス	3,800	2,873.00	10,917,400	
イオンディライト	1,300	4,055.00	5,271,500	
ナック	700	1,091.00	763,700	
ニチイ学館	1,500	1,291.00	1,936,500	
ダイセキ	1,700	2,623.00	4,459,100	
ステップ	400	1,441.00	576,400	
合 計	12,649,000		24,588,277,590	

(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 3月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	1,147,732,956
コール・ローン	208,757,910
株式	18,599,767,365
投資証券	503,993,380
派生商品評価勘定	8,682,146
未収入金	847,774,286
未収配当金	40,590,800
差入委託証拠金	267,771,078
流動資産合計	21,625,069,921
資産合計	
21,625,069,921	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,691,671
未払解約金	1,004,550,000
未払利息	566
流動負債合計	1,006,242,237
負債合計	
1,006,242,237	
純資産の部	
元本等	
元本	16,899,742,836
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,719,084,848
元本等合計	20,618,827,684
純資産合計	
20,618,827,684	
負債純資産合計	
21,625,069,921	

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	8,527,780,611円
期中追加設定元本額	15,214,204,862円
期中一部解約元本額	6,842,242,637円
期末元本額	16,899,742,836円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	816,266,146円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	263,279,220円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,923,178,972円
DCりそな グローバルバランス	8,983,574円
つみたてバランスファンド	351,124,697円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	132,985,344円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	47,896,217円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	32,047,772円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	10,728,310,116円
Smart-i 先進国株式インデックス	632,099,556円
Smart-i 8資産バランス 安定型	9,881,646円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	43,990,855円

Smart-i 8資産バランス 成長型	67,712,740円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	755,181,900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）	2,874,525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）	83,929,556円
2. 計算日における受益権の総数	16,899,742,836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	1.2201円
(10,000口当たり純資産額)	(12,201円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p>
2.時価の算定方法	<p>株式、投資証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引</p> <p>（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		993,796,953
投資証券		39,449,489
合計		1,033,246,442

(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 3月25日現在)

(単位 : 円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,503,992,812	-	1,511,299,832	7,307,020
	合計	1,503,992,812	-	1,511,299,832	7,307,020

(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 3月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	39,032,235	-	38,715,690	316,545
	米ドル	29,898,612	-	29,670,300	228,312
	カナダドル	1,656,856	-	1,635,800	21,056
	ユーロ	3,401,757	-	3,350,430	51,327
	英ポンド	4,075,010	-	4,059,160	15,850
	合計	39,032,235	-	38,715,690	316,545

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	2,551	43.23	110,279.73	
	APACHE CORP	1,606	34.82	55,920.92	
	BAKER HUGHES A GE CO	2,628	27.16	71,376.48	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,262	25.96	58,721.52	
	CHENIERE ENERGY INC	885	67.60	59,826.00	
	CHEVRON CORP	9,221	123.09	1,135,012.89	
	CIMAREX ENERGY CO	530	67.90	35,987.00	
	CONCHO RESOURCES INC	997	104.51	104,196.47	
	CONOCOPHILLIPS	5,551	66.07	366,754.57	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	42.38	16,146.78	
	DEVON ENERGY CORP	2,137	30.34	64,836.58	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	649	101.37	65,789.13	
	EOG RESOURCES INC	2,786	93.68	260,992.48	
	EXXON MOBIL CORP	20,394	80.48	1,641,309.12	
	HALLIBURTON CO	4,360	28.73	125,262.80	
	HELMERICH & PAYNE	441	54.48	24,025.68	
	HESS CORP	1,131	58.75	66,446.25	
	HOLLYFRONTIER CORP	873	50.61	44,182.53	
	KINDER MORGAN INC	9,720	19.90	193,428.00	
	MARATHON OIL CORP	3,583	16.68	59,764.44	
	MARATHON PETROLEUM CORP	3,348	61.30	205,232.40	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,607	26.63	42,794.41	
	NOBLE ENERGY INC	2,029	23.97	48,635.13	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,692	65.24	240,866.08	
	ONEOK INC	2,045	69.01	141,125.45	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	640	18.26	11,686.40	
	PHILLIPS 66	2,144	95.98	205,781.12	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	849	140.56	119,335.44	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	200	24.55	4,910.00	
	SCHLUMBERGER LTD	6,655	42.47	282,637.85	
TARGA RESOURCES CORP	947	40.73	38,571.31		
TECHNIPFMC PLC	1,813	22.66	41,082.58		
VALERO ENERGY CORP	2,094	84.63	177,215.22		

WILLIAMS COS INC	5,954	28.47	169,510.38
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,084	186.30	201,949.20
ALBEMARLE CORP	669	82.72	55,339.68
AVERY DENNISON CORP	466	108.99	50,789.34
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	486	24.88	12,091.68
BALL CORP	1,367	57.94	79,203.98
CELANESE CORP	568	98.14	55,743.52
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	983	39.01	38,346.83
CHEMOURS CO/THE	1,010	38.30	38,683.00
CROWN HOLDINGS INC	569	54.05	30,754.45
DOWDUPONT INC	10,963	53.92	591,124.96
EASTMAN CHEMICAL CO	753	75.14	56,580.42
ECOLAB INC	1,276	173.38	221,232.88
FMC CORP	567	74.98	42,513.66
FREEPORT-MCMORAN INC	5,755	12.18	70,095.90
INTERNATIONAL PAPER CO	1,618	44.40	71,839.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	359	124.69	44,763.71
LINDE PLC	2,635	169.86	447,581.10
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,654	85.07	140,705.78
MARTIN MARIETTA MATERIALS	265	192.11	50,909.15
MOSAIC CO/THE	1,542	26.85	41,402.70
NEWMONT MINING CORP	2,744	34.50	94,668.00
NUCOR CORP	1,614	57.00	91,998.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	504	95.13	47,945.52
PPG INDUSTRIES INC	1,221	106.69	130,268.49
SEALED AIR CORP	504	45.04	22,700.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	417	420.72	175,440.24
STEEL DYNAMICS INC	1,252	33.97	42,530.44
VULCAN MATERIALS CO	705	113.45	79,982.25
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	66.08	10,837.12
WESTROCK CO	1,074	36.75	39,469.50
3M CO	2,796	204.66	572,229.36
ACUITY BRANDS INC	165	118.95	19,626.75
AERCAP HOLDINGS NV	312	44.90	14,008.80
ALLEGION PLC	510	87.22	44,482.20

AMETEK INC	1,205	79.41	95,689.05
ARCONIC INC	1,855	18.72	34,725.60
BOEING CO/THE	2,582	362.17	935,122.94
CATERPILLAR INC	2,854	129.77	370,363.58
CUMMINS INC	794	155.63	123,570.22
DEERE & CO	1,491	155.94	232,506.54
DOVER CORP	630	90.30	56,889.00
EATON CORP PLC	2,163	79.02	170,920.26
EMERSON ELECTRIC CO	3,095	66.86	206,931.70
FASTENAL CO	1,492	61.70	92,056.40
FLOWSERVE CORP	456	43.51	19,840.56
FLUOR CORP	326	35.59	11,602.34
FORTIVE CORP	1,540	82.23	126,634.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	586	45.01	26,375.86
GENERAL DYNAMICS CORP	1,237	165.85	205,156.45
GENERAL ELECTRIC CO	41,767	9.98	416,834.66
HARRIS CORP	609	159.28	97,001.52
HD SUPPLY HOLDINGS INC	708	41.71	29,530.68
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,545	155.83	552,417.35
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	233	203.13	47,329.29
IDEX CORP	327	147.93	48,373.11
ILLINOIS TOOL WORKS	1,485	141.65	210,350.25
INGERSOLL-RAND PLC	1,248	104.23	130,079.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	686	73.07	50,126.02
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,000	64.15	64,150.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	1,100	37.86	41,646.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	4,627	36.13	167,173.51
L3 TECHNOLOGIES INC	334	205.30	68,570.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	195	257.13	50,140.35
LOCKHEED MARTIN CORP	1,234	294.01	362,808.34
MASCO CORP	1,312	38.25	50,184.00
MIDDLEBY CORP	299	126.05	37,688.95
NORTHROP GRUMMAN CORP	811	268.36	217,639.96
OWENS CORNING	260	46.28	12,032.80
PACCAR INC	1,799	67.03	120,586.97

PARKER HANNIFIN CORP	681	163.39	111,268.59
PENTAIR PLC	504	42.26	21,299.04
RAYTHEON COMPANY	1,394	179.99	250,906.06
ROCKWELL AUTOMATION INC	619	169.93	105,186.67
ROPER TECHNOLOGIES INC	519	329.47	170,994.93
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	912	45.70	41,678.40
SMITH (A.O.) CORP	762	51.74	39,425.88
SNAP-ON INC	241	149.96	36,140.36
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	572	89.40	51,136.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	789	130.90	103,280.10
TEXTRON INC	1,060	49.97	52,968.20
TRANSDIGM GROUP INC	244	444.71	108,509.24
UNITED RENTALS INC	353	110.96	39,168.88
UNITED TECHNOLOGIES CORP	3,918	125.15	490,337.70
WABCO HOLDINGS INC	276	143.36	39,567.36
WABTEC CORP	944	70.05	66,127.20
WW GRAINGER INC	204	292.51	59,672.04
XYLEM INC	767	77.06	59,105.02
CINTAS CORP	508	194.55	98,831.40
COPART INC	910	59.25	53,917.50
COSTAR GROUP INC	158	465.08	73,482.64
EQUIFAX INC	524	112.88	59,149.12
IHS MARKIT LTD	2,053	54.54	111,970.62
MANPOWERGROUP INC	288	80.75	23,256.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	1,233	26.86	33,118.38
REPUBLIC SERVICES INC	975	78.90	76,927.50
ROBERT HALF INTL INC	673	63.73	42,890.29
ROLLINS INC	337	40.38	13,608.06
TRANSUNION	804	65.41	52,589.64
VERISK ANALYTICS INC	831	128.89	107,107.59
WASTE CONNECTIONS INC	1,374	85.34	117,257.16
WASTE MANAGEMENT INC	2,125	101.90	216,537.50
AMERCO	6	359.00	2,154.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	30.57	6,052.86
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	608	84.68	51,485.44

CSX CORP	3,957	72.51	286,922.07
DELTA AIR LINES INC	759	49.76	37,767.84
EXPEDITORS INTL WASH INC	765	74.12	56,701.80
FEDEX CORP	1,229	173.99	213,833.71
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	384	97.54	37,455.36
KANSAS CITY SOUTHERN	449	112.46	50,494.54
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	250	31.37	7,842.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,366	177.94	243,066.04
OLD DOMINION FREIGHT LINE	328	142.72	46,812.16
SOUTHWEST AIRLINES CO	380	49.32	18,741.60
UNION PACIFIC CORP	3,521	160.62	565,543.02
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	364	79.63	28,985.32
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,338	107.35	358,334.30
XPO LOGISTICS INC	557	49.46	27,549.22
APTIV PLC	1,375	77.61	106,713.75
AUTOLIV INC	349	73.93	25,801.57
BORGWARNER INC	1,123	36.24	40,697.52
FORD MOTOR CO	18,481	8.54	157,827.74
GENERAL MOTORS CO	6,196	36.44	225,782.24
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	537	17.40	9,343.80
HARLEY-DAVIDSON INC	382	33.84	12,926.88
LEAR CORP	352	132.12	46,506.24
TESLA INC	626	264.53	165,595.78
CAPRI HOLDINGS LTD	819	43.70	35,790.30
DR HORTON INC	1,583	40.93	64,792.19
GARMIN LTD	502	83.58	41,957.16
HANESBRANDS INC	1,521	16.92	25,735.32
HASBRO INC	534	83.51	44,594.34
LEGGETT & PLATT INC	366	40.77	14,921.82
LENNAR CORP-A	1,293	47.84	61,857.12
LULULEMON ATHLETICA INC	440	143.21	63,012.40
MATTEL INC	1,378	13.21	18,203.38
MOHAWK INDUSTRIES INC	281	124.86	35,085.66
NEWELL RUBBERMAID INC	2,593	15.00	38,895.00
NIKE INC -CL B	6,136	82.19	504,317.84

NVR INC	15	2,780.91	41,713.65
POLARIS INDUSTRIES INC	141	79.58	11,220.78
PULTEGROUP INC	1,087	26.58	28,892.46
PVH CORP	342	107.21	36,665.82
RALPH LAUREN CORP	168	120.23	20,198.64
TAPESTRY INC	1,276	30.93	39,466.68
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	20.72	8,474.48
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,055	18.41	19,422.55
VF CORP	1,730	83.72	144,835.60
WHIRLPOOL CORP	201	129.04	25,937.04
ARAMARK	1,317	28.91	38,074.47
CARNIVAL CORP	2,158	56.42	121,754.36
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	147	671.46	98,704.62
DARDEN RESTAURANTS INC	531	117.44	62,360.64
DOMINO'S PIZZA INC	170	239.25	40,672.50
H&R BLOCK INC	571	24.13	13,778.23
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,451	84.57	122,711.07
LAS VEGAS SANDS CORP	2,004	59.57	119,378.28
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,463	124.50	182,143.50
MCDONALD'S CORP	3,682	186.81	687,834.42
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	21.62	23,782.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,180	26.09	56,876.20
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	941	55.62	52,338.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	886	115.58	102,403.88
STARBUCKS CORP	6,107	71.96	439,459.72
VAIL RESORTS INC	173	211.79	36,639.67
WYNN RESORTS LTD	419	116.91	48,985.29
YUM! BRANDS INC	1,586	98.97	156,966.42
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,586	46.87	168,075.82
ALPHABET INC-CL A	1,443	1,207.65	1,742,638.95
ALPHABET INC-CL C	1,518	1,205.50	1,829,949.00
ALTICE USA INC- A	1,779	21.37	38,017.23
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	1,468	45.06	66,148.08
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	791	360.78	285,376.98
COMCAST CORP-CLASS A	21,661	39.46	854,743.06

DISCOVERY INC - A	622	26.67	16,588.74
DISCOVERY INC-C	1,636	25.45	41,636.20
DISH NETWORK CORP-A	1,248	31.27	39,024.96
ELECTRONIC ARTS INC	1,529	102.34	156,477.86
FACEBOOK INC-A	11,583	164.34	1,903,550.22
FOX CORP - CLASS A	1,707	38.72	66,095.04
FOX CORP- CLASS B	764	37.46	28,619.44
IAC/INTERACTIVECORP	339	219.57	74,434.23
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,689	21.13	35,688.57
LIBERTY BROADBAND-C	470	92.81	43,620.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	356	26.03	9,266.68
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	2,308	25.36	58,530.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,085	34.14	37,041.90
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	933	39.02	36,405.66
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	206	38.82	7,996.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	644	62.95	40,539.80
NETFLIX INC	2,118	361.01	764,619.18
NEWS CORP - CLASS A	910	12.63	11,493.30
OMNICOM GROUP	1,199	73.07	87,610.93
SIRIUS XM HOLDINGS INC	8,406	5.76	48,418.56
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	501	96.02	48,106.02
TRIPADVISOR INC	467	50.75	23,700.25
TWITTER INC	3,589	33.02	118,508.78
VIACOM INC-CLASS B	1,555	25.34	39,403.70
WALT DISNEY CO/THE	8,640	108.23	935,107.20
ZILLOW GROUP INC - C	458	35.71	16,355.18
ADVANCE AUTO PARTS INC	317	164.84	52,254.28
AMAZON.COM INC	1,999	1,764.77	3,527,775.23
AUTOZONE INC	135	981.27	132,471.45
BEST BUY CO INC	1,071	70.11	75,087.81
BOOKING HOLDINGS INC	228	1,721.59	392,522.52
BURLINGTON STORES INC	360	145.99	52,556.40
CARMAX INC	755	61.63	46,530.65
DOLLAR GENERAL CORP	1,323	117.47	155,412.81
DOLLAR TREE INC	1,207	101.43	122,426.01

EBAY INC	4,692	36.65	171,961.80
EXPEDIA GROUP INC	524	121.64	63,739.36
GAP INC/THE	696	24.52	17,065.92
GENUINE PARTS CO	625	107.48	67,175.00
GRUBHUB INC	288	68.59	19,753.92
HOME DEPOT INC	5,407	188.75	1,020,571.25
KOHL'S CORP	714	67.03	47,859.42
L BRANDS INC	683	26.67	18,215.61
LKQ CORP	1,698	28.36	48,155.28
LOWE'S COS INC	3,891	104.95	408,360.45
MACY'S INC	1,638	23.31	38,181.78
MERCADOLIBRE INC	179	497.37	89,029.23
NORDSTROM INC	281	42.93	12,063.33
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	403	376.30	151,648.90
QURATE RETAIL INC	1,842	17.02	31,350.84
ROSS STORES INC	1,861	89.53	166,615.33
TARGET CORP	2,472	78.32	193,607.04
TIFFANY & CO	471	103.21	48,611.91
TJX COMPANIES INC	6,001	52.34	314,092.34
TRACTOR SUPPLY COMPANY	521	92.68	48,286.28
ULTA BEAUTY INC	298	330.52	98,494.96
WAYFAIR INC- CLASS A	341	158.50	54,048.50
COSTCO WHOLESALE CORP	2,086	237.56	495,550.16
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	7.91	791.00
KROGER CO	4,003	24.34	97,433.02
SYSCO CORP	2,423	65.56	158,851.88
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	4,047	62.41	252,573.27
WALMART INC	6,980	98.28	685,994.40
ALTRIA GROUP INC	8,975	55.92	501,882.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,785	42.62	118,696.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,119	51.74	57,897.06
BUNGE LTD	734	51.70	37,947.80
CAMPBELL SOUP CO	939	38.24	35,907.36
COCA-COLA CO/THE	19,695	45.93	904,591.35
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	756	49.42	37,361.52

CONAGRA BRANDS INC	2,528	26.45	66,865.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	830	169.53	140,709.90
GENERAL MILLS INC	2,961	50.74	150,241.14
HERSHEY CO/THE	593	112.00	66,416.00
HORMEL FOODS CORP	1,231	43.59	53,659.29
INGREDION INC	294	94.01	27,638.94
JM SMUCKER CO/THE	480	114.30	54,864.00
KELLOGG CO	1,091	56.74	61,903.34
KRAFT HEINZ CO/THE	3,006	32.29	97,063.74
LAMB WESTON HOLDINGS INC	762	71.66	54,604.92
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	656	142.37	93,394.72
MOLSON COORS BREWING CO -B	798	59.45	47,441.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	7,032	49.13	345,482.16
MONSTER BEVERAGE CORP	2,070	53.51	110,765.70
PEPSICO INC	6,887	120.72	831,398.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	7,379	91.17	672,743.43
TYSON FOODS INC-CL A	1,635	66.61	108,907.35
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,230	67.10	82,533.00
CLOROX COMPANY	518	158.13	81,911.34
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,947	66.00	260,502.00
COTY INC-CL A	2,506	11.22	28,117.32
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,093	159.50	174,333.50
KIMBERLY-CLARK CORP	1,674	122.05	204,311.70
PROCTER & GAMBLE CO/THE	12,001	101.66	1,220,021.66
ABBOTT LABORATORIES	8,317	77.97	648,476.49
ABIOMED INC	178	323.21	57,531.38
ALIGN TECHNOLOGY INC	389	269.62	104,882.18
AMERISOURCEBERGEN CORP	678	78.77	53,406.06
ANTHEM INC	1,245	301.51	375,379.95
BAXTER INTERNATIONAL INC	2,484	77.24	191,864.16
BECTON DICKINSON AND CO	1,284	240.12	308,314.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	6,673	37.30	248,902.90
CARDINAL HEALTH INC	1,286	48.64	62,551.04
CENTENE CORP	2,038	57.14	116,451.32
CERNER CORP	1,229	56.96	70,003.84

CIGNA CORP	1,817	166.09	301,785.53
COOPER COS INC/THE	205	291.76	59,810.80
CVS HEALTH CORP	6,165	56.04	345,486.60
DANAHER CORP	3,018	129.69	391,404.42
DAVITA INC	412	54.05	22,268.60
DENTSPLY SIRONA INC	928	49.24	45,694.72
DEXCOM INC	461	129.03	59,482.83
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,025	188.99	193,714.75
HCA HEALTHCARE INC	1,352	134.44	181,762.88
HENRY SCHEIN INC	799	59.80	47,780.20
HOLOGIC INC	1,514	46.85	70,930.90
HUMANA INC	670	272.60	182,642.00
IDEXX LABORATORIES INC	444	219.43	97,426.92
INTUITIVE SURGICAL INC	547	561.26	307,009.22
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	426	154.32	65,740.32
MCKESSON CORP	995	118.54	117,947.30
MEDTRONIC PLC	6,408	90.39	579,219.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	571	89.24	50,956.04
RESMED INC	591	100.14	59,182.74
STRYKER CORP	1,621	194.44	315,187.24
TELEFLEX INC	191	301.69	57,622.79
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,664	247.09	1,152,427.76
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	449	135.31	60,754.19
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	478	138.59	66,246.02
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	704	123.12	86,676.48
WELLCARE HEALTH PLANS INC	261	241.84	63,120.24
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,023	126.68	129,593.64
ABBVIE INC	7,145	79.76	569,885.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,634	78.99	129,069.66
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,086	130.21	141,408.06
ALKERMES PLC	613	33.96	20,817.48
ALLERGAN PLC	1,620	149.30	241,866.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	358	84.52	30,258.16
AMGEN INC	3,054	186.70	570,181.80
BEIGENE LTD-ADR	100	124.46	12,446.00

