

【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】	2020年9月10日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	F Wりそな国内債券インデックスファンド F Wりそな国内株式インデックスファンド F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） F Wりそな新興国債券インデックスファンド F Wりそな先進国株式インデックスファンド F Wりそな新興国株式インデックスファンド F Wりそな国内リートインデックスファンド F Wりそな先進国リートインデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	F Wりそな国内債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

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

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

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

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

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：取得申込受付日の翌営業日の基準

価額とします。

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

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

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

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

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2020年9月11日から2021年3月10日までとします。

・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

ファンドの基本的性格

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券 (クレジット属性 ())	(毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (NOMURA-BPI 総合)
その他資産 (投資信託証券(債券 一般))	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(債券 一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(債券)とが異なります。

< F W りそな国内株式インデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		東証株価指数
社債		オセアニア		(TOPIX、配当込み)
その他債券	年12回			
クレジット属性	(毎月)	中南米		
()	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他
不動産投信	その他	中近東		()
()	()	(中東)		
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		エマージング		
資産複合				
()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(株式一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

< F W Rりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし) >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< F W りそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除 く日本、円ヘッ ジ・円ベー ス))
その他資産 (投資信託証券(債 券 公債))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< F W りそな新興国債券インデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株 式	インデックス型
	海外	債 券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(債券 公債))	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (JPモルガンGBI -EMグローバル ・ダイバーシ ファイド(円換 算ベース))
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< F W りそな先進国株式インデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
	年2回	日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(株式一般))	その他 ()	アフリカ			その他 (MSCI-KOKUSAI 指数(配当込 み、円換算ベ ース))
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(株式一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

< F W I りそな新興国株式インデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(株式 一般)))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	日経 225
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券(不動産投信))	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	その他 (東証 REIT 指数 (配当込み))
	その他 ()	アフリカ		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

<FWりそな先進国リートインデックスファンド>

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

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

4. 独立した区分

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

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

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

< 補足として使用する商品分類 >

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

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1

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

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

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

2

「りそなファンドラップ(スタンダードコース)」を構成する各ファンドは、各マザーファンドを通じて実質的に投資を行うファミリーファンド方式で運用を行います。

■ ファンドの仕組み



3 各ファンドの運用方針は以下の通りです。

FWりそな国内債券インデックスファンド

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

*[NOMURA-BPI総合]は、野村證券株式会社が公表する、日本の公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。

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

FWりそな国内株式インデックスファンド

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

*[東証株価指数(TOPIX、配当込み)]は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。

2. RAM国内株式マザーファンドを通じて、国内の株式への投資を行います。
 - 東証株価指数(TOPIX、配当込み)への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

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

*[FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)]は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

2. RAM先進国債券マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。
 - FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)または海外の債券先物取引を活用することがあります。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

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

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

2. RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)を通じて、日本を除く先進国の債券への投資を行います。

- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)または海外の債券先物取引を活用することがあります。

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

FWりそな新興国債券インデックスファンド

1. 新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)*の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

2. RAM新興国債券マザーファンドを通じて、新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。

- JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

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

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

2. RAM先進国株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式*または先進国株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。

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

*DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

1. 新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）*の動きに連動する投資成果を目指します。
 - *[MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）]は、MSCIエマージング・マーケット指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数（米ドルベース）は、MSCI Inc.が発行した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。
2. RAM新興国株式マザーファンドを通じて、新興国の株式*または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）への投資を行います。
 - MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。
 - *DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

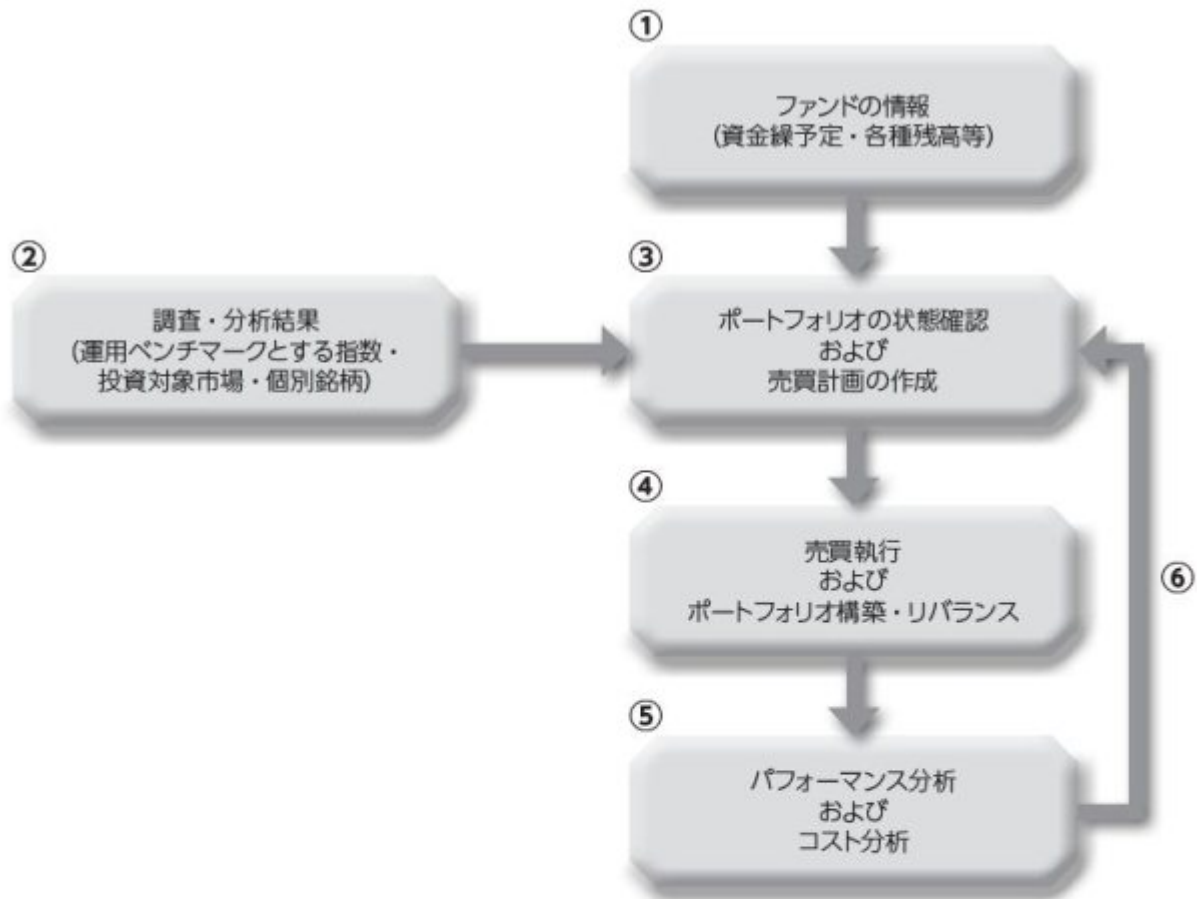
FWりそな国内リートインデックスファンド

1. 国内の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）*の動きに連動する投資成果を目指します。
 - *[東証REIT指数（配当込み）]は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託（REIT）全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。
2. RAM国内リートマザーファンドを通じて、国内の不動産投資信託証券*への投資を行います。
 - 東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。
 - *一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

1. 日本を除く先進国の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）*の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - *[S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）]は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（REIT）および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。
2. RAM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）への投資を行います。
 - S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。
 - *一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

■ 運用プロセスのイメージ



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

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

■ 主な投資制限

● FWりそな国内債券インデックスファンド

- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への投資は、行いません。
- デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

● FWりそな国内株式インデックスファンド

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

● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

● FWりそな新興国債券インデックスファンド

- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

● FWりそな先進国株式インデックスファンド

● FWりそな新興国株式インデックスファンド

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

● FWりそな国内リートインデックスファンド

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

● FWりそな先進国リートインデックスファンド

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

■ 分配方針

原則、毎年12月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

● RAM国内債券マザーファンド

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

● RAM国内株式マザーファンド

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

● RAM先進国債券マザーファンド

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

● RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

● RAM新興国債券マザーファンド

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

● RAM先進国株式マザーファンド

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

● RAM新興国株式マザーファンド

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

● RAM国内リートマザーファンド

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

● RAM先進国リートマザーファンド

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

信託金限度額

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

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

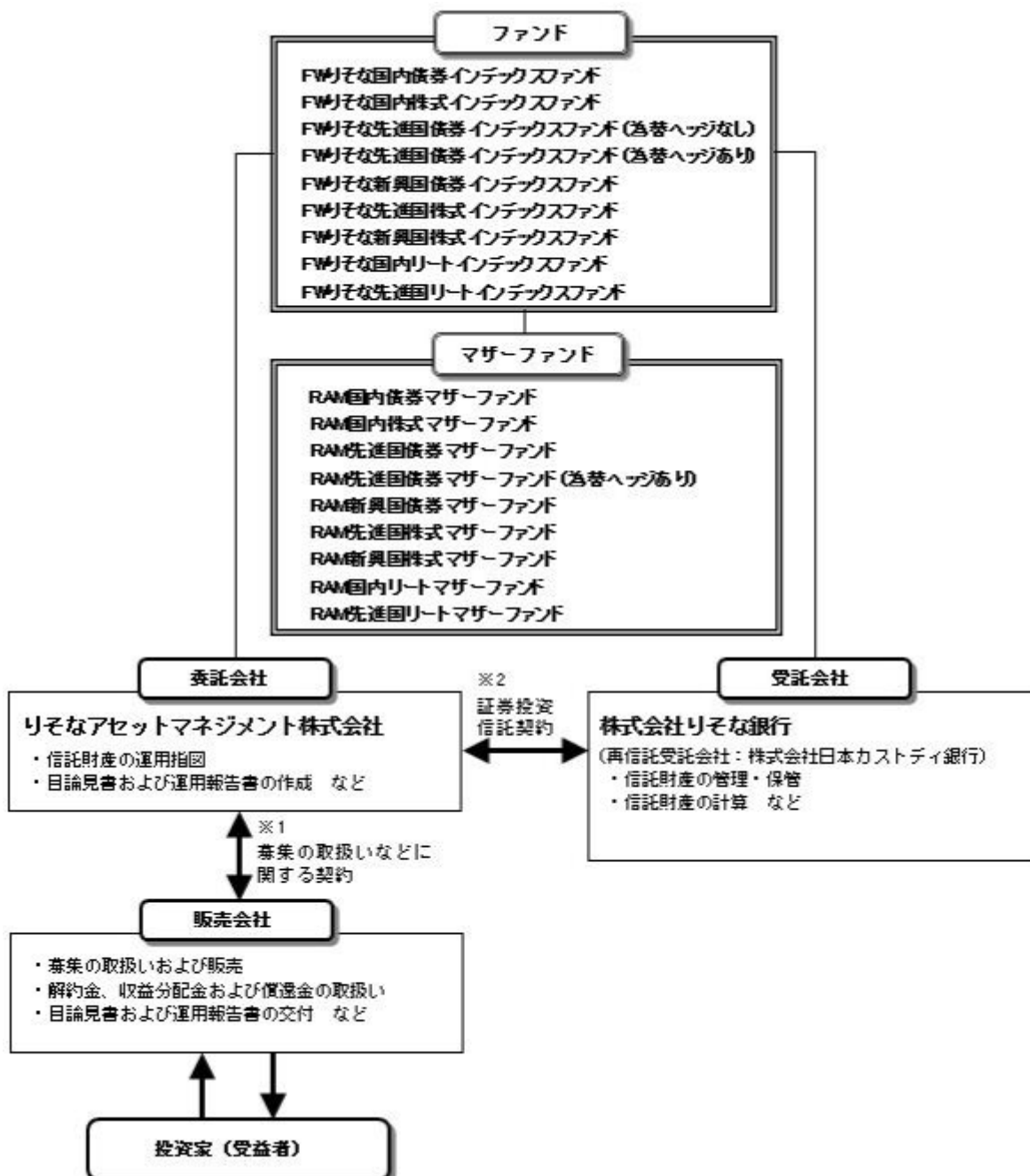
(2) 【ファンドの沿革】

2017年1月5日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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（2020年6月末現在）

1）資本金

1,000百万円

2）沿革

2015年8月3日： りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

< F W りそな国内債券インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

< F W りそな国内株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、東証株価指数（TOPIX、配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

< F W りそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

ない場合があります。

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）>

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド>

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド>

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド>

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取

引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に投資し、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、前述の「運用プロセスのイメージ」をご参照ください。

（２）【投資対象】

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ）為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1）転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2）国債証券
- 3）地方債証券
- 4）特別の法律により法人の発行する債券
- 5）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 6）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 16) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、1) の証券または証書ならびに8) および13) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券ならびに10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) の証券または証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9) の証券および10) の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- 1) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限りません。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 16) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、1) の証券または証書ならびに8) および13) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券ならびに10) の証券のうち投資法人債券ならびに8) および13) の証券または証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9) の証券および10) の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といい

ます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- 1) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限りません。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをい

います。)

- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 16) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書ならびに8)および13)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9)の証券および10)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

- 1) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定

めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限り、)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券

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

なお、1)の証券または証書ならびに8)および13)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに10)の証券のうち投資法人債券ならびに8)および13)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9)の証券および10)の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F W りそな先進国株式インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

することができます。

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

す。)

- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

R A M国内リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、国内の不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）に直接投資することがあります。

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

委託者は、信託金を、主として、親投資信託「R A M国内リートマザーファンド」の受益証券、ならび

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

信用取引の運用指図、先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引の運用指図、有

価証券の貸付けの指図、資金の借入れの指図を行うことができます。

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

R A M先進国リートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）、不動産関連株式および不動産投資信託証券に関する指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に直接投資することがあります。

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《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	<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す。）の行使等により取得したものに限り ます。</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。 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は、行いません。</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および金利変動リスクを回避す る目的以外には利用しません。</p> <p>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	<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"> ・東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式

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

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

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

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

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

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

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

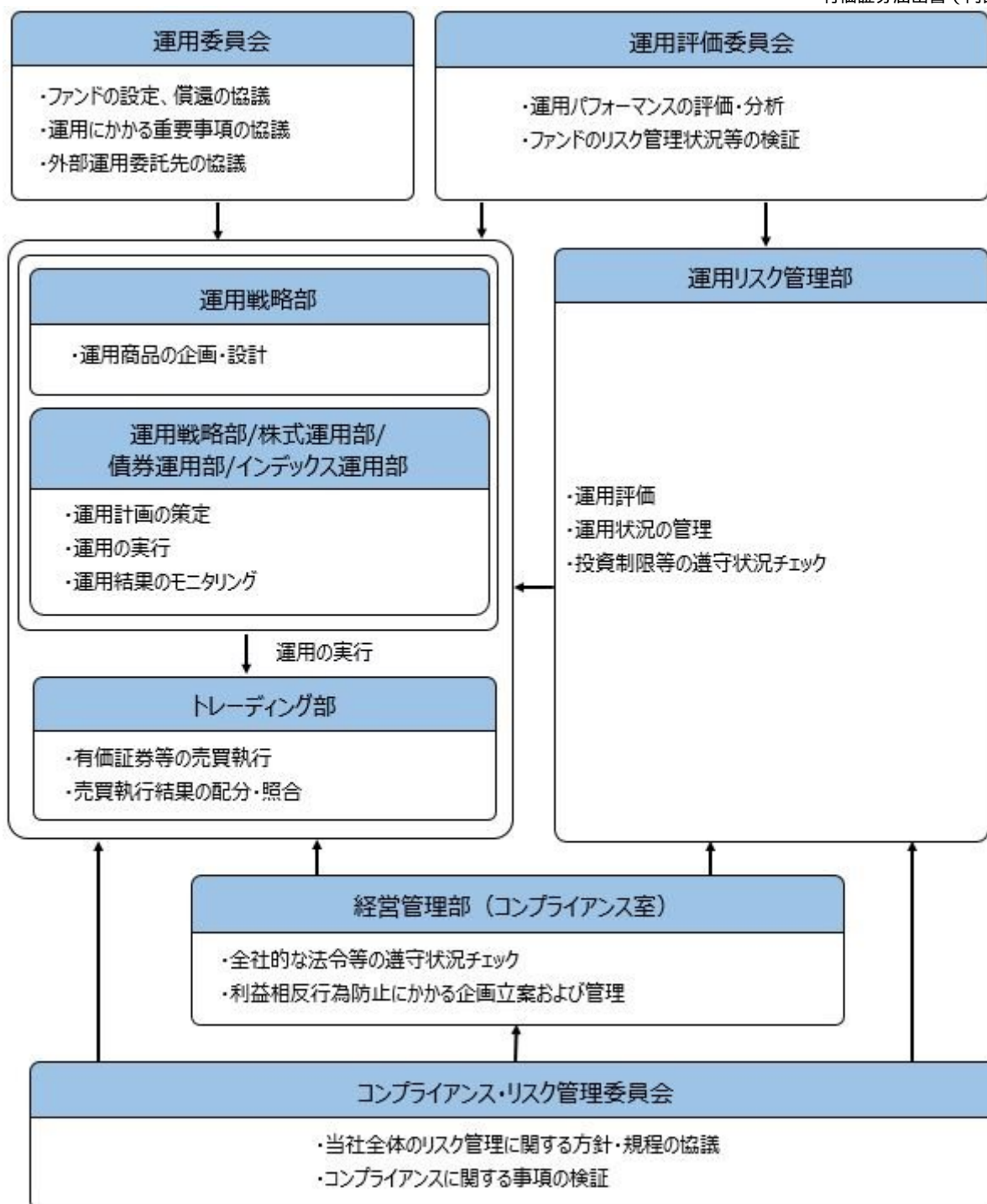
< R A M先進国リートマザーファンド >

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

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



運用委員会は5名程度、運用評価委員会は5名程度、コンプライアンス・リスク管理委員会は3名程度で構成されています。

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、2020年6月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)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

< F W Rりそな国内債券インデックスファンド >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 9) スワップ取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 10) 金利先渡取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 5. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 6. 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) 有価証券の貸付けの指図および範囲
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 12) 資金の借入れ
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 4) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
- ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）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まれるものとします（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものと

し、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

12) 金利先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信

託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

14) 資金の借入れ

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

<FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

ポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

7) 投資する株式の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

8) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象と

する金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

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

9）スワップ取引の運用指図および範囲

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

10）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) 有価証券の貸付けの指図および範囲
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 12) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 13) 外国為替予約取引の指図および範囲
- 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 14) 資金の借入れ
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むもの)とし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
 2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 9)スワップ取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
 2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

11) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

12) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

13) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

14) 資金の借入れ

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象

とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わ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、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 9)スワップ取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないも

のとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

11) 直物為替先渡取引の運用指図

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

12) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

13) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

14) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

15) 資金の借入れ

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

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(ホ)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含

めるものとし（以下同じ。）。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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、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、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、
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、
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、

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、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとし、
4. 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、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、
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、

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

13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

14) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

15) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

16) 資金の借入れ

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

< F W りそな新興国株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うことと

します。

8) 投資する株式等の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

9) 信用取引の指図範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

ドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

17) 資金の借入れ

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

8) 投資する株式等の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

9) 信用取引の指図範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券

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

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

12) 金利先渡取引の運用指図および範囲

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

証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

14) 資金の借入れ

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

- 1) 不動産投資信託証券および株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うものとします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引

されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

9) 信用取引の指図範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
- ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
- ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものにつ

いてはこの限りではありません。

3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 13) 有価証券の貸付けの指図および範囲
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 14) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 15) 外国為替予約取引の指図および範囲
- 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指

図することができます。

16) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

< F W りそな国内債券インデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・金利（債券価格）変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(その他の留意点)

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

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

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

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

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

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

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

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

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

< F W りそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

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

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

市場リスク

- ・金利（債券価格）変動リスク

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

- ・為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用します

が、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

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

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

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

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

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

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

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

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

市場リスク

・ 金利（債券価格）変動リスク

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

・ 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることとしていますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替変動の影響を受け、基準価額が下落する場合があります。また為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(その他の留意点)

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

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

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

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

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

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・金利(債券価格)変動リスク

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

・為替変動リスク

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

信用リスク

実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合ま

たはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバシファイド（円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

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

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

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

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

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

<FWりそな先進国株式インデックスファンド>

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

・為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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戻りに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさった場合も同様です。

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失

を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・ リートの価格変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

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

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

市場リスク

・ リートの価格変動リスク

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

・ 為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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感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評価を実施するとともに、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。

運用評価委員会は、運用実績および主な投資制限等の遵守状況や運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。

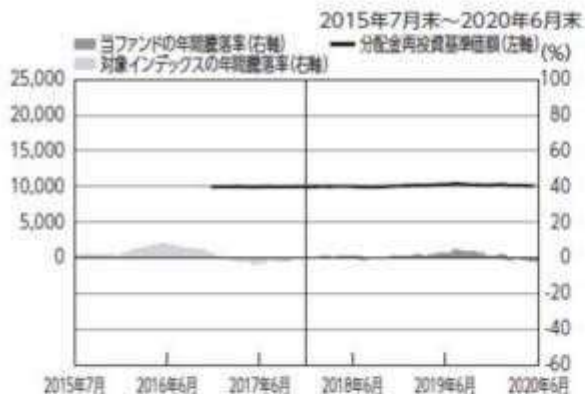
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

上記体制は2020年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

FWりそな国内債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

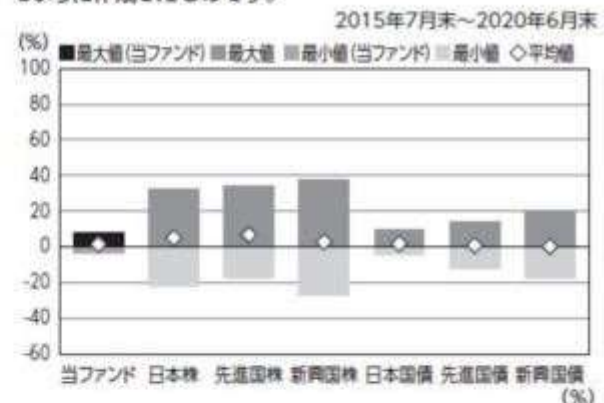


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.2	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△3.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.5	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな国内株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

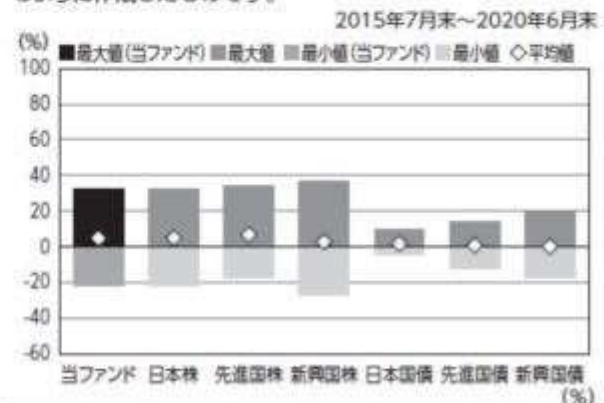


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	32.2	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△22.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	4.8	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

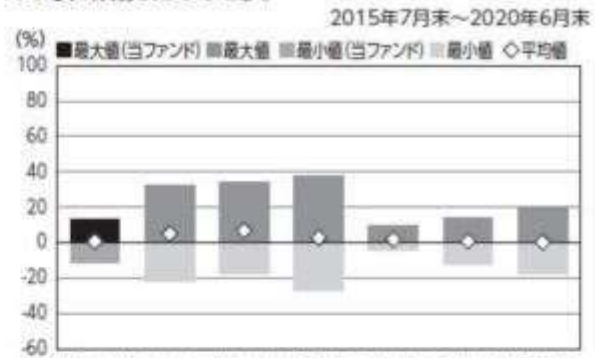


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



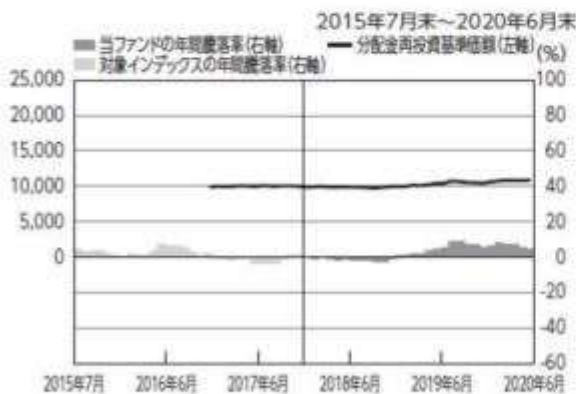
当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	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	13.2	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△11.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.7	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