BIOGEN INC	957	216.71	207,391.47
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	943	88.05	83,031.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	7,735	48.16	372,517.60
CELGENE CORP	3,347	88.15	295,038.05
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	1,402	32.72	45,873.44
ELI LILLY & CO	4,345	128.30	557,463.50
GILEAD SCIENCES INC	6,138	63.77	391,420.26
ILLUMINA INC	704	308.79	217,388.16
INCYTE CORP	963	85.34	82,182.42
IQVIA HOLDINGS INC	826	141.65	117,002.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	304	136.60	41,526.40
JOHNSON & JOHNSON	12,947	136.91	1,772,573.77
MERCK & CO. INC.	12,515	82.29	1,029,859.35
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	132	702.07	92,673.24
MYLAN NV	2,742	28.69	78,667.98
NEKTAR THERAPEUTICS	868	32.17	27,923.56
PERRIGO CO PLC	394	47.25	18,616.50
PFIZER INC	27,556	41.85	1,153,218.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	384	391.80	150,451.20
SEATTLE GENETICS INC	559	73.99	41,360.41
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	5,249	16.33	85,716.17
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,906	263.81	502,821.86
UNITED THERAPEUTICS CORP	172	120.80	20,777.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,222	181.53	221,829.66
WATERS CORP	385	245.37	94,467.45
ZOETIS INC	2,312	97.93	226,414.16
BANK OF AMERICA CORP	44,639	27.01	1,205,699.39
BB&T CORP	3,749	45.09	169,042.41
CIT GROUP INC	280	46.12	12,913.60
CITIGROUP INC	11,875	60.98	724,137.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2,420	31.77	76,883.40
COMERICA INC	695	72.07	50,088.65
EAST WEST BANCORP INC	760	46.63	35,438.80
FIFTH THIRD BANCORP	3,203	24.62	78,857.86
FIRST REPUBLIC BANK/CA	853	98.10	83,679.30

HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,477	12.25	54,843.25
JPMORGAN CHASE & CO	16,015	99.76	1,597,656.40
KEYCORP	4,956	14.97	74,191.32
M & T BANK CORP	551	153.79	84,738.29
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	1,365	15.89	21,689.85
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,221	119.18	264,698.78
REGIONS FINANCIAL CORP	4,461	13.53	60,357.33
SIGNATURE BANK	290	126.10	36,569.00
SUNTRUST BANKS INC	2,259	57.40	129,666.60
SVB FINANCIAL GROUP	216	212.19	45,833.04
US BANCORP	7,364	48.28	355,533.92
WELLS FARGO & CO	21,540	48.31	1,040,597.40
ZIONS BANCORPORATION	992	43.64	43,290.88
AFFILIATED MANAGERS GROUP	216	99.16	21,418.56
ALLY FINANCIAL INC	2,221	26.07	57,901.47
AMERICAN EXPRESS CO	3,507	109.46	383,876.22
AMERIPRISE FINANCIAL INC	593	124.13	73,609.09
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	743	19.72	14,651.96
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	4,841	50.50	244,470.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	6,244	200.55	1,252,234.20
BLACKROCK INC	580	417.36	242,068.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,337	80.00	186,960.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	471	95.44	44,952.24
CME GROUP INC	1,717	163.32	280,420.44
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,730	70.35	121,705.50
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,093	45.02	49,206.86
EATON VANCE CORP	362	39.76	14,393.12
FRANKLIN RESOURCES INC	1,664	32.10	53,414.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,623	188.96	306,682.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,792	72.76	203,145.92
INVESCO LTD	2,612	19.06	49,784.72
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	716	18.47	13,224.52
KKR & CO INC -A	2,700	23.66	63,882.00
MOODY'S CORP	860	177.89	152,985.40
MORGAN STANLEY	6,311	41.72	263,294.92

MSCI INC	374	191.86	71,755.64
NASDAQ INC	606	83.89	50,837.34
NORTHERN TRUST CORP	882	88.59	78,136.38
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	553	76.76	42,448.28
S&P GLOBAL INC	1,221	205.49	250,903.29
SCHWAB (CHARLES) CORP	5,871	41.80	245,407.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	534	50.36	26,892.24
STATE STREET CORP	1,891	65.00	122,915.00
SYNCHRONY FINANCIAL	2,926	31.83	93,134.58
T ROWE PRICE GROUP INC	1,224	98.76	120,882.24
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,191	49.70	59,192.70
VOYA FINANCIAL INC	845	48.32	40,830.40
AFLAC INC	3,751	49.46	185,524.46
ALLEGHANY CORP	63	613.68	38,661.84
ALLSTATE CORP	1,707	94.17	160,748.19
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	395	94.71	37,410.45
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	4,331	42.62	184,587.22
AON PLC	1,185	166.31	197,077.35
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,718	32.06	55,079.08
ARTHUR J GALLAGHER & CO	774	78.88	61,053.12
ASSURANT INC	206	94.56	19,479.36
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	570	41.13	23,444.10
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	560	35.54	19,902.40
CHUBB LTD	2,224	136.62	303,842.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	655	84.64	55,439.20
EVEREST RE GROUP LTD	173	214.99	37,193.27
FNF GROUP	1,165	36.53	42,557.45
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,507	48.53	73,134.71
LINCOLN NATIONAL CORP	919	57.68	53,007.92
LOEWS CORP	1,139	47.33	53,908.87
MARKEL CORP	72	984.51	70,884.72
MARSH & MCLENNAN COS	2,453	92.07	225,847.71
METLIFE INC	4,124	41.79	172,341.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,207	49.45	59,686.15
PROGRESSIVE CORP	2,847	72.78	207,204.66

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,034	89.96	182,978.64
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	270	141.80	38,286.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	157	143.31	22,499.67
TORCHMARK CORP	558	80.31	44,812.98
TRAVELERS COS INC/THE	1,313	134.90	177,123.70
UNUM GROUP	1,141	33.37	38,075.17
WILLIS TOWERS WATSON PLC	661	174.61	115,417.21
WR BERKLEY CORP	512	83.53	42,767.36
CBRE GROUP INC - A	1,394	48.25	67,260.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	7,400	7.25	53,650.00
JONES LANG LASALLE INC	240	148.20	35,568.00
ACCENTURE PLC-CL A	3,051	165.24	504,147.24
ADOBE INC	2,324	259.69	603,519.56
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	701	71.23	49,932.23
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	164.56	42,621.04
ANSYS INC	348	177.18	61,658.64
AUTODESK INC	1,079	154.22	166,403.38
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,108	153.81	324,231.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	481	100.37	48,277.97
CADENCE DESIGN SYS INC	1,169	61.76	72,197.44
CDK GLOBAL INC	509	56.23	28,621.07
CHECK POINT SOFTWARE TECH	740	125.43	92,818.20
CITRIX SYSTEMS INC	560	100.46	56,257.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	2,831	70.89	200,689.59
DXC TECHNOLOGY CO	1,455	64.34	93,614.70
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,612	110.41	177,980.92
FIRST DATA CORP- CLASS A	2,215	25.38	56,216.70
FISERV INC	1,997	85.58	170,903.26
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	463	237.46	109,943.98
FORTINET INC	594	85.19	50,602.86
GARTNER INC	375	145.91	54,716.25
GLOBAL PAYMENTS INC	806	134.00	108,004.00
GODADDY INC - CLASS A	684	74.99	51,293.16
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4,335	139.45	604,515.75
INTUIT INC	1,177	252.68	297,404.36

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	319	135.77	43,310.63
LEIDOS HOLDINGS INC	749	62.99	47,179.51
MASTERCARD INC-CLASS A	4,358	230.76	1,005,652.08
MICROSOFT CORP	35,039	117.05	4,101,314.95
ORACLE CORP	12,735	52.77	672,025.95
PALO ALTO NETWORKS INC	481	242.36	116,575.16
PAYCHEX INC	1,624	78.44	127,386.56
PAYPAL HOLDINGS INC	5,347	101.27	541,490.69
PTC INC	586	93.12	54,568.32
RED HAT INC	874	181.70	158,805.80
SABRE CORP	980	21.03	20,609.40
SALESFORCE.COM INC	3,716	161.50	600,134.00
SERVICENOW INC	873	241.21	210,576.33
SPLUNK INC	776	125.68	97,527.68
SQUARE INC - A	1,527	75.09	114,662.43
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	892	62.14	55,428.88
SYMANTEC CORP	2,569	22.86	58,727.34
SYNOPSYS INC	614	110.31	67,730.34
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	373	127.85	47,688.05
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	678	93.33	63,277.74
VERISIGN INC	556	181.67	101,008.52
VISA INC-CLASS A SHARES	8,373	153.07	1,281,655.11
VMWARE INC-CLASS A	430	183.70	78,991.00
WESTERN UNION CO	2,343	18.25	42,759.75
WIX.COM LTD	197	117.98	23,242.06
WORKDAY INC-CLASS A	730	191.08	139,488.40
WORLDPAY INC-CLASS A	1,507	110.39	166,357.73
AMPHENOL CORP-CL A	1,526	94.54	144,268.04
APPLE INC	22,798	191.05	4,355,557.90
ARISTA NETWORKS INC	224	300.16	67,235.84
ARROW ELECTRONICS INC	452	76.66	34,650.32
CDW CORP/DE	646	95.87	61,932.02
CISCO SYSTEMS INC	21,658	52.74	1,142,242.92
COGNEX CORP	928	50.10	46,492.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	750	21.24	15,930.00

CORNING INC	4,114	33.83	139,176.62
DELL TECHNOLOGIES -C	803	59.55	47,818.65
F5 NETWORKS INC	328	152.24	49,934.72
FLEX LTD	1,502	10.19	15,305.38
FLIR SYSTEMS INC	391	47.54	18,588.14
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	7,609	15.29	116,341.61
HP INC	7,870	19.34	152,205.80
IPG PHOTONICS CORP	85	144.77	12,305.45
JUNIPER NETWORKS INC	1,471	26.32	38,716.72
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	800	84.76	67,808.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	825	138.64	114,378.00
NETAPP INC	1,096	66.84	73,256.64
SEAGATE TECHNOLOGY	1,164	46.93	54,626.52
TE CONNECTIVITY LTD	1,757	81.69	143,529.33
TRIMBLE INC	1,348	39.43	53,151.64
WESTERN DIGITAL CORP	1,243	48.39	60,148.77
XEROX CORP	1,113	31.07	34,580.91
AT&T INC	35,109	31.07	1,090,836.63
CENTURYLINK INC	4,178	12.17	50,846.26
SPRINT CORP	4,378	6.25	27,362.50
T-MOBILE US INC	1,728	71.90	124,243.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	19,908	59.76	1,189,702.08
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	876	28.29	24,782.04
AES CORP	2,824	18.06	51,001.44
ALLIANT ENERGY CORP	998	47.55	47,454.90
AMEREN CORPORATION	1,031	73.75	76,036.25
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,414	85.14	205,527.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	762	106.78	81,366.36
ATMOS ENERGY CORP	586	102.81	60,246.66
CENTERPOINT ENERGY INC	2,092	30.72	64,266.24
CMS ENERGY CORP	1,206	55.64	67,101.84
CONSOLIDATED EDISON INC	1,562	84.91	132,629.42
DOMINION ENERGY INC	3,624	75.52	273,684.48
DTE ENERGY COMPANY	924	124.89	115,398.36
DUKE ENERGY CORP	3,429	90.70	311,010.30

EDISON INTERNATIONAL	1,665	64.69	107,708.85
ENERGY CORP	765	96.12	73,531.80
EVERGY INC	1,151	58.00	66,758.00
EVERSOURCE ENERGY	1,610	71.69	115,420.90
EXELON CORP	4,697	50.28	236,165.16
FIRSTENERGY CORP	2,607	41.77	108,894.39
NEXTERA ENERGY INC	2,254	193.93	437,118.22
NISOURCE INC	1,549	28.61	44,316.89
NRG ENERGY INC	1,599	42.49	67,941.51
OGE ENERGY CORP	654	43.11	28,193.94
PINNACLE WEST CAPITAL	478	96.72	46,232.16
PPL CORP	3,651	32.19	117,525.69
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	2,521	59.63	150,327.23
SEMPRA ENERGY	1,351	126.07	170,320.57
SOUTHERN CO/THE	4,919	51.88	255,197.72
UGI CORP	916	55.69	51,012.04
VISTRA ENERGY CORP	1,777	25.98	46,166.46
WEC ENERGY GROUP INC	1,592	79.33	126,293.36
XCEL ENERGY INC	2,544	57.07	145,186.08
ADVANCED MICRO DEVICES	4,756	26.37	125,415.72
ANALOG DEVICES INC	1,802	107.40	193,534.80
APPLIED MATERIALS INC	4,764	39.86	189,893.04
BROADCOM INC	2,042	292.65	597,591.30
INTEL CORP	21,699	53.26	1,155,688.74
KLA-TENCOR CORP	802	120.53	96,665.06
LAM RESEARCH CORP	777	179.45	139,432.65
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	2,516	19.71	49,590.36
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	1,126	54.21	61,040.46
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,189	85.42	101,564.38
MICRON TECHNOLOGY INC	5,590	41.62	232,655.80
NVIDIA CORP	2,741	177.50	486,527.50
NXP SEMICONDUCTORS NV	1,674	90.66	151,764.84
ON SEMICONDUCTOR CORP	1,652	21.64	35,749.28
QORVO INC	422	71.67	30,244.74
QUALCOMM INC	5,782	56.82	328,533.24

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	725	82.59	59,877.75	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	4,607	109.68	505,295.76	
	XILINX INC	1,244	126.89	157,851.16	
	米ドル 小計	1,435,593		114,676,671.49 (12,604,112,963)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	570	9.52	5,426.40	
	CAMECO CORP	2,464	15.85	39,054.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	6,092	37.02	225,525.84	
	CENOVUS ENERGY INC	6,181	11.77	72,750.37	
	ENBRIDGE INC	9,755	49.17	479,653.35	
	ENCANA CORP	8,507	9.43	80,221.01	
	HUSKY ENERGY INC	1,391	13.59	18,903.69	
	IMPERIAL OIL LTD	1,699	36.43	61,894.57	
	INTER PIPELINE LTD	1,871	21.78	40,750.38	
	KEYERA CORP	888	31.14	27,652.32	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,735	49.61	135,683.35	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	18.54	9,585.18	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	460	10.63	4,889.80	
	SUNCOR ENERGY INC	7,940	45.19	358,808.60	
	TOURMALINE OIL CORP	465	21.35	9,927.75	
	TRANSCANADA CORP	4,501	60.67	273,075.67	
	VERMILION ENERGY INC	590	33.60	19,824.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,078	59.47	64,108.66	
	BARRICK GOLD CORP	9,190	18.36	168,728.40	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	723	52.96	38,290.08	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	14.10	60,446.70	
	FRANCO-NEVADA CORP	827	101.94	84,304.38	
	GOLDCORP INC	4,072	14.51	59,084.72	
	KINROSS GOLD CORP	3,281	4.68	15,355.08	
	LUNDIN MINING CORP	1,800	5.98	10,764.00	
	METHANEX CORP	131	77.50	10,152.50	
NUTRIEN LTD	3,121	67.73	211,385.33		
TECK RESOURCES LTD-CLS B	2,293	30.25	69,363.25		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	828	2.21	1,829.88		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	64.36	21,560.60		

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,710	32.93	89,240.30
BOMBARDIER INC-B	8,071	2.72	21,953.12
CAE INC	869	29.57	25,696.33
FINNING INTERNATIONAL INC	736	23.03	16,950.08
SNC-LAVALIN GROUP INC	871	34.56	30,101.76
WSP GLOBAL INC	680	72.27	49,143.60
THOMSON REUTERS CORP	973	77.69	75,592.37
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,580	116.20	415,996.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	730	269.11	196,450.30
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,772	63.70	112,876.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,100	49.01	53,911.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,071	85.25	91,302.75
STARS GROUP INC/THE	623	23.05	14,360.15
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,257	27.71	62,541.47
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	230	142.47	32,768.10
DOLLARAMA INC	1,497	34.91	52,260.27
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	2,235	72.71	162,506.85
EMPIRE CO LTD 'A'	864	28.89	24,960.96
LOBLAW COMPANIES LTD	889	65.63	58,345.07
METRO INC	1,417	48.94	69,347.98
WESTON (GEORGE) LTD	297	95.25	28,289.25
SAPUTO INC	1,126	44.64	50,264.64
AURORA CANNABIS INC	4,385	12.10	53,058.50
BAUSCH HEALTH COS INC	1,459	33.18	48,409.62
CANOPY GROWTH CORP	1,137	59.54	67,696.98
BANK OF MONTREAL	3,122	100.74	314,510.28
BANK OF NOVA SCOTIA	5,933	71.39	423,556.87
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,188	109.28	239,104.64
NATIONAL BANK OF CANADA	1,434	61.34	87,961.56
ROYAL BANK OF CANADA	6,863	102.13	700,918.19
TORONTO-DOMINION BANK	8,719	74.00	645,206.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	4,218	61.63	259,955.34
CI FINANCIAL CORP	775	17.94	13,903.50
IGM FINANCIAL INC	81	33.72	2,731.32
ONEX CORPORATION	292	74.92	21,876.64

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	153	596.25	91,226.25	
	GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	32.25	59,533.50	
	IA FINANCIAL CORP INC	304	49.39	15,014.56	
	INTACT FINANCIAL CORP	637	109.28	69,611.36	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	9,955	22.36	222,593.80	
	POWER CORP OF CANADA	1,735	30.93	53,663.55	
	POWER FINANCIAL CORP	1,074	31.21	33,519.54	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	3,131	50.32	157,551.92	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	101	20.97	2,117.97	
	BLACKBERRY LTD	1,407	12.12	17,052.84	
	CGI INC	1,079	90.59	97,746.61	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	87	1,103.49	96,003.63	
	OPEN TEXT CORP	1,567	50.27	78,773.09	
	SHOPIFY INC - CLASS A	487	267.02	130,038.74	
	BCE INC	1,000	59.17	59,170.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,954	72.70	142,055.80	
	TELUS CORP	320	48.80	15,616.00	
	ALTAGAS LTD	544	17.87	9,721.28	
	ATCO LTD -CLASS I	63	45.45	2,863.35	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	105	36.46	3,828.30	
	EMERA INC	50	49.98	2,499.00	
	FORTIS INC	1,889	49.71	93,902.19	
	HYDRO ONE LTD	1,625	20.55	33,393.75	
	カナダドル 小計	194,909		8,780,245.48 (718,224,080)	
ユーロ	ENAGAS SA	1,292	26.90	34,754.80	
	ENI SPA	12,457	15.70	195,574.90	
	GALP ENERGIA SGPS SA	2,089	13.83	28,901.31	
	NESTE OYJ	690	94.00	64,860.00	
	OMV AG	718	47.94	34,420.92	
	REPSOL SA	7,075	15.21	107,610.75	
	SNAM SPA	12,445	4.59	57,184.77	
	TENARIS SA	2,562	12.89	33,024.18	
	TOTAL SA	11,721	49.43	579,369.03	
	VOPAK	56	41.58	2,328.48	

AIR LIQUIDE SA	2,089	110.65	231,147.85
AKZO NOBEL	951	79.53	75,633.03
ARCELORMITTAL	2,858	18.36	52,495.74
ARKEMA	423	85.84	36,310.32
BASF SE	4,477	65.65	293,915.05
COVESTRO AG	1,141	47.23	53,889.43
CRH PLC	4,397	27.19	119,554.43
EVONIK INDUSTRIES AG	393	24.26	9,534.18
FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	37.50	2,100.00
HEIDELBERGCEMENT AG	882	64.10	56,536.20
IMERYS SA	29	45.04	1,306.16
KONINKLIJKE DSM NV	780	95.94	74,833.20
LANXESS AG	195	48.57	9,471.15
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,086	25.52	27,714.72
SOLVAY SA	460	96.40	44,344.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	2,714	10.77	29,243.35
SYMRISE AG	577	79.50	45,871.50
THYSSENKRUPP AG	2,040	12.41	25,326.60
UMICORE	1,263	40.28	50,873.64
UPM-KYMMENE OYJ	2,370	25.50	60,435.00
VOESTALPINE AG	712	27.61	19,658.32
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	1,191	38.63	46,008.33
AIRBUS SE	2,825	114.60	323,745.00
ALSTOM	969	38.31	37,122.39
ANDRITZ AG	352	39.88	14,037.76
BOUYGUES SA	1,029	31.70	32,619.30
BRENNTAG AG	735	45.60	33,516.00
CNH INDUSTRIAL NV	5,890	9.27	54,600.30
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	2,144	31.13	66,742.72
DASSAULT AVIATION SA	11	1,326.00	14,586.00
EIFFAGE	476	85.08	40,498.08
FERROVIAL SA	2,305	20.56	47,390.80
GEA GROUP AG	434	22.53	9,778.02
HOCHTIEF AG	17	142.10	2,415.70
KINGSPAN GROUP PLC	481	40.22	19,345.82

KION GROUP AG	150	47.01	7,051.50
KONE OYJ-B	1,500	44.31	66,465.00
LEGRAND SA	1,157	58.62	67,823.34
LEONARDO SPA	873	10.13	8,847.85
METSO OYJ	90	30.30	2,727.00
MTU AERO ENGINES AG	247	194.70	48,090.90
OSRAM LICHT AG	172	35.11	6,038.92
PRYSMIAN SPA	1,283	16.70	21,426.10
REXEL SA	790	10.00	7,903.95
SAFRAN SA	1,647	118.10	194,510.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,733	67.74	185,133.42
SIEMENS AG-REG	3,701	95.47	353,334.47
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	13.72	5,488.00
THALES SA	469	105.70	49,573.30
VINCI SA	2,501	84.84	212,184.84
WARTSILA OYJ ABP	2,705	13.90	37,599.50
BUREAU VERITAS SA	1,842	21.09	38,847.78
EDENRED	1,421	40.49	57,536.29
RANDSTAD NV	555	44.72	24,819.60
SOCIETE BIC SA	23	78.50	1,805.50
TELEPERFORMANCE	270	162.00	43,740.00
WOLTERS KLUWER	1,271	58.38	74,200.98
ADP	115	172.80	19,872.00
AENA SME SA	368	159.45	58,677.60
ATLANTIA SPA	2,455	22.17	54,427.35
BOLLORE	3,240	3.92	12,707.28
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	19.71	27,731.97
DEUTSCHE POST AG-REG	5,082	28.49	144,786.18
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	67.78	26,095.30
GETLINK	2,348	13.23	31,075.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,713	69.82	119,601.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	119	60.65	7,217.35
CONTINENTAL AG	559	137.55	76,890.45
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	4,493	50.90	228,693.70
FAURECIA	200	37.71	7,542.00

FERRARI NV	553	114.40	63,263.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	4,779	12.77	61,056.50
MICHELIN (CGDE)	862	102.95	88,742.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	30.83	13,041.09
PEUGEOT SA	2,496	21.75	54,288.00
PIRELLI & C SPA	1,734	5.93	10,289.55
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	699	55.90	39,074.10
RENAULT SA	820	57.58	47,215.60
VALEO SA	1,068	26.19	27,970.92
VOLKSWAGEN AG	194	144.90	28,110.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	949	140.02	132,878.98
ADIDAS AG	947	209.50	198,396.50
ESSILORLUXOTTICA	1,442	97.96	141,258.32
HERMES INTERNATIONAL	170	583.20	99,144.00
HUGO BOSS AG -ORD	184	60.10	11,058.40
KERING	382	492.20	188,020.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	1,343	313.45	420,963.35
MONCLER SPA	678	35.34	23,960.52
PUMA SE	20	500.00	10,000.00
SEB SA	151	143.20	21,623.20
ACCOR SA	1,120	36.96	41,395.20
PADDY POWER BETFAIR PLC	501	67.95	34,042.95
SODEXO	412	96.96	39,947.52
AXEL SPRINGER SE	35	45.96	1,608.60
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	16.25	6,646.25
JC DECAUX SA	60	27.34	1,640.40
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	510	14.06	7,173.15
PUBLICIS GROUPE	1,162	48.70	56,589.40
RTL GROUP	32	50.20	1,606.40
SES	2,232	14.03	31,314.96
TELENET GROUP HOLDING NV	192	42.40	8,140.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	398	79.50	31,641.00
VIVENDI	5,303	25.51	135,279.53
DELIVERY HERO SE	416	35.14	14,618.24
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	5,414	26.27	142,225.78

ZALANDO SE	220	35.20	7,744.00
CARREFOUR SA	2,663	16.90	45,004.70
CASINO GUICHARD PERRACHON	45	38.21	1,719.45
COLRUYT SA	290	65.98	19,134.20
JERONIMO MARTINS	703	13.26	9,321.78
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	6,087	23.62	143,805.37
METRO AG	170	14.77	2,511.75
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	3,706	71.81	266,127.86
DANONE	3,002	67.70	203,235.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,500	8.47	29,645.00
HEINEKEN HOLDING NV	516	88.25	45,537.00
HEINEKEN NV	1,321	92.74	122,509.54
KERRY GROUP PLC-A	713	96.65	68,911.45
PERNOD RICARD SA	1,046	157.50	164,745.00
REMY COINTREAU	18	115.00	2,070.00
BEIERSDORF AG	451	89.34	40,292.34
HENKEL AG & CO KGAA	464	82.20	38,140.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	942	87.80	82,707.60
L'OREAL	1,209	234.70	283,752.30
UNILEVER NV-CVA	7,316	51.08	373,701.28
BIOMERIEUX	110	72.80	8,008.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	959	68.50	65,691.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	2,189	46.61	102,029.29
KONINKLIJKE PHILIPS NV	4,640	35.31	163,838.40
SARTORIUS AG-VORZUG	166	148.80	24,700.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	863	37.30	32,189.90
BAYER AG-REG	4,482	59.45	266,454.90
EUROFINS SCIENTIFIC	48	360.00	17,280.00
GRIFOLS SA	1,382	23.48	32,449.36
IPSEN	158	119.55	18,888.90
MERCK KGAA	572	98.98	56,616.56
ORION OYJ-CLASS B	184	34.90	6,421.60
QIAGEN N.V.	1,252	34.99	43,807.48
RECORDATI SPA	180	35.64	6,415.20
SANOFI	5,343	78.31	418,410.33

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	88	111.10	9,776.80
UCB SA	546	75.80	41,386.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	2,182	19.50	42,549.00
AIB GROUP PLC	2,000	3.77	7,544.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	32,092	5.18	166,493.29
BANCO DE SABADELL SA	20,523	0.91	18,675.93
BANCO SANTANDER SA	77,183	4.14	320,000.71
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,800	5.24	19,912.00
BANKIA SA	1,600	2.35	3,760.00
BANKINTER SA	2,829	6.93	19,627.60
BNP PARIBAS	5,409	41.62	225,149.62
CAIXABANK S.A	18,123	2.80	50,762.52
COMMERZBANK AG	5,632	6.95	39,193.08
CREDIT AGRICOLE SA	4,796	10.51	50,405.96
ERSTE GROUP BANK AG	1,374	32.32	44,407.68
ING GROEP NV-CVA	18,667	10.46	195,331.48
INTESA SANPAOLO	72,940	2.15	157,295.11
KBC GROEP NV	1,288	61.42	79,108.96
MEDIOBANCA SPA	3,575	8.94	31,981.95
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	20.07	24,405.12
SOCIETE GENERALE SA	3,799	25.52	96,969.47
UNICREDIT SPA	9,973	11.38	113,492.74
AMUNDI SA	140	55.72	7,800.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	10,658	7.34	78,229.72
DEUTSCHE BOERSE AG	998	111.75	111,526.50
EURAZEO	384	67.30	25,843.20
EXOR NV	564	56.16	31,674.24
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	375	84.82	31,807.50
NATIXIS	3,105	4.59	14,251.95
WENDEL	24	111.80	2,683.20
AEGON NV	8,027	4.31	34,596.37
AGEAS	674	42.53	28,665.22
ALLIANZ SE-REG	2,067	196.44	406,041.48
ASSICURAZIONI GENERALI	5,197	16.35	84,970.95
AXA SA	9,448	22.33	210,973.84

CNP ASSURANCES	1,015	19.86	20,157.90
HANNOVER RUECK SE	285	125.90	35,881.50
MAPFRE SA	942	2.49	2,347.46
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	751	207.90	156,132.90
NN GROUP NV	1,587	36.37	57,719.19
POSTE ITALIANE SPA	2,118	8.56	18,130.08
SAMPO OYJ-A SHS	1,923	42.23	81,208.29
SCOR SE	756	38.22	28,894.32
AROUNDTOWN SA	2,775	7.73	21,450.75
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,604	44.22	70,928.88
VONOVIA SE	2,593	46.54	120,678.22
ADYEN NV	50	657.80	32,890.00
AMADEUS IT GROUP SA	2,151	67.28	144,719.28
ATOS SE	424	85.48	36,243.52
CAPGEMINI SA	831	103.75	86,216.25
DASSAULT SYSTEMES SA	677	129.90	87,942.30
SAP SE	4,713	98.56	464,513.28
WIRECARD AG	639	101.00	64,539.00
INGENICO GROUP	134	63.18	8,466.12
NOKIA OYJ	28,094	5.23	147,100.18
1&1 DRILLISCH AG	130	38.22	4,968.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	16,403	15.65	256,788.96
ELISA OYJ	741	40.41	29,943.81
ILIAD SA	98	87.86	8,610.28
KONINKLIJKE KPN NV	18,669	2.84	53,113.30
ORANGE	10,031	14.41	144,546.71
PROXIMUS	918	25.05	22,995.90
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.52	37,870.21
TELECOM ITALIA-RSP	9,717	0.47	4,583.50
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	2.99	1,854.42
TELEFONICA SA	22,891	7.60	173,971.60
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	260	34.48	8,964.80
E.ON SE	11,451	9.93	113,765.68
EDF	2,738	12.47	34,142.86
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	10,894	3.43	37,366.42

	ENDESA SA	1,577	23.14	36,491.78
	ENEL SPA	39,691	5.63	223,619.09
	ENGIE	9,138	13.24	121,032.81
	FORTUM OYJ	2,481	19.68	48,826.08
	IBERDROLA SA	30,008	7.72	231,901.82
	INNOGY SE	500	41.03	20,515.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	1,916	24.67	47,267.72
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,367	19.41	45,943.47
	RWE AG	2,948	23.70	69,867.60
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	11.80	26,491.00
	TERNA SPA	8,163	5.54	45,255.67
	UNIPER SE	1,177	27.36	32,202.72
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,392	19.96	47,756.28
	VERBUND AG	245	43.36	10,623.20
	ASML HOLDING NV	1,949	167.30	326,067.70
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	5,770	19.15	110,524.35
	STMICROELECTRONICS NV	3,664	14.53	53,237.92
	ユーロ 小計	922,315		17,923,707.61 (2,224,152,877)
英債券	BP PLC	94,730	5.52	523,004.33
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	21,779	23.91	520,844.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	17,797	24.06	428,195.82
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	1,490	5.45	8,129.44
	ANGLO AMERICAN PLC	5,350	19.62	104,977.70
	ANTOFAGASTA PLC	1,120	9.37	10,498.88
	BHP GROUP PLC	10,352	17.60	182,215.90
	CRODA INTERNATIONAL PLC	597	48.97	29,235.09
	FRESNILLO PLC	180	8.33	1,500.48
	GLENCORE PLC	55,987	3.11	174,315.52
	JOHNSON MATTHEY PLC	877	31.00	27,187.00
	MONDI PLC	2,064	17.09	35,273.76
	RIO TINTO PLC	5,686	42.31	240,574.66
	ASHTED GROUP PLC	2,200	18.60	40,920.00
	BAE SYSTEMS PLC	17,261	4.70	81,126.70
	BUNZL PLC	1,544	24.68	38,105.92

DCC PLC	453	65.40	29,626.20
FERGUSON PLC	1,019	52.69	53,691.11
MEGGITT PLC	2,323	5.08	11,810.13
MELROSE INDUSTRIES PLC	27,430	1.81	49,758.02
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	9,094	9.04	82,209.76
SMITHS GROUP PLC	1,824	14.31	26,110.56
WEIR GROUP PLC/THE	572	15.74	9,003.28
BABCOCK INTL GROUP PLC	204	5.08	1,036.72
EXPERIAN PLC	4,774	20.29	96,864.46
G4S PLC	2,741	1.86	5,102.37
INTERTEK GROUP PLC	759	47.34	35,931.06
RELX PLC	9,819	16.15	158,576.85
EASYJET PLC	130	11.57	1,504.75
ROYAL MAIL PLC	2,932	2.40	7,045.59
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	4,892	5.86	28,686.68
BERKELEY GROUP HOLDINGS	728	37.80	27,518.40
BURBERRY GROUP PLC	1,998	18.39	36,743.22
PERSIMMON PLC	1,824	21.38	38,997.12
TAYLOR WIMPEY PLC	19,095	1.74	33,320.77
CARNIVAL PLC	802	41.36	33,170.72
COMPASS GROUP PLC	7,875	17.40	137,025.00
GVC HOLDINGS PLC	1,500	5.19	7,785.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	970	45.38	44,023.45
MERLIN ENTERTAINMENT	2,373	3.37	8,013.62
TUI AG-DI	1,248	7.85	9,801.79
WHITBREAD PLC	835	49.46	41,299.10
AUTO TRADER GROUP PLC	3,830	5.12	19,617.26
INFORMA PLC	7,050	7.41	52,254.60
ITV PLC	10,960	1.30	14,253.48
PEARSON PLC	3,737	8.49	31,734.60
WPP PLC	5,757	8.24	47,437.68
KINGFISHER PLC	12,732	2.28	29,105.35
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	2.68	24,548.95
NEXT PLC	786	53.80	42,286.80
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.36	22,668.86

TESCO PLC	48,600	2.33	113,335.20
WM MORRISON SUPERMARKETS	9,127	2.24	20,476.42
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,943	23.35	45,369.05
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	10,984	30.86	339,021.16
COCA-COLA HBC AG-DI	749	25.92	19,414.08
DIAGEO PLC	11,747	30.85	362,453.68
IMPERIAL BRANDS PLC	4,719	25.88	122,151.31
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,221	64.08	206,401.68
UNILEVER PLC	5,414	43.29	234,399.13
CONVATEC GROUP PLC	2,000	1.34	2,685.00
NMC HEALTH PLC	438	24.24	10,617.12
SMITH & NEPHEW PLC	3,769	15.03	56,666.91
ASTRAZENECA PLC	6,008	63.51	381,568.08
GLAXOSMITHKLINE PLC	23,505	15.55	365,502.75
BARCLAYS PLC	83,275	1.55	129,442.66
HSBC HOLDINGS PLC	96,949	6.13	594,297.37
LLOYDS BANKING GROUP PLC	342,081	0.62	213,150.67
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	24,752	2.48	61,434.46
STANDARD CHARTERED PLC	14,322	5.78	82,867.09
3I GROUP PLC	5,362	9.59	51,464.47
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,573	17.73	27,897.15
INVESTEC PLC	2,302	4.37	10,068.94
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,352	45.94	62,110.88
SCHRODERS PLC	320	26.67	8,534.40
ST JAMES'S PLACE PLC	2,926	10.07	29,464.82
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	10,584	2.59	27,465.48
ADMIRAL GROUP PLC	1,104	21.42	23,647.68
AVIVA PLC	19,920	4.09	81,652.08
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	3.55	26,497.56
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	25,718	2.68	69,155.70
PRUDENTIAL PLC	12,566	15.59	195,966.77
RSA INSURANCE GROUP PLC	4,693	5.05	23,699.65
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,931	19.39	37,442.09
SAGE GROUP PLC/THE	4,159	6.85	28,514.10
BT GROUP PLC	42,966	2.25	96,974.26

	VODAFONE GROUP PLC	130,459	1.44	188,200.15	
	CENTRICA PLC	25,998	1.19	31,015.61	
	NATIONAL GRID PLC	16,767	8.86	148,605.92	
	SEVERN TRENT PLC	1,000	20.71	20,710.00	
	SSE PLC	4,481	12.22	54,780.22	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,711	8.63	40,684.19	
	英ポンド 小計	1,432,753		8,390,475.23 (1,216,451,098)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	20.93	12,139.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	23	561.00	12,903.00	
	GIVAUDAN-REG	40	2,531.00	101,240.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	2,563	48.86	125,228.18	
	SIKA AG-REG	572	138.40	79,164.80	
	ABB LTD-REG	9,245	18.50	171,032.50	
	GEBERIT AG-REG	169	406.00	68,614.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	52	201.60	10,483.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	195	208.40	40,638.00	
	ADECCO SA-REG	950	51.46	48,887.00	
	SGS SA-REG	25	2,523.00	63,075.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	313	134.00	41,942.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	2,642	70.60	186,525.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	154	282.30	43,474.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	54.70	13,729.70	
	DUFREY AG-REG	57	104.80	5,973.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	1,776.00	3,552.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	6	6,675.00	40,050.00	
	NESTLE SA-REG	14,804	93.86	1,389,503.44	
	SONOVA HOLDING AG-REG	259	192.75	49,922.25	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	58	791.50	45,907.00	
	LONZA GROUP AG-REG	383	288.50	110,495.50	
	NOVARTIS AG-REG	10,485	93.04	975,524.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,398	269.40	915,421.20	
	VIFOR PHARMA AG	251	132.65	33,295.15	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	12,845	11.45	147,075.25	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,053	40.98	43,151.94	

	PARGESA HOLDING SA-BR	29	78.00	2,262.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	80	699.00	55,920.00	
	UBS GROUP AG-REG	18,838	11.84	223,041.92	
	BALOISE HOLDING AG - REG	158	162.30	25,643.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	184	428.70	78,880.80	
	SWISS RE AG	1,531	96.44	147,649.64	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	740	328.80	243,312.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	447	86.55	38,687.85	
	TEMENOS GROUP AG-REG	342	141.80	48,495.60	
	SWISSCOM AG-REG	146	483.20	70,547.20	
	スイスフラン 小計	83,870		5,713,388.32 (631,500,811)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,099	315.70	346,954.30	
	BOLIDEN AB	1,647	251.40	414,055.80	
	ALFA LAVAL AB	1,784	200.30	357,335.20	
	ASSA ABLOY AB-B	4,422	194.05	858,089.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,979	246.25	733,578.75	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,370	226.95	537,871.50	
	EPIROC AB-A	2,606	89.54	233,341.24	
	EPIROC AB-B	1,290	85.07	109,740.30	
	SANDVIK AB	5,007	151.65	759,311.55	
	SKANSKA AB-B SHS	1,380	170.50	235,290.00	
	SKF AB-B SHARES	2,513	155.00	389,515.00	
	VOLVO AB-B SHS	8,383	134.75	1,129,609.25	
	SECURITAS AB-B SHS	933	144.55	134,865.15	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	239.70	367,220.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	75.12	213,115.44	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	3,998	136.08	544,047.84	
	ICA GRUPPEN AB	65	371.70	24,160.50	
	SWEDISH MATCH AB	1,030	464.40	478,332.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,608	268.30	699,726.40	
	NORDEA BANK ABP	15,400	83.00	1,278,200.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	6,957	94.06	654,375.42		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	8,093	103.20	835,197.60		
SWEDBANK AB - A SHARES	4,689	176.20	826,201.80		

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	194.30	122,991.90	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	1,125	237.00	266,625.00	
	INVESTOR AB-B SHS	2,422	416.00	1,007,552.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	284.20	25,578.00	
	ERICSSON LM-B SHS	16,103	86.84	1,398,384.52	
	HEXAGON AB-B SHS	1,193	475.90	567,748.70	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	144	568.00	81,792.00	
	TELE2 AB-B SHS	2,409	127.45	307,027.05	
	TELIA CO AB	13,001	42.15	547,992.15	
	スウェーデンクローナ 小計	120,742		16,485,825.86 (195,192,178)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	242	305.20	73,858.40	
	EQUINOR ASA	5,043	193.50	975,820.50	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	34.90	282,899.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	907	359.30	325,885.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	323.50	178,572.00	
	MOWI ASA	2,062	199.75	411,884.50	
	ORKLA ASA	2,391	66.94	160,053.54	
	DNB ASA	4,848	162.55	788,042.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	158.40	104,860.80	
	TELENOR ASA	3,461	174.30	603,252.30	
	ノルウェークローネ 小計	28,274		3,905,128.94 (50,102,804)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	469	697.00	326,893.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,239	315.90	391,400.10	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	888	542.00	481,296.00	
	ISS A/S	982	206.00	202,292.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	10	8,270.00	82,700.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	37	8,682.00	321,234.00	
	DSV A/S	888	546.80	485,558.40	
	PANDORA A/S	432	305.20	131,846.40	
	CARLSBERG AS-B	576	819.60	472,089.60	
	COLOPLAST-B	649	717.40	465,592.60	
	DEMANT A/S	550	206.80	113,740.00	
GENMAB A/S	283	1,153.00	326,299.00		

	H LUNDBECK A/S	120	298.90	35,868.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,631	336.35	2,903,036.85	
	DANSKE BANK A/S	3,142	121.55	381,910.10	
	TRYG A/S	94	183.10	17,211.40	
	ORSTED A/S	877	508.60	446,042.20	
	デンマーククローネ 小計	19,867		7,585,009.65 (126,138,710)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	829	26.49	21,960.21	
	OIL SEARCH LTD	6,702	8.27	55,425.54	
	ORIGIN ENERGY LTD	8,373	7.56	63,299.88	
	SANTOS LTD	8,669	7.19	62,330.11	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	28.93	10,328.01	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	4,972	35.80	177,997.60	
	WORLEYPARSONS LTD	1,064	14.85	15,800.40	
	ALUMINA LTD	7,748	2.61	20,222.28	
	AMCOR LIMITED	5,343	15.19	81,160.17	
	BHP GROUP LTD	14,199	37.61	534,024.39	
	BLUESCOPE STEEL LTD	2,175	13.85	30,123.75	
	BORAL LTD	3,791	4.59	17,400.69	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	9,510	6.59	62,670.90	
	INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.21	17,147.82	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,601	17.93	28,705.93	
	NEWCREST MINING LTD	3,468	25.39	88,052.52	
	ORICA LTD	2,316	18.56	42,984.96	
	RIO TINTO LTD	1,953	94.17	183,914.01	
	SOUTH32 LTD	23,242	3.87	89,946.54	
	CIMIC GROUP LTD	682	50.46	34,413.72	
	BRAMBLES LTD	7,526	12.11	91,139.86	
	SEEK LTD	909	18.19	16,534.71	
	AURIZON HOLDINGS LTD	10,676	4.55	48,575.80	
	SYDNEY AIRPORT	5,230	7.15	37,394.50	
TRANSURBAN GROUP	14,547	12.86	187,074.42		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,767	24.82	68,676.94		
CROWN RESORTS LTD	773	11.71	9,051.83		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	49	41.21	2,019.29		

FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	42.64	1,876.16
TABCORP HOLDINGS LTD	11,731	4.72	55,370.32
REA GROUP LTD	43	75.71	3,255.53
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	3.81	1,684.02
WESFARMERS LTD	5,732	34.80	199,473.60
COLES GROUP LTD	6,235	11.68	72,824.80
WOOLWORTHS GROUP LTD	6,516	30.51	198,803.16
COCA-COLA AMATIL LTD	469	8.44	3,958.36
TREASURY WINE ESTATES LTD	3,550	15.44	54,812.00
COCHLEAR LTD	279	178.89	49,910.31
RAMSAY HEALTH CARE LTD	611	64.86	39,629.46
SONIC HEALTHCARE LTD	2,502	24.63	61,624.26
CSL LTD	2,157	197.19	425,338.83
AUST AND NZ BANKING GROUP	13,810	26.52	366,241.20
BANK OF QUEENSLAND LTD	304	9.18	2,790.72
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	368	9.62	3,540.16
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	8,365	71.43	597,511.95
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	13,169	25.09	330,410.21
WESTPAC BANKING CORP	16,435	26.51	435,691.85
AMP LTD	11,656	2.20	25,643.20
ASX LTD	927	69.89	64,788.03
CHALLENGER LTD	1,796	7.48	13,434.08
MACQUARIE GROUP LTD	1,620	126.97	205,691.40
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	12,407	7.69	95,409.83
MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	2.70	43,696.80
QBE INSURANCE GROUP LTD	6,342	12.54	79,528.68
SUNCORP GROUP LTD	6,999	13.44	94,066.56
LENDLEASE GROUP	3,591	12.15	43,630.65
COMPUTERSHARE LTD	2,732	17.76	48,520.32
TELSTRA CORP LTD	20,785	3.28	68,174.80
TPG TELECOM LTD	287	6.72	1,928.64
AGL ENERGY LTD	3,650	22.04	80,446.00
APA GROUP	6,885	10.06	69,263.10
AUSNET SERVICES	1,437	1.78	2,557.86
	344,873		5,939,903.63