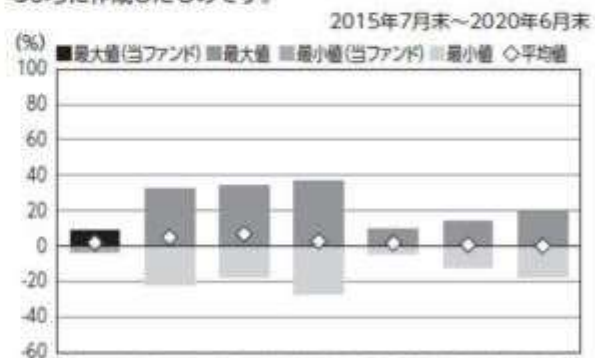


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



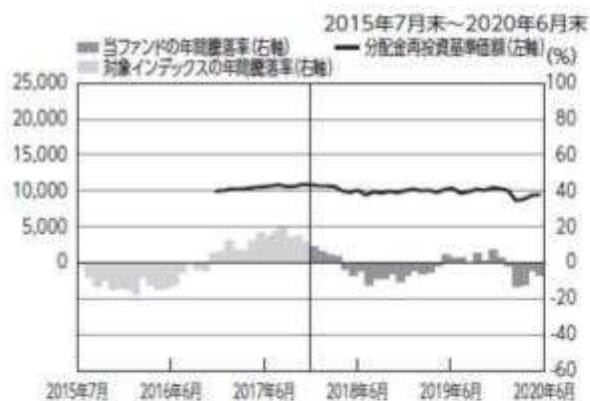
当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.7	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△3.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.9	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな新興国債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

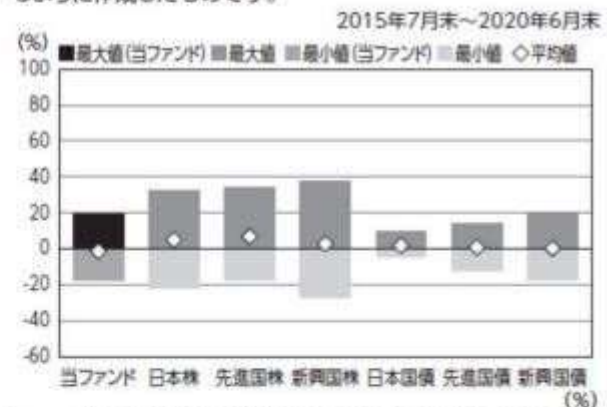


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	19.0	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△17.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	△1.4	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

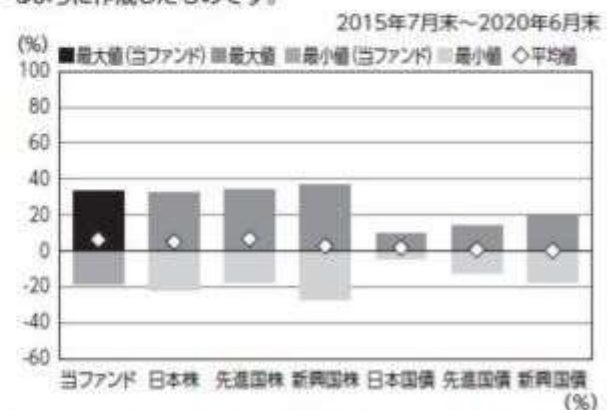


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	33.5	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△18.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	6.4	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

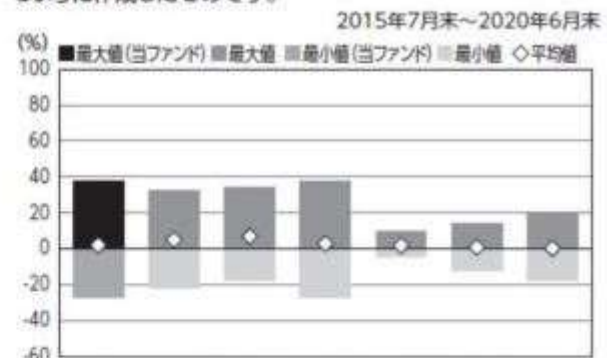


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	37.6	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△27.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.0	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな国内リートインデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

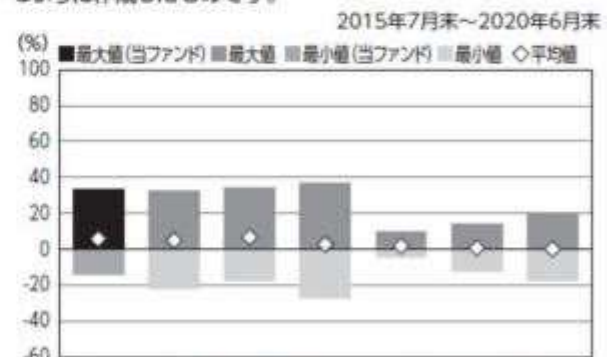


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	33.1	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△13.9	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	5.8	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- * 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。
- * 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

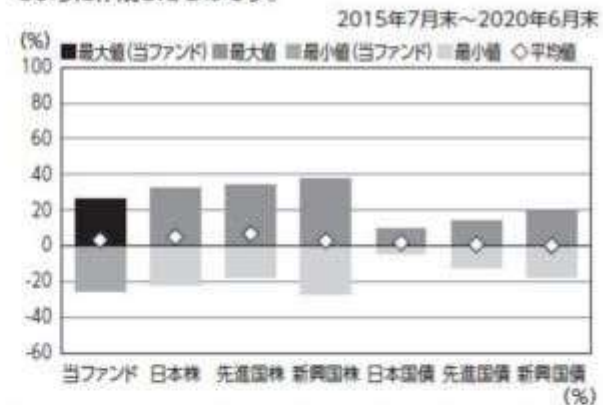


- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	26.1	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値	△25.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.3	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- 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。
- 2015年7月から2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。
 信託財産留保額
 ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

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

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

す。)を控除した利益

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

原則として、益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

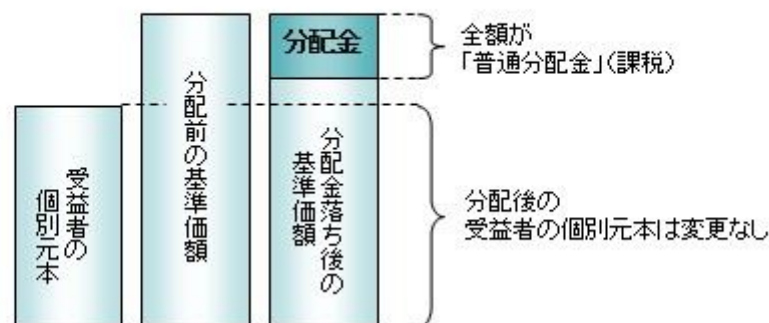
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

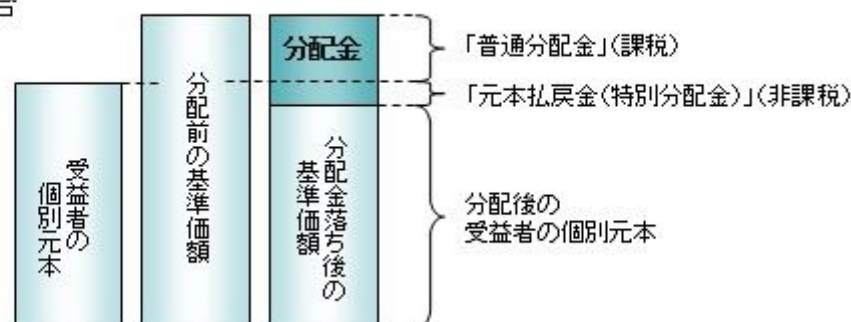
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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2020年6月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年6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	55,004,567,189	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		38,189,831	0.07
合計(純資産総額)		55,042,757,020	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	52,345,419,861	1.0587	55,418,650,107	1.0508	55,004,567,189	99.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.93
合計	99.93

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	28,958	28,958	0.9997	0.9997
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,611	47,611	1.0020	1.0020
第3計算期間末 (2019年12月10日)	40,701	40,701	1.0188	1.0188
2019年 6月末日	46,166		1.0275	
7月末日	41,362		1.0284	
8月末日	42,353		1.0419	
9月末日	42,360		1.0306	
10月末日	40,091		1.0263	
11月末日	40,505		1.0225	
12月末日	41,320		1.0193	
2020年 1月末日	43,177		1.0234	
2月末日	44,329		1.0310	
3月末日	48,784		1.0140	
4月末日	51,802		1.0172	
5月末日	52,149		1.0126	
6月末日	55,042		1.0082	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.03
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.23
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1.68
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	0.82

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,909,645,686	1,943,062,889
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	26,877,211,328	8,328,798,276
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	13,059,303,045	20,624,350,895
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	18,256,502,938	5,443,481,017

(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。

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	9,558,839,763	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		4,666,173	0.05
合計(純資産総額)		9,563,505,936	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M国内株式マザーファンド	8,645,057,216	1.1571	10,003,662,385	1.1057	9,558,839,763	99.95

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	8,186	8,186	1.1849	1.1849
第2計算期間末 (2018年12月10日)	16,834	16,834	1.0571	1.0571
第3計算期間末 (2019年12月10日)	24,185	24,185	1.1689	1.1689
2019年 6月末日	18,265		1.0451	
7月末日	19,118		1.0542	
8月末日	18,699		1.0182	
9月末日	20,032		1.0793	
10月末日	23,136		1.1328	
11月末日	23,720		1.1545	
12月末日	24,461		1.1708	
2020年 1月末日	22,982		1.1453	
2月末日	21,076		1.0274	
3月末日	9,627		0.9655	
4月末日	9,336		1.0069	
5月末日	9,575		1.0751	
6月末日	9,563		1.0730	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	18.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10.79
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	10.58
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	4.45

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	8,464,438,150	1,555,516,946
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	10,773,198,886	1,757,205,923
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,880,522,314	4,115,126,539
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	6,480,946,189	18,523,012,368

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)】

以下の運用状況は2020年 6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	24,106,467,281	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		14,473,251	0.06
合計(純資産総額)		24,120,940,532	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	22,969,478,115	1.0079	23,152,845,187	1.0495	24,106,467,281	99.94

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	8,788	8,788	1.0508	1.0508
第2計算期間末 (2018年12月10日)	19,813	19,813	1.0139	1.0139
第3計算期間末 (2019年12月10日)	23,444	23,444	1.0437	1.0437
2019年 6月末日	19,484		1.0287	
7月末日	19,765		1.0314	
8月末日	20,118		1.0378	
9月末日	20,408		1.0424	
10月末日	23,080		1.0523	
11月末日	23,493		1.0525	
12月末日	23,961		1.0569	
2020年 1月末日	24,707		1.0651	
2月末日	25,440		1.0773	
3月末日	22,004		1.0786	
4月末日	22,078		1.0574	
5月末日	22,615		1.0721	
6月末日	24,120		1.0885	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	5.08

第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	3.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2.94
当中間期	2019年12月11日～2020年6月10日	3.71

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2017年1月5日～2017年12月11日	9,816,051,299	1,452,754,871
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	16,644,523,180	5,465,983,147
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	8,262,356,144	5,341,817,591
当中間期	2019年12月11日～2020年6月10日	4,976,839,585	5,749,875,956

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)】

以下の運用状況は2020年6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	83,299,317,888	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		50,482,675	0.06
合計(純資産総額)		83,349,800,563	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)	78,112,638,680	1.0325	80,657,736,434	1.0664	83,299,317,888	99.94

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	28,986	28,986	1.0090	1.0090
第2計算期間末 (2018年12月10日)	47,560	47,560	0.9899	0.9899
第3計算期間末 (2019年12月10日)	60,513	60,513	1.0475	1.0475
2019年 6月末日	57,279		1.0399	
7月末日	61,892		1.0436	
8月末日	64,479		1.0751	
9月末日	64,589		1.0670	
10月末日	59,390		1.0532	
11月末日	60,346		1.0517	
12月末日	61,007		1.0452	
2020年 1月末日	65,596		1.0638	
2月末日	67,510		1.0755	
3月末日	65,991		1.0854	
4月末日	77,291		1.0831	
5月末日	78,003		1.0815	
6月末日	83,349		1.0888	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1.89
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	5.82
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	2.60

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	30,662,448,431	1,934,517,343
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	27,497,514,870	8,180,419,930
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25,565,889,158	15,842,703,502
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	26,747,681,411	10,393,907,264

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	1,716,148,870	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,087,574	0.06
合計（純資産総額）		1,717,236,444	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	1,667,297,066	1.0862	1,811,089,146	1.0293	1,716,148,870	99.94

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.94
合 計	99.94

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	742	742	1.0790	1.0790
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,769	1,769	0.9796	0.9796
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,302	2,302	1.0120	1.0120
2019年 6月末日	1,471		1.0214	
7月末日	1,479		1.0362	
8月末日	1,399		0.9662	
9月末日	1,447		0.9871	
10月末日	2,286		1.0245	
11月末日	2,273		1.0066	
12月末日	2,401		1.0440	
2020年 1月末日	2,345		1.0298	
2月末日	2,334		1.0075	
3月末日	1,588		0.8664	
4月末日	1,664		0.8840	
5月末日	1,759		0.9389	
6月末日	1,717		0.9461	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000

当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	
------	-------------------------	--

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.90
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	9.21
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	3.31
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	4.18

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	735,295,511	47,003,360
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,230,517,990	112,441,673
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,175,865,521	706,944,106
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	481,940,587	957,826,762

(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。

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	17,250,053,428	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		7,807,254	0.05
合計（純資産総額）		17,257,860,682	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	親投資信託受益証券	R A M先進国株式マザーファンド	13,433,574,822	1.2736	17,109,830,722	1.2841	17,250,053,428	99.95
----	-----------	-------------------	----------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合 計	99.95

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	5,912	5,912	1.1507	1.1507
第2計算期間末 (2018年12月10日)	6,033	6,033	1.1001	1.1001
第3計算期間末 (2019年12月10日)	17,429	17,429	1.2657	1.2657
2019年 6月末日	13,509		1.1826	
7月末日	13,894		1.2140	
8月末日	13,433		1.1542	
9月末日	13,959		1.1902	
10月末日	17,010		1.2374	
11月末日	17,588		1.2827	
12月末日	18,287		1.3211	
2020年 1月末日	17,278		1.3229	
2月末日	16,258		1.2153	
3月末日	14,786		1.0347	
4月末日	17,438		1.1380	
5月末日	18,110		1.1861	
6月末日	17,257		1.2066	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	15.07
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	4.40
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	15.05
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	0.40

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	6,405,695,993	1,267,334,524
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	6,421,790,557	6,075,525,169
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	11,072,413,261	2,786,271,649
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	6,651,048,881	6,206,055,111

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	1,874,165,388	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		789,823	0.04
合計(純資産総額)		1,874,955,211	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国株式マザーファンド	1,537,966,017	1.2662	1,947,519,010	1.2186	1,874,165,388	99.96

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.96
合 計	99.96

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	873	873	1.2449	1.2449
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,999	1,999	1.0986	1.0986
第3計算期間末 (2019年12月10日)	2,810	2,810	1.1520	1.1520
2019年 6月末日	1,789		1.1452	
7月末日	1,829		1.1424	
8月末日	1,705		1.0454	
9月末日	1,795		1.0877	
10月末日	2,764		1.1493	
11月末日	2,820		1.1641	
12月末日	3,055		1.2411	
2020年 1月末日	2,670		1.1808	
2月末日	2,614		1.1311	
3月末日	1,679		0.9083	
4月末日	1,839		0.9897	
5月末日	1,824		0.9963	
6月末日	1,874		1.0790	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	24.49
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.75
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	4.86
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	4.94

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	814,658,599	112,792,530
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,273,924,653	155,611,382
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,307,480,891	687,984,458
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	643,042,458	1,348,544,899

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	2,476,819,583	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,231,570	0.05
合計（純資産総額）		2,478,051,153	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M国内リートマザーファンド	2,159,577,630	1.4268	3,081,428,875	1.1469	2,476,819,583	99.95

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合 計	99.95

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	1,168	1,168	0.9275	0.9275
第2計算期間末 (2018年12月10日)	2,602	2,602	1.0343	1.0343
第3計算期間末 (2019年12月10日)	3,360	3,360	1.2962	1.2962
2019年 6月末日	2,222		1.1416	
7月末日	2,290		1.1911	
8月末日	2,409		1.2356	
9月末日	2,557		1.2934	
10月末日	3,369		1.3356	
11月末日	3,399		1.3230	
12月末日	3,413		1.2838	
2020年 1月末日	3,723		1.3290	
2月末日	3,504		1.2158	

3月末日	2,635		0.9613
4月末日	2,347		0.9524
5月末日	2,525		1.0305
6月末日	2,478		1.0128

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.25
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	11.51
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	25.32
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	17.69

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,436,731,064	176,969,258
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,606,741,957	350,251,304
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	1,116,951,844	1,041,002,462
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	763,572,554	972,378,309

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2020年 6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	2,608,047,982	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,169,894	0.04
合計(純資産総額)		2,609,217,876	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	2,821,951,940	1.1513	3,248,999,532	0.9242	2,608,047,982	99.96

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年12月11日)	1,518	1,518	1.0266	1.0266
第2計算期間末 (2018年12月10日)	1,887	1,887	1.0271	1.0271
第3計算期間末 (2019年12月10日)	4,089	4,089	1.1296	1.1296
2019年 6月末日	2,664		1.0507	
7月末日	2,838		1.0766	
8月末日	2,874		1.0678	
9月末日	3,028		1.1098	
10月末日	4,043		1.1468	
11月末日	4,097		1.1423	

12月末日	4,166		1.1292
2020年 1月末日	4,373		1.1486
2月末日	4,234		1.0799
3月末日	2,522		0.8073
4月末日	2,708		0.8618
5月末日	2,761		0.8690
6月末日	2,609		0.8785

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.0000
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.0000
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	0.0000
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	2.66
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	0.05
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	9.98
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	14.64

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	1,618,331,745	138,782,803
第2期	2017年12月12日～2018年12月10日	1,601,705,660	1,243,412,814
第3期	2018年12月11日～2019年12月10日	2,308,663,405	525,928,645
当中間期	2019年12月11日～2020年 6月10日	956,183,583	1,527,540,222

(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)

R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	75,026,644,570	84.64
地方債証券	日本	4,246,032,700	4.79
特殊債券	日本	5,221,730,599	5.89
社債券	日本	3,303,235,000	3.73
	フランス	98,504,000	0.11
	オーストラリア	100,197,000	0.11
	小計	3,501,936,000	3.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		643,861,064	0.73
合計（純資産総額）		88,640,204,933	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135回利付国債（5年）	1,300,000,000	100.83	1,310,875,800	100.66	1,308,684,000	0.100	2023/3/20	1.48
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	1,280,000,000	100.66	1,288,557,000	100.54	1,286,988,800	0.100	2022/9/20	1.45
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,260,000,000	101.00	1,272,715,200	100.85	1,270,823,400	0.100	2024/3/20	1.43
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	1,070,000,000	101.00	1,080,752,900	100.91	1,079,811,900	0.100	2024/6/20	1.22
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	1,060,000,000	100.72	1,067,646,500	100.60	1,066,434,200	0.100	2022/12/20	1.20
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	910,000,000	101.30	921,897,300	100.92	918,390,200	0.100	2029/9/20	1.04
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	880,000,000	101.53	893,538,800	101.30	891,457,600	0.100	2026/12/20	1.01
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	860,000,000	100.90	867,758,900	100.80	866,897,200	0.100	2023/12/20	0.98
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	850,000,000	100.82	856,970,000	100.73	856,205,000	0.100	2023/6/20	0.97
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	814,000,000	103.09	839,166,700	102.67	835,798,920	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	810,000,000	101.86	825,137,400	101.35	820,951,200	0.100	2027/3/20	0.93
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	790,000,000	101.42	801,240,300	101.28	800,112,000	0.100	2028/9/20	0.90
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	760,000,000	101.22	769,287,600	100.80	766,102,800	0.100	2029/12/20	0.86
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	730,000,000	101.45	740,613,600	101.19	738,687,000	0.100	2028/12/20	0.83
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	730,000,000	101.10	738,063,400	100.97	737,088,300	0.100	2025/3/20	0.83

日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	690,000,000	101.62	701,209,900	101.39	699,597,900	0.100	2027/12/20	0.79
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	690,000,000	101.51	700,480,300	101.28	698,852,700	0.100	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第132回利付国債（5年）	690,000,000	100.63	694,359,300	100.48	693,332,700	0.100	2022/6/20	0.78
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	680,000,000	101.50	690,230,500	101.26	688,574,800	0.100	2026/6/20	0.78
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	680,000,000	101.40	689,526,200	100.98	686,711,600	0.100	2029/6/20	0.77
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	680,000,000	101.09	687,446,200	100.96	686,568,800	0.100	2024/12/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	640,000,000	101.50	649,627,000	101.09	646,988,800	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	631,000,000	102.78	648,591,900	102.39	646,106,140	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	630,000,000	101.03	636,507,900	100.72	634,580,100	0.100	2030/3/20	0.72
日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	620,000,000	101.03	626,409,800	100.95	625,914,800	0.100	2024/9/20	0.71
日本	国債証券	第408回利付国債（2年）	610,000,000	100.45	612,782,100	100.39	612,391,200	0.100	2022/1/1	0.69
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	600,000,000	101.81	610,894,800	101.35	608,148,000	0.100	2028/3/20	0.69
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	585,000,000	102.68	600,721,800	102.52	599,753,700	0.400	2025/6/20	0.68
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	470,000,000	118.09	555,038,600	116.35	546,854,400	1.400	2034/9/20	0.62
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	532,000,000	102.98	547,859,440	102.54	545,539,400	0.600	2023/12/20	0.62

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.64
地方債証券	4.79
特殊債券	5.89
社債券	3.95
合計	99.27

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	21,710,639,140	98.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		416,354,457	1.88
合計（純資産総額）		22,126,993,597	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	451,965,000	2.04

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

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	110,800	7,368.86	816,470,715	6,762.00	749,229,600	3.39
日本	株式	ソニー	電気機器	62,200	7,473.84	464,873,190	7,384.00	459,284,800	2.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,300	4,595.65	355,244,054	5,450.00	421,285,000	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	9,000	38,733.90	348,605,165	45,030.00	405,270,000	1.83
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	130,300	2,692.26	350,801,659	2,515.50	327,769,650	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	82,600	4,104.63	339,043,218	3,848.00	317,844,800	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	6,100	42,301.90	258,041,619	48,010.00	292,861,000	1.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	670,100	519.44	348,081,476	421.60	282,514,160	1.28
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	68,000	4,026.12	273,776,646	3,682.00	250,376,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	28,400	7,547.78	214,357,025	8,806.00	250,090,400	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	71,000	3,233.63	229,587,730	3,234.00	229,614,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	12,700	15,286.84	194,142,907	17,335.00	220,154,500	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	78,200	2,798.44	218,838,506	2,755.50	215,480,100	0.97
日本	株式	信越化学工業	化学	16,700	12,160.48	203,080,128	12,595.00	210,336,500	0.95
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	67,700	3,540.02	239,659,418	3,032.00	205,266,400	0.93
日本	株式	花王	化学	23,800	8,873.28	211,184,132	8,540.00	203,252,000	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	19,700	10,553.95	207,912,994	10,260.00	202,122,000	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	69,700	3,101.02	216,141,261	2,882.00	200,875,400	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	29,200	6,300.69	183,980,425	6,316.00	184,427,200	0.83
日本	株式	中外製薬	医薬品	31,100	3,883.74	120,784,615	5,765.00	179,291,500	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	9,300	18,994.26	176,646,618	19,260.00	179,118,000	0.81

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,331,000	149.69	199,245,958	132.20	175,958,200	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	23,900	6,934.90	165,744,147	7,196.00	171,984,400	0.78
日本	株式	S M C	機械	3,100	48,773.12	151,196,676	55,180.00	171,058,000	0.77
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	6,300	23,779.77	149,812,603	26,440.00	166,572,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	34,600	5,603.06	193,866,212	4,698.00	162,550,800	0.73
日本	株式	日立製作所	電気機器	47,700	4,034.08	192,425,664	3,403.00	162,323,100	0.73
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	68,400	2,481.94	169,765,167	2,321.50	158,790,600	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	86,100	1,834.70	157,968,448	1,799.50	154,936,950	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	64,100	2,684.90	172,102,090	2,270.00	145,507,000	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.54
		食料品	3.87
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.17
		医薬品	6.77
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.54
		機械	5.18
		電気機器	14.83
		輸送用機器	7.13
		精密機器	2.59
		その他製品	2.45
		電気・ガス業	1.53
		陸運業	3.95
		海運業	0.13
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.77		
卸売業	4.38		
小売業	4.88		
銀行業	4.85		
証券、商品先物取引業	0.77		
保険業	1.96		

	その他金融業	1.11
	不動産業	1.98
	サービス業	5.19
合 計		98.12

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	29	日本円	468,875,950	451,965,000	2.04