	オーストラリアドル 小計			(461,708,709)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	1,115	4.69	5,229.35	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,787	7.88	29,860.49	
	A2 MILK CO LTD	3,750	13.81	51,787.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,400	15.40	21,560.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	11.70	18,684.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	10,150	3.58	36,337.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,074	4.08	4,381.92	
	ニュージーランドドル 小計	22,873		167,841.16	(12,692,148)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	14,000	83.80	1,173,200.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	16.64	166,400.00	
	MTR CORP	8,000	47.30	378,400.00	
	MINTH GROUP LTD	2,000	24.10	48,200.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	7,500	50.70	380,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	26.50	13,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	11,000	53.85	592,350.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	800	16.00	12,800.00	
	SANDS CHINA LTD	14,200	38.45	545,990.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	2,000	11.30	22,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.01	18,020.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	19.10	99,320.00	
	WH GROUP LTD	45,000	8.47	381,150.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	25.65	92,340.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	16,500	33.00	544,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	4,100	191.60	785,560.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	5,900	272.80	1,609,520.00	
	AIA GROUP LTD	57,800	77.10	4,456,380.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	13,500	68.20	920,700.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	1,200	24.65	29,580.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	19.06	247,780.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	9,015	47.65	429,564.75	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	2,300	41.70	95,910.00	
KERRY PROPERTIES LTD	500	34.25	17,125.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	31,000	12.28	380,680.00		

	SINO LAND CO	18,000	14.70	264,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	8,200	130.70	1,071,740.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,700	99.70	169,490.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	33.35	166,750.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	8,000	23.20	185,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	8,000	58.05	464,400.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	3,400	56.30	191,420.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	16,000	12.48	199,680.00	
	PCCW LTD	4,000	4.73	18,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	63.50	279,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	7,500	91.15	683,625.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.88	3,940.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	40,800	18.32	747,456.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	8,000	53.90	431,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	90.50	144,800.00	
	香港ドル 小計	415,715		18,464,590.75	(258,688,916)
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	7,500	6.22	46,650.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	800	2.55	2,040.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.75	45,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	1.51	2,265.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	6,700	2.53	16,951.00	
	SATS LTD	1,200	5.09	6,108.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,700	9.75	26,325.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	28,800	1.03	29,664.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	2.43	32,076.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	32.59	3,259.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,700	0.28	1,596.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,600	3.31	35,086.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	8,900	25.35	225,615.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	15,700	11.16	175,212.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,700	25.20	168,840.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	4,500	7.32	32,940.00	
	CAPITALAND LTD	10,200	3.47	35,394.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,600	9.04	14,464.00	

	UOL GROUP LTD	2,100	6.73	14,133.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	18.01	23,413.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	36,500	2.97	108,405.00	
	シンガポールドル 小計	178,300		1,045,436.00 (84,941,675)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,122	18.32	75,515.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	52	463.20	24,086.40	
	BANK HAPOLIM BM	5,096	24.80	126,380.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	6,884	24.58	169,208.72	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	110	73.22	8,054.20	
	AZRIELI GROUP	234	211.40	49,467.60	
	NICE SYSTEMS LTD	153	425.50	65,101.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,770	2.59	4,596.69	
	イスラエルシュケル 小計	18,421		522,410.95 (15,860,396)	
	合 計	5,218,505		18,599,767,365 (18,599,767,365)	

(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	2,778	50,004.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	457	64,766.04	
		AMERICAN TOWER CORP	2,124	411,312.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,848	59,942.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	702	140,112.18	
		BOSTON PROPERTIES INC	754	99,158.54	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	544	11,103.04	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	401	40,023.81	
		CROWN CASTLE INTL CORP	2,034	255,267.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,057	125,909.84	
		DUKE REALTY CORP	1,542	47,293.14	
		EQUINIX INC	398	179,697.00	

	EQUITY RESIDENTIAL	1,868	138,979.20	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	282	81,980.22	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	546	54,933.06	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	317	42,642.84	
	HCP INC	2,028	64,186.20	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	4,008	75,350.40	
	INVITATION HOMES INC	1,643	39,464.86	
	IRON MOUNTAIN INC	1,174	41,230.88	
	KIMCO REALTY CORP	2,217	40,194.21	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	799	38,439.89	
	MACERICH CO/THE	178	7,792.84	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	491	52,998.54	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	848	45,944.64	
	PROLOGIS INC	3,103	220,530.21	
	PUBLIC STORAGE	782	173,697.84	
	REALTY INCOME CORP	1,427	103,600.20	
	REGENCY CENTERS CORP	658	43,500.38	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	485	95,603.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,505	267,288.00	
	SL GREEN REALTY CORP	468	41,988.96	
	UDR INC	1,156	51,996.88	
	VENTAS INC	1,831	117,605.13	
	VEREIT INC	3,812	32,135.16	
	VORNADO REALTY TRUST	739	49,379.98	
	WELLTOWER INC	1,878	146,145.96	
	WEYERHAEUSER CO	3,208	82,638.08	
	WP CAREY INC	695	54,050.15	
	米ドル 小計	56,785	3,688,887.10 (405,445,581)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,651.64	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	130	3,419.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,841.75	
	カナダドル 小計	297	7,912.39 (647,233)	
ユーロ	COVIVIO	222	20,868.00	
		223	29,168.40	

	GECINA SA			
	ICADE	30	2,233.50	
	KLEPIERRE	1,285	39,398.10	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	715	108,780.10	
	ユーロ 小計	2,475	200,448.10 (24,873,604)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	4,343	25,632.38	
	HAMMERSON PLC	1,987	6,765.73	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,465	31,649.31	
	SEGRO PLC	5,784	38,243.80	
	英ポンド 小計	15,579	102,291.22 (14,830,181)	
オーストラリアドル	DEXUS	6,106	77,240.90	
	GOODMAN GROUP	7,561	101,241.79	
	GPT GROUP	9,342	57,173.04	
	MIRVAC GROUP	19,387	53,120.38	
	SCENTRE GROUP	24,098	98,319.84	
	STOCKLAND	15,223	57,847.40	
	VICINITY CENTRES	17,168	43,950.08	
	オーストラリアドル 小計	98,885	488,893.43 (38,001,686)	
香港ドル	LINK REIT	9,500	836,475.00	
	香港ドル 小計	9,500	836,475.00 (11,719,014)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	18,700	53,482.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,600	14,820.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	8,100	19,359.00	
	SUNTEC REIT	8,500	16,660.00	
	シンガポールドル 小計	42,900	104,321.00 (8,476,081)	
合計			503,993,380 (503,993,380)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 596銘柄	96.9%		65.9%
	投資証券 39銘柄		3.1%	2.1%
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 237銘柄	98.9%		11.6%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式 92銘柄	98.8%		6.4%
	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	95.7%		1.4%
	投資証券 1銘柄		4.3%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.9%		0.4%
	投資証券 4銘柄		9.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	370,551,468
コール・ローン	16,603,150
株式	5,348,241,756
投資証券	18,139,439
未収入金	293,500,000
未収配当金	5,520,855
差入委託証拠金	95,289,002
流動資産合計	6,147,845,670
資産合計	
6,147,845,670	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,323,569
未払解約金	210,253,000
未払利息	45
流動負債合計	217,576,614
負債合計	
217,576,614	
純資産の部	
元本等	
元本	4,572,442,524
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,357,826,532
元本等合計	5,930,269,056
純資産合計	
5,930,269,056	
負債純資産合計	
6,147,845,670	

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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	2,230,769,450円
期中追加設定元本額	3,974,927,018円
期中一部解約元本額	1,633,253,944円
期末元本額	4,572,442,524円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	428,435,042円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,485,628,031円
りそなラップ型ファンド(成長型)	680,853,557円
DCりそな グローバルバランス	4,709,899円
つみたてバランスファンド	81,862,640円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	45,459,150円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	16,330,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	10,936,216円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,380,470,020円
Smart-i 新興国株式インデックス	278,449,783円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,774,907円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	13,871,277円
Smart-i 8資産バランス 成長型	22,914,983円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	119,217,546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)	528,495円
2. 計算日における受益権の総数	4,572,442,524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	1.2970円
(10,000口当たり純資産額)	(12,970円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	211,885,914	
投資証券	325,697	
合計	211,560,217	

(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 3月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	563,318,425	-	557,477,808	5,840,617
合計		563,318,425	-	557,477,808	5,840,617

(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 3月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	99,420,012	-	97,937,060	1,482,952
	米ドル	65,126,046	-	64,180,960	945,086
	メキシコペソ	3,490,610	-	3,415,300	75,310
	香港ドル	25,563,720	-	25,200,000	363,720
	南アフリカランド	5,239,636	-	5,140,800	98,836
合計		99,420,012	-	97,937,060	1,482,952

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	49,429	4.63	228,856.27	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	7,200	1.23	8,863.20	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,462	89.28	398,367.36	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	812	179.00	145,348.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	10,217	6.30	64,367.10	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	16,510	3.71	61,285.12	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,500	70.10	175,250.00	

CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	1,190	17.40	20,706.00
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	1,150	8.99	10,338.50
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	5,669	22.32	126,532.08
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,112	25.56	28,422.72
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	600	12.67	7,602.00
POLYUS PJSC-REG S-GDR	603	41.00	24,723.00
SEVERSTAL - GDR REG S	2,000	15.48	30,960.00
SOUTHERN COPPER CORP	885	37.59	33,267.15
51JOB INC-ADR	300	73.83	22,149.00
DP WORLD PLC	1,270	16.10	20,447.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,200	17.69	56,608.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,200	39.00	46,800.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,250	79.51	99,387.50
TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,200	34.82	111,424.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	3,350	43.44	145,524.00
58.COM INC-ADR	860	61.76	53,113.60
AUTOHOME INC-ADR	520	90.31	46,961.20
BAIDU INC - SPON ADR	2,550	166.73	425,161.50
IQIYI INC-ADR	1,300	25.02	32,526.00
MOMO INC-SPON ADR	1,350	37.13	50,125.50
NETEASE INC-ADR	682	232.35	158,462.70
SINA CORP	630	57.76	36,388.80
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,000	16.98	16,980.00
WEIBO CORP-SPON ADR	530	58.70	31,111.00
YY INC-ADR	420	79.64	33,448.80
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	11,930	176.26	2,102,781.80
BAOZUN INC-SPN ADR	200	36.65	7,330.00
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	3,620	40.26	145,741.20
JD.COM INC-ADR	6,720	28.00	188,160.00
PINDUODUO INC-ADR	1,900	23.50	44,650.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,300	6.95	29,885.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	3,115	14.30	44,544.50
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,150	25.00	28,750.00
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	28.58	17,148.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	12,461	4.01	50,030.91

	CREDICORP LTD	644	241.43	155,480.92
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	24,667	12.95	319,437.65
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	7,102	1.17	8,309.34
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	200	44.96	8,992.00
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	8,400	1.47	12,423.60
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	400	34.08	13,632.00
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,500	8.09	36,405.00
	米ドル 小計	219,860		5,965,209.02 (655,636,123)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	132,300	8.75	1,157,625.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	31,800	50.80	1,615,440.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	244.90	336,737.50
	MEXICHEM SAB DE CV-*	10,000	46.57	465,700.00
	ALFA S.A.B.-A	28,900	20.15	582,335.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,000	73.61	147,220.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,400	168.14	571,676.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,970	294.39	579,948.30
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,750	190.46	333,305.00
	ALSEA SAB DE CV	2,700	42.34	114,318.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	22,300	40.66	906,718.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	3,600	86.90	312,840.00
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	800	119.29	95,432.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	49,900	50.64	2,526,936.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	107.68	463,024.00
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	3,800	120.04	456,152.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	18,400	174.83	3,216,872.00
	GRUMA S.A.B.-B	1,415	202.20	286,113.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,600	39.09	609,804.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	14,900	32.86	489,614.00
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	19,300	24.71	476,903.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	25,400	101.24	2,571,496.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	19,200	27.70	531,840.00
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	315,100	14.20	4,474,420.00
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	5,300	76.87	407,411.00
		735,510		23,729,879.80

メキシコペソ 小計				(136,446,808)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,500	45.19	67,785.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	67,400	27.00	1,819,800.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3,400	49.30	167,620.00
	BRASKEM SA-PREF A	1,600	51.89	83,024.00
	GERDAU SA-PREF	10,100	14.94	150,894.00
	KLABIN SA - UNIT	6,900	17.16	118,404.00
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	5,407	45.79	247,586.53
	VALE SA	29,200	50.05	1,461,460.00
	EMBRAER SA	5,400	18.70	100,980.00
	WEG SA	6,950	18.22	126,629.00
	CCR SA	11,700	11.69	136,773.00
	LOCALIZA RENT A CAR	4,900	32.23	157,927.00
	RUMO SA	10,800	18.52	200,016.00
	KROTON EDUCACIONAL SA	12,900	10.87	140,223.00
	B2W CIA DIGITAL	1,800	42.50	76,500.00
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	7,300	16.79	122,567.00
	LOJAS RENNER S.A.	7,000	42.65	298,550.00
	MAGAZINE LUIZA SA	700	173.30	121,310.00
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	3,500	23.70	82,950.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	4,900	19.63	96,187.00
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1,500	91.69	137,535.00
	RAIA DROGASIL SA	2,300	66.41	152,743.00
	AMBEV SA	43,400	16.72	725,648.00
	BRF SA	5,100	22.20	113,220.00
	JBS SA	9,400	14.29	134,326.00
	M DIAS BRANCO SA	500	43.00	21,500.00
	NATURA COSMETICOS SA	1,600	41.50	66,400.00
	HYPERA SA	2,900	26.15	75,835.00
	BANCO BRADESCO SA-PREF	39,250	41.26	1,619,455.00
	BANCO DO BRASIL S.A.	7,800	47.65	371,670.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,900	43.26	168,714.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	44,500	33.55	1,492,975.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	38,900	11.93	464,077.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	18,100	32.55	589,155.00	

	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	6,400	26.22	167,808.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,300	89.12	115,856.00	
	PORTO SEGURO SA	700	53.54	37,478.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	2,800	29.00	81,200.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	9,300	12.51	116,343.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,500	23.51	82,285.00	
	CIELO SA	11,300	9.95	112,435.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	47.67	195,447.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,600	12.30	118,080.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,900	36.06	140,634.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,400	13.78	101,972.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,500	40.12	140,420.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,075	40.88	84,826.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,700	79.75	135,575.00	
	ブラジルリアル 小計	490,082		13,540,797.53	(380,902,634)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	3,614	8,648.00	31,253,872.00	
	EMPRESAS CMPC SA	11,717	2,270.00	26,597,590.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,121	25,935.00	29,073,135.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	7,348.00	21,757,428.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	6,754	4,950.00	33,432,300.00	
	CENCOSUD SA	13,424	1,195.00	16,041,680.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,479	9,680.00	14,316,720.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	2,478.00	7,062,300.00	
	BANCO DE CHILE	230,670	103.89	23,964,306.30	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	386	44,600.00	17,215,600.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	612,457	50.84	31,137,313.88	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	5.93	11,148,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	7,000.10	7,007,100.10	
	AGUAS ANDINAS SA-A	31,578	388.00	12,252,264.00	
	COLBUN SA	83,944	153.74	12,905,550.56	
	ENEL AMERICAS SA	278,858	118.90	33,156,216.20	
	ENEL CHILE SA	188,505	69.15	13,035,120.75	
	チリペソ 小計	3,351,319		341,356,896.79	(55,163,274)

コロンビアペソ	ECOPETROL SA	51,116	3,430.00	175,327,880.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	2,000	7,900.00	15,800,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	18,300.00	53,070,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,150	39,600.00	85,140,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,129	40,600.00	167,637,400.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	30,000	1,215.00	36,450,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,568	36,500.00	93,732,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	480	35,000.00	16,800,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,406	16,080.00	70,848,480.00	
コロンビアペソ 小計		99,749		714,805,760.00	(25,089,682)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	604	21.40	12,925.60	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	280	19.38	5,426.40	
	OPAP SA	2,215	9.00	19,935.00	
	JUMBO SA	1,110	14.78	16,405.80	
	ALPHA BANK AE	14,218	1.24	17,701.41	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,403	11.32	27,201.96	
ユーロ 小計		20,830		99,596.17	(12,358,888)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,237	148.20	183,323.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	13,819	8.80	121,607.20	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	3,410	4.62	15,754.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,600	22.22	79,992.00	
	KOC HOLDING AS	7,765	17.84	138,527.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	3,500	6.07	21,245.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	23.74	35,610.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	13.49	74,195.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	49.56	22,302.00	
	ARCELIK AS	1,000	18.58	18,580.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,144	80.80	173,235.20	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	20.18	38,745.60	
	AKBANK T.A.S.	29,702	6.36	188,904.72	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	22,540	9.18	206,917.20	
	TURKIYE HALK BANKASI	6,000	6.99	41,940.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,000	5.93	71,160.00	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,100	8.45	59,995.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,100	13.16	146,076.00	
	トルコリラ 小計	134,287		1,638,110.12	(31,730,193)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	958.50	717,916.50	
	MONETA MONEY BANK AS	4,600	79.80	367,080.00	
	CEZ AS	1,553	550.00	854,150.00	
	チェココルナ 小計	6,902		1,939,146.50	(9,346,686)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,230	3,320.00	10,723,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,233	5,295.00	6,528,735.00	
	OTP BANK PLC	1,985	12,860.00	25,527,100.00	
	ハンガリーフォリント 小計	6,448		42,779,435.00	(16,765,260)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	1,113	85.76	95,450.88	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,775	100.00	277,500.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	12,397	6.29	78,039.11	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	450	62.50	28,125.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,402	103.50	145,107.00	
	CCC SA	371	209.00	77,539.00	
	LPP SA	13	8,350.00	108,550.00	
	CD PROJEKT SA	659	185.90	122,508.10	
	CYFROWY POLSAT SA	3,290	25.92	85,276.80	
	DINO POLSKA SA	350	122.90	43,015.00	
	ALIOR BANK SA	690	61.55	42,469.50	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	250	68.30	17,075.00	
	BANK MILLENNIUM SA	2,800	9.22	25,816.00	
	BANK PEKAO SA	1,633	109.65	179,058.45	
	MBANK SA	165	442.20	72,963.00	
	PKO BANK POLSKI SA	8,156	38.70	315,637.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	345	389.40	134,343.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	5,792	40.76	236,081.92	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	5.38	22,596.00	
	PGE SA	8,891	10.02	89,087.82	
		55,742		2,196,238.78	

	ポーランドズロチ 小計			(63,383,451)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	7,000	3.34	23,380.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	18,000	8.20	147,600.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	238,000	6.51	1,549,380.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	31,000	19.66	609,460.00
	CNOOC LTD	165,000	14.10	2,326,500.00
	KUNLUN ENERGY CO LTD	30,000	8.43	252,900.00
	PETROCHINA CO LTD-H	194,000	5.28	1,024,320.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	18,000	7.85	141,300.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	48,000	3.12	149,760.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	4,000	6.11	24,440.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	12,000	45.60	547,200.00
	BBMG CORP-H	25,000	2.89	72,250.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	27,500	5.52	151,800.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	45,000	3.40	153,000.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	38,000	6.35	241,300.00
	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	16,000	5.14	82,240.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	24,000	8.11	194,640.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	4.06	69,832.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	10.82	162,300.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	19,000	6.69	127,110.00
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	24,000	4.03	96,720.00
	MMG LTD	32,000	3.53	112,960.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	17,000	7.42	126,140.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	4.04	137,360.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,000	8.63	103,560.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	3.32	192,560.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	5.00	130,000.00
	BOC AVIATION LTD	2,200	60.35	132,770.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	8.37	351,540.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	15,000	27.20	408,000.00
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	19,500	10.84	211,380.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	36,000	7.31	263,160.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	14,000	7.34	102,760.00
CITIC LTD	53,000	11.70	620,100.00	

CRRG CORP LTD - H	40,000	7.97	318,800.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	12.42	304,290.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	67,500	0.98	66,150.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	17.08	136,640.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	2.30	73,600.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	14,000	3.00	42,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	17.76	35,520.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	7.92	138,600.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,500	16.96	161,120.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	20,000	12.30	246,000.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	11.34	68,040.00	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	5,300	46.30	245,390.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	33,000	7.86	259,380.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	12,000	14.26	171,120.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	7.20	72,000.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	8.51	153,180.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	18,000	7.73	139,140.00	
CAR INC	9,000	6.80	61,200.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,000	5.18	20,720.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	16.42	229,880.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	6.50	156,000.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	4.53	45,300.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	34,500	3.17	109,365.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	8.08	145,440.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	11.34	136,080.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	9,500	16.10	152,950.00	
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	3.60	54,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	8.75	157,500.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,000	4.84	58,080.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	28,000	7.44	208,320.00	
BYD CO LTD-H	6,000	51.35	308,100.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	26,000	3.72	96,720.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	26,000	8.41	218,660.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	26.70	138,840.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	45,000	15.24	685,800.00	

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	20,500	5.64	115,620.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	9.56	267,680.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	9.70	106,700.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,000	51.75	517,500.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	12,000	24.70	296,400.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	180,000	0.25	45,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	7,000	107.50	752,500.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	12,000	2.21	26,520.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.43	200,200.00	
CHINA LITERATURE LTD	1,800	36.85	66,330.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	52,200	365.00	19,053,000.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	43,000	0.76	32,680.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	3,400	49.70	168,980.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	19.14	38,280.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	23,500	7.10	166,850.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	24,000	2.79	66,960.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	25,000	26.65	666,250.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	14,000	31.90	446,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	23,000	5.71	131,330.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	11.56	208,080.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	33.70	67,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	5,000	7.61	38,050.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	47,000	6.48	304,560.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	3,000	28.05	84,150.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	6,500	68.10	442,650.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	32,000	9.33	298,560.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	20,000	7.62	152,400.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,200	18.20	112,840.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,800	33.30	359,640.00	
3SBIO INC	13,000	14.88	193,440.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	10,000	7.73	77,300.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	17,500	11.30	197,750.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	4.79	114,960.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	42,000	15.04	631,680.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	15.08	90,480.00	

LUYE PHARMA GROUP LTD	7,500	6.14	46,050.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	5,500	28.95	159,225.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	17,000	1.93	32,810.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	64,500	7.30	470,850.00
SSY GROUP LTD	10,000	7.15	71,500.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	4,000	10.30	41,200.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,500	78.00	351,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	274,000	3.70	1,013,800.00
BANK OF CHINA LTD-H	733,000	3.66	2,682,780.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	81,000	6.55	530,550.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	83,000	5.20	431,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	882,000	6.94	6,121,080.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	11,000	3.80	41,800.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	36,500	37.00	1,350,500.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	58,600	5.98	350,428.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	29,000	5.00	145,000.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	639,000	5.96	3,808,440.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	78,000	4.75	370,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	98,000	2.23	218,540.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	8,000	23.10	184,800.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	10,000	15.78	157,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	37,000	5.16	190,920.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.75	180,250.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	10,800	17.82	192,456.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	22,000	17.96	395,120.00
FAR EAST HORIZON LTD	22,000	8.47	186,340.00
GF SECURITIES CO LTD-H	10,600	12.08	128,048.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	17.50	133,000.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	10.20	322,320.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,400	15.20	249,280.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	69,000	21.25	1,466,250.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	23,600	30.40	717,440.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	1.77	97,350.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,800	23.45	347,060.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	7,700	40.30	310,310.00

PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	69,000	3.49	240,810.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	62,000	8.96	555,520.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	48,000	86.50	4,152,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,700	27.70	47,090.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	11.92	214,560.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	22,000	27.95	614,900.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	52,000	4.71	244,920.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	36,000	28.60	1,029,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	26,000	32.45	843,700.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	12,300	32.00	393,600.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	26,000	5.70	148,200.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	64,000	12.20	780,800.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	20,000	9.23	184,600.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	8,000	7.28	58,240.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	17.14	198,824.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	10,000	4.09	40,900.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	15,000	3.78	56,700.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	4,000	8.31	33,240.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	16,000	12.48	199,680.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	14,500	24.70	358,150.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	10,000	3.04	30,400.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	12,000	21.70	260,400.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.99	55,720.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	13,000	3.41	44,330.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	3.20	38,400.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	23,000	37.95	872,850.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	74,000	1.78	131,720.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	12,000	4.52	54,240.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	16,000	9.10	145,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	5,000	18.30	91,500.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	22.45	202,050.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	6,500	46.45	301,925.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,500	9.92	34,720.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	6.47	97,050.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	7,000	27.75	194,250.00	

	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	15,500	8.61	133,455.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	21.65	73,610.00	
	LENOVO GROUP LTD	70,000	7.08	495,600.00	
	MEITU INC	7,000	3.97	27,790.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	6,800	92.70	630,360.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	33,800	11.28	381,264.00	
	ZTE CORP-H	4,600	21.45	98,670.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	26,000	7.35	191,100.00	
	CHINA MOBILE LTD	56,500	81.90	4,627,350.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	126,000	4.34	546,840.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	378,000	1.86	703,080.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	10.22	572,320.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	5,000	44.60	223,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	56,000	4.67	261,520.00	
	CGN POWER CO LTD-H	105,000	2.25	236,250.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	16,200	27.15	439,830.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	5.50	176,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.97	116,230.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,000	31.80	254,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	18,000	12.06	217,080.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	2.10	67,200.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	7,000	77.10	539,700.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	28,000	14.90	417,200.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	3.38	67,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	42,000	4.65	195,300.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	58,000	2.17	125,860.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	6.10	67,100.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	18.74	56,220.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	30,000	7.83	234,900.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	10,000	3.77	37,700.00	
	香港ドル 小計	8,596,400		91,855,082.00 (1,286,889,698)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	37,000	3.20	118,400.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	900	24.84	22,356.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,800	9.03	205,884.00	

PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,400	4.72	77,408.00
GAMUDA BHD	13,300	2.89	38,437.00
HAP SENG CONSOLIDATED	6,800	9.88	67,184.00
IJM CORP BHD	23,600	2.10	49,560.00
SIME DARBY BERHAD	17,000	2.23	37,910.00
AIRASIA GROUP BHD	7,500	2.79	20,925.00
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	5,300	7.69	40,757.00
MISC BHD	9,000	6.74	60,660.00
WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.80	25,840.00
GENTING BHD	20,400	6.92	141,168.00
GENTING MALAYSIA BHD	28,900	3.38	97,682.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	1,800	35.48	63,864.00
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,700	34.80	59,160.00
GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.40	31,200.00
IOI CORP BHD	19,700	4.49	88,453.00
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,300	24.34	104,662.00
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	146.20	87,720.00
PPB GROUP BERHAD	5,820	17.74	103,246.80
QL RESOURCES BHD	2,400	6.93	16,632.00
SIME DARBY PLANTATION BHD	23,600	5.07	119,652.00
HARTALEGA HOLDINGS BHD	13,600	4.62	62,832.00
IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.82	140,262.00
TOP GLOVE CORP BHD	14,600	4.43	64,678.00
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	6,500	4.16	27,040.00
AMMB HOLDINGS BHD	19,000	4.52	85,880.00
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	43,700	5.33	232,921.00
HONG LEONG BANK BERHAD	6,500	20.40	132,600.00
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,500	19.46	29,190.00
MALAYAN BANKING BHD	35,200	9.29	327,008.00
PUBLIC BANK BERHAD	27,500	23.86	656,150.00
RHB BANK BHD	5,500	5.70	31,350.00
IOI PROPERTIES GROUP BHD	11,000	1.40	15,400.00
SIME DARBY PROPERTY BHD	11,900	1.10	13,090.00
SP SETIA BHD	7,000	2.22	15,540.00
AXIATA GROUP BERHAD	30,200	4.27	128,954.00

	DIGI.COM BHD	30,200	4.65	140,430.00	
	MAXIS BHD	22,900	5.56	127,324.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	5,000	3.17	15,850.00	
	PETRONAS GAS BHD	4,900	17.86	87,514.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	28,500	12.88	367,080.00	
	YTL CORP BHD	19,380	1.10	21,318.00	
	マレーシアリングット 小計	647,300		4,401,171.80	(118,919,662)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	13,000	16.30	211,900.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	12,700	49.00	622,300.00	
	IRPC PCL - NVDR	97,700	5.85	571,545.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	12,900	126.50	1,631,850.00	
	PTT PCL-NVDR	94,700	48.75	4,616,625.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	11,200	72.00	806,400.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	49.75	820,875.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	21,200	68.75	1,457,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	3,700	484.00	1,790,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	40,300	68.25	2,750,475.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	78,900	10.10	796,890.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	63,000	10.90	686,700.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	26,100	39.00	1,017,900.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	42,000	15.30	642,600.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	58.00	191,400.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	12,000	50.50	606,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	45,300	76.00	3,442,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	37,900	26.25	994,875.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	9,000	18.90	170,100.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	37,200	24.50	911,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	2,800	178.50	499,800.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	2,700	216.00	583,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	193.00	3,184,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	41,400	19.20	794,880.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	16,800	135.00	2,268,000.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	85,000	2.12	180,200.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,800	46.25	360,750.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	13,300	73.00	970,900.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	30,000	10.70	321,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,200	70.75	155,650.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	9,600	186.00	1,785,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	102,100	4.84	494,164.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	900	283.00	254,700.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	2,200	91.00	200,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	5,200	92.50	481,000.00	
	タイパーツ 小計	1,017,100		37,275,479.00 (129,718,666)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	14,500	59.55	863,475.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	18,000	16.30	293,400.00	
	DMCI HOLDINGS INC	18,000	12.40	223,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	21,700	64.40	1,397,480.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,940	970.50	1,882,770.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,460	124.20	1,174,932.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	312.40	1,405,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,510	149.20	1,418,892.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	7,200	88.00	633,600.00	
	BDO UNIBANK INC	19,610	133.90	2,625,779.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,320	81.00	1,078,920.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	171.20	239,680.00	
	AYALA CORPORATION	2,480	940.00	2,331,200.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	704	1,040.00	732,160.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.92	713,400.00	
	AYALA LAND INC	71,900	45.00	3,235,500.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	5.81	569,380.00	
	ROBINSONS LAND CO	22,000	24.65	542,300.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	100,100	39.50	3,953,950.00	
	GLOBE TELECOM INC	430	1,996.00	858,280.00	
PLDT INC	870	1,185.00	1,030,950.00		
ABOITIZ POWER CORP	16,000	35.60	569,600.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	1,400	387.00	541,800.00		
	フィリピンペソ 小計	598,024		28,316,448.00 (59,464,540)	

インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,425.00	215,032,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	4,100.00	164,000,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	16,100	28,000.00	450,800,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	9,800.00	263,620,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,900	21,050.00	292,595,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	11,750.00	176,250,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	30,700	13,675.00	419,822,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	5,325.00	98,512,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	182,800	7,250.00	1,325,300,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	36,000	1,745.00	62,820,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	71,900	7,750.00	557,225,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,700	85,900.00	403,730,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	3,800.00	346,180,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	15,500	10,325.00	160,037,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	30,000	7,400.00	222,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	14,300	49,250.00	704,275,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	220,000	1,515.00	333,300,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	91,500	27,450.00	2,511,675,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	22,000	8,950.00	196,900,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	170,000	7,450.00	1,266,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	71,300	9,600.00	684,480,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	517,500	4,060.00	2,101,050,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	2,520.00	65,520,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	1,450.00	95,700,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	97,000	695.00	67,415,000.00		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	433,400	3,820.00	1,655,588,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	13,000	4,200.00	54,600,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	81,000	2,360.00	191,160,000.00		
	インドネシアルピア 小計	2,567,000		15,086,088,000.00	(117,671,486)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	590	53,400.00	31,506,000.00	
	S-OIL CORP	428	96,100.00	41,130,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	588	195,500.00	114,954,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	800	22,050.00	17,640,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	45,650.00	35,926,550.00	

KOREA ZINC CO LTD	85	461,500.00	39,227,500.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	110	93,100.00	10,241,000.00	
LG CHEM LTD	462	379,500.00	175,329,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	166	281,000.00	46,646,000.00	
OCI CO LTD	198	98,500.00	19,503,000.00	
POSCO	692	259,000.00	179,228,000.00	
POSCO CHEMTECH CO LTD	291	65,100.00	18,944,100.00	
CJ CORP	181	127,000.00	22,987,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	296	94,300.00	27,912,800.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	582	5,010.00	2,915,820.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	27,950.00	14,366,300.00	
DOOSAN BOBCAT INC	580	30,600.00	17,748,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	531	41,650.00	22,116,150.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	48,900.00	13,643,100.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	760	51,500.00	39,140,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	367	126,000.00	46,242,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	97	340,000.00	32,980,000.00	
KCC CORP	65	316,000.00	20,540,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	777	36,700.00	28,515,900.00	
LG CORP	799	78,300.00	62,561,700.00	
LOTTE CORP	242	49,150.00	11,894,300.00	
POSCO DAEWOO CORP.	500	18,000.00	9,000,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	642	107,500.00	69,015,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	16,100.00	25,824,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	4,450	8,740.00	38,893,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	264	276,000.00	72,864,000.00	
S-1 CORPORATION	210	97,800.00	20,538,000.00	
CJ LOGISTICS	36	173,000.00	6,228,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	133	125,000.00	16,625,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	594	32,600.00	19,364,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	950	4,210.00	3,999,500.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	637	41,250.00	26,276,250.00	
HANON SYSTEMS	2,300	11,650.00	26,795,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	667	214,500.00	143,071,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,462	123,500.00	180,557,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	79,500.00	19,080,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,425	34,500.00	83,662,500.00	
COWAY CO LTD	400	96,900.00	38,760,000.00	
FILA KOREA LTD	546	73,200.00	39,967,200.00	
HLB INC	309	80,200.00	24,781,800.00	
LG ELECTRONICS INC	892	76,100.00	67,881,200.00	
KANGWON LAND INC	1,025	32,350.00	33,158,750.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	320	24,150.00	7,728,000.00	
KAKAO CORP	472	104,000.00	49,088,000.00	
NAVER CORP	1,234	127,000.00	156,718,000.00	
NCSOFT CORP	162	478,000.00	77,436,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	263	115,500.00	30,376,500.00	
PEARL ABYSS CORP	40	162,300.00	6,492,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	226,500.00	25,594,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	254	93,700.00	23,799,800.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	183	104,500.00	19,123,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	83	188,000.00	15,604,000.00	
SHINSEGAE INC	79	326,000.00	25,754,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	99	214,000.00	21,186,000.00	
E-MART INC	200	177,000.00	35,400,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	101	37,950.00	3,832,950.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	85	326,000.00	27,710,000.00	
KT&G CORP	1,063	106,000.00	112,678,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	185	98,000.00	18,130,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	747,000.00	9,711,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	323	193,000.00	62,339,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	390	71,200.00	27,768,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	97	1,389,000.00	134,733,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	533	70,100.00	37,363,300.00	
CELLTRION INC	792	199,500.00	158,004,000.00	
CELLTRION PHARM INC	60	59,600.00	3,576,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	66	458,500.00	30,261,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	77	77,300.00	5,952,100.00	
MEDY-TOX INC	46	546,100.00	25,120,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	154	338,500.00	52,129,000.00	

SILLAJEN INC	564	69,200.00	39,028,800.00
VIROMED CO LTD	138	281,300.00	38,819,400.00
YUHAN CORP	99	240,500.00	23,809,500.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	1,900	6,950.00	13,205,000.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	750	8,660.00	6,495,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	2,731	37,000.00	101,047,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	14,200.00	36,792,200.00
KB FINANCIAL GROUP INC	3,821	42,500.00	162,392,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,108	43,250.00	177,671,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,112	14,050.00	57,773,600.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	434	64,700.00	28,079,800.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,101	7,550.00	30,962,550.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	13,200.00	20,328,000.00
SAMSUNG CARD CO	180	34,000.00	6,120,000.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	698	33,900.00	23,662,200.00
DB INSURANCE CO LTD	482	70,600.00	34,029,200.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	4,070.00	16,780,610.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	720	38,600.00	27,792,000.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	200	37,000.00	7,400,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	282	300,500.00	84,741,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	651	87,100.00	56,702,100.00
SAMSUNG SDS CO LTD	321	232,500.00	74,632,500.00
LG DISPLAY CO LTD	2,274	20,800.00	47,299,200.00
LG INNOTEK CO LTD	160	111,000.00	17,760,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	524	102,500.00	53,710,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	45,820	46,550.00	2,132,921,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	5,200	37,850.00	196,820,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	500	214,500.00	107,250,000.00
KT CORP	75	27,950.00	2,096,250.00
LG UPLUS CORP	886	15,050.00	13,334,300.00
SK TELECOM	190	252,000.00	47,880,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,125	31,950.00	67,893,750.00
KOREA GAS CORPORATION	225	47,400.00	10,665,000.00
SK HYNIX INC	5,355	76,100.00	407,515,500.00
	136,920		7,437,198,730.00

	韓国ウォン 小計			(721,408,276)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	115.50	1,386,000.00
	ASIA CEMENT CORP	22,000	39.50	869,000.00
	CHINA STEEL CORP	115,000	25.00	2,875,000.00
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	34,000	109.00	3,706,000.00
	FORMOSA PLASTICS CORP	41,000	107.50	4,407,500.00
	NAN YA PLASTICS CORP	50,000	77.00	3,850,000.00
	TAIWAN CEMENT	43,100	38.70	1,667,970.00
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	393.00	393,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	32,000	31.30	1,001,600.00
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,050	271.00	555,550.00
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	9.87	167,790.00
	EVA AIRWAYS CORP	9,733	15.20	147,941.60
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,550	12.25	141,487.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	21,000	35.05	736,050.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	19,000	42.95	816,050.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	430.50	869,610.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,000	219.50	878,000.00
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	4,000	36.45	145,800.00
	GIANT MANUFACTURING	2,000	207.50	415,000.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	275.00	275,000.00
	POU CHEN	23,000	38.25	879,750.00
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	81.20	194,880.00
	TATUNG CO LTD	21,000	25.65	538,650.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	370.00	740,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	297.00	1,485,000.00
	STANDARD FOODS CORP	3,120	51.30	160,056.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	44,000	73.90	3,251,600.00
	TAIMED BIOLOGICS INC	2,000	172.00	344,000.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	41,348	18.20	752,533.60
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	107,000	10.20	1,091,400.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	171,000	20.90	3,573,900.00
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	90,830	23.60	2,143,588.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	92,477	21.10	1,951,264.70	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	72,810	19.25	1,401,592.50	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	100,000	28.00	2,800,000.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	83,995	11.20	940,744.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	86,630	13.85	1,199,825.50
TAIWAN BUSINESS BANK	22,139	11.80	261,240.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	83,754	19.45	1,629,015.30
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	32,000	47.55	1,521,600.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,200	123.00	1,377,600.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	96,000	17.55	1,684,800.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	70,000	46.20	3,234,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	27.15	714,588.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	57,000	46.40	2,644,800.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	99,835	9.12	910,495.20
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	10,000	49.25	492,500.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	4,320	48.25	208,440.00
ACER INC	31,000	20.30	629,300.00
ADVANTECH CO LTD	3,000	259.00	777,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	228.00	1,596,000.00
AU OPTRONICS CORP	86,000	11.60	997,600.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	231.00	1,617,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	9,015	69.90	630,148.50
COMPAL ELECTRONICS	49,000	19.10	935,900.00
DELTA ELECTRONICS INC	19,000	161.50	3,068,500.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	10,000	62.60	626,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	123,800	73.00	9,037,400.00
INNOLUX CORP	91,000	10.10	919,100.00
INVENTEC CORP	27,000	24.05	649,350.00
LARGAN PRECISION CO LTD	500	4,665.00	2,332,500.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	22,000	44.85	986,700.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	85.60	599,200.00
PEGATRON CORP	19,000	52.10	989,900.00
QUANTA COMPUTER INC	26,000	56.50	1,469,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	11,000	37.20	409,200.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	194.50	583,500.00
WISTRON CORP	21,951	21.75	477,434.25
WPG HOLDINGS LTD	15,960	39.90	636,804.00

	YAGEO CORPORATION	2,198	331.00	727,538.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	91.70	550,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	37,000	108.50	4,014,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	15,000	73.30	1,099,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	15,000	110.00	1,650,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	32,000	65.90	2,108,800.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	306.00	612,000.00	
	MEDIATEK INC	14,000	284.00	3,976,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	63.10	757,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	191.00	1,146,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	278.50	278,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	8,000	73.10	584,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	180.00	900,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	227,000	248.50	56,409,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	11.80	1,345,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	10,000	68.20	682,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	200.50	401,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	37,000	14.90	551,300.00	
	新台湾ドル 小計	3,039,055		171,193,786.85 (611,161,819)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,346	378.95	2,783,766.70	
	COAL INDIA LTD	6,701	231.95	1,554,296.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,166	268.35	1,922,996.10	
	INDIAN OIL CORP LTD	16,201	157.05	2,544,367.05	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	10,649	152.35	1,622,375.15	
	PETRONET LNG LTD	6,627	241.75	1,602,077.25	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	26,239	1,341.75	35,206,178.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,028	229.85	925,835.80	
	ASIAN PAINTS LTD	2,681	1,471.25	3,944,421.25	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,105	820.10	2,546,410.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	11,115	209.10	2,324,146.50	
	JSW STEEL LTD	7,943	285.75	2,269,712.25	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	839	1,185.00	994,215.00	
	SHREE CEMENT LTD	58	18,118.25	1,050,858.50	
	TATA STEEL LTD	3,407	518.40	1,766,188.80	

ULTRATECH CEMENT LTD	895	3,929.75	3,517,126.25
UPL LTD	3,443	934.95	3,219,032.85
VEDANTA LTD	12,337	173.90	2,145,404.30
ASHOK LEYLAND LTD	8,200	89.60	734,720.00
HAVELLS INDIA LTD	2,526	758.05	1,914,834.30
LARSEN & TOUBRO LTD	4,340	1,394.70	6,052,998.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	5,155	360.75	1,859,666.25
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,335	513.70	685,789.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	850	1,427.05	1,212,992.50
BAJAJ AUTO LTD	800	2,949.75	2,359,800.00
BHARAT FORGE LTD	1,306	494.60	645,947.60
BOSCH LTD	73	18,287.05	1,334,954.65
EICHER MOTORS LTD	124	21,446.85	2,659,409.40
HERO MOTOCORP LTD	370	2,603.30	963,221.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	6,761	678.80	4,589,366.80
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	950	6,552.70	6,225,065.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,741	147.00	990,927.00
TATA MOTORS LTD	14,842	175.40	2,603,286.80
PAGE INDUSTRIES LTD	54	23,702.55	1,279,937.70
TITAN CO LTD	2,932	1,102.55	3,232,676.60
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	4,637	434.85	2,016,399.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,191	1,503.70	1,790,906.70
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	564	3,098.60	1,747,610.40
ITC LTD	32,062	298.20	9,560,888.40
NESTLE INDIA LTD	220	10,600.65	2,332,143.00
UNITED SPIRITS LTD	2,147	565.10	1,213,269.70
DABUR INDIA LTD	5,088	425.05	2,162,654.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,395	699.75	2,375,651.25
HINDUSTAN UNILEVER LTD	6,068	1,678.05	10,182,407.40
MARICO LTD	4,549	339.65	1,545,067.85
AUROBINDO PHARMA LTD	2,579	768.30	1,981,445.70
CADILA HEALTHCARE LTD	870	332.85	289,579.50
CIPLA LTD	3,351	526.80	1,765,306.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	700	1,663.65	1,164,555.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,084	2,751.30	2,982,409.20