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

R A M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	14,234,043,740	44.82
	カナダ	605,373,206	1.91
	メキシコ	236,691,299	0.75
	ドイツ	2,380,937,904	7.50
	イタリア	2,856,885,828	9.00
	フランス	3,174,909,644	10.00
	オランダ	614,799,496	1.94
	スペイン	1,861,710,070	5.86
	ベルギー	805,343,560	2.54
	オーストリア	484,144,583	1.52
	フィンランド	178,727,294	0.56
	アイルランド	233,207,440	0.73
	イギリス	2,057,197,409	6.48
	スウェーデン	87,285,375	0.27
	ノルウェー	63,083,304	0.20
	デンマーク	156,180,263	0.49
	ポーランド	181,425,340	0.57
オーストラリア	679,025,265	2.14	
シンガポール	137,088,023	0.43	

	マレーシア	150,891,494	0.48
	イスラエル	118,628,654	0.37
	小計	31,297,579,191	98.54
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		462,248,414	1.46
合計(純資産総額)		31,759,827,605	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		108,142,330	0.34

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,670,000	11,021.64	184,061,421	11,111.10	185,555,498	1.625	2022/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,480,000	10,841.96	160,461,124	11,095.53	164,213,933	1.750	2022/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,260,000	11,137.01	140,326,388	11,912.84	150,101,849	1.750	2029/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	10,756.97	145,219,190	10,760.74	145,270,024	0.125	2023/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,070,000	12,066.03	129,106,600	13,041.37	139,542,762	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,110,000	11,433.91	126,916,487	12,451.54	138,212,152	2.375	2029/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	11,517.59	133,604,150	11,664.11	135,303,751	1.500	2030/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,240,000	10,826.35	134,246,788	10,906.57	135,241,532	1.125	2021/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	11,858.67	122,144,352	12,643.24	130,225,432	2.625	2029/2/15	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	870,000	14,913.60	129,748,360	14,924.99	129,847,491	2.750	2027/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,040,000	11,788.94	122,605,006	12,113.80	125,983,572	2.250	2027/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	830,000	13,054.21	108,349,990	15,171.55	125,923,939	3.125	2048/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,050,000	11,056.60	116,094,366	11,840.45	124,324,796	2.000	2026/11/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	550,000	22,002.26	121,012,472	22,290.82	122,599,553	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	11,680.09	110,960,887	12,582.01	119,529,112	2.750	2028/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	11,003.78	112,238,646	11,524.18	117,546,653	2.000	2024/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	740,000	13,822.91	102,289,569	15,852.29	117,307,012	3.625	2044/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,804.05	106,236,473	12,730.36	114,573,280	2.875	2028/5/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	18,504.53	114,728,119	18,358.13	113,820,452	5.500	2029/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	11,143.72	108,094,130	11,713.14	113,617,525	2.250	2024/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	11,270.82	104,818,659	12,148.10	112,977,378	2.250	2027/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	11,051.45	104,988,781	11,634.44	110,527,237	2.000	2025/2/15	0.35
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	550,000	19,626.11	107,943,629	19,892.99	109,411,479	2.500	2044/7/4	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	10,887.63	105,610,023	11,094.27	107,614,451	2.000	2022/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	12,530.03	90,216,250	14,648.01	105,465,674	2.875	2049/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,310.37	101,793,398	11,554.06	103,986,561	1.625	2026/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	910,000	10,972.65	99,851,201	11,409.07	103,822,597	1.375	2026/8/31	0.33

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	12,623.04	89,623,617	14,599.40	103,655,741	3.000	2045/11/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	800,000	13,089.13	104,713,084	12,911.48	103,291,895	3.000	2022/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	11,050.29	98,347,615	11,546.27	102,761,856	2.125	2024/3/31	0.32

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.54
合 計	98.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	503,900.00	54,015,896	54,285,147	0.17
	ユーロ	買建	358,600.00	43,125,738	43,419,288	0.14
	英ポンド	買建	60,100.00	8,001,052	7,963,250	0.03
	オーストラリアドル	買建	33,500.00	2,472,400	2,474,645	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M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2020年 6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	77,749,378,904	45.27
	カナダ	3,329,639,667	1.94
	メキシコ	1,328,867,108	0.77
	ドイツ	12,990,246,209	7.56
	イタリア	15,594,757,927	9.08
	フランス	17,336,640,210	10.09
	オランダ	3,360,500,154	1.96
	スペイン	10,177,766,720	5.93
	ベルギー	4,400,698,571	2.56
	オーストリア	2,651,559,874	1.54
	フィンランド	978,894,980	0.57

	アイルランド	1,313,063,256	0.76
	イギリス	11,251,875,507	6.55
	スウェーデン	454,579,999	0.26
	ノルウェー	316,466,110	0.18
	デンマーク	836,162,086	0.49
	ポーランド	985,416,709	0.57
	オーストラリア	3,707,493,859	2.16
	シンガポール	762,353,115	0.44
	マレーシア	798,584,912	0.47
	イスラエル	644,235,422	0.38
	小計	170,969,181,299	99.55
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	767,471,083	0.45
	合計（純資産総額）	171,736,652,382	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		507,032,620	0.30
	売建		171,150,765,650	99.66

(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	8,900,000	11,135.02	991,017,300	11,162.66	993,477,045	1.625	2022/12/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	13,618.33	857,955,168	14,823.08	933,854,538	3.000	2048/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	11,227.77	894,853,565	11,320.90	902,276,252	1.375	2025/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	11,304.71	859,158,193	11,367.83	863,955,204	1.500	2024/11/30	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,690,000	12,329.65	824,854,101	12,774.76	854,631,790	2.875	2028/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,560,000	11,125.23	841,067,569	11,094.27	838,727,062	2.000	2022/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,780,000	12,801.27	739,913,931	13,041.37	753,791,745	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,861.26	750,493,645	14,889.79	751,934,599	3.000	2048/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,525.31	726,094,975	11,664.11	734,839,348	1.500	2030/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,703.55	649,547,396	12,113.80	672,316,182	2.250	2027/8/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,010,000	22,023.27	662,900,468	22,290.82	670,953,923	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,552.55	643,477,376	11,875.59	661,470,831	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,554.26	633,173,974	11,702.20	641,280,827	2.750	2023/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,927.61	625,007,067	12,148.10	636,560,712	2.250	2027/11/15	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	18,481.76	635,772,835	18,358.13	631,519,930	5.500	2029/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	11,202.49	627,339,853	11,179.07	626,028,286	2.375	2022/3/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,010,000	11,278.22	565,038,982	12,451.54	623,822,414	2.375	2029/5/15	0.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,363.94	602,289,205	11,702.20	620,216,858	2.000	2025/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,974.74	587,149,114	11,546.27	617,725,767	2.125	2024/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,979.59	581,010,576	12,582.01	610,227,575	2.750	2028/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,790,000	11,798.32	565,139,611	12,730.36	609,784,458	2.875	2028/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,530,000	10,764.04	595,251,530	10,767.26	595,429,824	0.125	2022/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,660,000	12,602.55	587,278,888	12,643.24	589,175,259	2.625	2029/2/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,090,000	14,089.91	576,277,537	14,267.57	583,543,645	1.500	2031/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	14,105.68	507,804,751	15,909.11	572,728,128	3.375	2048/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,197.95	571,095,802	11,205.17	571,463,675	1.875	2022/10/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	11,482.92	567,256,703	11,533.86	569,772,740	1.625	2026/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,080,000	11,094.80	563,616,061	11,148.14	566,325,681	1.625	2022/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,780,000	12,717.66	480,727,692	14,947.03	564,997,769	3.000	2049/2/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,730,000	14,884.22	555,181,595	14,924.99	556,702,456	2.750	2027/10/25	0.32

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.55
合 計	99.55

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	2,234,000.00	239,454,641	240,668,820	0.14
	ユーロ	買建	1,803,800.00	216,927,513	218,404,104	0.13
	英ポンド	買建	275,100.00	36,623,787	36,450,750	0.02
	オーストラリアドル	買建	155,800.00	11,498,507	11,508,946	0.01
	米ドル	売建	723,965,000.00	77,760,684,226	77,992,662,410	45.41
	カナダドル	売建	42,306,000.00	3,308,758,161	3,333,284,900	1.94
	メキシコペソ	売建	290,473,000.00	1,400,028,753	1,350,699,450	0.79
	ユーロ	売建	566,904,000.00	67,669,352,397	68,640,770,720	39.97
	英ポンド	売建	85,514,000.00	11,354,506,234	11,330,597,200	6.60
	スウェーデンクローナ	売建	39,402,000.00	445,448,644	455,093,100	0.26
	ノルウェークローネ	売建	28,724,000.00	315,912,663	319,698,120	0.19
	デンマーククローネ	売建	51,676,000.00	827,227,603	839,735,000	0.49
	ポーランドズロチ	売建	36,880,000.00	987,300,346	1,002,029,600	0.58
	オーストラリアドル	売建	50,435,000.00	3,618,191,116	3,725,631,910	2.17
	シンガポールドル	売建	10,000,000.00	760,359,867	773,000,000	0.45
	マレーシアリングット	売建	29,690,000.00	738,603,838	746,109,700	0.43

イスラエルシュケル	売建	20,566,000.00	631,050,760	641,453,540	0.37
-----------	----	---------------	-------------	-------------	------

(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2020年 6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	1,307,058,109	29.52
	アイルランド	3,089,460,016	69.78
	小計	4,396,518,125	99.30
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		31,056,647	0.70
合計(純資産総額)		4,427,574,772	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		31,284,792	0.71

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	511,645	6,261.34	3,203,585,789	6,038.28	3,089,460,016	69.78
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	394,267	3,595.95	1,417,765,387	3,315.15	1,307,058,109	29.52

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.30
合計	99.30

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	290,400.00	31,133,515	31,284,792	0.71

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	23,126,410,067	47.99
	カナダ	1,202,228,302	2.49
	パナマ	6,696,377	0.01
	ドイツ	1,094,416,427	2.27
	イタリア	232,582,783	0.48
	フランス	1,223,178,166	2.54
	オランダ	668,236,495	1.39
	スペイン	292,023,882	0.61
	ベルギー	110,960,220	0.23
	オーストリア	18,655,052	0.04
	ルクセンブルク	22,290,575	0.05
	フィンランド	144,436,222	0.30
	アイルランド	618,295,905	1.28
	ポルトガル	22,422,286	0.05
	イギリス	1,619,262,877	3.36
	スイス	1,336,948,282	2.77
	スウェーデン	345,576,598	0.72
	ノルウェー	63,417,785	0.13
	デンマーク	282,851,843	0.59
	ケイマン	71,118,235	0.15
リベリア	8,497,497	0.02	
オーストラリア	736,066,713	1.53	
バミューダ	104,864,594	0.22	
ニュージーランド	38,925,379	0.08	
パプアニューギニア	3,280,275	0.01	
香港	297,070,797	0.62	

	シンガポール	110,137,024	0.23
	イスラエル	72,383,214	0.15
	キュラソー	23,374,027	0.05
	ジャージー	101,506,010	0.21
	マン島	6,840,776	0.01
	小計	34,004,954,685	70.56
投資証券	アメリカ	729,615,214	1.51
	カナダ	7,536,562	0.02
	フランス	18,232,555	0.04
	イギリス	18,616,520	0.04
	オーストラリア	47,953,827	0.10
	香港	18,225,541	0.04
	シンガポール	22,763,465	0.05
	小計	862,943,684	1.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,325,889,797	27.65
合計（純資産総額）		48,193,788,166	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	10,458,240,451	21.70
	買建	ドイツ	2,863,502,040	5.94

(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		274,025,480	0.57

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	37,257	34,290.37	1,277,556,574	38,978.17	1,452,209,948	3.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	61,513	18,047.78	1,110,173,207	21,379.92	1,315,143,363	2.73
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	3,603	209,452.45	754,657,198	288,784.14	1,040,489,261	2.16
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	20,495	23,589.65	483,469,968	23,771.75	487,202,090	1.01

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	2,615	157,478.38	411,805,985	150,294.06	393,018,987	0.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	2,556	157,468.86	402,490,419	150,531.09	384,757,481	0.80
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	22,466	15,986.85	359,160,699	14,980.16	336,544,490	0.70
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	25,419	12,249.11	311,360,232	11,879.04	301,953,379	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	14,543	21,942.95	319,116,395	20,619.28	299,866,207	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・ パーソナル 用品	21,041	13,353.23	280,965,403	12,676.68	266,730,201	0.55
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	26,199	13,871.18	363,411,227	10,019.81	262,509,264	0.54
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	8,095	31,732.17	256,871,925	31,218.74	252,715,720	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	9,305	25,247.55	234,928,498	26,516.96	246,740,395	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	7,631	34,533.24	263,523,178	31,560.27	240,836,483	0.50
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	36,471	7,302.22	266,319,552	6,278.00	228,965,295	0.48
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	11,831	23,613.17	279,367,492	19,090.45	225,859,121	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	6,008	36,752.22	220,807,357	37,526.76	225,460,828	0.47
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	35,338	6,450.61	227,951,783	5,892.30	208,222,119	0.43
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	5,222	29,062.67	151,765,287	39,648.31	207,043,527	0.43
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	61,287	4,044.94	247,902,496	3,222.50	197,497,566	0.41
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	4,116	38,386.80	158,000,089	45,703.30	188,114,816	0.39
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・ 娯楽	15,408	14,732.50	226,998,440	12,015.16	185,129,659	0.38
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	3,747	39,108.97	146,541,327	48,185.63	180,551,584	0.37
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	36,261	5,247.19	190,268,559	4,972.20	180,296,980	0.37
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	21,669	9,184.99	199,029,714	8,201.16	177,711,127	0.37
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	18,403	10,226.69	188,201,832	9,439.15	173,708,703	0.36
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェ ア・サービ ス	9,517	13,191.88	125,547,203	18,138.02	172,619,622	0.36
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	36,108	6,824.09	246,404,347	4,775.03	172,417,029	0.36
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	67,010	3,546.06	237,621,531	2,520.03	168,867,787	0.35

アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	11,874	15,225.79	180,791,145	14,122.55	167,691,268	0.35
------	----	-------------	-----------	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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	2.50
		素材	3.11
		資本財	4.49
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	1.34
		自動車・自動車部品	0.84
		耐久消費財・アパレル	1.26
		消費者サービス	1.05
		メディア・娯楽	4.71
		小売	4.33
		食品・生活必需品小売り	1.11
		食品・飲料・タバコ	3.33
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	3.84
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.52
		銀行	3.97
		各種金融	3.10
		保険	2.30
		不動産	0.34
		ソフトウェア・サービス	8.88
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.14		
電気通信サービス	1.60		
公益事業	2.54		
半導体・半導体製造装置	2.81		
投資証券			1.79
合計			72.35

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 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2009	買建	637	米ドル	96,979,685	10,448,591,261	97,069,245	10,458,240,451	21.70

株価指数先物取引	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002009	買建	1,319	ユーロ	23,161,061	2,804,341,265	23,649,670	2,863,502,040	5.94
----------	-----	-------------------	--------------	----	-------	-----	------------	---------------	------------	---------------	------

(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	1,872,000.00	200,705,599	201,670,560	0.42
	ユーロ	買建	508,000.00	61,002,976	61,508,640	0.13
	オーストラリアドル	買建	73,000.00	5,372,062	5,392,510	0.01
	香港ドル	買建	213,000.00	2,943,958	2,958,570	0.01
	イスラエルシェケル	買建	80,000.00	2,498,792	2,495,200	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	19,337,062	0.24
	アルゼンチン	2,054,257	0.03
	メキシコ	90,944,627	1.12
	ブラジル	281,629,745	3.45
	チリ	31,340,911	0.38
	コロンビア	9,515,477	0.12
	ペルー	2,019,834	0.02
	オランダ	4,086,742	0.05
	ルクセンブルク	7,449,938	0.09
	ギリシャ	6,707,113	0.08
	トルコ	23,960,966	0.29
	チェコ	6,378,112	0.08
	ハンガリー	12,187,069	0.15
	ポーランド	38,673,282	0.47
	ロシア	172,301,283	2.11
	ケイマン	1,350,807,476	16.56
	バミューダ	48,776,341	0.60
	香港	137,504,249	1.69
シンガポール	1,477,014	0.02	
マレーシア	93,479,228	1.15	

	タイ	119,305,383	1.46
	フィリピン	44,785,401	0.55
	インドネシア	79,357,596	0.97
	韓国	620,417,413	7.61
	台湾	636,734,484	7.81
	中国	650,116,952	7.97
	インド	432,948,934	5.31
	カタール	44,249,551	0.54
	エジプト	5,151,901	0.06
	南アフリカ	199,329,534	2.44
	アラブ首長国連邦	27,859,730	0.34
	マン島	1,608,798	0.02
	サウジアラビア	144,441,031	1.77
	小計	5,346,937,434	65.57
投資証券	メキシコ	2,032,575	0.02
	南アフリカ	1,976,213	0.02
	小計	4,008,788	0.05
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,803,725,723	34.38
合計(純資産総額)		8,154,671,945	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	2,799,610,427	34.33

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

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		12,388,950	0.15

(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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	16,130	22,873.39	368,947,915	23,166.25	373,671,690	4.58
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	49,200	5,401.47	265,752,607	6,755.40	332,365,680	4.08
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	211,000	1,196.13	252,383,761	1,138.80	240,286,800	2.95

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	41,031	5,373.46	220,478,798	4,716.00	193,502,196	2.37
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	3,829	15,566.52	59,604,216	19,396.98	74,271,038	0.91
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	30,600	1,886.16	57,716,554	2,386.63	73,030,878	0.90
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	828,000	88.75	73,487,658	86.59	71,702,316	0.88
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	24,530	2,149.41	52,725,072	2,481.33	60,867,172	0.75
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	51,500	1,269.29	65,368,649	1,081.42	55,693,130	0.68
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	7,320	4,712.99	34,499,099	6,419.14	46,988,172	0.58
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	53,000	938.78	49,755,809	720.02	38,161,060	0.47
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	14,211	3,372.86	47,931,844	2,507.25	35,630,615	0.44
ブラジル	株式	VALE SA	素材	32,000	1,060.67	33,941,623	1,108.70	35,478,589	0.44
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	4,705	8,658.06	40,736,216	7,524.00	35,400,420	0.43
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	525,000	77.43	40,652,913	66.02	34,663,125	0.43
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	108,800	327.38	35,619,587	310.98	33,834,624	0.41
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	682	36,582.46	24,949,242	46,612.63	31,789,816	0.39
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	52,902	763.65	40,398,852	597.52	31,610,322	0.39
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	29,708	1,108.17	32,921,728	1,053.72	31,303,914	0.38
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,350	13,627.80	32,025,335	13,067.78	30,709,294	0.38
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	24,506	1,739.72	42,633,654	1,249.24	30,614,005	0.38
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	3,686	10,857.62	40,021,194	8,117.13	29,919,747	0.37
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,129	4,274.03	30,469,592	4,144.50	29,546,141	0.36
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	687,000	43.77	30,073,412	40.17	27,597,477	0.34
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	13,000	1,530.91	19,901,928	2,062.25	26,809,250	0.33
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,070	16,425.91	17,575,726	23,760.00	25,423,200	0.31
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	3,300	5,204.15	17,173,710	7,265.98	23,977,752	0.29
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	7,883	3,100.72	24,443,043	3,026.37	23,856,922	0.29
韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	816	16,187.01	13,208,608	27,990.00	22,839,840	0.28
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	7,109	3,099.15	22,031,913	3,143.44	22,346,772	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	3.96
		素材	4.50
		資本財	1.90
		商業・専門サービス	0.18
		運輸	0.99
		自動車・自動車部品	1.24
		耐久消費財・アパレル	0.78
		消費者サービス	1.09
		メディア・娯楽	6.24
		小売	8.24
		食品・生活必需品小売り	1.02
		食品・飲料・タバコ	2.44
		家庭用品・パーソナル用品	0.81
		ヘルスケア機器・サービス	0.85
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.99
		銀行	9.00
		各種金融	1.38
		保険	2.22
		不動産	1.65
		ソフトウェア・サービス	1.29
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.30
電気通信サービス	2.53		
公益事業	1.50		
半導体・半導体製造装置	4.48		
投資証券		0.05	
合計		65.62	

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 2009	買建	525	米ドル	25,211,845	2,716,324,179	25,984,875	2,799,610,427	34.33

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

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	115,000.00	12,331,381	12,388,950	0.15

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 6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	16,438,312,920	97.45
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		430,071,101	2.55
合計（純資産総額）		16,868,384,021	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	422,144,000	2.50

(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	1,845	818,129.74	1,509,449,373	614,000	1,132,830,000	6.72
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,905	744,186.65	1,417,675,580	553,000	1,053,465,000	6.25
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,866	297,453.16	852,500,762	328,000	940,048,000	5.57
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,150	174,562.58	1,073,559,892	129,400	795,810,000	4.72
日本	投資証券	G L P 投資法人	4,929	136,315.95	671,901,334	156,500	771,388,500	4.57
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,718	277,447	754,100,948	254,000	690,372,000	4.09
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,807	337,585.79	610,017,525	321,500	580,950,500	3.44
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,796	213,624.29	810,917,827	141,400	536,754,400	3.18
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,277	177,876.5	760,777,819	115,800	495,276,600	2.94
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,600	209,360.13	753,696,478	134,500	484,200,000	2.87
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,453	165,413	405,758,113	173,600	425,840,800	2.52
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,252	451,984.01	565,883,991	316,000	395,632,000	2.35
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	633	681,805.12	431,582,644	624,000	394,992,000	2.34
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,570	86,428.31	481,405,687	69,200	385,444,000	2.29
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,245	284,057.05	353,651,038	292,800	364,536,000	2.16
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	955	521,613.97	498,141,342	371,500	354,782,500	2.10

日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	589	797,976.96	470,008,435	601,000	353,989,000	2.10
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,192	174,629.62	382,788,132	136,200	298,550,400	1.77
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,771	164,111.54	290,641,555	166,200	294,340,200	1.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,137	65,332.36	400,944,716	44,500	273,096,500	1.62
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	829	347,502.13	288,079,274	322,000	266,938,000	1.58
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	440	804,534.38	353,995,131	597,000	262,680,000	1.56
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	542	514,364.3	278,785,453	480,500	260,431,000	1.54
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,056	141,183.81	290,273,916	114,400	235,206,400	1.39
日本	投資証券	大和証券りびング投資法人	2,332	102,754.75	239,624,081	100,400	234,132,800	1.39
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,356	48,495.88	405,231,623	27,790	232,213,240	1.38
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,243	205,577.8	255,533,216	186,100	231,322,300	1.37
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	677	421,707.87	285,496,232	340,500	230,518,500	1.37
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,762	179,542.71	316,354,260	125,200	220,602,400	1.31
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,620	182,436.62	295,547,336	134,000	217,080,000	1.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	97.45
合計	97.45

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	256	日本円	439,691,160	422,144,000	2.50

(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2020年6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	10,631,238,061	74.43
	カナダ	267,021,350	1.87
	ドイツ	39,885,087	0.28
	イタリア	2,083,148	0.01

	フランス	328,542,081	2.30
	オランダ	26,041,717	0.18
	スペイン	74,871,246	0.52
	ベルギー	173,745,332	1.22
	アイルランド	20,866,134	0.15
	イギリス	718,936,942	5.03
	オーストラリア	916,850,050	6.42
	ニュージーランド	63,159,290	0.44
	香港	257,963,567	1.81
	シンガポール	623,861,799	4.37
	韓国	7,598,610	0.05
	イスラエル	8,541,677	0.06
	ガーンジー	29,441,051	0.21
	マン島	3,044,285	0.02
	小計	14,193,691,427	99.36
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	90,769,986	0.64
	合計(純資産総額)	14,284,461,413	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		77,447,840	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。

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	90,749	10,094.41	916,058,356	9,822.65	891,396,191	6.24
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	10,874	66,070.17	718,447,107	74,224.24	807,114,395	5.65
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	33,002	14,292.03	471,665,635	15,097.60	498,251,200	3.49
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	18,498	23,308.96	431,169,257	20,589.11	380,857,431	2.67
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,342	22,031.19	382,064,927	16,484.21	285,869,343	2.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	51,069	8,260.33	421,847,299	5,522.75	282,041,442	1.97
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,401	13,373.64	500,187,574	7,340.32	274,535,540	1.92
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	42,324	7,669.84	324,618,389	6,440.69	272,596,068	1.91
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,548	17,404.60	270,606,780	17,414.01	270,753,124	1.90
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	43,116	8,341.51	359,652,670	6,213.36	267,895,480	1.88
香港	投資証券	LINK REIT	251,600	1,075.25	270,534,190	884.73	222,599,326	1.56
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	199,153	1,094.37	217,948,414	1,110.41	221,142,757	1.55
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,076	31,479.68	254,229,927	24,395.56	197,018,609	1.38

アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	66,496	3,194.73	212,436,902	2,918.67	194,080,319	1.36
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,965	3,580.65	236,197,625	2,928.37	193,170,138	1.35
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	45,746	5,571.31	254,865,372	3,954.05	180,882,337	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	12,007	16,412.09	197,060,033	14,484.56	173,916,179	1.22
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	146,016	1,182.57	172,675,081	1,182.78	172,705,426	1.21
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	17,644	13,834.82	244,101,623	9,661.04	170,459,492	1.19
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,974	14,123.16	197,357,067	12,015.16	167,899,913	1.18
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	45,028	3,814.37	171,753,781	3,725.64	167,758,532	1.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,765	11,402.73	179,764,085	9,893.76	155,975,193	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	21,163	8,529.02	180,499,747	7,204.57	152,470,395	1.07
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,284	7,477.95	166,638,712	6,642.17	148,014,139	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	36,042	4,927.94	177,613,045	3,963.75	142,861,643	1.00
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	64,888	2,279.41	147,906,772	1,986.72	128,914,651	0.90
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	57,406	2,638.92	151,490,315	2,154.80	123,698,449	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	11,910	11,377.42	135,505,140	9,684.74	115,345,356	0.81
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	14,136	6,923.64	97,872,698	8,023.39	113,418,751	0.79
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	20,817	6,303.70	131,224,155	4,936.64	102,766,176	0.72

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.36
合計	99.36

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	527,000.00	56,563,210	56,773,710	0.40
	ユーロ	買建	24,500.00	2,949,236	2,966,460	0.02
	英ポンド	買建	51,000.00	6,757,398	6,757,500	0.05
	オーストラリアドル	買建	101,000.00	7,445,326	7,460,870	0.05
	シンガポールドル	買建	29,000.00	2,232,536	2,241,700	0.02
	イスラエルシェケル	買建	40,000.00	1,252,000	1,247,600	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

FWりそな国内債券インデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.3%
先物	0.0%
現金等	0.7%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第135回利付国債(5年)	0.10%	2023/3/20	1.5%
2	第133回利付国債(5年)	0.10%	2022/9/20	1.5%
3	第139回利付国債(5年)	0.10%	2024/3/20	1.4%
4	第140回利付国債(5年)	0.10%	2024/6/20	1.2%
5	第134回利付国債(5年)	0.10%	2022/12/20	1.2%
6	第356回利付国債(10年)	0.10%	2029/9/20	1.0%
7	第345回利付国債(10年)	0.10%	2026/12/20	1.0%
8	第138回利付国債(5年)	0.10%	2023/12/20	1.0%
9	第136回利付国債(5年)	0.10%	2023/6/20	1.0%
10	第340回利付国債(10年)	0.40%	2025/9/20	0.9%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(NOMURA-BPI総合)の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな国内株式インデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	98.1%
先物	2.0%
現金等	-0.2%
合計	100.0%

■組入上位業種

業種	組入比率
1 電気機器	14.8%
2 情報・通信業	9.8%
3 化学	7.2%
4 輸送用機器	7.1%
5 医薬品	6.8%

■組入上位銘柄

	銘柄名	業種	組入比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
2	ソニー	電気機器	2.1%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9%
4	キーエンス	電気機器	1.8%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
6	武田薬品工業	医薬品	1.4%
7	任天堂	その他製品	1.3%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3%
9	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
10	第一三共	医薬品	1.1%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(東証株価指数(TOPIX、配当込み))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	98.5%
先物	0.0%
現金等	1.5%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	44.8%
ユーロ	39.6%
英ポンド	6.5%
豪ドル	2.1%
カナダドル	1.9%
その他	5.0%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2022/8/15	0.6%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	1.750%	2022/5/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.750%	2029/11/15	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	0.125%	2023/5/15	0.5%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	3.125%	2028/11/15	0.4%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	2.375%	2029/5/15	0.4%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	1.500%	2030/2/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	1.125%	2021/9/30	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	2.625%	2029/2/15	0.4%
10	GOV OF FRANCE	フランス	2.750%	2027/10/25	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(FW世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
債券	99.6%
先物	0.0%
現金等	0.4%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	45.3%
ユーロ	40.1%
英ポンド	6.6%
豪ドル	2.2%
カナダドル	1.9%
その他	4.0%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2022/12/15	0.6%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	3.000%	2048/2/15	0.5%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	1.375%	2025/1/31	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	1.500%	2024/11/30	0.5%
5	US TREASURY N/B	アメリカ	2.875%	2028/8/15	0.5%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	2.000%	2022/2/15	0.5%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	3.125%	2028/11/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	3.000%	2048/8/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	1.500%	2030/2/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	2.250%	2027/8/15	0.4%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな新興国債券インデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

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

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
インドネシアルピア	10.3%
ブラジルレアル	10.0%
メキシコペソ	9.6%
タイバーツ	8.8%
ポーランドズロチ	8.1%
その他	53.2%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	アイルランド	-	-	69.8%
2	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	アメリカ	-	-	29.5%
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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

※通貨別資産配分は、マザーファンドが実質的に保有している債券の通貨を基準に算出しています。

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(JPMオルガンG8I-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース))の年間騰落率です。

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

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	72.3%
先物	27.6%
現金等	0.0%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	50.7%
イギリス	3.7%
スイス	2.7%
フランス	2.6%
カナダ	2.5%
その他	37.9%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	3.0%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.7%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.2%
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	0.8%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	0.8%
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品/バイオテクノロジー/ヘルスケア	0.7%
8	NESTLE SA-REG	スイス	食品・飲料・タバコ	0.6%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.6%
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	0.6%

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

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

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

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな新興国株式インデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
株式	65.6%
先物	34.3%
現金等	0.1%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
中国	26.0%
台湾	8.0%
韓国	7.6%
インド	5.3%
ブラジル	3.4%
その他	49.7%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	小売	4.6%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	メディア・娯楽	4.1%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	2.9%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.4%
5	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	小売	0.9%
6	MEITUAN DIANPING-CLASS B	中国	小売	0.9%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	0.9%
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	0.7%
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	保険	0.7%
10	JD.COM INC-ADR	中国	小売	0.6%

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

※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(MSCI Eマージン・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな国内リートインデックスファンド

2020年6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)を再投資したもものとして計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

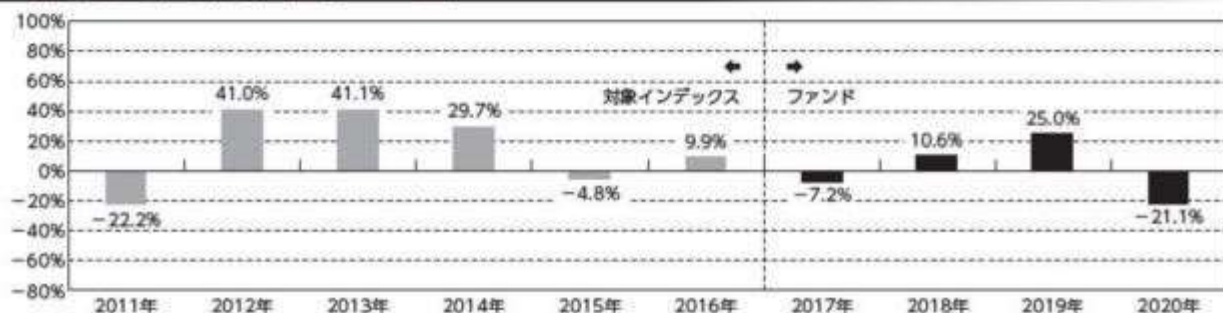
資産	組入比率
不動産投資信託証券	97.5%
先物	2.5%
現金等	0.0%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.7%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.2%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.6%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.7%
5	GLP投資法人	4.6%
6	大和ハウスリート投資法人	4.1%
7	アドバンス・レジデンス投資法人	3.4%
8	オリックス不動産投資法人	3.2%
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.9%
10	日本リートールファンド投資法人	2.9%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(東証REIT指数(配当込み))の年間騰落率です。
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
 ・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
 ・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国リートインデックスファンド

2020年6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)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

資産	組入比率
不動産投資信託証券	99.4%
先物	0.0%
現金等	0.6%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	74.5%
オーストラリア	6.4%
イギリス	5.1%
シンガポール	4.2%
フランス	2.3%
その他	7.5%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.7%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.5%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.7%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.0%
6	WELLTOWER INC	アメリカ	2.0%
7	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	1.9%
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.9%
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.9%
10	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	1.9%

※組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※国・地域は発行国もしくは投資国を表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2011年から2016年までは、対象インデックス(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2020年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

＜FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）＞

＜FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）＞

＜FWりそな新興国債券インデックスファンド＞

＜FWりそな先進国株式インデックスファンド＞

・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

＜FWりそな新興国株式インデックスファンド＞

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

＜FWりそな先進国リートインデックスファンド＞

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(6) 申込金額

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

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

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）：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。

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）：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。

FWりそな新興国債券インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

FWりそな先進国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

FWりそな新興国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

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

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(7) 申込単位

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

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、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。

い。

(5) 解約価額

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(6) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

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

(8) 解約代金の支払い

F Wりそな国内債券インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

F Wりそな国内株式インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

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

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

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

F Wりそな国内リートインデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

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

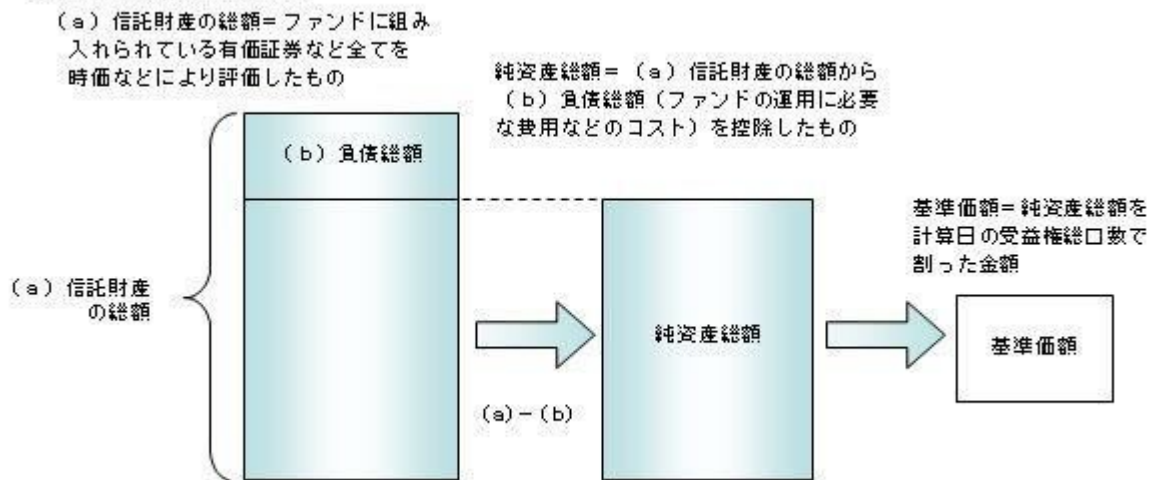
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2017年1月5日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年12月11日から翌年12月10日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 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

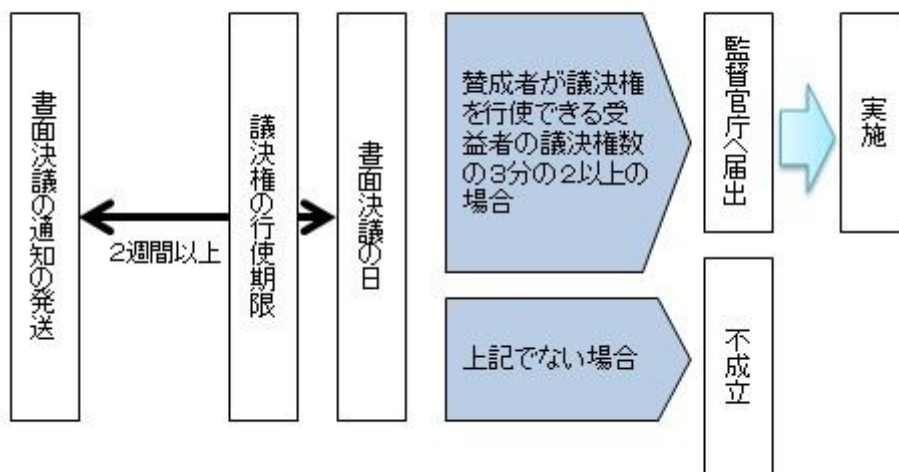
 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年12月11日から2019年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	151,809,503	123,687,640
親投資信託受益証券	47,582,711,764	40,672,964,303
未収入金	30,000,000	-
流動資産合計	47,764,521,267	40,796,651,943
資産合計	47,764,521,267	40,796,651,943
負債の部		
流動負債		
未払解約金	87,553,692	36,488,718
未払受託者報酬	7,509,891	6,810,717
未払委託者報酬	55,072,458	49,945,206
未払利息	411	335
その他未払費用	2,504,733	2,270,667
流動負債合計	152,641,185	95,515,643
負債合計	152,641,185	95,515,643
純資産の部		
元本等		
元本	47,514,995,849	39,949,947,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	96,884,233	751,188,301
（分配準備積立金）	309,036,484	549,091,662
元本等合計	47,611,880,082	40,701,136,300
純資産合計	47,611,880,082	40,701,136,300
負債純資産合計	47,764,521,267	40,796,651,943

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		184,973,102		928,552,539
営業収益合計		184,973,102		928,552,539
営業費用				
支払利息		101,699		124,473
受託者報酬		13,242,624		14,224,191
委託者報酬		97,112,395		104,310,592
その他費用		4,418,376		4,746,694
営業費用合計		114,875,094		123,405,950
営業利益又は営業損失（ ）		70,098,008		805,146,589
経常利益又は経常損失（ ）		70,098,008		805,146,589
当期純利益又は当期純損失（ ）		70,098,008		805,146,589
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（ ）		22,700,321		343,083,823
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,873,281		96,884,233
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,500,787		270,803,932
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,500,787		270,803,932
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,541,602		78,562,630
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,541,602		78,562,630
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		96,884,233		751,188,301

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 28,966,582,797円	期首元本額 47,514,995,849円
期中追加設定元本額 26,877,211,328円	期中追加設定元本額 13,059,303,045円
期中一部解約元本額 8,328,798,276円	期中一部解約元本額 20,624,350,895円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 47,514,995,849口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 39,949,947,999口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0020円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0188円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,020円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,188円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 242,731,308円	A 費用控除後の配当等収益額 266,867,881円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 91,205,565円
C 収益調整金額 116,020,947円	C 収益調整金額 202,096,639円
D 分配準備積立金額 66,305,176円	D 分配準備積立金額 191,018,216円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 425,057,431円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 751,188,301円
F 当ファンドの期末残存口数 47,514,995,849口	F 当ファンドの期末残存口数 39,949,947,999口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 89円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 188円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	214,866,433	688,445,975
合計	214,866,433	688,445,975

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	38,363,482,648	40,672,964,303	
	合計	38,363,482,648	40,672,964,303	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R A M国内債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	62,252,717	69,124,091
親投資信託受益証券	16,821,725,624	24,173,864,663
未収入金	10,800,000	-
流動資産合計	16,894,778,341	24,242,988,754
資産合計	16,894,778,341	24,242,988,754
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,221,016	22,827,987
未払受託者報酬	2,584,525	3,341,321
未払委託者報酬	23,260,669	30,071,859
未払利息	168	187
その他未払費用	861,979	1,113,997
流動負債合計	59,928,357	57,355,351
負債合計	59,928,357	57,355,351
純資産の部		
元本等		
元本	15,924,914,167	20,690,309,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	909,935,817	3,495,323,461
(分配準備積立金)	1,035,492,938	1,540,495,805
元本等合計	16,834,849,984	24,185,633,403
純資産合計	16,834,849,984	24,185,633,403
負債純資産合計	16,894,778,341	24,242,988,754

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,643,589,236		2,325,049,039
営業収益合計		1,643,589,236		2,325,049,039
営業費用				
支払利息		35,670		55,257
受託者報酬		4,242,332		6,217,645
委託者報酬		38,180,880		55,958,712
その他費用		1,415,535		2,074,786
営業費用合計		43,874,417		64,306,400
営業利益又は営業損失()		1,687,463,653		2,260,742,639
経常利益又は経常損失()		1,687,463,653		2,260,742,639
当期純利益又は当期純損失()		1,687,463,653		2,260,742,639
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		8,572,866		34,377,761
期首剰余金又は期首欠損金()		1,277,263,187		909,935,817
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,618,598,644		587,201,311
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,618,598,644		587,201,311
剰余金減少額又は欠損金増加額		307,035,227		228,178,545
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		307,035,227		228,178,545
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		909,935,817		3,495,323,461

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 6,908,921,204円	期首元本額 15,924,914,167円
期中追加設定元本額 10,773,198,886円	期中追加設定元本額 8,880,522,314円
期中一部解約元本額 1,757,205,923円	期中一部解約元本額 4,115,126,539円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 15,924,914,167口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 20,690,309,942口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0571円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1689円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,571円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,689円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 222,639,644円	A 費用控除後の配当等収益額 446,819,665円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 273,604,733円
C 収益調整金額 1,484,889,112円	C 収益調整金額 2,461,470,418円
D 分配準備積立金額 812,853,294円	D 分配準備積立金額 820,071,407円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 2,520,382,050円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 4,001,966,223円
F 当ファンドの期末残存口数 15,924,914,167口	F 当ファンドの期末残存口数 20,690,309,942口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,582円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,934円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,656,134,427	2,355,217,065
合計	1,656,134,427	2,355,217,065

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内株式マザーファンド	20,106,350,049	24,173,864,663	
合計		20,106,350,049	24,173,864,663	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「RAM国内株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,897,259	64,145,484
親投資信託受益証券	19,801,804,178	23,430,503,865
流動資産合計	19,868,701,437	23,494,649,349
資産合計	19,868,701,437	23,494,649,349
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,794,215	8,716,253
未払受託者報酬	2,000,137	3,427,023
未払委託者報酬	21,334,805	36,554,750
未払利息	181	173
その他未払費用	667,097	1,142,469
流動負債合計	54,796,435	49,840,668
負債合計	54,796,435	49,840,668
純資産の部		
元本等		
元本	19,541,836,461	22,462,375,014
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	272,068,541	982,433,667
（分配準備積立金）	441,299,750	716,911,508
元本等合計	19,813,905,002	23,444,808,681
純資産合計	19,813,905,002	23,444,808,681
負債純資産合計	19,868,701,437	23,494,649,349

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		165,101,716		612,029,687
営業収益合計		165,101,716		612,029,687
営業費用				
支払利息		26,299		50,274
受託者報酬		3,525,420		6,440,593
委託者報酬		37,604,449		68,699,427
その他費用		1,176,111		2,148,643
営業費用合計		42,332,279		77,338,937
営業利益又は営業損失（ ）		207,433,995		534,690,750
経常利益又は経常損失（ ）		207,433,995		534,690,750
当期純利益又は当期純損失（ ）		207,433,995		534,690,750
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（ ）		169,034,799		3,795,388
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		425,183,780		272,068,541
剰余金増加額又は欠損金減少額		94,915,577		257,886,087
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		94,915,577		257,886,087
剰余金減少額又は欠損金増加額		209,631,620		78,416,323
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		209,631,620		78,416,323
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		272,068,541		982,433,667

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 8,363,296,428円	期首元本額 19,541,836,461円
期中追加設定元本額 16,644,523,180円	期中追加設定元本額 8,262,356,144円
期中一部解約元本額 5,465,983,147円	期中一部解約元本額 5,341,817,591円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 19,541,836,461口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 22,462,375,014口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0139円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0437円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,139円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,437円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 212,778,610円	A 費用控除後の配当等収益額 384,362,083円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 784,347,335円	C 収益調整金額 1,089,873,193円
D 分配準備積立金額 228,521,140円	D 分配準備積立金額 332,549,425円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,225,647,085円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,806,784,701円
F 当ファンドの期末残存口数 19,541,836,461口	F 当ファンドの期末残存口数 22,462,375,014口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 627円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 804円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	25,874,556	656,431,113
合計	25,874,556	656,431,113

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド	23,334,831,058	23,430,503,865	
合計		23,334,831,058	23,430,503,865	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R A M先進国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	192,311,792	177,840,660
親投資信託受益証券	47,533,577,926	60,476,767,221
流動資産合計	47,725,889,718	60,654,607,881
資産合計	47,725,889,718	60,654,607,881
負債の部		
流動負債		
未払解約金	75,732,020	21,476,383
未払受託者報酬	7,477,619	9,963,176
未払委託者報酬	79,761,274	106,273,821
未払利息	521	482
その他未払費用	2,493,978	3,321,588
流動負債合計	165,465,412	141,035,450
負債合計	165,465,412	141,035,450
純資産の部		
元本等		
元本	48,045,026,028	57,768,211,684
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	484,601,722	2,745,360,747
(分配準備積立金)	996,408,055	2,195,849,034
元本等合計	47,560,424,306	60,513,572,431
純資産合計	47,560,424,306	60,513,572,431
負債純資産合計	47,725,889,718	60,654,607,881

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		466,820,356		3,286,189,295
営業収益合計		466,820,356		3,286,189,295
営業費用				
支払利息		99,550		143,832
受託者報酬		13,147,543		17,936,847
委託者報酬		140,240,331		191,326,241
その他費用		4,386,772		5,983,931
営業費用合計		157,874,196		215,390,851
営業利益又は営業損失（ ）		624,694,552		3,070,798,444
経常利益又は経常損失（ ）		624,694,552		3,070,798,444
当期純利益又は当期純損失（ ）		624,694,552		3,070,798,444
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（ ）		137,428,167		649,491,194
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		258,698,303		484,601,722
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		808,655,219
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		44,566,073
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		764,089,146
剰余金減少額又は欠損金増加額		256,033,640		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		24,117,317		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		231,916,323		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		484,601,722		2,745,360,747

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 28,727,931,088円	期首元本額 48,045,026,028円
期中追加設定元本額 27,497,514,870円	期中追加設定元本額 25,565,889,158円
期中一部解約元本額 8,180,419,930円	期中一部解約元本額 15,842,703,502円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 48,045,026,028口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 57,768,211,684口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 484,601,722円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9899円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0475円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,899円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,475円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 795,642,410円	A 費用控除後の配当等収益額 1,108,013,614円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 346,134,679円
C 収益調整金額 326,017,027円	C 収益調整金額 892,211,876円
D 分配準備積立金額 200,765,645円	D 分配準備積立金額 741,700,741円
E 当ファンドの分配対象収益額 1,322,425,082円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 3,088,060,910円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 48,045,026,028口	F 当ファンドの期末残存口数 57,768,211,684口
G 10,000口当たり収益分配対象額 275円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 534円 (G=E/F×10,000)
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	394,823,794	2,905,619,327
合計	394,823,794	2,905,619,327

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	59,076,650,602	60,476,767,221	
合計		59,076,650,602	60,476,767,221	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,731,019	8,033,315
親投資信託受益証券	1,768,599,488	2,301,230,940
流動資産合計	1,776,330,507	2,309,264,255
資産合計	1,776,330,507	2,309,264,255
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,595,505	1,309,920
未払受託者報酬	223,430	282,200
未払委託者報酬	3,872,657	4,891,425
未払利息	20	21
その他未払費用	74,456	93,996
流動負債合計	6,766,068	6,577,562
負債合計	6,766,068	6,577,562
純資産の部		
元本等		
元本	1,806,368,468	2,275,289,883
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	36,804,029	27,396,810
(分配準備積立金)	79,281,730	132,343,609
元本等合計	1,769,564,439	2,302,686,693
純資産合計	1,769,564,439	2,302,686,693
負債純資産合計	1,776,330,507	2,309,264,255

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		85,730,914		70,801,452
営業収益合計		85,730,914		70,801,452
営業費用				
支払利息		3,335		4,768
受託者報酬		372,814		512,620
委託者報酬		6,461,900		8,885,363
その他費用		124,257		170,856
営業費用合計		6,962,306		9,573,607
営業利益又は営業損失（ ）		92,693,220		61,227,845
経常利益又は経常損失（ ）		92,693,220		61,227,845
当期純利益又は当期純損失（ ）		92,693,220		61,227,845
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（ ）		5,307,617		3,689,214
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		54,374,651		36,804,029
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,154,355		13,726,867
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,726,867
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,154,355		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,947,432		7,064,659
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,947,432		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		7,064,659
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		36,804,029		27,396,810

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 688,292,151円	期首元本額 1,806,368,468円
期中追加設定元本額 1,230,517,990円	期中追加設定元本額 1,175,865,521円
期中一部解約元本額 112,441,673円	期中一部解約元本額 706,944,106円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,806,368,468口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,275,289,883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 36,804,029円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	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 0.9796円	1口当たり純資産額 1.0120円
(10,000口当たり純資産額) (9,796円)	(10,000口当たり純資産額) (10,120円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 58,687,263円	A 費用控除後の配当等収益額 82,074,294円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 52,374,326円	C 収益調整金額 120,600,484円
D 分配準備積立金額 20,594,467円	D 分配準備積立金額 50,269,315円
E 当ファンドの分配対象収益額 131,656,056円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 252,944,093円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 1,806,368,468口	F 当ファンドの期末残存口数 2,275,289,883口
G 10,000口当たり収益分配対象額 728円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 1,111円 (G=E/F×10,000)
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000) 0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	85,424,222	71,617,761
合計	85,424,222	71,617,761

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	2,097,175,741	2,301,230,940	
	合計	2,097,175,741	2,301,230,940	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,520,443	48,079,551
親投資信託受益証券	6,029,475,373	17,421,883,306
流動資産合計	6,062,995,816	17,469,962,857
資産合計	6,062,995,816	17,469,962,857
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,236,771	7,338,966
未払受託者報酬	1,484,700	2,414,931
未払委託者報酬	18,311,196	29,784,081
未払利息	90	130
その他未払費用	495,105	805,048
流動負債合計	29,527,862	40,343,156
負債合計	29,527,862	40,343,156
純資産の部		
元本等		
元本	5,484,626,857	13,770,768,469
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	548,841,097	3,658,851,232
(分配準備積立金)	316,280,514	2,092,660,729
元本等合計	6,033,467,954	17,429,619,701
純資産合計	6,033,467,954	17,429,619,701
負債純資産合計	6,062,995,816	17,469,962,857

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		236,829,328		2,473,207,933
営業収益合計		236,829,328		2,473,207,933
営業費用				
支払利息		23,095		34,518
受託者報酬		2,670,462		4,290,146
委託者報酬		32,935,536		52,911,669
その他費用		891,087		1,431,346
営業費用合計		36,520,180		58,667,679
営業利益又は営業損失()		200,309,148		2,414,540,254
経常利益又は経常損失()		200,309,148		2,414,540,254
当期純利益又は当期純損失()		200,309,148		2,414,540,254
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()		455,728,103		297,223,789
期首剰余金又は期首欠損金()		774,534,515		548,841,097
剰余金増加額又は欠損金減少額		912,326,827		1,242,071,711
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		912,326,827		1,242,071,711
剰余金減少額又は欠損金増加額		882,601,290		249,378,041
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		882,601,290		249,378,041
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		548,841,097		3,658,851,232

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在		第3期 2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	5,138,361,469円	期首元本額	5,484,626,857円
期中追加設定元本額	6,421,790,557円	期中追加設定元本額	11,072,413,261円
期中一部解約元本額	6,075,525,169円	期中一部解約元本額	2,786,271,649円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,484,626,857口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	13,770,768,469口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.1001円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額	1.2657円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(11,001円)	(10,000口当たり純資産額)	(12,657円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日		第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	92,303,068円	A 費用控除後の配当等収益額	262,260,711円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,582,379,972円
C 収益調整金額	352,702,182円	C 収益調整金額	1,566,190,503円
D 分配準備積立金額	223,977,446円	D 分配準備積立金額	248,020,046円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	668,982,696円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	3,658,851,232円
F 当ファンドの期末残存口数	5,484,626,857口	F 当ファンドの期末残存口数	13,770,768,469口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	1,219円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	2,656円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	228,340,997	2,340,085,864
合計	228,340,997	2,340,085,864

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M先進国株式マザーファンド	12,965,604,902	17,421,883,306	
合計		12,965,604,902	17,421,883,306	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R A M先進国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,880,403	9,887,993
親投資信託受益証券	1,998,217,451	2,809,230,275
未収入金	120,000	-
流動資産合計	2,008,217,854	2,819,118,268
資産合計	2,008,217,854	2,819,118,268
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,151,445	1,662,633
未払受託者報酬	268,200	344,313
未払委託者報酬	5,095,703	6,541,952
未払利息	26	26
その他未払費用	89,395	114,711
流動負債合計	8,604,769	8,663,635
負債合計	8,604,769	8,663,635
純資産の部		
元本等		
元本	1,820,179,340	2,439,675,773
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	179,433,745	370,778,860
(分配準備積立金)	89,052,823	96,834,457
元本等合計	1,999,613,085	2,810,454,633
純資産合計	1,999,613,085	2,810,454,633
負債純資産合計	2,008,217,854	2,819,118,268

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日	自	2018年12月11日
	至	2018年12月10日	至	2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		178,498,895		147,082,824
営業収益合計		178,498,895		147,082,824
営業費用				
支払利息		4,457		6,257
受託者報酬		445,181		634,532
委託者報酬		8,458,169		12,056,151
その他費用		148,421		211,591
営業費用合計		9,056,228		12,908,531
営業利益又は営業損失（ ）		187,555,123		134,174,293
経常利益又は経常損失（ ）		187,555,123		134,174,293
当期純利益又は当期純損失（ ）		187,555,123		134,174,293
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,491,645		2,324,553
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		171,886,880		179,433,745
剰余金増加額又は欠損金減少額		229,973,937		122,489,569
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		229,973,937		122,489,569
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,363,594		67,643,300
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,363,594		67,643,300
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		179,433,745		370,778,860

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 701,866,069円	期首元本額 1,820,179,340円
期中追加設定元本額 1,273,924,653円	期中追加設定元本額 1,307,480,891円
期中一部解約元本額 155,611,382円	期中一部解約元本額 687,984,458円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,820,179,340口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,439,675,773口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0986円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.1520円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,986円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,520円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 21,355,033円	A 費用控除後の配当等収益額 37,495,160円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 142,313,383円	C 収益調整金額 273,944,403円
D 分配準備積立金額 67,697,790円	D 分配準備積立金額 59,339,297円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 231,366,206円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 370,778,860円
F 当ファンドの期末残存口数 1,820,179,340口	F 当ファンドの期末残存口数 2,439,675,773口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,271円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,519円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	180,635,343	158,295,423
合計	180,635,343	158,295,423

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M新興国株式マザーファンド	2,167,281,496	2,809,230,275	
合計		2,167,281,496	2,809,230,275	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R A M新興国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,106,106	9,091,877
親投資信託受益証券	2,600,564,748	3,358,381,719
流動資産合計	2,608,670,854	3,367,473,596
資産合計	2,608,670,854	3,367,473,596
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,762,928	2,909,773
未払受託者報酬	330,344	439,866
未払委託者報酬	2,973,033	3,958,746
未払利息	21	24
その他未払費用	110,089	146,561
流動負債合計	6,176,415	7,454,970
負債合計	6,176,415	7,454,970
純資産の部		
元本等		
元本	2,516,252,459	2,592,201,841
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	86,241,980	767,816,785
（分配準備積立金）	159,085,643	548,420,068
元本等合計	2,602,494,439	3,360,018,626
純資産合計	2,602,494,439	3,360,018,626
負債純資産合計	2,608,670,854	3,367,473,596

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		194,155,830		483,726,971
営業収益合計		194,155,830		483,726,971
営業費用				
支払利息		4,485		6,159
受託者報酬		560,953		783,840
委託者報酬		5,048,484		7,054,482
その他費用		186,966		261,352
営業費用合計		5,800,888		8,105,833
営業利益又は営業損失 ()		188,354,942		475,621,138
経常利益又は経常損失 ()		188,354,942		475,621,138
当期純利益又は当期純損失 ()		188,354,942		475,621,138
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 ()		14,437,786		24,214,110
期首剰余金又は期首欠損金 ()		91,387,947		86,241,980
剰余金増加額又は欠損金減少額		21,669,482		271,648,139
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,669,482		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		271,648,139
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,956,711		41,480,362
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		41,480,362
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,956,711		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		86,241,980		767,816,785

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,259,761,806円	期首元本額 2,516,252,459円
期中追加設定元本額 1,606,741,957円	期中追加設定元本額 1,116,951,844円
期中一部解約元本額 350,251,304円	期中一部解約元本額 1,041,002,462円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,516,252,459口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,592,201,841口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0343円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.2962円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,343円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,962円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 63,357,675円	A 費用控除後の配当等収益額 86,810,891円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 79,470,629円	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 364,596,137円
C 収益調整金額 31,791,307円	C 収益調整金額 219,396,717円
D 分配準備積立金額 16,257,339円	D 分配準備積立金額 97,013,040円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 190,876,950円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 767,816,785円
F 当ファンドの期末残存口数 2,516,252,459口	F 当ファンドの期末残存口数 2,592,201,841口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 758円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,962円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	187,544,853	486,536,250
合計	187,544,853	486,536,250

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内リートマザーファンド	2,291,784,987	3,358,381,719	
合 計		2,291,784,987	3,358,381,719	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM国内リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,081,239	10,135,788
親投資信託受益証券	1,886,710,077	4,087,941,200
流動資産合計	1,893,791,316	4,098,076,988
資産合計	1,893,791,316	4,098,076,988
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,647,403	1,079,358
未払受託者報酬	327,335	529,047
未払委託者報酬	4,037,028	6,524,797
未払利息	19	27
その他未払費用	109,095	176,283
流動負債合計	6,120,880	8,309,512
負債合計	6,120,880	8,309,512
純資産の部		
元本等		
元本	1,837,841,788	3,620,576,548
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	49,828,648	469,190,928
(分配準備積立金)	99,774,968	388,395,947
元本等合計	1,887,670,436	4,089,767,476
純資産合計	1,887,670,436	4,089,767,476
負債純資産合計	1,893,791,316	4,098,076,988

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		30,943,562		358,234,123
営業収益合計		30,943,562		358,234,123
営業費用				
支払利息		4,835		6,722
受託者報酬		589,225		924,892
委託者報酬		7,266,965		11,406,800
その他費用		196,427		308,378
営業費用合計		8,057,452		12,646,792
営業利益又は営業損失（ ）		22,886,110		345,587,331
経常利益又は経常損失（ ）		22,886,110		345,587,331
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,886,110		345,587,331
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（ ）		31,432,159		31,304,037
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		39,361,184		49,828,648
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,521,367		113,783,452
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,521,367		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		113,783,452
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,372,172		8,704,466
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		8,704,466
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,372,172		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		49,828,648		469,190,928

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,479,548,942円	期首元本額 1,837,841,788円
期中追加設定元本額 1,601,705,660円	期中追加設定元本額 2,308,663,405円
期中一部解約元本額 1,243,412,814円	期中一部解約元本額 525,928,645円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,837,841,788口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 3,620,576,548口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0271円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.1296円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,271円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,296円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 62,819,893円	A 費用控除後の配当等収益額 99,717,907円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 207,662,191円
C 収益調整金額 60,986,488円	C 収益調整金額 241,111,476円
D 分配準備積立金額 36,955,075円	D 分配準備積立金額 81,015,849円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 160,761,456円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 629,507,423円
F 当ファンドの期末残存口数 1,837,841,788口	F 当ファンドの期末残存口数 3,620,576,548口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 874円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,738円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年12月10日現在	第3期 2019年12月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	57,662,433	345,961,903
合計	57,662,433	345,961,903

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M先進国リートマザーファンド	3,447,993,590	4,087,941,200	
合計		3,447,993,590	4,087,941,200	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「R A M先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	691,363
コール・ローン	661,617,107
国債証券	61,862,128,360
地方債証券	3,826,597,200
特殊債券	4,302,277,783
社債券	3,026,568,000
未収入金	393,442,700
未収利息	177,499,122
前払費用	13,976,252
流動資産合計	74,264,797,887
資産合計	74,264,797,887
負債の部	
流動負債	
未払解約金	857,353,000
未払利息	1,794
その他未払費用	1,117
流動負債合計	857,355,911
負債合計	857,355,911

2019年12月10日現在

純資産の部	
元本等	
元本	69,237,421,107
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,170,020,869
元本等合計	73,407,441,976
純資産合計	73,407,441,976
負債純資産合計	74,264,797,887

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	<p>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。</p>
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	62,165,264,291円
期中追加設定元本額	41,953,947,613円
期中一部解約元本額	34,881,790,797円
期末元本額	69,237,421,107円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	4,957,084,465円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,218,007,660円
りそなラップ型ファンド(成長型)	53,561,714円
DCりそな グローバルバランス	226,963,059円
つみたてバランスファンド	933,518,521円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	593,818,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	112,223,471円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	24,717,769円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,612,848円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	982,320円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	124,095円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,818円
FWりそな円建債券アクティブファンド	635,613,146円
FWりそな国内債券インデックスファンド	38,363,482,648円
Smart-i 国内債券インデックス	478,773,416円
Smart-i 8資産バランス 安定型	148,319,567円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	113,976,501円
Smart-i 8資産バランス 成長型	46,395,156円

りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,145,636,013円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,596,920,461円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	6,443,221,176円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	3,611,319,158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)	4,554,243円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	5,525,589,370円
2. 計算日における受益権の総数	69,237,421,107口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0602円
(10,000口当たり純資産額)	(10,602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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年12月10日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		80,040,200
地方債証券		6,588,400
特殊債券		14,882,229
社債券		3,089,000
合計		98,421,829

(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396回利付国債(2年)	390,000,000	390,947,700	
	第397回利付国債(2年)	200,000,000	200,514,000	
	第398回利付国債(2年)	200,000,000	200,560,000	
	第399回利付国債(2年)	240,000,000	240,736,800	
	第400回利付国債(2年)	160,000,000	160,510,400	
	第401回利付国債(2年)	200,000,000	200,678,000	
	第402回利付国債(2年)	500,000,000	501,750,000	
	第403回利付国債(2年)	130,000,000	130,479,700	
	第404回利付国債(2年)	170,000,000	170,659,600	
	第405回利付国債(2年)	380,000,000	381,546,600	
	第406回利付国債(2年)	200,000,000	200,852,000	
	第127回利付国債(5年)	350,000,000	351,022,000	
	第128回利付国債(5年)	470,000,000	471,612,100	
	第129回利付国債(5年)	450,000,000	451,800,000	
	第130回利付国債(5年)	560,000,000	562,497,600	
	第131回利付国債(5年)	510,000,000	512,667,300	
	第132回利付国債(5年)	630,000,000	633,666,600	
	第133回利付国債(5年)	740,000,000	745,046,800	
	第134回利付国債(5年)	970,000,000	977,216,800	
	第135回利付国債(5年)	560,000,000	564,508,000	
	第136回利付国債(5年)	400,000,000	403,468,000	
	第137回利付国債(5年)	500,000,000	504,360,000	
	第138回利付国債(5年)	730,000,000	736,489,700	
	第139回利付国債(5年)	700,000,000	706,454,000	
	第140回利付国債(5年)	530,000,000	535,056,200	
	第141回利付国債(5年)	530,000,000	535,342,400	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	61,410,800	
	第2回利付国債(40年)	70,000,000	104,521,900	
	第3回利付国債(40年)	110,000,000	165,699,600	
	第4回利付国債(40年)	130,000,000	197,787,200	
	第5回利付国債(40年)	130,000,000	191,917,700	
	第6回利付国債(40年)	140,000,000	204,059,800	
	第7回利付国債(40年)	160,000,000	224,721,600	
	第8回利付国債(40年)	180,000,000	237,103,200	
第9回利付国債(40年)	260,000,000	257,147,800		
第10回利付国債(40年)	240,000,000	278,469,600		
第11回利付国債(40年)	210,000,000	236,699,400		
第12回利付国債(40年)	100,000,000	102,009,000		

第313回利付国債(10年)	320,000,000	325,804,800	
第314回利付国債(10年)	130,000,000	132,026,700	
第315回利付国債(10年)	145,000,000	147,920,300	
第316回利付国債(10年)	300,000,000	305,583,000	
第317回利付国債(10年)	60,000,000	61,302,000	
第318回利付国債(10年)	366,000,000	373,290,720	
第319回利付国債(10年)	140,000,000	143,451,000	
第320回利付国債(10年)	352,000,000	359,962,240	
第321回利付国債(10年)	291,000,000	298,420,500	
第322回利付国債(10年)	220,000,000	225,108,400	
第323回利付国債(10年)	340,000,000	348,775,400	
第324回利付国債(10年)	183,000,000	187,260,240	
第325回利付国債(10年)	470,000,000	482,036,700	
第326回利付国債(10年)	280,000,000	287,011,200	
第327回利付国債(10年)	387,000,000	397,866,960	
第328回利付国債(10年)	461,000,000	472,054,780	
第329回利付国債(10年)	477,000,000	492,698,070	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	265,966,730	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	92,457,000	
第332回利付国債(10年)	312,000,000	321,082,320	
第333回利付国債(10年)	445,000,000	458,754,950	
第334回利付国債(10年)	421,000,000	434,686,710	
第335回利付国債(10年)	175,000,000	180,167,750	
第336回利付国債(10年)	180,000,000	185,641,200	
第337回利付国債(10年)	200,000,000	204,246,000	
第338回利付国債(10年)	681,000,000	699,965,850	
第339回利付国債(10年)	335,000,000	344,778,650	
第340回利付国債(10年)	674,000,000	694,583,960	
第341回利付国債(10年)	370,000,000	379,542,300	
第342回利付国債(10年)	220,000,000	223,128,400	
第343回利付国債(10年)	610,000,000	619,021,900	
第344回利付国債(10年)	600,000,000	609,222,000	
第345回利付国債(10年)	310,000,000	315,053,000	
第346回利付国債(10年)	670,000,000	681,061,700	
第347回利付国債(10年)	220,000,000	223,588,200	
第348回利付国債(10年)	440,000,000	447,242,400	
第349回利付国債(10年)	420,000,000	426,967,800	
第350回利付国債(10年)	560,000,000	569,100,000	
第351回利付国債(10年)	340,000,000	345,399,200	
第352回利付国債(10年)	380,000,000	385,871,000	
第353回利付国債(10年)	500,000,000	507,255,000	
第354回利付国債(10年)	470,000,000	476,340,300	

第355回利付国債(10年)	360,000,000	364,640,400
第356回利付国債(10年)	640,000,000	647,833,600
第1回利付国債(30年)	60,000,000	76,534,200
第11回利付国債(30年)	10,000,000	12,134,800
第12回利付国債(30年)	40,000,000	50,835,600
第13回利付国債(30年)	90,000,000	113,492,700
第14回利付国債(30年)	20,000,000	26,416,600
第15回利付国債(30年)	100,000,000	133,973,000
第16回利付国債(30年)	70,000,000	94,118,500
第17回利付国債(30年)	110,000,000	146,797,200
第18回利付国債(30年)	120,000,000	158,754,000
第19回利付国債(30年)	100,000,000	132,716,000
第20回利付国債(30年)	60,000,000	81,729,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	120,185,100
第22回利付国債(30年)	50,000,000	68,554,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	219,915,200
第24回利付国債(30年)	100,000,000	137,890,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	134,907,000
第26回利付国債(30年)	225,000,000	308,151,000
第27回利付国債(30年)	155,000,000	216,192,450
第28回利付国債(30年)	150,000,000	210,442,500
第29回利付国債(30年)	140,000,000	194,853,400
第30回利付国債(30年)	190,000,000	262,333,000
第31回利付国債(30年)	130,000,000	177,936,200
第32回利付国債(30年)	215,000,000	300,034,650
第33回利付国債(30年)	250,000,000	335,740,000
第34回利付国債(30年)	225,000,000	312,981,750
第35回利付国債(30年)	276,000,000	374,198,040
第36回利付国債(30年)	255,000,000	347,310,000
第37回利付国債(30年)	270,000,000	363,646,800
第38回利付国債(30年)	170,000,000	225,960,600
第39回利付国債(30年)	160,000,000	216,724,800
第40回利付国債(30年)	165,000,000	220,169,400
第41回利付国債(30年)	145,000,000	190,490,850
第42回利付国債(30年)	160,000,000	210,676,800
第43回利付国債(30年)	190,000,000	250,475,100
第44回利付国債(30年)	150,000,000	198,199,500
第45回利付国債(30年)	170,000,000	216,727,900
第46回利付国債(30年)	210,000,000	267,934,800
第47回利付国債(30年)	220,000,000	286,444,400
第48回利付国債(30年)	203,000,000	254,596,510
第49回利付国債(30年)	220,000,000	276,416,800
第50回利付国債(30年)	190,000,000	210,569,400

第5 1 回利付国債(30年)	240,000,000	235,656,000	
第5 2 回利付国債(30年)	210,000,000	216,650,700	
第5 3 回利付国債(30年)	180,000,000	190,170,000	
第5 4 回利付国債(30年)	230,000,000	254,814,700	
第5 5 回利付国債(30年)	80,000,000	88,592,800	
第5 6 回利付国債(30年)	180,000,000	199,242,000	
第5 7 回利付国債(30年)	240,000,000	265,864,800	
第5 8 回利付国債(30年)	290,000,000	321,093,800	
第5 9 回利付国債(30年)	180,000,000	194,322,600	
第6 0 回利付国債(30年)	140,000,000	158,677,400	
第6 1 回利付国債(30年)	140,000,000	151,117,400	
第6 2 回利付国債(30年)	200,000,000	204,972,000	
第6 3 回利付国債(30年)	160,000,000	159,368,000	
第6 4 回利付国債(30年)	110,000,000	109,417,000	
第4 9 回利付国債(20年)	30,000,000	30,855,300	
第5 0 回利付国債(20年)	150,000,000	153,894,000	
第5 1 回利付国債(20年)	90,000,000	92,916,900	
第5 2 回利付国債(20年)	190,000,000	197,514,500	
第5 3 回利付国債(20年)	20,000,000	20,901,000	
第5 4 回利付国債(20年)	180,000,000	188,474,400	
第5 5 回利付国債(20年)	100,000,000	104,845,000	
第5 6 回利付国債(20年)	10,000,000	10,537,800	
第5 7 回利付国債(20年)	110,000,000	115,637,500	
第5 8 回利付国債(20年)	100,000,000	105,624,000	
第5 9 回利付国債(20年)	40,000,000	42,216,000	
第6 0 回利付国債(20年)	30,000,000	31,389,000	
第6 1 回利付国債(20年)	50,000,000	51,856,000	
第6 2 回利付国債(20年)	80,000,000	82,632,800	
第6 3 回利付国債(20年)	60,000,000	64,087,200	
第6 4 回利付国債(20年)	120,000,000	129,168,000	
第6 5 回利付国債(20年)	380,000,000	410,958,600	
第6 7 回利付国債(20年)	20,000,000	21,729,800	
第6 8 回利付国債(20年)	90,000,000	98,942,400	
第6 9 回利付国債(20年)	60,000,000	65,704,200	
第7 0 回利付国債(20年)	110,000,000	122,551,000	
第7 1 回利付国債(20年)	100,000,000	110,501,000	
第7 2 回利付国債(20年)	150,000,000	165,913,500	
第7 3 回利付国債(20年)	180,000,000	199,238,400	
第7 5 回利付国債(20年)	100,000,000	111,776,000	
第7 6 回利付国債(20年)	100,000,000	110,715,000	
第7 7 回利付国債(20年)	20,000,000	22,249,200	
第7 8 回利付国債(20年)	50,000,000	55,615,500	

第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,357,400
第80回利付国債(20年)	180,000,000	202,217,400
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,698,700
第82回利付国債(20年)	170,000,000	191,947,000
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,347,200
第84回利付国債(20年)	120,000,000	135,438,000
第85回利付国債(20年)	150,000,000	171,040,500
第86回利付国債(20年)	100,000,000	115,291,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	103,193,100
第88回利付国債(20年)	185,000,000	214,433,500
第89回利付国債(20年)	70,000,000	80,677,100
第90回利付国債(20年)	90,000,000	104,262,300
第91回利付国債(20年)	10,000,000	11,653,000
第92回利付国債(20年)	105,000,000	121,556,400
第93回利付国債(20年)	90,000,000	103,995,000
第94回利付国債(20年)	90,000,000	104,655,600
第95回利付国債(20年)	35,000,000	41,398,700
第96回利付国債(20年)	70,000,000	81,735,500
第97回利付国債(20年)	130,000,000	153,489,700
第98回利付国債(20年)	70,000,000	82,099,500
第99回利付国債(20年)	205,000,000	241,483,850
第100回利付国債(20年)	151,000,000	179,815,330
第101回利付国債(20年)	20,000,000	24,149,800
第102回利付国債(20年)	145,000,000	175,858,900
第103回利付国債(20年)	20,000,000	24,084,800
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,870,800
第105回利付国債(20年)	132,000,000	157,291,200
第106回利付国債(20年)	40,000,000	48,017,200
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,408,500
第108回利付国債(20年)	130,000,000	153,050,300
第109回利付国債(20年)	180,000,000	212,594,400
第110回利付国債(20年)	115,000,000	137,965,500
第111回利付国債(20年)	200,000,000	242,710,000
第112回利付国債(20年)	55,000,000	66,220,000
第113回利付国債(20年)	155,000,000	187,275,650
第114回利付国債(20年)	180,000,000	218,111,400
第115回利付国債(20年)	100,000,000	122,176,000
第116回利付国債(20年)	140,000,000	171,634,400
第117回利付国債(20年)	215,000,000	261,373,350
第118回利付国債(20年)	231,000,000	279,322,890
第119回利付国債(20年)	60,000,000	71,289,600
第120回利付国債(20年)	140,000,000	163,399,600
第121回利付国債(20年)	165,000,000	198,458,700