	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	600	645.25	387,150.00	
	LUPIN LTD	1,640	743.20	1,218,848.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	800	2,600.70	2,080,560.00	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	7,697	473.25	3,642,605.25	
	AXIS BANK LTD	18,190	757.05	13,770,739.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	15,263	1,981.55	30,244,397.65	
	ICICI BANK LTD	21,463	391.80	8,409,203.40	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	2,636	727.00	1,916,372.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	3,282	528.15	1,733,388.30	
	STATE BANK OF INDIA	16,376	298.05	4,880,866.80	
	YES BANK LTD	15,733	252.60	3,974,155.80	
	BAJAJ FINANCE LTD	1,607	2,836.65	4,558,496.55	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,300	416.05	956,915.00	
	REC LTD	3,000	140.95	422,850.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,483	1,198.55	1,777,449.65	
	BAJAJ FINSERV LTD	358	6,960.05	2,491,697.90	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	5,023	1,024.85	5,147,821.55	
	INFOSYS LTD	32,785	743.10	24,362,533.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	8,519	2,005.65	17,086,132.35	
	TECH MAHINDRA LTD	4,321	788.75	3,408,188.75	
	WIPRO LTD	13,798	260.55	3,595,068.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	12,772	331.55	4,234,556.60	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	316.10	758,640.00	
	VODAFONE IDEA LTD	14,000	32.20	450,800.00	
	GAIL INDIA LTD	7,475	348.95	2,608,401.25	
	NTPC LTD	22,279	134.65	2,999,867.35	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	14,819	198.50	2,941,571.50	
	TATA POWER CO LTD	14,068	72.55	1,020,633.40	
	インドルピー 小計	521,331		305,475,208.25 (488,760,333)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	1,800	121.50	218,700.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	1,440	43.03	61,963.20	
	MASRAF AL RAYAN	3,700	36.90	136,530.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,201	150.20	180,390.20	
	QATAR NATIONAL BANK	4,180	178.10	744,458.00	

	QATAR INSURANCE CO	1,130	34.94	39,482.20
	BARWA REAL ESTATE CO	2,143	35.94	77,019.42
	EZDAN HOLDING GROUP	7,870	11.64	91,606.80
	OOREDOO QPSC	580	65.98	38,268.40
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	500	170.30	85,150.00
	カタールリアル 小計	24,544		1,673,568.22 (50,608,702)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,451	165.31	405,174.81
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	320	835.00	267,200.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	3,882	205.83	799,032.06
	GOLD FIELDS LTD	8,800	59.00	519,200.00
	KUMBA IRON ORE LTD	750	394.00	295,500.00
	MONDI LTD	1,146	328.36	376,300.56
	SAPPI LIMITED	5,098	66.88	340,954.24
	SASOL LTD	5,403	452.00	2,442,156.00
	BIDVEST GROUP LTD	3,562	196.00	698,152.00
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,072	117.80	479,681.60
	NASPERS LTD-N SHS	4,072	3,278.00	13,348,016.00
	MR PRICE GROUP LTD	2,412	181.03	436,644.36
	THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	160.36	377,166.72
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	4,631	66.28	306,942.68
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	9,500	44.41	421,895.00
	BID CORP LTD	3,032	299.86	909,175.52
	CLICKS GROUP LTD	2,381	184.49	439,270.69
	PICK N PAY STORES LTD	2,165	65.51	141,829.15
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,022	154.08	619,709.76
	SPAR GROUP LIMITED/THE	1,400	187.87	263,018.00
	TIGER BRANDS LTD	1,537	263.15	404,461.55
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	27.07	345,494.41
	NETCARE LTD	7,437	24.67	183,470.79
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,629	91.09	330,565.61
ABSA GROUP LTD	6,561	151.88	996,484.68	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	391	1,322.89	517,249.99	
NEDBANK GROUP LTD	3,670	249.17	914,453.90	
STANDARD BANK GROUP LTD	11,461	183.00	2,097,363.00	

	FIRSTSTRAND LTD	31,907	61.00	1,946,327.00	
	INVESTEC LTD	2,200	84.59	186,098.00	
	PSG GROUP LTD	1,100	252.20	277,420.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,442	246.21	355,034.82	
	REMGRO LTD	4,835	186.41	901,292.35	
	RMB HOLDINGS LTD	6,716	72.90	489,596.40	
	DISCOVERY LTD	3,279	136.00	445,944.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	800	99.14	79,312.00	
	MMI HOLDINGS LTD	3,900	16.51	64,389.00	
	OLD MUTUAL LTD	44,402	21.90	972,403.80	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,300	31.90	169,070.00	
	SANLAM LTD	17,083	72.78	1,243,300.74	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	3,590	122.10	438,339.00	
	MTN GROUP LTD	15,190	93.50	1,420,265.00	
	TELKOM SA SOC LTD	2,500	77.12	192,800.00	
	VODACOM GROUP LTD	5,505	116.20	639,681.00	
	南アフリカランド 小計	268,649		39,497,836.19	(298,998,619)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	21,748	9.50	206,606.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	13,700	4.82	66,034.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	26,833	15.04	403,568.32	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	26,700	1.88	50,196.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	8,000	1.38	11,040.00	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	9,000	3.88	34,920.00	
	EMAAR MALLS PJSC	9,000	1.76	15,840.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	34,480	4.68	161,366.40	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	16,189	16.92	273,917.88	
	アラブディルハム 小計	165,650		1,223,488.60	(36,667,953)
オフショア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	3,200	5.98	19,136.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	500	21.13	10,565.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	4.46	4,906.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	6.08	3,040.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	2,100	7.77	16,317.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	700	9.00	6,300.00	

SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	7.97	2,391.00
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	6.31	2,524.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	4.32	9,072.00
ANGANG STEEL CO LTD-A	600	5.89	3,534.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	500	37.35	18,675.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	2,000	7.41	14,820.00
BBMG CORPORATION-A	900	4.45	4,005.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	800	4.78	3,824.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	11.56	5,780.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	300	18.48	5,544.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	3.49	5,235.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	3,900	1.91	7,449.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	16.05	4,815.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	29.58	5,916.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	7.07	2,828.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	4.07	2,849.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	11.93	4,772.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	300	32.00	9,600.00
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	5.13	2,565.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	5.55	3,330.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	36.98	7,396.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.65	3,975.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	200	38.74	7,748.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	12.56	5,024.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.57	3,428.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,800	3.59	6,462.00
AECC AVIATION POWER CO-A	200	26.70	5,340.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	17.19	6,876.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	33.28	3,328.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	16.69	1,669.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	12.80	3,840.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	7.28	3,640.00
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	200	14.00	2,800.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	6.68	3,340.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	1,300	11.70	15,210.00

CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	4,900	5.32	26,068.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	26.18	2,618.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,800	6.25	30,000.00	
CRRC CORP LTD-A	2,200	9.24	20,328.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	10.83	6,498.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	200	22.93	4,586.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	600	24.50	14,700.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	3.64	6,552.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	500	21.74	10,870.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,000	5.89	5,890.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	800	12.87	10,296.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	6.14	4,912.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	7.51	2,253.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	11.25	4,500.00	
TBEA CO LTD-A	400	8.53	3,412.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	800	11.60	9,280.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	4.50	4,950.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.15	2,745.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	16.05	6,420.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	26.68	5,336.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.31	2,862.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	4.57	4,113.00	
TUS-SOUND ENVIRONMEN-RES A	200	15.16	3,032.00	
AIR CHINA LTD-A	800	9.86	7,888.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	6.39	8,307.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	8.23	9,053.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	3.11	4,665.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	5.27	6,324.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	2,100	8.51	17,871.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	3.89	3,890.00	
S F HOLDING CO LTD-A	200	34.54	6,908.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	100	59.95	5,995.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	7.25	7,250.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	38.29	3,829.00	
BYD CO LTD -A	200	57.00	11,400.00	

CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	200	24.44	4,888.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	8.77	4,385.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	24.23	4,846.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	12.12	2,424.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	300	20.35	6,105.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	900	26.24	23,616.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	17.17	1,717.00
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	7.01	2,804.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	24.68	2,468.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	400	46.16	18,464.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	28.36	2,836.00
HEILAN HOME CO LTD -A	200	9.82	1,964.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	900	48.60	43,740.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	107.90	10,790.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	700	16.67	11,669.00
TCL CORP-A	1,900	4.04	7,676.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	11.71	4,684.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	300	64.25	19,275.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.34	8,074.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	17.94	3,588.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	13.47	2,694.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	16.80	1,680.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	6.77	3,385.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	24.11	4,822.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	34.70	3,470.00
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	300	13.17	3,951.00
WUHU SHUNRONG SANQI INTERA-A	200	14.50	2,900.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	5.22	2,610.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	15.25	3,050.00
SUNING.COM CO LTD-A	1,300	12.70	16,510.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	1,100	8.60	9,460.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	5.17	2,585.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	300	77.81	23,343.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	400	25.78	10,312.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	700	27.92	19,544.00

JIANGSU YANGHE BREWERY -A	200	118.92	23,784.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	200	794.00	158,800.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	200	61.03	12,206.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	200	54.65	10,930.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	500	12.42	6,210.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	100	57.69	5,769.00	
TONGWEI CO LTD-A	400	11.81	4,724.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	40.19	4,019.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	500	86.05	43,025.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	200	33.54	6,708.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	16.33	3,266.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	400	18.38	7,352.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	23.06	4,612.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	30.07	6,014.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	28.69	2,869.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	48.23	4,823.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	39.32	7,864.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	500	73.13	36,565.00	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A	700	10.93	7,651.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	200	29.40	5,880.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	29.76	5,952.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	28.70	2,870.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	27.90	5,580.00	
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	22.87	4,574.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	18.85	3,770.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	200	86.02	17,204.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	100	108.80	10,880.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,500	3.72	31,620.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,500	6.27	15,675.00	
BANK OF CHINA LTD-A	5,400	3.80	20,520.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	4,400	6.39	28,116.00	
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	200	13.18	2,636.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	8.73	4,365.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	1,200	7.08	8,496.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	900	8.00	7,200.00	

BANK OF NINGBO CO LTD -A	500	20.68	10,340.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	1,200	12.02	14,424.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	6.30	3,780.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,000	7.03	7,030.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	4,300	4.11	17,673.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	2,500	32.35	80,875.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,900	6.42	25,038.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,400	8.31	11,634.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	6,000	5.58	33,480.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	2,500	18.10	45,250.00	
PING AN BANK CO LTD-A	1,700	12.59	21,403.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,500	11.39	39,865.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	7.35	3,675.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	6.01	5,409.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	7.58	6,064.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	600	17.52	10,512.00	
CITIC SECURITIES CO-A	1,100	24.80	27,280.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	13.82	2,764.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	13.26	5,304.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.84	3,920.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	800	7.64	6,112.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	800	16.73	13,384.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	13.45	8,070.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	800	19.87	15,896.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	10.36	5,180.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	800	13.97	11,176.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.11	2,844.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	700	22.94	16,058.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	11.80	3,540.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	7.23	5,061.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	600	12.02	7,212.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	13.99	8,394.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	8.93	3,572.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,600	5.66	14,716.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	10.70	3,210.00	

SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	10.06	3,018.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	11.92	5,960.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	300	28.89	8,667.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	700	33.14	23,198.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	6.99	4,194.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	300	55.55	16,665.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	1,300	74.72	97,136.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	400	31.27	12,508.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	900	22.62	20,358.00
CHINA VANKE CO LTD -A	1,400	29.19	40,866.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	8.37	3,348.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	300	41.82	12,546.00
GEMDALE CORP-A	600	13.36	8,016.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	7.74	9,288.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	6.64	4,648.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	1,700	13.94	23,698.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	10.88	6,528.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.89	4,668.00
YOUNGOR GROUP CO-A	500	9.18	4,590.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	800	4.72	3,776.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	26.57	7,971.00
AISINO CORP-A	200	28.36	5,672.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	33.41	3,341.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	9.13	3,652.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	100	86.39	8,639.00
IFLYTEK CO LTD - A	300	36.41	10,923.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	600	6.16	3,696.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	200	35.03	7,006.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	4,700	4.07	19,129.00
DONGXU OPTOELECTRONIC TECH-A	800	6.26	5,008.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,700	6.94	11,798.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	700	15.09	10,563.00
GOERTEK INC -A	500	10.15	5,075.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.96	2,988.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	1,300	34.60	44,980.00

HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	21.73	4,346.00	
NINESTAR CORP-A	100	33.10	3,310.00	
O-FILM TECH CO LTD-A	400	14.61	5,844.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	16.39	4,917.00	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	100	43.92	4,392.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	16.93	6,772.00	
ZTE CORP-A	500	28.22	14,110.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	3,400	7.00	23,800.00	
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	800	4.28	3,424.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,800	6.23	11,214.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	2,200	17.12	37,664.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.74	7,672.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.40	5,720.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	6.59	5,272.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	4.34	2,604.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.51	9,361.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.74	4,018.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	6.77	3,385.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.64	6,748.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	1,400	4.93	6,902.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	200	25.89	5,178.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	300	15.33	4,599.00	
オフショア人民元 小計	206,000		2,519,841.00 (41,149,003)	
合 計	22,908,702		5,348,241,756 (5,348,241,756)	

(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	867,312.00	
		メキシコペソ 小計	31,700	867,312.00 (4,987,044)	

南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	232,199.00	
	FORTRESS REIT LTD-B	8,600	99,588.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	22,964	556,417.72	
	HYPROP INVESTMENTS LTD	2,850	210,985.50	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	51,557	493,400.49	
	RESILIENT REIT LTD	2,600	144,846.00	
南アフリカランド 小計		100,671	1,737,436.71	(13,152,395)
合計			18,139,439	(18,139,439)

(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 49銘柄	100.0%		12.2%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.5%		2.5%
	投資証券 1銘柄		3.5%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%		7.1%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%		1.0%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%		0.5%
ユーロ	株式 6銘柄	100.0%		0.2%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%		0.6%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式 20銘柄	100.0%		1.2%
香港ドル	株式 204銘柄	100.0%		24.1%
マレーシアリングット	株式 44銘柄	100.0%		2.2%
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%		1.1%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%		2.2%
韓国ウォン	株式 109銘柄	100.0%		13.4%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		11.4%

インドルピー	株式	78銘柄	100.0%		9.1%
カタールリアル	株式	10銘柄	100.0%		0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	95.8%		5.6%
	投資証券	6銘柄		4.2%	0.2%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%		0.7%
オフショア人民元	株式	238銘柄	100.0%		0.8%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	938,091,109
投資証券	13,223,738,500
派生商品評価勘定	9,786,224
未収入金	361,296,040
未収配当金	109,141,209
差入委託証拠金	6,800,000
流動資産合計	14,648,853,082
資産合計	14,648,853,082
負債の部	
流動負債	
前受金	12,127,600
未払金	499,868,950
未払解約金	372,850,000
未払利息	2,544
流動負債合計	884,849,094
負債合計	884,849,094
純資産の部	
元本等	
元本	11,074,952,278
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,689,051,710

2019年 3月25日現在

元本等合計	13,764,003,988
純資産合計	13,764,003,988
負債純資産合計	14,648,853,082

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 3月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	13,715,761,982円
期中追加設定元本額	12,919,463,851円
期中一部解約元本額	15,560,273,555円
期末元本額	11,074,952,278円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	433,921,913円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	428,441,486円
りそなラップ型ファンド(成長型)	338,633,281円
DCりそな グローバルバランス	4,782,710円
つみたてバランスファンド	175,894,175円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	29,602,165円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	10,555,879円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	6,848,680円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,436,197,257円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,675,027,794円
Smart-i リートインデックス	652,069,508円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,958,841円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	10,523,451円

Smart-i 8資産バランス 成長型	14,580,384円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	63,385,524円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,791,669,297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）	859,933円
2. 計算日における受益権の総数	11,074,952,278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	1.2428円
(10,000口当たり純資産額)	(12,428円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3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 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		392,665,828
合計		392,665,828

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2019年 3月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	500,349,776	-	510,136,000	9,786,224
合計		500,349,776	-	510,136,000	9,786,224

(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	470	266,020,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,594	162,428,600	
	森ヒルズリート投資法人	1,622	233,081,400	
	産業ファンド投資法人	1,648	200,067,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,379	426,111,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	874	157,844,400	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	743	344,380,500	
	GLP投資法人	3,505	411,136,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	587	174,808,600	
	日本プロロジスリート投資法人	1,897	445,415,600	
	星野リゾート・リート投資法人	215	116,745,000	
	Oneリート投資法人	206	57,577,000	
	イオンリート投資法人	1,452	190,938,000	
	ヒューリックリート投資法人	1,144	208,894,400	
	日本リート投資法人	457	192,397,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	8,385	144,054,300	
	日本ヘルスケア投資法人	65	11,284,000	
	積水ハウス・リート投資法人	3,650	303,315,000	
	トーセイ・リート投資法人	272	31,552,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	518	144,418,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	296	33,270,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	283	27,451,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,401	697,558,500	
いちごホテルリート投資法人	247	32,826,300		
ラサールロジポート投資法人	1,067	114,595,800		

スターアジア不動産投資法人	439	47,192,500	
マリモ地方創生リート投資法人	122	13,395,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	343	119,878,500	
大江戸温泉リート投資法人	228	19,266,000	
さくら総合リート投資法人	306	26,071,200	
投資法人みらい	381	75,285,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	332	44,687,200	
三菱地所物流リート投資法人	150	38,100,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	142	15,364,400	
ザイマックス・リート投資法人	130	15,392,000	
タカラレーベン不動産投資法人	212	19,461,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	219	20,739,300	
日本ビルファンド投資法人	1,370	1,005,580,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,415	925,410,000	
日本リテールファンド投資法人	2,674	589,617,000	
オリックス不動産投資法人	2,819	535,046,200	
日本プライムリアルティ投資法人	895	402,750,000	
プレミア投資法人	1,345	183,189,000	
東急リアル・エステート投資法人	948	163,245,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	904	121,226,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,120	542,568,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,011	176,621,700	
インヴィンシブル投資法人	4,880	257,664,000	
フロンティア不動産投資法人	481	222,703,000	
平和不動産リート投資法人	881	112,679,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	924	217,047,600	
福岡リート投資法人	732	123,122,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	438	336,384,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,174	122,448,200	
大和証券オフィス投資法人	326	257,540,000	
阪急阪神リート投資法人	636	93,810,000	
スターツプロシード投資法人	223	38,222,200	
大和ハウスリート投資法人	1,898	461,403,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,553	406,582,900	
日本賃貸住宅投資法人	1,591	141,758,100	
ジャパンエクセレント投資法人	1,267	204,113,700	
合計	76,486	13,223,738,500	

(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 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	34,419,925
コール・ローン	24,145,411
投資証券	12,814,560,256
未収入金	353,233,309
未収配当金	30,081,445
流動資産合計	13,256,440,346
資産合計	13,256,440,346
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,425,828
未払金	158,581,558
未払解約金	221,060,000
未払利息	65
流動負債合計	382,067,451
負債合計	382,067,451
純資産の部	
元本等	
元本	11,637,116,981
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,237,255,914
元本等合計	12,874,372,895
純資産合計	12,874,372,895
負債純資産合計	13,256,440,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 3月27日
期首元本額	8,619,248,602円
期中追加設定元本額	9,379,325,464円
期中一部解約元本額	6,361,457,085円
期末元本額	11,637,116,981円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	457,580,759円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	819,729,122円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,358,688,927円
DCりそな グローバルバランス	5,025,799円
つみたてバランスファンド	97,874,487円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	36,959,199円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	12,712,418円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	8,716,279円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,849,332,293円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,421,828,500円
Smart-i 先進国リートインデックス	395,252,934円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,192,770円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	11,640,589円
Smart-i 8資産バランス 成長型	18,852,092円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	139,461,629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)	1,269,184円
2. 計算日における受益権の総数	11,637,116,981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	1.1063円
(10,000口当たり純資産額)	(11,063円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2019年 3月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年 3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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券	734,094,791	
合計	734,094,791	

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2019年 3月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	155,069,968	-	152,644,140	2,425,828
	米ドル	112,216,367	-	110,558,640	1,657,727
	カナダドル	2,931,110	-	2,862,650	68,460
	ユーロ	11,403,081	-	11,168,100	234,981
	英ポンド	7,979,983	-	7,828,380	151,603
	オーストラリアドル	11,047,875	-	10,880,650	167,225
	香港ドル	5,116,636	-	5,040,000	76,636
	シンガポールドル	4,374,916	-	4,305,720	69,196
合計	155,069,968	-	152,644,140	2,425,828	