第122回利付国債(20年)	150,000,000	178,803,000	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	239,485,350	
第124回利付国債(20年)	150,000,000	182,569,500	
第125回利付国債(20年)	90,000,000	111,875,400	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	122,060,000	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	60,469,000	
第128回利付国債(20年)	285,000,000	345,605,250	
第129回利付国債(20年)	70,000,000	84,083,300	
第130回利付国債(20年)	170,000,000	204,826,200	
第131回利付国債(20年)	120,000,000	143,178,000	
第132回利付国債(20年)	160,000,000	191,326,400	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	295,893,850	
第134回利付国債(20年)	85,000,000	102,953,700	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,961,600	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,949,600	
第137回利付国債(20年)	110,000,000	132,258,500	
第138回利付国債(20年)	160,000,000	188,403,200	
第139回利付国債(20年)	160,000,000	190,390,400	
第140回利付国債(20年)	290,000,000	349,409,400	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,567,800	
第142回利付国債(20年)	170,000,000	207,556,400	
第143回利付国債(20年)	265,000,000	317,268,600	
第144回利付国債(20年)	140,000,000	165,778,200	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	430,785,400	
第146回利付国債(20年)	320,000,000	389,305,600	
第147回利付国債(20年)	305,000,000	367,512,800	
第148回利付国債(20年)	385,000,000	459,543,700	
第149回利付国債(20年)	370,000,000	442,568,100	
第150回利付国債(20年)	360,000,000	425,970,000	
第151回利付国債(20年)	255,000,000	294,774,900	
第152回利付国債(20年)	290,000,000	335,457,500	
第153回利付国債(20年)	280,000,000	328,596,800	
第154回利付国債(20年)	348,000,000	403,686,960	
第155回利付国債(20年)	290,000,000	327,546,300	
第156回利付国債(20年)	340,000,000	351,546,400	
第157回利付国債(20年)	220,000,000	220,176,000	
第158回利付国債(20年)	280,000,000	293,633,200	
第159回利付国債(20年)	250,000,000	266,242,500	
第160回利付国債(20年)	150,000,000	162,249,000	
第161回利付国債(20年)	340,000,000	361,797,400	
第162回利付国債(20年)	220,000,000	234,099,800	
第163回利付国債(20年)	270,000,000	287,039,700	

	第164回利付国債(20年)	320,000,000	334,560,000
	第165回利付国債(20年)	280,000,000	292,390,000
	第166回利付国債(20年)	370,000,000	399,859,000
	第167回利付国債(20年)	250,000,000	260,640,000
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	194,523,900
	第169回利付国債(20年)	220,000,000	221,018,600
	第170回利付国債(20年)	310,000,000	311,159,400
	国債証券合計	56,168,000,000	61,862,128,360
地方債証券	第705回東京都公募公債	100,000,000	102,390,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,874,000
	第729回東京都公募公債	100,000,000	102,947,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,700,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,337,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,151,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,998,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	102,127,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,344,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	100,010,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	113,423,200
	第435回大阪府公募公債	100,000,000	101,082,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,163,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	101,102,000
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,717,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	102,242,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,267,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,412,000
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,854,000
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,262,000
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	120,235,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,674,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,145,000
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,701,000
	第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,230,000
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,072,000
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,009,000
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,470,000
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,272,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,774,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	120,245,000
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,652,000
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	100,009,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,678,000

	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,782,000	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,038,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	101,209,000	
	地方債証券合計	3,730,000,000	3,826,597,200	
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	102,577,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,655,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,000,000	
	第27回道路債券	100,000,000	110,296,000	
	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	102,911,930	
	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	117,580,740	
	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	130,633,470	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,562,000	
	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	102,915,000	
	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	135,944,620	
	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	101,108,000	
	第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,436,000	
	第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,643,000	
	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	101,005,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	111,748,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	130,634,740	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,505,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,805,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,748,700	
	第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,899,530	
	F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,917,000	
	第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,043,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	116,185,000	
	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,010,000	
	第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,397,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,519,000	91,846,008	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,839,000	91,913,625	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,848,000	92,794,952	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,663,000	92,740,040	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,722,000	95,655,011	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,536,000	97,044,513	

	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,845,000	99,255,914
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	75,510,000	75,460,918
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	78,615,000	78,620,503
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	82,953,000	82,901,569
	第327回信中金債	100,000,000	100,098,000
	第340回信中金債	100,000,000	100,329,000
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,882,000
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,060,000
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,040,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,475,000
	特殊債券合計	4,152,050,000	4,302,277,783
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	100,326,000
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,127,000
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,672,000
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,535,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,720,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,779,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,908,000
	第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,515,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,192,000
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,381,000
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,555,000
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,176,000
	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	100,580,000
	第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,966,000
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,997,000
	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	99,594,000
	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	100,055,000
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,867,000
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,819,000
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,624,000
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,487,000

第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,983,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,842,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,261,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,943,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,196,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,501,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,616,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,670,000	
社債券合計	3,000,000,000	3,026,568,000	
合計		73,017,571,343	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年12月10日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	867,565,862
株式	41,117,141,140
派生商品評価勘定	659,150
未収入金	3,330,097,050
未収配当金	10,837,940
差入委託証拠金	20,640,000
流動資産合計	45,346,941,142
資産合計	45,346,941,142
負債の部	
流動負債	
前受金	51,360,000
未払金	3,371,329,793
未払解約金	12,040,000
未払利息	2,353
その他未払費用	1,226
流動負債合計	3,434,733,372
負債合計	3,434,733,372
純資産の部	
元本等	
元本	34,860,384,469
剰余金	

2019年12月10日現在

剰余金又は欠損金（ ）	7,051,823,301
元本等合計	41,912,207,770
純資産合計	41,912,207,770
負債純資産合計	45,346,941,142

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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12月10日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	21,251,159,523円
期中追加設定元本額	24,598,586,234円
期中一部解約元本額	10,989,361,288円
期末元本額	34,860,384,469円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,187,730,530円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,701,524,070円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,716,089,950円
DCりそな グローバルバランス	56,559,136円
つみたてバランスファンド	1,242,068,051円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	398,032,093円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	179,663,712円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	104,858,745円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,761,483円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,464,917円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,178,338円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,051,724円
FWりそな国内株式アクティブファンド	250,788,979円

FWりそな国内株式インデックスファンド	20,106,350,049円
Smart-i TOPIXインデックス	472,740,880円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,870,399円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	124,160,997円
Smart-i 8資産バランス 成長型	153,053,745円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	188,001,183円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	590,842,334円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,055,426,946円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	594,118,270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)	5,031,032円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	532,536,175円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	156,480,731円
2. 計算日における受益権の総数	34,860,384,469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	1.2023円
(10,000口当たり純資産額)	(12,023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12月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		3,187,393,674
合計		3,187,393,674

(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12月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	807,035,850	-	807,695,000	659,150
	合計	807,035,850	-	807,695,000	659,150

（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	800	2,880.00	2,304,000	
日本水産	23,000	639.00	14,697,000	
マルハニチロ	3,300	2,812.00	9,279,600	
カネコ種苗	700	1,499.00	1,049,300	
サカタのタネ	2,700	3,535.00	9,544,500	
ホクト	1,800	2,009.00	3,616,200	
ホクリヨウ	300	667.00	200,100	
住石ホールディングス	4,600	150.00	690,000	
日鉄鉱業	500	4,715.00	2,357,500	
三井松島ホールディングス	900	1,225.00	1,102,500	
国際石油開発帝石	92,200	1,091.50	100,636,300	
石油資源開発	3,000	3,045.00	9,135,000	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,576.00	1,733,600	
ヒノキヤグループ	600	2,400.00	1,440,000	
ショーボンドホールディングス	3,300	4,620.00	15,246,000	
ミライト・ホールディングス	6,800	1,677.00	11,403,600	
タマホーム	1,100	1,749.00	1,923,900	
サンヨーホームズ	200	684.00	136,800	
日本アクア	900	635.00	571,500	

ファーストコーポレーション	700	656.00	459,200	
ベステラ	400	1,319.00	527,600	
T A T E R U	4,700	234.00	1,099,800	
スペースバリューホールディングス	2,800	529.00	1,481,200	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,078.00	431,200	
第一カッター興業	300	1,794.00	538,200	
安藤・間	13,700	937.00	12,836,900	
東急建設	6,700	795.00	5,326,500	
コムシスホールディングス	8,200	3,240.00	26,568,000	
ミサワホーム	1,600	1,183.00	1,892,800	
ピーアールホールディングス	2,500	505.00	1,262,500	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,774.00	3,883,600	
東建コーポレーション	700	7,270.00	5,089,000	
ソネック	200	806.00	161,200	
ヤマウラ	1,000	881.00	881,000	
大成建設	17,700	4,510.00	79,827,000	
大林組	53,100	1,256.00	66,693,600	
清水建設	53,900	1,099.00	59,236,100	
飛島建設	1,500	1,571.00	2,356,500	
長谷工コーポレーション	20,600	1,463.00	30,137,800	
松井建設	2,100	804.00	1,688,400	
銭高組	200	4,100.00	820,000	
鹿島建設	41,700	1,504.00	62,716,800	
不動テトラ	1,400	1,736.00	2,430,400	
大末建設	600	1,000.00	600,000	
鉄建建設	1,200	2,959.00	3,550,800	
西松建設	4,100	2,516.00	10,315,600	
三井住友建設	12,800	652.00	8,345,600	
大豊建設	1,200	3,035.00	3,642,000	
前田建設工業	13,300	1,054.00	14,018,200	
佐田建設	1,100	433.00	476,300	
ナカノフドー建設	1,500	479.00	718,500	
奥村組	2,900	3,110.00	9,019,000	
東鉄工業	2,300	3,325.00	7,647,500	
イチケン	400	1,813.00	725,200	
富士ピー・エス	700	601.00	420,700	

浅沼組	600	4,505.00	2,703,000	
戸田建設	22,000	722.00	15,884,000	
熊谷組	2,500	3,390.00	8,475,000	
北野建設	300	2,700.00	810,000	
植木組	200	2,584.00	516,800	
矢作建設工業	2,300	815.00	1,874,500	
ピーエス三菱	1,700	765.00	1,300,500	
日本ハウスホールディングス	3,600	487.00	1,753,200	
大東建託	6,400	13,550.00	86,720,000	
新日本建設	2,300	984.00	2,263,200	
N I P P O	4,400	2,377.00	10,458,800	
東亜道路工業	300	3,540.00	1,062,000	
前田道路	5,600	2,656.00	14,873,600	
日本道路	500	6,970.00	3,485,000	
東亜建設工業	1,700	1,651.00	2,806,700	
日本国土開発	3,100	666.00	2,064,600	
若築建設	1,000	1,740.00	1,740,000	
東洋建設	6,000	535.00	3,210,000	
五洋建設	21,000	689.00	14,469,000	
世紀東急工業	2,500	923.00	2,307,500	
福田組	600	5,140.00	3,084,000	
住友林業	13,400	1,644.00	22,029,600	
日本基礎技術	1,800	420.00	756,000	
巴コーポレーション	2,400	426.00	1,022,400	
大和ハウス工業	52,500	3,433.00	180,232,500	
ライト工業	3,000	1,639.00	4,917,000	
積水ハウス	58,100	2,402.00	139,556,200	
日特建設	1,400	872.00	1,220,800	
北陸電気工事	900	1,132.00	1,018,800	
ユアテック	3,000	707.00	2,121,000	
四電工	200	2,858.00	571,600	
中電工	2,100	2,641.00	5,546,100	
関電工	7,600	1,086.00	8,253,600	
きんでん	12,600	1,701.00	21,432,600	
東京エネシス	1,800	919.00	1,654,200	
トーエネック	500	3,855.00	1,927,500	

住友電設	1,500	2,552.00	3,828,000
日本電設工業	2,900	2,313.00	6,707,700
協和エクシオ	8,100	2,908.00	23,554,800
新日本空調	1,400	2,230.00	3,122,000
九電工	3,700	3,570.00	13,209,000
三機工業	3,800	1,552.00	5,897,600
日揮ホールディングス	16,300	1,700.00	27,710,000
中外炉工業	600	1,844.00	1,106,400
ヤマト	1,700	739.00	1,256,300
太平電業	1,300	2,367.00	3,077,100
高砂熱学工業	4,600	1,978.00	9,098,800
三晃金属工業	200	2,659.00	531,800
朝日工業社	400	3,495.00	1,398,000
明星工業	3,400	957.00	3,253,800
大気社	2,600	3,910.00	10,166,000
ダイダン	1,300	2,715.00	3,529,500
日比谷総合設備	1,700	1,972.00	3,352,400
東芝プラントシステム	3,700	2,663.00	9,853,100
OSJBホールディングス	8,400	275.00	2,310,000
東洋エンジニアリング	2,200	740.00	1,628,000
レイズネクスト	2,800	1,390.00	3,892,000
日本製粉	5,000	1,733.00	8,665,000
日清製粉グループ本社	19,200	1,985.00	38,112,000
日東富士製粉	100	6,460.00	646,000
昭和産業	1,600	3,145.00	5,032,000
鳥越製粉	1,500	943.00	1,414,500
中部飼料	2,100	1,487.00	3,122,700
フィード・ワン	11,400	176.00	2,006,400
東洋精糖	300	1,166.00	349,800
日本甜菜製糖	900	2,034.00	1,830,600
三井製糖	1,500	2,346.00	3,519,000
塩水港精糖	1,800	221.00	397,800
日新製糖	800	2,039.00	1,631,200
森永製菓	4,000	5,530.00	22,120,000
中村屋	400	4,510.00	1,804,000
江崎グリコ	5,000	4,910.00	24,550,000

名糖産業	800	1,320.00	1,056,000	
井村屋グループ	700	2,018.00	1,412,600	
不二家	900	2,217.00	1,995,300	
山崎製パン	12,700	1,941.00	24,650,700	
第一屋製パン	300	983.00	294,900	
モロゾフ	200	4,980.00	996,000	
亀田製菓	1,000	5,040.00	5,040,000	
寿スピリッツ	1,600	7,400.00	11,840,000	
カルビー	7,700	3,600.00	27,720,000	
森永乳業	3,100	4,500.00	13,950,000	
六甲バター	1,100	1,824.00	2,006,400	
ヤクルト本社	11,700	6,230.00	72,891,000	
明治ホールディングス	11,200	7,490.00	83,888,000	
雪印メグミルク	4,100	2,631.00	10,787,100	
プリマハム	2,700	2,593.00	7,001,100	
日本ハム	6,500	4,620.00	30,030,000	
林兼産業	500	748.00	374,000	
丸大食品	1,800	2,368.00	4,262,400	
S Foods	1,400	2,924.00	4,093,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,900	726.00	7,913,400	
サッポロホールディングス	5,800	2,700.00	15,660,000	
アサヒグループホールディングス	35,600	5,149.00	183,304,400	
キリンホールディングス	72,100	2,477.00	178,591,700	
宝ホールディングス	12,700	1,049.00	13,322,300	
オエノンホールディングス	4,500	406.00	1,827,000	
養命酒製造	500	1,990.00	995,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,900	2,719.00	32,356,100	
サントリー食品インターナショナル	11,400	4,710.00	53,694,000	
ダイドーグループホールディングス	900	4,650.00	4,185,000	
伊藤園	5,200	5,590.00	29,068,000	
キーコーヒー	1,700	2,385.00	4,054,500	
ユニカフェ	400	1,042.00	416,800	
ジャパンフーズ	200	1,245.00	249,000	
日清オイリオグループ	2,200	3,930.00	8,646,000	
不二製油グループ本社	4,100	3,100.00	12,710,000	

かどや製油	100	3,710.00	371,000	
J - オイルミルズ	900	4,375.00	3,937,500	
キッコーマン	12,200	5,520.00	67,344,000	
味の素	37,500	1,804.00	67,650,000	
キュービー	9,500	2,471.00	23,474,500	
ハウス食品グループ本社	6,400	3,850.00	24,640,000	
カゴメ	6,400	2,700.00	17,280,000	
焼津水産化学工業	800	1,041.00	832,800	
アリアケジャパン	1,600	7,890.00	12,624,000	
ピエトロ	200	1,624.00	324,800	
エバラ食品工業	400	2,207.00	882,800	
やまみ	100	2,190.00	219,000	
ニチレイ	8,100	2,579.00	20,889,900	
東洋水産	8,700	4,755.00	41,368,500	
イトアンド	600	1,784.00	1,070,400	
大冷	200	1,957.00	391,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	1,133.00	1,019,700	
日清食品ホールディングス	7,200	8,240.00	59,328,000	
永谷園ホールディングス	800	2,189.00	1,751,200	
一正蒲鉾	700	1,048.00	733,600	
フジッコ	1,800	1,991.00	3,583,800	
ロック・フィールド	1,800	1,586.00	2,854,800	
日本たばこ産業	98,100	2,504.00	245,642,400	
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,593.00	2,593,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,780.00	1,958,000	
なとり	900	1,669.00	1,502,100	
イフジ産業	200	773.00	154,600	
ピックルスコーポレーション	400	2,813.00	1,125,200	
北の達人コーポレーション	5,900	717.00	4,230,300	
ユーグレナ	7,200	817.00	5,882,400	
ミヨシ油脂	700	1,303.00	912,100	
理研ビタミン	800	3,970.00	3,176,000	
片倉工業	2,400	1,350.00	3,240,000	
ゲンゼ	1,200	5,310.00	6,372,000	
東洋紡	6,600	1,663.00	10,975,800	
ユニチカ	4,900	396.00	1,940,400	

富士紡ホールディングス	800	3,400.00	2,720,000
倉敷紡績	1,700	2,611.00	4,438,700
シキボウ	900	1,010.00	909,000
日本毛織	5,500	1,106.00	6,083,000
ダイトウボウ	2,300	85.00	195,500
トーア紡コーポレーション	600	583.00	349,800
ダイドーリミテッド	2,200	278.00	611,600
帝国繊維	1,900	2,078.00	3,948,200
帝人	13,500	2,093.00	28,255,500
東レ	120,100	746.30	89,630,630
サカイオーベックス	400	1,904.00	761,600
住江織物	500	2,921.00	1,460,500
日本フェルト	900	497.00	447,300
イチカワ	200	1,474.00	294,800
日東製網	200	1,706.00	341,200
アツギ	1,400	835.00	1,169,000
ダイニック	600	775.00	465,000
セーレン	4,100	1,583.00	6,490,300
ソトー	700	977.00	683,900
東海染工	200	1,128.00	225,600
小松マテーレ	2,700	820.00	2,214,000
ワコールホールディングス	4,300	2,981.00	12,818,300
ホギメディカル	1,900	3,650.00	6,935,000
レナウン	3,900	114.00	444,600
クラウドディアホールディングス	400	480.00	192,000
T S Iホールディングス	5,600	562.00	3,147,200
マツオカコーポレーション	500	2,292.00	1,146,000
ワールド	2,400	2,880.00	6,912,000
三陽商会	900	1,398.00	1,258,200
ナイガイ	500	457.00	228,500
オンワードホールディングス	10,000	664.00	6,640,000
ルックホールディングス	600	1,242.00	745,200
キムラタン	8,600	32.00	275,200
ゴールドウイン	3,000	8,360.00	25,080,000
デサント	3,200	1,978.00	6,329,600
キング	700	528.00	369,600

ヤマトインターナショナル	1,000	399.00	399,000	
特種東海製紙	1,100	4,015.00	4,416,500	
王子ホールディングス	69,300	626.00	43,381,800	
日本製紙	7,300	1,906.00	13,913,800	
三菱製紙	1,900	500.00	950,000	
北越コーポレーション	11,000	578.00	6,358,000	
中越パルプ工業	700	1,663.00	1,164,100	
巴川製紙所	500	915.00	457,500	
大王製紙	7,300	1,500.00	10,950,000	
阿波製紙	400	639.00	255,600	
レンゴー	15,700	821.00	12,889,700	
トモク	1,000	1,830.00	1,830,000	
ザ・バック	1,300	3,960.00	5,148,000	
クラレ	26,100	1,372.00	35,809,200	
旭化成	109,900	1,252.00	137,594,800	
共和レザー	900	840.00	756,000	
昭和電工	11,800	2,995.00	35,341,000	
住友化学	121,800	505.00	61,509,000	
住友精化	700	3,535.00	2,474,500	
日産化学	9,300	4,480.00	41,664,000	
ラサ工業	600	1,548.00	928,800	
クレハ	1,400	6,700.00	9,380,000	
多木化学	500	4,435.00	2,217,500	
テイカ	1,200	1,947.00	2,336,400	
石原産業	3,000	1,151.00	3,453,000	
片倉コープアグリ	400	1,189.00	475,600	
日本曹達	2,500	3,040.00	7,600,000	
東ソー	25,600	1,678.00	42,956,800	
トクヤマ	4,800	2,900.00	13,920,000	
セントラル硝子	3,400	2,765.00	9,401,000	
東亜合成	10,400	1,281.00	13,322,400	
大阪ソーダ	1,700	3,270.00	5,559,000	
関東電化工業	3,900	1,016.00	3,962,400	
デンカ	6,100	3,285.00	20,038,500	
信越化学工業	28,500	11,750.00	334,875,000	
日本カーバイド工業	600	1,507.00	904,200	

堺化学工業	1,100	2,586.00	2,844,600	
第一稀元素化学工業	1,800	901.00	1,621,800	
エア・ウォーター	15,400	1,610.00	24,794,000	
大陽日酸	15,900	2,460.00	39,114,000	
日本化学工業	500	3,300.00	1,650,000	
東邦アセチレン	200	1,346.00	269,200	
日本パーカラライジング	8,400	1,176.00	9,878,400	
高压ガス工業	2,600	812.00	2,111,200	
チタン工業	200	2,649.00	529,800	
四国化成工業	2,600	1,255.00	3,263,000	
戸田工業	400	2,252.00	900,800	
ステラ ケミファ	900	3,095.00	2,785,500	
保土谷化学工業	600	3,870.00	2,322,000	
日本触媒	2,600	6,730.00	17,498,000	
大日精化工業	1,500	3,235.00	4,852,500	
カネカ	4,300	3,555.00	15,286,500	
三菱瓦斯化学	15,700	1,677.00	26,328,900	
三井化学	15,100	2,671.00	40,332,100	
J S R	15,500	1,940.00	30,070,000	
東京応化工業	2,800	4,075.00	11,410,000	
大阪有機化学工業	1,500	1,393.00	2,089,500	
三菱ケミカルホールディングス	110,900	823.80	91,359,420	
K Hネオケム	2,900	2,466.00	7,151,400	
ダイセル	22,700	1,087.00	24,674,900	
住友ベークライト	2,600	4,260.00	11,076,000	
積水化学工業	35,700	1,912.00	68,258,400	
日本ゼオン	15,000	1,425.00	21,375,000	
アイカ工業	5,000	3,555.00	17,775,000	
宇部興産	8,400	2,376.00	19,958,400	
積水樹脂	3,000	2,265.00	6,795,000	
タキロンシーアイ	3,600	693.00	2,494,800	
旭有機材	900	1,746.00	1,571,400	
日立化成	7,700	4,075.00	31,377,500	
ニチバン	900	1,961.00	1,764,900	
リケンテクノス	4,200	534.00	2,242,800	
大倉工業	800	1,982.00	1,585,600	

積水化成成品工業	2,200	800.00	1,760,000	
群栄化学工業	300	2,621.00	786,300	
タイガースポリマー	800	615.00	492,000	
ミライアル	600	1,324.00	794,400	
ダイキアクシス	600	1,006.00	603,600	
ダイキョーニシカワ	3,500	878.00	3,073,000	
竹本容器	600	1,094.00	656,400	
森六ホールディングス	900	2,481.00	2,232,900	
日本化薬	10,300	1,377.00	14,183,100	
カーリットホールディングス	1,800	655.00	1,179,000	
日本精化	1,300	1,295.00	1,683,500	
扶桑化学工業	1,700	3,025.00	5,142,500	
トリケミカル研究所	400	7,490.00	2,996,000	
A D E K A	7,600	1,677.00	12,745,200	
日油	6,200	3,710.00	23,002,000	
新日本理化	2,700	212.00	572,400	
ハリマ化成グループ	1,400	1,213.00	1,698,200	
花王	40,500	8,919.00	361,219,500	
第一工業製薬	600	4,360.00	2,616,000	
石原ケミカル	500	1,978.00	989,000	
日華化学	600	920.00	552,000	
ニイタカ	300	1,684.00	505,200	
三洋化成工業	1,000	5,430.00	5,430,000	
有機合成薬品工業	1,200	299.00	358,800	
大日本塗料	1,900	1,200.00	2,280,000	
日本ペイントホールディングス	13,700	5,670.00	77,679,000	
関西ペイント	18,600	2,805.00	52,173,000	
神東塗料	1,100	224.00	246,400	
中国塗料	4,700	1,061.00	4,986,700	
日本特殊塗料	1,200	1,468.00	1,761,600	
藤倉化成	2,200	567.00	1,247,400	
太陽ホールディングス	1,200	4,215.00	5,058,000	
D I C	7,000	3,060.00	21,420,000	
サカタインクス	3,600	1,235.00	4,446,000	
東洋インキ S C ホールディングス	3,500	2,709.00	9,481,500	
T & K T O K A	1,300	997.00	1,296,100	

富士フイルムホールディングス	32,500	5,167.00	167,927,500	
資生堂	33,600	7,609.00	255,662,400	
ライオン	22,000	2,169.00	47,718,000	
高砂香料工業	1,100	2,580.00	2,838,000	
マンダム	3,800	2,949.00	11,206,200	
ミルボン	2,300	6,210.00	14,283,000	
ファンケル	6,900	2,850.00	19,665,000	
コーセー	3,200	16,880.00	54,016,000	
コタ	900	1,538.00	1,384,200	
シーボン	100	2,523.00	252,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	2,708.00	19,497,600	
ノエビアホールディングス	1,600	6,150.00	9,840,000	
アジュバンコスメジャパン	400	951.00	380,400	
エステー	1,100	1,742.00	1,916,200	
アグロ カネショウ	500	1,431.00	715,500	
コニシ	2,800	1,500.00	4,200,000	
長谷川香料	2,200	1,989.00	4,375,800	
星光PMC	1,000	1,028.00	1,028,000	
小林製薬	4,700	9,130.00	42,911,000	
荒川化学工業	1,500	1,571.00	2,356,500	
メック	1,200	1,581.00	1,897,200	
日本高純度化学	500	2,637.00	1,318,500	
タカラバイオ	4,400	2,104.00	9,257,600	
JCU	2,100	3,055.00	6,415,500	
新田ゼラチン	1,000	698.00	698,000	
OATアグリオ	300	1,660.00	498,000	
デクセリアルズ	4,400	1,127.00	4,958,800	
アース製薬	1,300	5,750.00	7,475,000	
北興化学工業	1,700	573.00	974,100	
大成ラミック	500	2,880.00	1,440,000	
クミアイ化学工業	7,000	1,029.00	7,203,000	
日本農薬	3,000	597.00	1,791,000	
アキレス	1,200	1,914.00	2,296,800	
有沢製作所	2,700	1,006.00	2,716,200	
日東電工	11,700	6,170.00	72,189,000	
レック	1,800	1,332.00	2,397,600	

三光合成	1,900	459.00	872,100
きもと	2,900	178.00	516,200
藤森工業	1,500	3,540.00	5,310,000
前澤化成工業	1,100	1,192.00	1,311,200
未来工業	900	2,213.00	1,991,700
ウェーブロックホールディングス	600	795.00	477,000
J S P	1,000	1,929.00	1,929,000
エフピコ	1,900	6,620.00	12,578,000
天馬	1,100	1,998.00	2,197,800
信越ポリマー	3,000	1,011.00	3,033,000
東リ	4,200	332.00	1,394,400
ニフコ	6,200	3,105.00	19,251,000
バルカー	1,400	2,565.00	3,591,000
ユニ・チャーム	32,600	3,466.00	112,991,600
ショーエイコーポレーション	200	740.00	148,000
協和キリン	17,000	2,398.00	40,766,000
武田薬品工業	140,900	4,422.00	623,059,800
アステラス製薬	148,900	1,881.00	280,080,900
大日本住友製薬	12,500	2,155.00	26,937,500
塩野義製薬	21,600	6,481.00	139,989,600
田辺三菱製薬	20,200	2,002.00	40,440,400
わかもと製薬	2,000	262.00	524,000
あすか製薬	1,900	1,315.00	2,498,500
日本新薬	4,400	9,550.00	42,020,000
バイオフェルミン製薬	300	2,409.00	722,700
中外製薬	17,700	9,939.00	175,920,300
科研製薬	2,900	6,000.00	17,400,000
エーザイ	20,300	8,111.00	164,653,300
ロート製薬	8,700	3,470.00	30,189,000
小野薬品工業	38,900	2,461.50	95,752,350
久光製薬	5,000	5,340.00	26,700,000
持田製薬	2,300	4,550.00	10,465,000
参天製薬	31,500	2,066.00	65,079,000
扶桑薬品工業	600	2,009.00	1,205,400
日本ケミファ	200	2,977.00	595,400
ツムラ	5,200	3,230.00	16,796,000

日医工	4,800	1,422.00	6,825,600	
キッセイ薬品工業	3,000	3,030.00	9,090,000	
生化学工業	3,300	1,275.00	4,207,500	
栄研化学	3,000	2,067.00	6,201,000	
日水製薬	700	1,296.00	907,200	
鳥居薬品	1,100	2,957.00	3,252,700	
J C R ファーマ	1,200	9,160.00	10,992,000	
東和薬品	2,200	2,885.00	6,347,000	
富士製薬工業	1,200	1,384.00	1,660,800	
沢井製薬	3,500	6,770.00	23,695,000	
ゼリア新薬工業	3,100	2,150.00	6,665,000	
第一三共	48,500	7,177.00	348,084,500	
キョーリン製薬ホールディングス	3,700	1,916.00	7,089,200	
大幸薬品	700	3,075.00	2,152,500	
ダイト	1,000	3,250.00	3,250,000	
大塚ホールディングス	32,300	4,915.00	158,754,500	
大正製薬ホールディングス	3,600	8,130.00	29,268,000	
ペプチドリーム	8,600	5,150.00	44,290,000	
日本コークス工業	14,300	79.00	1,129,700	
ニチレキ	2,000	1,320.00	2,640,000	
ユシロ化学工業	900	1,464.00	1,317,600	
ビービー・カストロール	600	1,584.00	950,400	
富士石油	4,500	246.00	1,107,000	
MORESCO	600	1,412.00	847,200	
出光興産	19,000	3,000.00	57,000,000	
J X T Gホールディングス	262,600	496.20	130,302,120	
コスモエネルギーホールディングス	4,900	2,583.00	12,656,700	
横浜ゴム	9,800	2,291.00	22,451,800	
TOYO TIRE	9,700	1,626.00	15,772,200	
ブリヂストン	52,000	4,335.00	225,420,000	
住友ゴム工業	15,200	1,420.00	21,584,000	
藤倉コンポジット	1,500	495.00	742,500	
オカモト	1,000	4,190.00	4,190,000	
フコク	700	723.00	506,100	
ニッタ	1,900	3,220.00	6,118,000	
住友理工	3,300	1,076.00	3,550,800	

三ツ星ベルト	2,200	2,191.00	4,820,200	
バンドー化学	3,000	941.00	2,823,000	
日東紡績	2,500	4,185.00	10,462,500	
A G C	16,700	3,965.00	66,215,500	
日本板硝子	8,100	659.00	5,337,900	
石塚硝子	300	2,375.00	712,500	
日本山村硝子	700	1,276.00	893,200	
日本電気硝子	6,800	2,397.00	16,299,600	
オハラ	700	1,478.00	1,034,600	
住友大阪セメント	3,200	4,850.00	15,520,000	
太平洋セメント	10,700	3,440.00	36,808,000	
日本ヒューム	1,700	852.00	1,448,400	
日本コンクリート工業	3,600	300.00	1,080,000	
三谷セキサン	800	3,615.00	2,892,000	
アジアパイルホールディングス	2,400	629.00	1,509,600	
東海カーボン	17,700	1,127.00	19,947,900	
日本カーボン	900	4,435.00	3,991,500	
東洋炭素	1,000	2,388.00	2,388,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,795.00	4,315,500	
T O T O	12,100	4,810.00	58,201,000	
日本碍子	20,700	1,896.00	39,247,200	
日本特殊陶業	13,200	2,203.00	29,079,600	
ダントーホールディングス	900	113.00	101,700	
M A R U W A	700	8,110.00	5,677,000	
品川リフラクトリーズ	400	3,460.00	1,384,000	
黒崎播磨	300	6,490.00	1,947,000	
ヨータイ	1,300	755.00	981,500	
イソライト工業	800	723.00	578,400	
東京窯業	2,200	352.00	774,400	
ニッカトー	800	799.00	639,200	
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,872.00	4,308,000	
クニミネ工業	700	1,206.00	844,200	
エーアンドエーマテリアル	300	1,381.00	414,300	
ニチアス	4,600	2,691.00	12,378,600	
ニチハ	2,400	2,791.00	6,698,400	
日本製鉄	74,900	1,737.00	130,101,300	

神戸製鋼所	30,600	621.00	19,002,600	
中山製鋼所	2,300	547.00	1,258,100	
合同製鐵	900	2,860.00	2,574,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,200	1,472.00	66,534,400	
東京製鐵	8,200	809.00	6,633,800	
共英製鋼	1,900	2,176.00	4,134,400	
大和工業	3,600	2,809.00	10,112,400	
東京鐵鋼	700	1,593.00	1,115,100	
大阪製鐵	900	1,492.00	1,342,800	
淀川製鋼所	2,300	2,111.00	4,855,300	
丸一鋼管	5,400	3,140.00	16,956,000	
モリ工業	500	2,424.00	1,212,000	
大同特殊鋼	2,700	4,945.00	13,351,500	
日本高周波鋼業	600	443.00	265,800	
日本冶金工業	1,400	2,318.00	3,245,200	
山陽特殊製鋼	1,200	1,564.00	1,876,800	
愛知製鋼	900	3,775.00	3,397,500	
日立金属	18,000	1,546.00	27,828,000	
日本金属	400	969.00	387,600	
大平洋金属	1,100	2,434.00	2,677,400	
新日本電工	10,800	181.00	1,954,800	
栗本鐵工所	800	2,077.00	1,661,600	
虹技	200	1,501.00	300,200	
日本鑄鉄管	200	1,386.00	277,200	
三菱製鋼	1,200	1,139.00	1,366,800	
日亜鋼業	2,400	347.00	832,800	
日本精線	300	3,275.00	982,500	
エンビプロ・ホールディングス	600	789.00	473,400	
シンニッタン	2,600	444.00	1,154,400	
新家工業	400	1,459.00	583,600	
大紀アルミニウム工業所	2,800	800.00	2,240,000	
日本輕金属ホールディングス	42,400	232.00	9,836,800	
三井金属鉱業	4,500	2,852.00	12,834,000	
東邦亜鉛	900	2,170.00	1,953,000	
三菱マテリアル	11,100	3,010.00	33,411,000	
住友金属鉱山	21,400	3,412.00	73,016,800	

DOWAホールディングス	4,200	4,135.00	17,367,000	
古河機械金属	3,000	1,540.00	4,620,000	
エス・サイエンス	6,800	49.00	333,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	1,567.00	2,663,900	
東邦チタニウム	3,000	983.00	2,949,000	
UACJ	2,500	2,530.00	6,325,000	
CKサンエツ	300	3,030.00	909,000	
古河電気工業	5,200	2,998.00	15,589,600	
住友電気工業	62,600	1,650.00	103,290,000	
フジクラ	20,200	475.00	9,595,000	
昭和電線ホールディングス	1,900	1,275.00	2,422,500	
東京特殊電線	300	2,278.00	683,400	
タツタ電線	3,300	623.00	2,055,900	
カナレ電気	300	1,857.00	557,100	
平河ヒューテック	600	1,456.00	873,600	
リョービ	2,100	2,165.00	4,546,500	
アーレスティ	2,200	564.00	1,240,800	
アサヒホールディングス	2,900	2,679.00	7,769,100	
稲葉製作所	900	1,467.00	1,320,300	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,216.00	1,108,000	
トーカロ	4,700	1,102.00	5,179,400	
アルファC o	600	1,308.00	784,800	
SUMCO	20,000	1,705.00	34,100,000	
川田テクノロジーズ	300	7,120.00	2,136,000	
RS Technologies	500	3,630.00	1,815,000	
信和	700	1,092.00	764,400	
東洋製罐グループホールディングス	10,700	1,925.00	20,597,500	
ホッカンホールディングス	900	1,951.00	1,755,900	
コロナ	900	1,154.00	1,038,600	
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,031.00	6,296,100	
駒井ハルテック	300	1,790.00	537,000	
高田機工	100	2,638.00	263,800	
三和ホールディングス	16,100	1,231.00	19,819,100	
文化シャッター	4,900	992.00	4,860,800	
三協立山	2,300	1,263.00	2,904,900	
アルインコ	1,200	1,309.00	1,570,800	

東洋シャッター	400	753.00	301,200
LIXILグループ	24,700	1,974.00	48,757,800
日本フィルコン	1,300	511.00	664,300
ノーリツ	3,500	1,549.00	5,421,500
長府製作所	1,700	2,460.00	4,182,000
リンナイ	3,300	8,500.00	28,050,000
ダイニチ工業	900	692.00	622,800
日東精工	2,300	650.00	1,495,000
三洋工業	200	2,034.00	406,800
岡部	3,400	962.00	3,270,800
ジーテクト	2,100	1,788.00	3,754,800
東プレ	3,100	1,829.00	5,669,900
高周波熱錬	3,200	891.00	2,851,200
東京製網	1,200	1,298.00	1,557,600
サンコール	900	525.00	472,500
モリテック スチール	1,200	426.00	511,200
パイオラックス	2,500	2,196.00	5,490,000
エイチワン	1,600	847.00	1,355,200
日本発條	18,000	1,005.00	18,090,000
中央発條	200	3,065.00	613,000
アドバネクス	200	1,577.00	315,400
立川ブラインド工業	700	1,405.00	983,500
三益半導体工業	1,500	2,035.00	3,052,500
日本ドライケミカル	400	1,664.00	665,600
日本製鋼所	5,100	2,197.00	11,204,700
三浦工業	7,200	3,650.00	26,280,000
タクマ	5,700	1,296.00	7,387,200
ツガミ	3,500	1,114.00	3,899,000
オークマ	2,000	6,090.00	12,180,000
東芝機械	1,900	3,035.00	5,766,500
アマダホールディングス	21,300	1,268.00	27,008,400
アイダエンジニアリング	4,500	1,032.00	4,644,000
滝澤鉄工所	500	1,395.00	697,500
F U J I	7,200	1,989.00	14,320,800
牧野フライス製作所	2,000	5,410.00	10,820,000
オーエスジー	7,700	2,218.00	17,078,600

ダイジェット工業	200	1,494.00	298,800	
旭ダイヤモンド工業	4,400	668.00	2,939,200	
D M G 森精機	10,600	1,743.00	18,475,800	
ソディック	3,900	1,030.00	4,017,000	
ディスコ	2,300	23,440.00	53,912,000	
日東工器	900	2,391.00	2,151,900	
日進工具	500	2,310.00	1,155,000	
パンチ工業	1,500	535.00	802,500	
富士ダイス	700	675.00	472,500	
豊和工業	900	835.00	751,500	
O K K	700	685.00	479,500	
石川製作所	400	1,621.00	648,400	
東洋機械金属	1,200	575.00	690,000	
津田駒工業	300	1,350.00	405,000	
エンシュウ	400	1,418.00	567,200	
島精機製作所	2,700	2,755.00	7,438,500	
オプトラ	1,900	2,899.00	5,508,100	
N C ホールディングス	500	638.00	319,000	
イワキポンプ	800	1,229.00	983,200	
フリー	1,600	1,100.00	1,760,000	
ヤマシンフィルタ	3,600	850.00	3,060,000	
日阪製作所	2,100	994.00	2,087,400	
やまびこ	3,200	1,204.00	3,852,800	
平田機工	800	7,760.00	6,208,000	
ペガサスミシン製造	1,700	515.00	875,500	
マルマエ	700	976.00	683,200	
タツモ	800	1,208.00	966,400	
ナブテスコ	9,900	3,395.00	33,610,500	
三井海洋開発	1,800	2,606.00	4,690,800	
レオン自動機	1,600	1,650.00	2,640,000	
S M C	5,300	50,150.00	265,795,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,500	541.00	811,500	
ホソカワミクロン	600	4,740.00	2,844,000	
ユニオンツール	600	3,230.00	1,938,000	
オイレス工業	2,200	1,719.00	3,781,800	

日精エー・エス・ビー機械	600	4,630.00	2,778,000	
サトーホールディングス	2,400	3,425.00	8,220,000	
技研製作所	1,500	4,995.00	7,492,500	
日本エアーテック	500	706.00	353,000	
カワタ	500	1,204.00	602,000	
日精樹脂工業	1,400	1,033.00	1,446,200	
オカダアイヨン	500	1,257.00	628,500	
ワイエイシイホールディングス	700	726.00	508,200	
小松製作所	76,700	2,691.50	206,438,050	
住友重機械工業	9,700	3,115.00	30,215,500	
日立建機	6,800	3,105.00	21,114,000	
日工	2,300	840.00	1,932,000	
巴工業	700	2,273.00	1,591,100	
井関農機	1,700	1,698.00	2,886,600	
T O W A	1,700	1,122.00	1,907,400	
丸山製作所	300	1,260.00	378,000	
北川鉄工所	800	2,370.00	1,896,000	
ローツェ	700	3,800.00	2,660,000	
タカキタ	500	550.00	275,000	
クボタ	89,800	1,722.00	154,635,600	
荏原実業	400	2,261.00	904,400	
三菱化工機	600	1,908.00	1,144,800	
月島機械	3,100	1,686.00	5,226,600	
帝国電機製作所	1,400	1,405.00	1,967,000	
東京機械製作所	700	372.00	260,400	
新東工業	4,000	1,041.00	4,164,000	
澁谷工業	1,500	3,265.00	4,897,500	
アイチ コーポレーション	2,900	747.00	2,166,300	
小森コーポレーション	4,300	1,164.00	5,005,200	
鶴見製作所	1,300	2,034.00	2,644,200	
住友精密工業	300	3,440.00	1,032,000	
日本ギア工業	400	408.00	163,200	
酒井重工業	300	2,967.00	890,100	
荏原製作所	7,000	3,395.00	23,765,000	
石井鐵工所	200	2,522.00	504,400	
西島製作所	1,700	950.00	1,615,000	

北越工業	1,700	1,285.00	2,184,500	
ダイキン工業	21,600	15,675.00	338,580,000	
オルガノ	600	6,750.00	4,050,000	
トーヨーカネツ	700	2,326.00	1,628,200	
栗田工業	9,200	3,160.00	29,072,000	
椿本チエイン	2,400	3,900.00	9,360,000	
大同工業	800	840.00	672,000	
木村化工機	1,400	754.00	1,055,600	
アネスト岩田	2,600	1,055.00	2,743,000	
ダイフク	8,700	6,590.00	57,333,000	
サムコ	500	1,227.00	613,500	
加藤製作所	900	1,838.00	1,654,200	
油研工業	300	1,737.00	521,100	
タダノ	8,200	1,069.00	8,765,800	
フジテック	6,200	1,815.00	11,253,000	
C K D	4,700	1,867.00	8,774,900	
キトー	1,300	1,700.00	2,210,000	
平和	4,700	2,266.00	10,650,200	
理想科学工業	1,500	1,948.00	2,922,000	
S A N K Y O	3,800	3,650.00	13,870,000	
日本金銭機械	1,900	929.00	1,765,100	
マースグループホールディングス	1,100	2,103.00	2,313,300	
フクシマガリレイ	1,000	3,935.00	3,935,000	
オーイズミ	700	600.00	420,000	
ダイコク電機	800	1,695.00	1,356,000	
竹内製作所	2,800	1,680.00	4,704,000	
アマノ	4,400	3,385.00	14,894,000	
J U K I	2,400	914.00	2,193,600	
サンデンホールディングス	2,200	760.00	1,672,000	
蛇の目ミシン工業	1,500	410.00	615,000	
マックス	2,600	2,146.00	5,579,600	
グローリー	4,700	3,355.00	15,768,500	
新晃工業	1,600	1,984.00	3,174,400	
大和冷機工業	2,400	1,269.00	3,045,600	
セガサミーホールディングス	16,800	1,595.00	26,796,000	
日本ピストンリング	600	1,488.00	892,800	

リケン	800	4,285.00	3,428,000	
T P R	2,300	2,117.00	4,869,100	
ツバキ・ナカシマ	3,400	1,703.00	5,790,200	
ホシザキ	4,900	9,820.00	48,118,000	
大豊工業	1,400	871.00	1,219,400	
日本精工	31,900	1,067.00	34,037,300	
N T N	39,200	351.00	13,759,200	
ジェイテクト	16,200	1,353.00	21,918,600	
不二越	1,600	5,020.00	8,032,000	
日本トムソン	5,000	505.00	2,525,000	
T H K	9,900	3,000.00	29,700,000	
ユーシン精機	1,300	1,034.00	1,344,200	
前澤給装工業	600	2,233.00	1,339,800	
イーグル工業	2,100	1,125.00	2,362,500	
前澤工業	1,000	403.00	403,000	
日本ピラー工業	1,700	1,474.00	2,505,800	
キッツ	6,900	760.00	5,244,000	
マキタ	22,100	3,665.00	80,996,500	
日立造船	13,400	440.00	5,896,000	
三菱重工業	28,400	4,244.00	120,529,600	
I H I	12,200	2,593.00	31,634,600	
スター精密	2,600	1,606.00	4,175,600	
日清紡ホールディングス	11,300	1,045.00	11,808,500	
イビデン	10,400	2,613.00	27,175,200	
コニカミノルタ	37,000	725.00	26,825,000	
ブラザー工業	20,700	2,258.00	46,740,600	
ミネベアミツミ	31,400	2,244.00	70,461,600	
日立製作所	81,400	4,306.00	350,508,400	
三菱電機	169,300	1,535.00	259,875,500	
富士電機	10,200	3,360.00	34,272,000	
東洋電機製造	700	1,547.00	1,082,900	
安川電機	18,200	4,035.00	73,437,000	
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,419.00	3,121,800	
明電舎	3,100	2,251.00	6,978,100	
オリジン	500	1,482.00	741,000	
山洋電気	800	5,520.00	4,416,000	

デンヨー	1,400	2,173.00	3,042,200	
東芝テック	2,100	4,685.00	9,838,500	
芝浦メカトロニクス	300	3,830.00	1,149,000	
マブチモーター	4,700	4,305.00	20,233,500	
日本電産	20,400	15,725.00	320,790,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	611.00	611,000	
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,479.00	1,479,000	
東光高岳	900	1,186.00	1,067,400	
ダブル・スコープ	2,600	892.00	2,319,200	
宮越ホールディングス	600	1,118.00	670,800	
ダイヘン	1,900	3,680.00	6,992,000	
ヤーマン	2,500	687.00	1,717,500	
JVCケンウッド	13,800	269.00	3,712,200	
ミマキエンジニアリング	1,500	523.00	784,500	
第一精工	700	2,693.00	1,885,100	
日新電機	4,000	1,297.00	5,188,000	
大崎電気工業	3,400	727.00	2,471,800	
オムロン	15,700	6,470.00	101,579,000	
日東工業	2,500	2,591.00	6,477,500	
I D E C	2,400	2,309.00	5,541,600	
正興電機製作所	400	837.00	334,800	
不二電機工業	200	1,291.00	258,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,700	2,382.00	13,577,400	
サクサホールディングス	400	1,943.00	777,200	
メルコホールディングス	600	3,135.00	1,881,000	
テクノメディカ	300	2,058.00	617,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	1,030.00	309,000	
日本電気	20,500	4,545.00	93,172,500	
富士通	16,300	10,215.00	166,504,500	
沖電気工業	6,900	1,566.00	10,805,400	
岩崎通信機	700	815.00	570,500	
電気興業	800	3,195.00	2,556,000	
サンケン電気	1,800	3,245.00	5,841,000	
ナカヨ	300	1,627.00	488,100	
アイホン	1,000	1,991.00	1,991,000	

ルネサスエレクトロニクス	80,800	719.00	58,095,200	
セイコーエプソン	21,000	1,704.00	35,784,000	
ワコム	11,400	469.00	5,346,600	
アルバック	3,400	4,265.00	14,501,000	
アクセル	700	677.00	473,900	
E I Z O	1,300	4,150.00	5,395,000	
ジャパンディスプレイ	48,900	68.00	3,325,200	
日本信号	4,300	1,413.00	6,075,900	
京三製作所	4,000	552.00	2,208,000	
能美防災	2,200	2,538.00	5,583,600	
ホーチキ	1,200	1,765.00	2,118,000	
星和電機	800	567.00	453,600	
エレコム	1,800	4,125.00	7,425,000	
パナソニック	193,400	1,057.50	204,520,500	
シャープ	19,600	1,702.00	33,359,200	
アンリツ	10,900	2,086.00	22,737,400	
富士通ゼネラル	4,600	2,283.00	10,501,800	
ソニー	107,000	7,245.00	775,215,000	
T D K	8,200	12,150.00	99,630,000	
帝国通信工業	700	1,214.00	849,800	
タムラ製作所	5,700	690.00	3,933,000	
アルプスアルパイン	15,000	2,584.00	38,760,000	
池上通信機	500	1,036.00	518,000	
日本電波工業	1,500	571.00	856,500	
鈴木	900	802.00	721,800	
日本トリム	200	4,760.00	952,000	
ローランド ディー . ジー .	900	2,202.00	1,981,800	
フォスター電機	1,800	2,021.00	3,637,800	
S M K	400	3,005.00	1,202,000	
ヨコオ	1,100	3,150.00	3,465,000	
ティアック	1,100	226.00	248,600	
ホシデン	4,600	1,366.00	6,283,600	
ヒロセ電機	2,600	13,660.00	35,516,000	
日本航空電子工業	3,900	2,229.00	8,693,100	
T O A	1,800	1,150.00	2,070,000	
マクセルホールディングス	3,600	1,500.00	5,400,000	