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	7,795	210,309.10	
		AGREE REALTY CORP	3,596	244,276.28	
		ALEXANDER'S INC	354	128,509.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,033	1,563,596.76	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,623	163,433.53	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	13,192	617,385.60	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	5,269	56,641.75	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	24,790	560,006.10	
		AMERICOLD REALTY TRUST	14,398	435,539.50	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14,696	734,506.08	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	21,327	343,791.24	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,194	37,774.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,526	2,699,654.34	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,220	23,088.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,110	1,987,116.10	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	2,809	34,101.26	
BRANDYWINE REALTY TRUST	17,004	262,881.84	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28,869	518,198.55	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	10,132	206,794.12	
BRT APARTMENTS CORP	877	12,041.21	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9,459	944,102.79	
CARETRUST REIT INC	8,774	205,574.82	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	31,320.45	
CEDAR REALTY TRUST INC	7,920	26,532.00	
CHATHAM LODGING TRUST	4,397	81,652.29	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5,871	164,446.71	
CITY OFFICE REIT INC	4,306	47,064.58	
CLIPPER REALTY INC	1,350	17,496.00	
COLONY CAPITAL INC	46,665	247,791.15	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	11,236	250,001.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,743	60,185.79	
CORECIVIC INC	11,380	218,382.20	
CORESITE REALTY CORP	3,637	382,321.44	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10,955	297,318.70	
COUSINS PROPERTIES INC	41,479	409,812.52	
CUBESMART	18,197	584,123.70	
CYRUSONE INC	10,478	546,322.92	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20,078	216,641.62	
DIGITAL REALTY TRUST INC	20,320	2,420,518.40	
DOUGLAS EMMETT INC	15,894	637,508.34	
DUKE REALTY CORP	35,153	1,078,142.51	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,800	103,646.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,590	394,541.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13,378	211,104.84	
EPR PROPERTIES	7,384	561,331.68	
EQUITY COMMONWEALTH	12,021	391,884.60	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,744	995,941.60	
EQUITY RESIDENTIAL	36,126	2,687,774.40	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	3,432	65,173.68	

ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,419	1,866,067.49	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,424	1,249,978.64	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	19,521.41	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,292	980,919.84	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12,448	430,327.36	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,530	189,043.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	10,254	71,880.54	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	5,075	48,872.25	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,838	740,949.30	
GEO GROUP INC/THE	11,649	221,214.51	
GETTY REALTY CORP	3,143	99,255.94	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,864	58,654.72	
GLADSTONE LAND CORP	1,113	13,500.69	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,216	21,340.08	
GLOBAL NET LEASE INC	8,193	153,618.75	
HCP INC	46,749	1,479,605.85	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	12,365	393,454.30	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	19,956	564,555.24	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,693	64,516.71	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,015	461,290.90	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	16,171	420,931.13	
HOST HOTELS & RESORTS INC	72,522	1,363,413.60	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,918	513,328.38	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	8,733	91,783.83	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,230	123,603.20	
INFREIT INC	3,911	83,030.53	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	972	85,293.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,145	66,936.70	
INVITATION HOMES INC	29,087	698,669.74	
IRON MOUNTAIN INC	27,639	970,681.68	
JBG SMITH PROPERTIES	10,672	433,069.76	
KILROY REALTY CORP	9,919	754,835.90	
KIMCO REALTY CORP	40,963	742,659.19	
KITE REALTY GROUP TRUST	8,070	125,004.30	
LEXINGTON REALTY TRUST	20,100	183,513.00	

LIBERTY PROPERTY TRUST	14,362	690,955.82	
LIFE STORAGE INC	4,557	435,375.78	
LTC PROPERTIES INC	3,797	171,206.73	
MACERICH CO/THE	10,240	448,307.20	
MACK-CALI REALTY CORP	8,631	188,759.97	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	120,800	104,492.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,150	34,083.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36,996	685,905.84	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,139	1,202,343.66	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	8,718	113,857.08	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,861	859,348.98	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,400	150,660.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,182	327,157.86	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	8,795	44,766.55	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,025	76,099.50	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	4,845	83,043.30	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	4,608	128,056.32	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,047	741,338.06	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,420	42,046.20	
PARAMOUNT GROUP INC	19,407	275,967.54	
PARK HOTELS & RESORTS INC	19,619	610,150.90	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,628	392,857.08	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,885	35,898.50	
PHYSICIANS REALTY TRUST	18,036	341,060.76	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,231	248,044.68	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,092	61,625.52	
PROLOGIS INC	61,529	4,372,866.03	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,979	302,331.83	
PUBLIC STORAGE	14,640	3,251,836.80	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	5,367	237,972.78	
REALTY INCOME CORP	29,702	2,156,365.20	
REGENCY CENTERS CORP	16,417	1,085,327.87	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10,912	184,303.68	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	20,546	247,579.30	
RETAIL VALUE INC	1,429	45,413.62	

REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	9,381	330,117.39	
RLJ LODGING TRUST	16,776	295,928.64	
RPT REALTY	7,485	86,526.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,081	419,995.46	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	17,645	330,137.95	
SAFEHOLD INC	700	14,112.00	
SAUL CENTERS INC	1,066	53,534.52	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	22,608	266,322.24	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,601	115,562.43	
SIMON PROPERTY GROUP INC	30,164	5,357,126.40	
SITE CENTERS CORP	13,977	184,216.86	
SL GREEN REALTY CORP	8,222	737,677.84	
SPIRIT MTA REIT	4,253	30,451.48	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	8,519	321,847.82	
STAG INDUSTRIAL INC	10,905	314,064.00	
STORE CAPITAL CORP	19,068	632,104.20	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,908	108,888.92	
SUN COMMUNITIES INC	8,389	990,405.34	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22,656	322,621.44	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	8,979	183,351.18	
TAUBMAN CENTERS INC	6,064	315,691.84	
TERRENO REALTY CORP	6,044	249,919.40	
TIER REIT INC	5,135	130,839.80	
UDR INC	26,956	1,212,480.88	
UMH PROPERTIES INC	3,342	45,985.92	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,232	88,728.64	
URBAN EDGE PROPERTIES	10,919	202,656.64	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,951	60,170.89	
VENTAS INC	34,814	2,236,103.22	
VEREIT INC	94,970	800,597.10	
VICI PROPERTIES INC	34,869	763,631.10	
VORNADO REALTY TRUST	16,820	1,123,912.40	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	17,374	93,819.60	
WASHINGTON REIT	7,630	211,961.40	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11,855	336,326.35	

	WELLTOWER INC	37,743	2,937,160.26
	WHITESTONE REIT	3,672	43,549.92
	WP CAREY INC	15,771	1,226,510.67
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	10,874	211,825.52
	米ドル 小計	2,213,653	84,667,894.67 (9,305,848,303)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,984	246,359.12
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,199	68,932.88
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,176	88,672.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,301	378,191.80
	CHOICE PROPERTIES REIT	13,583	189,890.34
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9,139	109,211.05
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4,605	65,759.40
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,296	75,256.16
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8,371	116,022.06
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,081	60,006.61
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,868	70,581.48
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,269	145,102.55
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	13,632	317,080.32
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,648	80,201.60
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,549	85,020.81
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	759	15,233.13
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,123	38,214.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2,392	69,822.48
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,988	58,060.32
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,622	384,558.60
	SLATE OFFICE REIT	1,569	9,696.42
	SLATE RETAIL REIT - U	2,120	27,263.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,012	243,667.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,833	56,304.45
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,000	13,200.00
	カナダドル 小計	138,119	3,012,307.78 (246,406,776)
ユーロ	AEDIFICA	1,782	150,579.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	15,266	211,892.08

	ALTAREA	359	66,127.80
	BEFIMMO	2,148	111,910.80
	COFINIMMO	2,081	243,893.20
	COVIVIO	6,060	569,640.00
	EUROCOMMERCIAL PROPETIE-CV	3,966	101,767.56
	GECINA SA	5,297	692,847.60
	GREEN REIT PLC	64,291	95,279.26
	HAMBORNER REIT AG	7,124	66,253.20
	HIBERNIA REIT PLC	70,710	92,630.10
	ICADE	4,428	329,664.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,820	31,599.92
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	26,436	238,981.44
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,271	52,346.55
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33,867	52,832.52
	KLEPIERRE	20,321	623,041.86
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,602	57,319.08
	MERCIALYS	5,381	67,585.36
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	36,260	415,902.20
	MONTEA	737	52,621.80
	NSI NV	1,662	62,491.20
	RETAIL ESTATES	782	64,202.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,442	2,045,065.88
	VASTNED RETAIL NV	1,677	57,018.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,698	236,361.60
	WERELDHAVE NV	3,924	96,608.88
	ユーロ 小計	344,392	6,886,463.69 (854,541,279)
英ポンド	ASSURA PLC	228,810	130,421.70
	BIG YELLOW GROUP PLC	14,982	146,224.32
	BRITISH LAND CO PLC	94,821	559,633.54
	CAPITAL & REGIONAL PLC	46,200	11,434.50
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	61,927	58,830.65
	DERWENT LONDON PLC	10,924	346,290.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	58,846	54,079.47
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	27,498	206,564.97
	HAMMERSON PLC	74,198	252,644.19

	HANSTEEN HOLDINGS PLC	42,038	38,990.24	
	INTU PROPERTIES PLC	80,655	84,768.40	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	73,091	667,613.19	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	66,698	130,061.10	
	LXI REIT PLC	35,342	44,000.79	
	NEWRIVER REIT PLC	31,764	69,086.70	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	52,000	46,176.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	73,192	94,271.29	
	RDI REIT PLC	25,782	33,532.06	
	REGIONAL REIT LTD	30,560	31,537.92	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	20,913	123,386.70	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	57,640	31,702.00	
	SEGro PLC	106,213	702,280.35	
	SHAFTESBURY PLC	22,198	197,340.22	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	33,121	33,617.81	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	162,851	234,016.88	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	66,619	57,492.19	
	UNITE GROUP PLC	25,175	228,463.12	
	WORKSPACE GROUP PLC	12,504	123,351.96	
	英債券 小計	1,636,562	4,737,813.06 (686,888,137)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	32,226	120,525.24	
	APN INDUSTRIA REIT	5,250	15,067.50	
	ARENA REIT	23,166	65,328.12	
	BWP TRUST	47,352	172,361.28	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	22,680	79,606.80	
	CHARTER HALL GROUP	45,779	446,803.04	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	23,109	107,456.85	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	32,401	151,312.67	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	161,093	176,396.83	
	DEXUS	98,840	1,250,326.00	
	GDI PROPERTY GROUP	52,244	73,141.60	
	GOODMAN GROUP	156,498	2,095,508.22	
	GPT GROUP	175,743	1,075,547.16	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,685	110,742.75	

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	14,520	49,803.60
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	19,077	58,184.85
	MIRVAC GROUP	357,691	980,073.34
	NATIONAL STORAGE REIT	69,757	122,772.32
	RURAL FUNDS GROUP	29,734	68,388.20
	SCENTRE GROUP	520,500	2,123,640.00
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	85,748	218,657.40
	STOCKLAND	234,300	890,340.00
	VICINITY CENTRES	310,616	795,176.96
	VIVA ENERGY REIT	43,952	108,561.44
	オーストラリアドル 小計	2,588,961	11,355,722.17 (882,680,284)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	90,106	111,731.44
	GOODMAN PROPERTY TRUST	91,245	154,204.05
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	145,255	207,714.65
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	105,398	162,839.91
	STRIDE STAPLED GROUP	39,111	79,395.33
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	26,700	57,538.50
	ニュージーランドドル 小計	497,815	773,423.88 (58,486,313)
香港ドル	CHAMPION REIT	194,000	1,295,920.00
	FORTUNE REIT	136,000	1,358,640.00
	LINK REIT	205,900	18,129,495.00
	PROSPERITY REIT	124,000	425,320.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	103,000	599,460.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	132,000	722,040.00
	香港ドル 小計	894,900	22,530,875.00 (315,657,558)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	52,800	74,448.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	77,300	67,637.50
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	249,500	713,570.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	121,800	143,724.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	120,400	86,688.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	272,400	531,180.00
	CAPITALAND MALL TRUST	274,900	657,011.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	56,100	86,394.00

	CDL HOSPITALITY TRUSTS	67,600	110,188.00	
	ESR REIT	195,300	104,485.50	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	83,200	55,328.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	61,100	60,489.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	57,700	134,441.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	63,300	91,785.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	58,500	42,997.50	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	149,900	172,385.00	
	KEPPEL DC REIT	95,500	139,430.00	
	KEPPEL REIT	176,100	223,647.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	138,000	27,186.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	184,100	344,267.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	136,200	283,296.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	225,500	326,975.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	206,100	265,869.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	121,700	88,841.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,300	114,363.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	38,400	16,128.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	65,900	39,869.50	
	SPH REIT	68,600	71,344.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,500	96,950.00	
	SUNTEC REIT	218,400	428,064.00	
	シンガポールドル 小計	3,814,100	5,598,981.00 (454,917,206)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	23,985,000.00	
	韓国ウォン 小計	4,100	23,985,000.00 (2,326,545)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	14,365	224,237.65	
	イスラエルシュケル 小計	14,365	224,237.65 (6,807,855)	
合計			12,814,560,256 (12,814,560,256)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 158銘柄	100.0%	72.5%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.7%
英ポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 24銘柄	100.0%	6.8%
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%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

【中間財務諸表】

Smart - i 8資産バランス 安定型
Smart - i 8資産バランス 安定成長型
Smart - i 8資産バランス 成長型

- (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2期中間計算期間(2019年 3月26日から2019年 9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。

【Smart-i 8資産バランス 安定型】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	714,297	2,591,465
親投資信託受益証券	123,491,010	367,311,502
未収入金	-	1,000,000
流動資産合計	124,205,307	370,902,967
資産合計	124,205,307	370,902,967
負債の部		
流動負債		
未払解約金	286,817	2,147,984
未払受託者報酬	6,581	26,223
未払委託者報酬	45,997	183,507
未払利息	1	7
その他未払費用	3,198	11,056
流動負債合計	342,594	2,368,777
負債合計	342,594	2,368,777
純資産の部		
元本等		
元本	121,076,869	348,802,146
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,785,844	19,732,044
(分配準備積立金)	2,100,887	1,893,890
元本等合計	123,862,713	368,534,190
純資産合計	123,862,713	368,534,190
負債純資産合計	124,205,307	370,902,967

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2018年 3月27日 至 2018年 9月26日	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	106,849	8,867,492
営業収益合計	106,849	8,867,492
営業費用		
支払利息	-	654
受託者報酬	247	26,223
委託者報酬	1,697	183,507
その他費用	243	11,071
営業費用合計	2,187	221,455
営業利益又は営業損失（ ）	104,662	8,646,037
経常利益又は経常損失（ ）	104,662	8,646,037
中間純利益又は中間純損失（ ）	104,662	8,646,037
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（ ）	445	399,504
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	2,785,844
剰余金増加額又は欠損金減少額	189,843	9,478,151
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	189,843	9,478,151
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,454	778,484
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,454	778,484
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	292,606	19,732,044

(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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9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 100,000円	期首元本額 121,076,869円
期中追加設定元本額 124,039,157円	期中追加設定元本額 254,812,229円
期中一部解約元本額 3,062,288円	期中一部解約元本額 27,086,952円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 121,076,869口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 348,802,146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 1.0230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 1.0566円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,230円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,566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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,943,061	1,797,250
親投資信託受益証券	258,844,318	530,127,022
未収入金	-	6,520,000
流動資産合計	260,787,379	538,444,272
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,928	6,332,612
未払受託者報酬	15,133	43,146
未払委託者報酬	121,022	345,118
未払利息	5	4
その他未払費用	7,473	18,246
流動負債合計	148,561	6,739,126
負債合計	148,561	6,739,126
純資産の部		
元本等		
元本	253,849,322	501,196,874
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,789,496	30,508,272
（分配準備積立金）	3,670,270	3,375,982
元本等合計	260,638,818	531,705,146
純資産合計	260,638,818	531,705,146
負債純資産合計	260,787,379	538,444,272

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2018年 3月27日 至 2018年 9月26日	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	514,257	14,648,704
営業収益合計	514,257	14,648,704
営業費用		
支払利息	1	1,011
受託者報酬	444	43,146
委託者報酬	3,514	345,118
その他費用	309	18,282
営業費用合計	4,268	407,557
営業利益又は営業損失（ ）	509,989	14,241,147
経常利益又は経常損失（ ）	509,989	14,241,147
中間純利益又は中間純損失（ ）	509,989	14,241,147
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（ ）	999	596,407
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	6,789,496
剰余金増加額又は欠損金減少額	857,883	11,049,970
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	857,883	11,049,970
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,195	975,934
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,195	975,934
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,359,678	30,508,272

(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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9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 100,000円	期首元本額 253,849,322円
期中追加設定元本額 261,694,625円	期中追加設定元本額 279,198,271円
期中一部解約元本額 7,945,303円	期中一部解約元本額 31,850,719円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 253,849,322口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 501,196,874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 1.0267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 1.0609円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,267円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,609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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【Smart-i 8資産バランス 成長型】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,168,519	4,746,305
親投資信託受益証券	297,236,299	536,462,343
流動資産合計	298,404,818	541,208,648
資産合計	298,404,818	541,208,648
負債の部		
流動負債		
未払解約金	208,966	2,675,321
未払受託者報酬	18,978	45,715
未払委託者報酬	170,752	411,352
未払利息	3	12
その他未払費用	9,407	19,345
流動負債合計	408,106	3,151,745
負債合計	408,106	3,151,745
純資産の部		
元本等		
元本	290,279,634	508,225,408
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,717,078	29,831,495
（分配準備積立金）	5,893,078	5,228,401
元本等合計	297,996,712	538,056,903
純資産合計	297,996,712	538,056,903
負債純資産合計	298,404,818	541,208,648

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2018年 3月27日 至 2018年 9月26日	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	718,138	14,711,044
営業収益合計	718,138	14,711,044
営業費用		
支払利息	2	1,250
受託者報酬	661	45,715
委託者報酬	6,004	411,352
その他費用	424	19,392
営業費用合計	7,091	477,709
営業利益又は営業損失（ ）	711,047	14,233,335
経常利益又は経常損失（ ）	711,047	14,233,335
中間純利益又は中間純損失（ ）	711,047	14,233,335
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（ ）	1,334	447,752
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	7,717,078
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,439,588	9,788,466
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,439,588	9,788,466
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,347	1,459,632
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,347	1,459,632
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,125,622	29,831,495

(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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9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 100,000円	期首元本額 290,279,634円
期中追加設定元本額 298,702,333円	期中追加設定元本額 264,971,883円
期中一部解約元本額 8,522,699円	期中一部解約元本額 47,026,109円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 290,279,634口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 508,225,408口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0266円	3. 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 1.0587円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,266円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,587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1期 2019年 3月25日現在	第2期中間計算期間末 2019年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

「Smart-i 8資産バランス」の各ファンドは「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（為替ヘッジあり）」、「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 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	886,292
コール・ローン	426,691,300
国債証券	59,818,307,790
地方債証券	3,839,034,300
特殊債券	4,328,949,715
社債券	3,049,887,000
未収入金	340,000,000
未収利息	71,453,737

2019年 9月25日現在	
前払費用	5,610,533
流動資産合計	71,880,820,667
資産合計	71,880,820,667
負債の部	
流動負債	
未払金	443,287,600
未払解約金	1,840,000
未払利息	1,157
流動負債合計	445,128,757
負債合計	445,128,757
純資産の部	
元本等	
元本	66,510,549,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,925,142,444
元本等合計	71,435,691,910
純資産合計	71,435,691,910
負債純資産合計	71,880,820,667

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	63,710,013,442円
期中追加設定元本額	27,842,154,459円
期中一部解約元本額	25,041,618,435円
期末元本額	66,510,549,466円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,347,344,355円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,334,454,856円
りそなラップ型ファンド(成長型)	49,792,573円
DCりそな グローバルバランス	220,254,880円
つみたてバランスファンド	735,792,962円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	436,650,785円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	78,485,143円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	16,960,881円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,158,216円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	395,623円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	60,057円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,066円
FWりそな円建債券アクティブファンド	425,487,592円
FWりそな国内債券インデックスファンド	39,271,385,486円
Smart-i 国内債券インデックス	324,979,169円
Smart-i 8資産バランス 安定型	97,730,352円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	76,897,617円
Smart-i 8資産バランス 成長型	35,140,282円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,198,799,563円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,793,217,321円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	6,654,999,966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)	4,921,997円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	5,405,637,724円
2. 計算日における受益権の総数	66,510,549,466口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0741円
(10,000口当たり純資産額)	(10,741円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2019年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	341,909,680
コール・ローン	242,549,065
国債証券	143,206,413,631
派生商品評価勘定	262,455,583
未収入金	1,465,146,635
未収利息	579,502,080
前払費用	382,353,212
流動資産合計	146,480,329,886
資産合計	146,480,329,886
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,112,659,471
前受収益	69,287
未払金	1,817,112,032
未払解約金	4,591,000
未払利息	657
流動負債合計	2,934,432,447
負債合計	2,934,432,447
純資産の部	
元本等	
元本	137,539,586,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,006,310,820
元本等合計	143,545,897,439
純資産合計	143,545,897,439
負債純資産合計	146,480,329,886

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	65,475,061,200円
期中追加設定元本額	87,500,762,459円
期中一部解約元本額	15,436,237,040円
期末元本額	137,539,586,619円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	12,988,569,691円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,715,612,092円
りそなラップ型ファンド(成長型)	121,516,284円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	453,462,065円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	81,312,447円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	17,574,213円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,201,534円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	409,608円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	61,780円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,245円
FWりそな円建債券アクティブファンド	339,351,773円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	61,658,149,135円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	263,699,540円
Smart-i 8資産バランス 安定型	101,362,769円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	79,861,987円
Smart-i 8資産バランス 成長型	36,487,720円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	4,979,271,401円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	15,754,931,320円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	27,641,201,294円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,300,474,873円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,073,848円
2. 計算日における受益権の総数	137,539,586,619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	1.0437円
(10,000口当たり純資産額)	(10,437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 9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	<p>国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。</p> <p>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。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2019年 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	1,602,655,411	-	1,596,946,698	5,708,713
	米ドル	766,901,520	-	763,337,520	3,564,000
	カナダドル	34,896,533	-	34,764,462	132,071
	ユーロ	662,618,616	-	660,829,500	1,789,116

英ポンド	103,197,892	-	103,051,326	146,566
オーストラリアドル	35,040,850	-	34,963,890	76,960
売建	143,989,557,735	-	144,834,052,910	844,495,175
米ドル	68,742,824,787	-	69,126,324,960	383,500,173
カナダドル	2,767,688,381	-	2,787,394,680	19,706,299
メキシコペソ	1,069,689,549	-	1,107,431,280	37,741,731
ユーロ	55,190,344,393	-	55,292,506,200	102,161,807
英ポンド	9,025,723,854	-	9,251,701,200	225,977,346
スウェーデンクローナ	487,155,504	-	493,840,060	6,684,556
ノルウェークローネ	343,047,132	-	346,330,990	3,283,858
デンマーククローネ	758,808,840	-	760,627,800	1,818,960
ポーランドズロチ	790,486,061	-	790,940,700	454,639
オーストラリアドル	2,836,080,577	-	2,862,616,640	26,536,063
シンガポールドル	589,358,697	-	597,115,000	7,756,303
マレーシアリンギット	624,247,168	-	632,090,400	7,843,232
南アフリカランド	764,102,792	-	785,133,000	21,030,208
合計	145,592,213,146	-	146,430,999,608	850,203,888

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

RAM先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	43,887,977
コール・ローン	64,266,910
国債証券	24,725,721,230
未収利息	169,227,491
前払費用	10,993,864
流動資産合計	25,014,097,472
資産合計	25,014,097,472
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	281,703
未払金	63,345,038
未払解約金	570,000
未払利息	174
流動負債合計	64,196,915
負債合計	64,196,915
純資産の部	
元本等	
元本	24,956,344,099
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,443,542
元本等合計	24,949,900,557
純資産合計	24,949,900,557
負債純資産合計	25,014,097,472

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	33,874,791,320円
期中追加設定元本額	4,315,316,108円
期中一部解約元本額	13,233,763,329円
期末元本額	24,956,344,099円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	3,139,395,337円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	367,285,598円
りそなラップ型ファンド（成長型）	188,383,704円
DCりそな グローバルバランス	56,202,379円
つみたてバランスファンド	195,074,561円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	254,365,927円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	46,114,517円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	9,567,098円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	679,592円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	222,997円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	34,825円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	103,287,851円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	28,196,588円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	20,254,835,680円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	110,588,018円
Smart-i 8資産バランス 安定型	58,691,654円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	42,410,662円
Smart-i 8資産バランス 成長型	21,419,784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）	499,092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）	79,088,235円
2. 計算日における受益権の総数	24,956,344,099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	6,443,542円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9997円
(10,000口当たり純資産額)	(9,997円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2019年 9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 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	55,667,435	-	55,385,732	281,703
	米ドル	29,591,651	-	29,429,054	162,597
	ユーロ	7,721,168	-	7,628,130	93,038
	英ポンド	18,354,616	-	18,328,548	26,068
	合計	55,667,435	-	55,385,732	281,703

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,812,054
コール・ローン	56,777,041
投資信託受益証券	4,063,391,276
流動資産合計	4,122,980,371
資産合計	4,122,980,371
負債の部	
流動負債	
未払解約金	54,417,000
未払利息	153
流動負債合計	54,417,153
負債合計	54,417,153
純資産の部	
元本等	
元本	3,798,948,413
剰余金	
剰余金又は欠損金()	269,614,805
元本等合計	4,068,563,218
純資産合計	4,068,563,218
負債純資産合計	4,122,980,371

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	2,387,673,835円
期中追加設定元本額	1,768,387,908円
期中一部解約元本額	357,113,330円
期末元本額	3,798,948,413円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	523,146,771円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	343,511,270円
りそなラップ型ファンド(成長型)	176,780,537円
DCりそな グローバルバランス	6,837,845円
つみたてバランスファンド	181,530,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	66,666,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	28,806,370円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	16,989,503円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	295,719円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	230,467円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	134,274円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	86,653円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	86,843,692円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,347,945,748円
Smart-i 8資産バランス 安定型	6,728,766円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	19,651,066円
Smart-i 8資産バランス 成長型	24,960,168円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	99,573,405円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	315,050,929円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	552,711,447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)	467,048円
2. 計算日における受益権の総数	3,798,948,413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	1.0710円
(10,000口当たり純資産額)	(10,710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 9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。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	454,770,986
株式	32,212,227,500
派生商品評価勘定	10,914,740
未収配当金	12,420,406
差入委託証拠金	9,120,000
流動資産合計	32,699,453,632
資産合計	32,699,453,632
負債の部	
流動負債	
前受金	12,540,000
未払解約金	164,633,000

2019年 9月25日現在

未払利息	1,233
流動負債合計	177,174,233
負債合計	177,174,233
純資産の部	
元本等	
元本	29,009,178,369
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,513,101,030
元本等合計	32,522,279,399
純資産合計	32,522,279,399
負債純資産合計	32,699,453,632

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 9月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	23,799,735,532円
期中追加設定元本額	10,248,896,154円
期中一部解約元本額	5,039,453,317円
期末元本額	29,009,178,369円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,801,896,233円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,854,543,361円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,320,473,555円
DCりそな グローバルバランス	32,825,626円
つみたてバランスファンド	1,061,511,911円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	315,452,966円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	136,689,327円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	79,186,174円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,345,269円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,092,638円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	625,597円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	401,456円
FWりそな国内株式アクティブファンド	296,760,631円
FWりそな国内株式インデックスファンド	17,958,060,287円
Smart-i TOPIXインデックス	369,721,613円
Smart-i 8資産バランス 安定型	26,281,248円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	90,602,962円
Smart-i 8資産バランス 成長型	125,970,561円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	192,108,720円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	607,831,104円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,066,389,125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）	4,052,834円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	532,712,870円
りそなFT TOPIXインデックス（適格機関投資家専用）	132,642,301円
2. 計算日における受益権の総数	29,009,178,369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	1.1211円
(10,000口当たり純資産額)	(11,211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 9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 9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	293,180,260	-	304,095,000	10,914,740
	合計	293,180,260	-	304,095,000	10,914,740

（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 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,654,486,282
コール・ローン	66,178,380
株式	32,319,607,076
投資証券	938,739,851
派生商品評価勘定	3,434,443
未収入金	354,636
未収配当金	39,813,142
差入委託証拠金	818,659,709
流動資産合計	39,841,273,519
資産合計	39,841,273,519
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	51,416,677
未払金	12,204,630

2019年 9月25日現在

未払解約金	795,416,000
未払利息	179
流動負債合計	859,037,486
負債合計	859,037,486
純資産の部	
元本等	
元本	31,054,603,014
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,927,633,019
元本等合計	38,982,236,033
純資産合計	38,982,236,033
負債純資産合計	39,841,273,519

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	16,899,742,836円
期中追加設定元本額	18,661,651,980円
期中一部解約元本額	4,506,791,802円
期末元本額	31,054,603,014円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,563,900,404円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,626,507,759円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,328,469,095円
DCりそな グローバルバランス	11,456,885円
つみたてバランスファンド	616,330,758円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	310,635,280円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	134,964,938円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	78,683,734円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,320,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,061,165円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	610,051円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	393,531円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	48,866,197円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	50,727,566円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	11,006,123,342円
Smart-i 先進国株式インデックス	1,167,148,781円
Smart-i 8資産バランス 安定型	28,653,051円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	87,311,971円
Smart-i 8資産バランス 成長型	118,153,770円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,003,667,816円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,175,801,615円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	5,571,826,366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）	3,910,964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）	118,077,081円
2. 計算日における受益権の総数	31,054,603,014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	1.2553円
(10,000口当たり純資産額)	(12,553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 9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 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,770,279,878	-	5,718,873,183	51,406,695
	合計	5,770,279,878	-	5,718,873,183	51,406,695

（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 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	14,882,479	-	14,881,340	1,139
	米ドル	14,882,479	-	14,881,340	1,139
	売建	731,054,700	-	727,629,100	3,425,600
	米ドル	520,692,120	-	517,935,600	2,756,520
	カナダドル	25,171,690	-	25,051,100	120,590
	ユーロ	81,647,700	-	81,351,000	296,700
	英ポンド	38,824,040	-	38,741,100	82,940
	スイスフラン	26,091,120	-	26,068,800	22,320
	スウェーデンクローナ	4,433,600	-	4,424,000	9,600
	ノルウェークローネ	1,785,300	-	1,780,500	4,800
	デンマーククローネ	4,121,000	-	4,108,000	13,000
	オーストラリアドル	15,314,040	-	15,264,900	49,140
	香港ドル	8,929,050	-	8,872,500	56,550
	シンガポールドル	3,125,840	-	3,113,600	12,240
	イスラエルシェケル	919,200	-	918,000	1,200
	合計		745,937,179	-	742,510,440

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,963,881,725
コール・ローン	16,982,013
株式	4,973,592,494
投資証券	12,667,967
派生商品評価勘定	566,180
未収入金	91,640
未収配当金	8,334,209
差入委託証拠金	464,537,570
流動資産合計	7,440,653,798
資産合計	
7,440,653,798	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,314,062
未払解約金	115,050,000
未払利息	46
流動負債合計	155,364,108
負債合計	
155,364,108	
純資産の部	
元本等	
元本	5,936,889,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,348,400,170
元本等合計	7,285,289,690
純資産合計	
7,285,289,690	
負債純資産合計	
7,440,653,798	

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	4,572,442,524円
期中追加設定元本額	3,385,317,732円
期中一部解約元本額	2,020,870,736円
期末元本額	5,936,889,520円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	456,144,591円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	619,140,423円
りそなラップ型ファンド(成長型)	840,504,899円
DCりそな グローバルバランス	6,539,521円
つみたてバランスファンド	155,967,568円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	111,509,448円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	48,905,809円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	28,782,521円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	480,639円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	380,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	222,571円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	140,385円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,463,564,643円
Smart-i 新興国株式インデックス	461,721,743円
Smart-i 8資産バランス 安定型	8,712,254円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	29,644,218円
Smart-i 8資産バランス 成長型	43,016,753円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	170,941,418円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	540,882,680円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	948,906,592円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	780,469円

2. 計算日における受益権の総数	5,936,889,520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	1.2271円
(10,000口当たり純資産額)	(12,271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 9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 9月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引			

	買建	2,341,210,915	-	2,300,896,853	40,314,062
	合計	2,341,210,915	-	2,300,896,853	40,314,062

(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 9月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	99,609,380	-	99,043,200	566,180
	米ドル	56,742,090	-	56,441,700	300,390
	メキシコペソ	2,210,000	-	2,196,000	14,000
	香港ドル	29,809,290	-	29,620,500	188,790
	南アフリカランド	10,848,000	-	10,785,000	63,000
	合計	99,609,380	-	99,043,200	566,180

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	503,357,289
投資証券	18,688,587,260
派生商品評価勘定	3,065,248
未収配当金	133,608,089
前払金	1,838,600
差入委託証拠金	7,008,000
流動資産合計	19,337,464,486
資産合計	19,337,464,486
負債の部	
流動負債	
未払金	100,664,960
未払解約金	71,797,000
未払利息	1,365
流動負債合計	172,463,325
負債合計	172,463,325
純資産の部	
元本等	
元本	13,271,567,990
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,893,433,171
元本等合計	19,165,001,161
純資産合計	19,165,001,161
負債純資産合計	19,337,464,486

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 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日

期首元本額	11,074,952,278円
期中追加設定元本額	7,939,827,088円
期中一部解約元本額	5,743,211,376円
期末元本額	13,271,567,990円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	389,185,821円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	256,396,257円
りそなラップ型ファンド(成長型)	337,506,470円
DCりそな グローバルバランス	5,402,438円
つみたてバランスファンド	277,429,174円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	62,322,381円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	26,988,581円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	15,270,543円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	254,659円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	212,945円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	119,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	77,239円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,542,253,341円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,743,478,136円
Smart-i Jリートインデックス	1,620,700,858円
Smart-i 8資産バランス 安定型	5,107,833円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	18,682,157円
Smart-i 8資産バランス 成長型	22,764,444円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	75,612,882円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	239,367,330円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	419,907,003円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	4,211,507,738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)	1,019,848円
2. 計算日における受益権の総数	13,271,567,990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	1.4441円
(10,000口当たり純資産額)	(14,441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 9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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2019年 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	466,032,752	-	469,098,000	3,065,248
	合計	466,032,752	-	469,098,000	3,065,248

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	15,370,319
コール・ローン	31,357,746
投資証券	16,993,984,250

2019年 9月25日現在

派生商品評価勘定	574,821
未収入金	825,525,873
未収配当金	28,358,169
流動資産合計	17,895,171,178
資産合計	17,895,171,178
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	820
未払金	714,716,563
未払解約金	150,101,000
未払利息	85
流動負債合計	864,818,468
負債合計	864,818,468
純資産の部	
元本等	
元本	14,866,908,703
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,163,444,007
元本等合計	17,030,352,710
純資産合計	17,030,352,710
負債純資産合計	17,895,171,178

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 9月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	11,637,116,981円
期中追加設定元本額	4,912,910,295円
期中一部解約元本額	1,683,118,573円
期末元本額	14,866,908,703円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	488,980,108円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,758,561,270円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,531,241,545円
DCりそな グローバルバランス	6,413,137円
つみたてバランスファンド	168,844,695円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	84,293,801円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	36,882,065円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	21,481,866円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	346,236円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	303,398円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	168,123円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	106,368円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,711,344,039円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,592,742,109円
Smart-i 先進国リートインデックス	603,578,545円
Smart-i 8資産バランス 安定型	6,256,960円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	22,873,933円
Smart-i 8資産バランス 成長型	32,550,175円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	185,080,117円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	585,652,236円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,027,505,142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)	1,702,835円
2. 計算日における受益権の総数	14,866,908,703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	1.1455円
(10,000口当たり純資産額)	(11,455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 9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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2019年 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,593,207	-	12,592,400	807
	米ドル	10,706,820	-	10,706,000	820
	ユーロ	1,886,387	-	1,886,400	13
	売建	121,040,778	-	120,465,970	574,808
	米ドル	79,352,790	-	78,932,700	420,090
	カナダドル	5,521,532	-	5,495,080	26,452
	ユーロ	10,413,040	-	10,375,200	37,840
	英ポンド	7,095,428	-	7,080,270	15,158
	オーストラリアドル	9,480,120	-	9,449,700	30,420
	ニュージーランドドル	270,940	-	270,600	340
	香港ドル	3,983,730	-	3,958,500	25,230
	シンガポールドル	4,923,198	-	4,903,920	19,278
合計		133,633,985	-	133,058,370	574,001

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 9月30日現在です。

【Smart-i 8資産バランス 安定型】

【純資産額計算書】

資産総額	373,650,557円
負債総額	11,237円
純資産総額（ - ）	373,639,320円
発行済口数	353,853,390口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0559円

【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

【純資産額計算書】

資産総額	535,247,823円
負債総額	37,993円
純資産総額（ - ）	535,209,830円
発行済口数	504,614,554口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0606円

【Smart-i 8資産バランス 成長型】

【純資産額計算書】

資産総額	548,385,684円
負債総額	591,453円
純資産総額（ - ）	547,794,231円
発行済口数	517,443,731口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0587円

（参考）

R A M国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	71,857,899,531円
負債総額	171,018,100円
純資産総額（ - ）	71,686,881,431円
発行済口数	66,881,114,777口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0719円

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	145,270,444,118円
負債総額	1,606,020,394円
純資産総額（ - ）	143,664,423,724円
発行済口数	137,882,809,782口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0419円

R A M先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	25,264,052,289円
負債総額	90,971,654円
純資産総額（ - ）	25,173,080,635円
発行済口数	25,122,461,113口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0020円

R A M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	4,083,655,390円
負債総額	9,349,035円
純資産総額（ - ）	4,074,306,355円
発行済口数	3,811,181,829口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0690円

R A M国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	32,342,829,011円
負債総額	48,394,612円
純資産総額（ - ）	32,294,434,399円
発行済口数	29,111,884,616口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1093円

R A M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	39,463,409,094円
負債総額	59,884,843円
純資産総額（ - ）	39,403,524,251円
発行済口数	31,214,105,112口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2624円

R A M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	7,356,373,949円
負債総額	74,092,197円
純資産総額（ - ）	7,282,281,752円
発行済口数	5,957,913,051口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2223円

R A M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	19,503,332,270円
負債総額	5,864,768円
純資産総額（ - ）	19,497,467,502円
発行済口数	13,342,955,251口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4613円

R A M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	17,406,308,190円
負債総額	53,973,841円
純資産総額（ - ）	17,352,334,349円
発行済口数	14,910,051,077口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1638円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（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9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9月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会において選任され、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

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

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。

社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

取締役会は、法令、定款等に定められた業務執行の重要事項を決定します。

取締役会の決議は、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

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

CHECK：検証 ACTION：改善

- 法令等や運用ガイドラインの遵守状況等については、運用部門から独立した業務部がモニタリングを行います。その結果は、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告するとともにすみやかに運用戦略部および株式運用部にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
- 運用実績等については運用委員会が統括し、運用戦略部および株式運用部に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年9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	67	694,293
単体型株式投資信託	3	83,526
合計	70	777,819

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

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	52,802	87,317
その他未払金	94,427	163,133
未払費用	21,235	23,612
未払法人税等	8,252	17,310
未払消費税等	12,000	39,930
預り金	106	444
賞与引当金	31,097	36,596
流動負債計	219,921	368,344
負債合計	219,921	368,344
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	171,316	7,236
利益剰余金計	171,316	7,236
株主資本計	1,318,683	1,482,763
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	11	0
評価・換算差額等計	11	0
純資産合計	1,318,695	1,482,762
負債・純資産合計	1,538,616	1,851,107

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	854,946	1,786,724
投資助言報酬	-	35,360
営業収益計	854,946	1,822,084
営業費用		
支払手数料	213,554	437,713
広告宣伝費	24,143	48,845
調査費		
調査費	155,859	192,459
委託調査費	111,085	199,514
委託計算費	92,905	149,138
営業雑経費		
印刷費	26,910	49,857
協会費	2,097	3,294

販売促進費	1,592	5,915
その他	41,568	42,522
営業費用計	669,717	1,129,261
一般管理費		
給料		
役員報酬	61,599	65,787
給料・手当	195,821	216,403
賞与	20,138	18,883
賞与引当金繰入額	31,097	36,596
旅費交通費	4,892	8,181
租税公課	7,802	14,129
不動産賃借料	16,648	23,852
固定資産減価償却費	11,306	15,147
諸経費	48,459	72,402
一般管理費計	397,765	471,383
営業利益	212,537	221,439
営業外収益		
投資有価証券売却益	1,616	176
雑収入	14	2
営業外収益計	1,630	179
営業外費用		
株式交付費	3,630	-
営業外費用計	3,630	-
経常利益	214,536	221,618
税引前当期純利益	214,536	221,618
法人税、住民税及び事業税	17,669	49,931
法人税等調整額	32,394	7,606
法人税等計	50,063	57,538
当期純利益	164,472	164,079

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

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

評価・換算差額等

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	413	413	483,569
当期変動額			
欠損填補			
新株の発行			1,000,000
当期純損失（ ）			164,472
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	401	401	401
当期変動額合計	401	401	835,125
当期末残高	11	11	1,318,695

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683
当期変動額						
当期純利益				164,079	164,079	164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	164,079	164,079	164,079
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	1,318,695
当期変動額			
当期純利益			164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	11	11	11
当期変動額合計	11	11	164,067
当期末残高	0	0	1,482,762

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(未適用の会計基準等)

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

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

(1) 概要

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

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」22,764千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」41,682千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当金の合計額を除く。)及び同注解(注9)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取り扱いに従って記載しておりません。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	1,273千円	540千円
器具備品	3,324千円	6,957千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
流動資産		
未収入金	18,947千円	-
流動負債		
その他未払金	-	44,766千円

（注）当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式（株）	1,960,000	2,000,000	-	3,960,000

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

当社の未収入金は、主に連結納税親会社から収受する金額であります。

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

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

2 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2018年3月31日）

（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年以内	5年超	合計
税務上の 繰越欠損金	-	-	-	-	-	54,381千円	54,381千円
評価性引当額	-	-	-	-	-	37,635千円	37,635千円
繰延税金資産	-	-	-	-	-	16,746千円	16,746千円

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

税引前当期純損失のため注記を省略しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.43%
評価性引当額の増減	3.23%
その他	1.89%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>25.96%</u>

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、記載を省略しております。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、記載を省略しております。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,472	持株会社としての経営管理	(直接)100%	連結納税資金の調達	連結法人税還付請求	18,947	未収入金	18,947
							増資の割当	1,000,000	-	-

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	-	投資信託の販売委託投資助言	支払手数料	177,380	未払手数料	45,605
							委託調査費	63,426	その他未払金	21,550

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主(会社等に限る)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,472	持株会社としての経営管理	(直接)100%	連結納税	連結納税に係る個別帰属額	44,766	その他未払金	44,766

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社の 子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	支払手数料	340,304	未払 手数料	72,673
							委託調査費	130,062	その他 未払金	51,486

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	333円	374円43銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失()	47円97銭	41円43銭

なお、前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月 31日)	当事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)
当期純利益又は当期純損失() (千円)	164,472	164,079
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失() (千円)	164,472	164,079
普通株式の期中平均株式数(株)	3,428,493	3,960,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月 31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常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
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	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SBI証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

(2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。

(3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	太田健司	印
--------------------	-------	------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第4期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2019年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 安定型の2018年3月27日から2019年3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、Smart-i 8資産バランス 安定型の2019年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 安定成長型の2018年3月27日から2019年3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、Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2019年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 成長型の2018年3月27日から2019年3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、Smart-i 8資産バランス 成長型の2019年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月20日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 安定型の2019年3月26日から2019年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、Smart-i 8資産バランス 安定型の2019年9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3月26日から2019年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月20日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 安定成長型の2019年3月26日から2019年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2019年9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3月26日から2019年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月20日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSmart-i 8資産バランス 成長型の2019年3月26日から2019年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、Smart-i 8資産バランス 成長型の2019年9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3月26日から2019年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。