古野電気	2,200	1,352.00	2,974,400	
ユニデンホールディングス	500	1,882.00	941,000	
スミダコーポレーション	1,300	1,349.00	1,753,700	
アイコム	900	2,720.00	2,448,000	
リオン	700	2,957.00	2,069,900	
本多通信工業	1,400	553.00	774,200	
船井電機	1,700	712.00	1,210,400	
横河電機	15,500	1,965.00	30,457,500	
新電元工業	600	3,765.00	2,259,000	
アズビル	10,700	3,205.00	34,293,500	
東亜ディーケーケー	800	914.00	731,200	
日本光電工業	7,000	2,966.00	20,762,000	
チノー	600	1,426.00	855,600	
共和電業	1,800	441.00	793,800	
日本電子材料	700	830.00	581,000	
堀場製作所	3,400	7,470.00	25,398,000	
アドバンテスト	12,600	5,340.00	67,284,000	
小野測器	700	545.00	381,500	
エスベック	1,500	2,210.00	3,315,000	
キーエンス	15,300	39,180.00	599,454,000	
日置電機	900	3,905.00	3,514,500	
シスメックス	12,100	7,616.00	92,153,600	
日本マイクロニクス	2,900	1,086.00	3,149,400	
メガチップス	1,600	2,382.00	3,811,200	
O B A R A G R O U P	900	3,840.00	3,456,000	
澤藤電機	200	2,221.00	444,200	
原田工業	800	1,024.00	819,200	
コーセル	2,100	1,260.00	2,646,000	
イリソ電子工業	1,400	5,310.00	7,434,000	
オブテックスグループ	2,800	1,621.00	4,538,800	
千代田インテグレ	800	2,476.00	1,980,800	
アイ・オー・データ機器	600	1,108.00	664,800	
レーザーテック	3,500	9,620.00	33,670,000	
スタンレー電気	11,900	3,120.00	37,128,000	
岩崎電気	700	1,448.00	1,013,600	
ウシオ電機	9,800	1,637.00	16,042,600	

岡谷電機産業	1,300	380.00	494,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	501.00	801,600
エノモト	500	1,122.00	561,000
日本セラミック	1,700	2,819.00	4,792,300
遠藤照明	800	707.00	565,600
古河電池	1,200	795.00	954,000
双信電機	800	502.00	401,600
山一電機	1,200	1,688.00	2,025,600
図研	1,100	2,437.00	2,680,700
日本電子	3,300	3,135.00	10,345,500
カシオ計算機	15,000	2,155.00	32,325,000
ファナック	16,100	21,270.00	342,447,000
日本シイエムケイ	4,000	661.00	2,644,000
エンプラス	900	3,480.00	3,132,000
大真空	600	1,608.00	964,800
ローム	7,500	8,920.00	66,900,000
浜松ホトニクス	12,100	4,535.00	54,873,500
三井ハイテック	1,900	2,099.00	3,988,100
新光電気工業	5,700	1,187.00	6,765,900
京セラ	23,800	7,395.00	176,001,000
太陽誘電	7,500	3,055.00	22,912,500
村田製作所	49,700	6,635.00	329,759,500
双葉電子工業	2,700	1,388.00	3,747,600
北陸電気工業	700	1,135.00	794,500
ニチコン	5,700	1,179.00	6,720,300
日本ケミコン	1,300	2,039.00	2,650,700
K O A	2,600	1,458.00	3,790,800
市光工業	2,500	843.00	2,107,500
小糸製作所	10,100	5,540.00	55,954,000
ミツバ	3,100	765.00	2,371,500
S C R E E Nホールディングス	2,900	7,360.00	21,344,000
キヤノン電子	1,800	2,152.00	3,873,600
キヤノン	91,100	3,059.00	278,674,900
リコー	43,100	1,168.00	50,340,800
象印マホービン	5,000	1,825.00	9,125,000
M U T O Hホールディングス	200	1,752.00	350,400

東京エレクトロン	11,300	22,250.00	251,425,000
トヨタ紡織	4,900	1,781.00	8,726,900
芦森工業	400	1,397.00	558,800
ユニプレス	3,300	1,625.00	5,362,500
豊田自動織機	13,700	6,380.00	87,406,000
モリタホールディングス	3,000	1,787.00	5,361,000
三櫻工業	2,100	1,293.00	2,715,300
デンソー	37,300	4,984.00	185,903,200
東海理化電機製作所	4,500	2,193.00	9,868,500
三井E & Sホールディングス	6,100	950.00	5,795,000
川崎重工業	13,200	2,495.00	32,934,000
名村造船所	5,400	279.00	1,506,600
サノヤスホールディングス	1,900	181.00	343,900
日本車輛製造	600	3,025.00	1,815,000
三菱ロジスネクスト	2,200	1,234.00	2,714,800
近畿車輛	300	1,589.00	476,700
日産自動車	199,700	679.60	135,716,120
いすゞ自動車	49,100	1,287.50	63,216,250
トヨタ自動車	188,700	7,650.00	1,443,555,000
日野自動車	21,100	1,151.00	24,286,100
三菱自動車工業	62,700	482.00	30,221,400
エフテック	1,200	775.00	930,000
レシップホールディングス	600	689.00	413,400
GMB	300	817.00	245,100
ファルテック	300	1,183.00	354,900
武蔵精密工業	3,800	1,484.00	5,639,200
日産車体	3,300	1,103.00	3,639,900
新明和工業	4,600	1,514.00	6,964,400
極東開発工業	3,100	1,650.00	5,115,000
日信工業	3,100	2,222.00	6,888,200
トピー工業	1,400	2,096.00	2,934,400
ティラド	600	1,990.00	1,194,000
曙ブレーキ工業	9,300	242.00	2,250,600
タチエス	2,800	1,445.00	4,046,000
NOK	9,100	1,726.00	15,706,600
フタバ産業	4,700	808.00	3,797,600

K Y B	1,900	3,315.00	6,298,500	
大同メタル工業	3,200	793.00	2,537,600	
プレス工業	8,400	443.00	3,721,200	
ミクニ	2,100	343.00	720,300	
太平洋工業	3,500	1,477.00	5,169,500	
ケーヒン	3,500	2,572.00	9,002,000	
河西工業	2,300	923.00	2,122,900	
アイシン精機	13,900	4,210.00	58,519,000	
マツダ	49,800	958.00	47,708,400	
今仙電機製作所	1,600	983.00	1,572,800	
本田技研工業	133,300	3,135.00	417,895,500	
スズキ	33,600	4,651.00	156,273,600	
S U B A R U	52,600	2,809.00	147,753,400	
安永	800	1,289.00	1,031,200	
ヤマハ発動機	22,100	2,282.00	50,432,200	
ショーワ	3,600	2,273.00	8,182,800	
T B K	2,000	431.00	862,000	
エクセディ	2,300	2,542.00	5,846,600	
豊田合成	5,500	2,710.00	14,905,000	
愛三工業	2,600	850.00	2,210,000	
盟和産業	200	1,135.00	227,000	
日本プラスト	1,300	736.00	956,800	
ヨロズ	1,600	1,437.00	2,299,200	
エフ・シー・シー	2,800	2,420.00	6,776,000	
シマノ	6,300	17,740.00	111,762,000	
テイ・エス テック	3,900	3,545.00	13,825,500	
ジャムコ	800	1,517.00	1,213,600	
テルモ	47,900	3,793.00	181,684,700	
クリエートメディック	600	1,061.00	636,600	
日機装	5,100	1,442.00	7,354,200	
日本エム・ディ・エム	1,000	2,220.00	2,220,000	
島津製作所	20,200	3,355.00	67,771,000	
J M S	1,400	774.00	1,083,600	
クボテック	400	423.00	169,200	
長野計器	1,200	861.00	1,033,200	
ブイ・テクノロジー	800	5,900.00	4,720,000	

東京計器	1,100	1,055.00	1,160,500	
愛知時計電機	200	4,330.00	866,000	
インターアクション	900	2,630.00	2,367,000	
オーバル	1,500	251.00	376,500	
東京精密	3,100	4,080.00	12,648,000	
マニー	6,700	2,914.00	19,523,800	
ニコン	27,400	1,453.00	39,812,200	
トプコン	8,500	1,456.00	12,376,000	
オリンパス	93,700	1,598.00	149,732,600	
理研計器	1,500	2,319.00	3,478,500	
タムロン	1,400	2,651.00	3,711,400	
H O Y A	34,100	9,924.00	338,408,400	
シード	700	1,077.00	753,900	
ノーリツ鋼機	1,100	1,930.00	2,123,000	
エー・アンド・デイ	1,500	899.00	1,348,500	
朝日インテック	14,400	3,090.00	44,496,000	
シチズン時計	19,800	610.00	12,078,000	
リズム時計工業	500	957.00	478,500	
大研医器	1,100	639.00	702,900	
メニコン	2,300	4,395.00	10,108,500	
シンシア	200	606.00	121,200	
松風	800	1,689.00	1,351,200	
セイコーホールディングス	2,400	2,977.00	7,144,800	
ニプロ	11,700	1,296.00	15,163,200	
中本パックス	400	1,535.00	614,000	
スノーピーク	800	1,071.00	856,800	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,565.00	8,217,000	
トランザクション	1,100	1,063.00	1,169,300	
S H O - B I	400	398.00	159,200	
ニホンフラッシュ	800	2,828.00	2,262,400	
前田工織	1,900	2,066.00	3,925,400	
永大産業	2,200	350.00	770,000	
アートネイチャー	1,800	800.00	1,440,000	
バンダイナムコホールディングス	17,500	6,682.00	116,935,000	
アイフィスジャパン	400	788.00	315,200	
共立印刷	2,800	167.00	467,600	

SHOEI	800	5,230.00	4,184,000
フランスベッドホールディングス	2,400	1,006.00	2,414,400
パイロットコーポレーション	3,000	4,480.00	13,440,000
萩原工業	900	1,676.00	1,508,400
トッパン・フォームズ	3,600	1,220.00	4,392,000
フジシールインターナショナル	3,800	2,383.00	9,055,400
タカラトミー	7,600	1,295.00	9,842,000
廣濟堂	1,200	859.00	1,030,800
エステールホールディングス	400	685.00	274,000
アーク	6,500	96.00	624,000
タカノ	700	831.00	581,700
プロネクサス	1,500	1,222.00	1,833,000
ホクシン	800	168.00	134,400
ウッドワン	600	1,204.00	722,400
大建工業	1,100	2,077.00	2,284,700
凸版印刷	23,900	2,176.00	52,006,400
大日本印刷	22,200	2,952.00	65,534,400
共同印刷	500	2,965.00	1,482,500
NISSHA	3,500	1,155.00	4,042,500
光村印刷	100	1,793.00	179,300
TAKARA & COMPANY	800	1,710.00	1,368,000
アシックス	14,000	1,750.00	24,500,000
ツツミ	500	2,235.00	1,117,500
小松ウオール工業	500	2,405.00	1,202,500
ヤマハ	10,100	6,090.00	61,509,000
河合楽器製作所	500	3,825.00	1,912,500
クリナップ	1,600	799.00	1,278,400
ピジョン	10,200	4,230.00	43,146,000
オリバー	400	3,565.00	1,426,000
兼松サステック	100	1,772.00	177,200
キングジム	1,400	890.00	1,246,000
リンテック	4,000	2,437.00	9,748,000
イトーキ	3,600	555.00	1,998,000
任天堂	10,400	46,370.00	482,248,000
三菱鉛筆	2,800	1,720.00	4,816,000
タカラスタANDARD	3,500	2,007.00	7,024,500

コクヨ	8,100	1,710.00	13,851,000	
ナカバヤシ	1,700	613.00	1,042,100	
グロープライド	800	2,680.00	2,144,000	
オカムラ	5,900	1,082.00	6,383,800	
美津濃	1,500	2,885.00	4,327,500	
東京電力ホールディングス	135,200	478.00	64,625,600	
中部電力	51,800	1,518.50	78,658,300	
関西電力	64,100	1,222.50	78,362,250	
中国電力	23,400	1,445.00	33,813,000	
北陸電力	15,500	783.00	12,136,500	
東北電力	42,300	1,076.00	45,514,800	
四国電力	15,200	1,058.00	16,081,600	
九州電力	34,900	935.00	32,631,500	
北海道電力	15,800	518.00	8,184,400	
沖縄電力	3,100	1,991.00	6,172,100	
電源開発	13,500	2,666.00	35,991,000	
エフオン	800	764.00	611,200	
イーレックス	2,400	1,810.00	4,344,000	
レノバ	2,800	1,126.00	3,152,800	
東京瓦斯	32,600	2,618.50	85,363,100	
大阪瓦斯	32,900	2,098.00	69,024,200	
東邦瓦斯	8,400	4,200.00	35,280,000	
北海道瓦斯	900	1,596.00	1,436,400	
広島ガス	3,500	355.00	1,242,500	
西部瓦斯	1,900	2,437.00	4,630,300	
静岡ガス	4,800	930.00	4,464,000	
メタウォーター	800	4,230.00	3,384,000	
SBSホールディングス	1,500	2,018.00	3,027,000	
東武鉄道	17,900	4,070.00	72,853,000	
相鉄ホールディングス	5,400	3,025.00	16,335,000	
東急	42,700	2,136.00	91,207,200	
京浜急行電鉄	21,700	2,168.00	47,045,600	
小田急電鉄	25,200	2,630.00	66,276,000	
京王電鉄	8,800	6,830.00	60,104,000	
京成電鉄	11,800	4,440.00	52,392,000	
富士急行	2,300	4,255.00	9,786,500	

新京成電鉄	400	2,332.00	932,800	
東日本旅客鉄道	29,800	9,870.00	294,126,000	
西日本旅客鉄道	15,100	9,473.00	143,042,300	
東海旅客鉄道	14,100	21,865.00	308,296,500	
西武ホールディングス	22,700	1,906.00	43,266,200	
鴻池運輸	2,700	1,659.00	4,479,300	
西日本鉄道	4,700	2,605.00	12,243,500	
ハマキョウレックス	1,300	3,570.00	4,641,000	
サカイ引越センター	900	7,000.00	6,300,000	
近鉄グループホールディングス	16,000	6,000.00	96,000,000	
阪急阪神ホールディングス	21,400	4,755.00	101,757,000	
南海電気鉄道	7,600	3,005.00	22,838,000	
京阪ホールディングス	7,100	5,370.00	38,127,000	
神戸電鉄	400	3,990.00	1,596,000	
名古屋鉄道	13,200	3,450.00	45,540,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,231.00	2,454,100	
日本通運	5,700	6,770.00	38,589,000	
ヤマトホールディングス	28,100	1,837.00	51,619,700	
山九	4,500	5,580.00	25,110,000	
丸運	800	285.00	228,000	
丸全昭和運輸	1,300	3,110.00	4,043,000	
センコーグループホールディングス	8,800	928.00	8,166,400	
トナミホールディングス	400	5,240.00	2,096,000	
ニッコンホールディングス	5,700	2,752.00	15,686,400	
日本石油輸送	200	2,813.00	562,600	
福山通運	2,100	4,135.00	8,683,500	
セイノーホールディングス	12,000	1,513.00	18,156,000	
エスライン	500	1,006.00	503,000	
神奈川中央交通	400	4,035.00	1,614,000	
日立物流	2,900	3,030.00	8,787,000	
丸和運輸機関	1,700	2,561.00	4,353,700	
C & F ロジホールディングス	1,600	1,455.00	2,328,000	
九州旅客鉄道	14,300	3,725.00	53,267,500	
S Gホールディングス	16,800	2,589.00	43,495,200	
日本郵船	13,400	1,980.00	26,532,000	
商船三井	10,100	3,005.00	30,350,500	

川崎汽船	4,900	1,958.00	9,594,200
N S ユナイテッド海運	900	2,292.00	2,062,800
明治海運	1,700	361.00	613,700
飯野海運	7,600	376.00	2,857,600
共栄タンカー	100	1,844.00	184,400
乾汽船	900	1,153.00	1,037,700
日本航空	29,400	3,350.00	98,490,000
A N A ホールディングス	29,300	3,700.00	108,410,000
パスコ	300	2,137.00	641,100
トランコム	400	7,850.00	3,140,000
日新	1,400	1,816.00	2,542,400
三菱倉庫	5,100	2,809.00	14,325,900
三井倉庫ホールディングス	1,800	2,007.00	3,612,600
住友倉庫	5,900	1,505.00	8,879,500
澁澤倉庫	900	2,240.00	2,016,000
東陽倉庫	2,900	338.00	980,200
日本トランスシティ	3,500	545.00	1,907,500
ケイヒン	300	1,314.00	394,200
中央倉庫	1,000	1,219.00	1,219,000
川西倉庫	300	1,056.00	316,800
安田倉庫	1,300	1,006.00	1,307,800
ファイズホールディングス	300	625.00	187,500
東洋埠頭	500	1,397.00	698,500
宇徳	1,400	542.00	758,800
上組	9,200	2,418.00	22,245,600
サンリツ	400	703.00	281,200
キムラユニティー	400	1,111.00	444,400
キューソー流通システム	400	1,905.00	762,000
近鉄エクスプレス	3,400	1,887.00	6,415,800
東海運	800	285.00	228,000
エーアイティー	1,100	954.00	1,049,400
内外トランスライン	600	1,510.00	906,000
日本コンセプト	500	1,480.00	740,000
N E C ネットズエスアイ	1,600	3,625.00	5,800,000
クロスキャット	400	1,086.00	434,400
システナ	5,900	1,803.00	10,637,700

デジタルアーツ	800	5,800.00	4,640,000
日鉄ソリューションズ	2,500	3,860.00	9,650,000
キューブシステム	900	803.00	722,700
エイジア	300	1,395.00	418,500
コア	700	1,416.00	991,200
ソリトンシステムズ	700	1,259.00	881,300
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,811.00	1,267,700
T I S	5,500	6,740.00	37,070,000
ネオス	700	906.00	634,200
電算システム	600	3,090.00	1,854,000
グリー	11,500	515.00	5,922,500
コーエーテクモホールディングス	3,400	2,693.00	9,156,200
三菱総合研究所	700	4,085.00	2,859,500
ボルテージ	300	493.00	147,900
電算	100	2,240.00	224,000
A G S	900	787.00	708,300
ファインデックス	1,400	1,292.00	1,808,800
ブレインパッド	300	5,570.00	1,671,000
K L a b	3,200	861.00	2,755,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	994.00	1,988,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,958.00	391,600
ネクソン	47,300	1,502.00	71,044,600
アイスタイル	4,300	756.00	3,250,800
エムアップ	500	2,700.00	1,350,000
エイチーム	1,100	1,179.00	1,296,900
エニグモ	1,200	1,009.00	1,210,800
テクノスジャパン	1,200	512.00	614,400
e n i s h	700	668.00	467,600
コロプラ	5,400	1,270.00	6,858,000
オルトプラス	1,200	1,042.00	1,250,400
ブロードリーフ	8,200	697.00	5,715,400
クロス・マーケティンググループ	700	370.00	259,000
デジタルハーツホールディングス	900	1,107.00	996,300
システム情報	800	1,076.00	860,800
メディアドゥホールディングス	500	3,910.00	1,955,000

じげん	4,100	567.00	2,324,700
ブイキューブ	1,000	578.00	578,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	852.00	255,600
サイバーリンクス	300	1,296.00	388,800
ディー・エル・イー	1,000	178.00	178,000
フィックスターズ	1,800	1,582.00	2,847,600
CARTA HOLDINGS	800	1,299.00	1,039,200
オブティム	400	3,370.00	1,348,000
セレス	500	1,204.00	602,000
SHIFT	400	7,840.00	3,136,000
ティーガイア	1,500	2,672.00	4,008,000
セック	200	3,770.00	754,000
日本アジアグループ	1,800	388.00	698,400
豆蔵ホールディングス	1,100	1,444.00	1,588,400
テクマトリックス	1,200	2,390.00	2,868,000
プロシップ	500	1,337.00	668,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,390.00	9,560,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	7,630.00	20,601,000
ザッパラス	900	421.00	378,900
システムリサーチ	400	1,761.00	704,400
インターネットイニシアティブ	2,500	2,656.00	6,640,000
さくらインターネット	1,800	730.00	1,314,000
ヴィンクス	500	1,242.00	621,000
GMOクラウド	300	2,853.00	855,900
SRAホールディングス	900	2,585.00	2,326,500
Minor iソリューションズ	300	2,700.00	810,000
システムインテグレータ	500	917.00	458,500
朝日ネット	1,200	638.00	765,600
eBASE	1,000	1,190.00	1,190,000
アバント	1,200	1,049.00	1,258,800
アドソル日進	600	2,328.00	1,396,800
フリービット	1,000	962.00	962,000
コムチュア	1,900	2,403.00	4,565,700
サイバーコム	300	2,190.00	657,000
アステリア	1,000	663.00	663,000
アイル	600	2,040.00	1,224,000

マークラインズ	800	2,127.00	1,701,600	
メディカル・データ・ビジョン	1,300	912.00	1,185,600	
g u m i	2,100	851.00	1,787,100	
ショーケース	400	646.00	258,400	
モバイルファクトリー	400	1,417.00	566,800	
テラスカイ	600	2,580.00	1,548,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,635.00	1,144,500	
P C Iホールディングス	300	2,202.00	660,600	
パイブドHD	200	1,705.00	341,000	
アイビーシー	300	1,250.00	375,000	
ネオジャパン	300	1,131.00	339,300	
P R T I M E S	100	2,259.00	225,900	
ランドコンピュータ	300	1,147.00	344,100	
ダブルスタンダード	200	5,080.00	1,016,000	
オープンドア	800	1,725.00	1,380,000	
マイネット	500	682.00	341,000	
アカツキ	600	6,170.00	3,702,000	
ベネフィットジャパン	100	1,529.00	152,900	
U b i c o mホールディングス	400	1,166.00	466,400	
L I N E	3,800	5,200.00	19,760,000	
カナミックネットワーク	1,000	711.00	711,000	
ノムラシステムコーポレーション	300	567.00	170,100	
チェンジ	300	2,727.00	818,100	
シンクロ・フード	700	607.00	424,900	
オークネット	1,000	1,404.00	1,404,000	
セグエグループ	300	909.00	272,700	
エイトレッド	200	1,527.00	305,400	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	713.00	1,212,100	
マクロミル	3,000	1,028.00	3,084,000	
ビーグリー	300	1,313.00	393,900	
オロ	400	4,070.00	1,628,000	
テモナ	200	486.00	97,200	
ニーズウェル	200	703.00	140,600	
サインポスト	300	2,525.00	757,500	
ソルクシーズ	700	939.00	657,300	

フェイス	600	797.00	478,200
プロトコーポレーション	1,500	1,191.00	1,786,500
ハイマックス	200	1,971.00	394,200
野村総合研究所	27,800	2,380.00	66,164,000
サイバネットシステム	1,200	813.00	975,600
C Eホールディングス	1,000	458.00	458,000
日本システム技術	300	1,263.00	378,900
インテージホールディングス	2,100	960.00	2,016,000
東邦システムサイエンス	400	939.00	375,600
ソースネクスト	7,900	489.00	3,863,100
インフォコム	1,800	2,487.00	4,476,600
ラクスル	900	3,395.00	3,055,500
F I G	1,800	312.00	561,600
システムサポート	100	2,322.00	232,200
イーソル	600	2,036.00	1,221,600
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,674.00	3,013,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,610.00	644,000
フォーカスシステムズ	1,000	893.00	893,000
クレスコ	500	3,590.00	1,795,000
フジ・メディア・ホールディングス	16,000	1,530.00	24,480,000
オービック	5,800	14,960.00	86,768,000
ジャストシステム	2,700	6,050.00	16,335,000
T D Cソフト	1,500	910.00	1,365,000
Zホールディングス	228,100	376.00	85,765,600
トレンドマイクロ	7,400	5,840.00	43,216,000
I Dホールディングス	600	1,433.00	859,800
日本オラクル	3,400	10,050.00	34,170,000
アルファシステムズ	500	3,010.00	1,505,000
フューチャー	2,000	1,869.00	3,738,000
C A C H o l d i n g s	1,100	1,629.00	1,791,900
S Bテクノロジー	600	1,982.00	1,189,200
トーセ	400	953.00	381,200
オービックビジネスコンサルタント	1,700	5,010.00	8,517,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,600	3,030.00	23,028,000
アイティフォー	2,000	871.00	1,742,000

東計電算	200	3,785.00	757,000	
エクスネット	300	971.00	291,300	
大塚商会	9,000	4,810.00	43,290,000	
サイボウズ	1,900	1,223.00	2,323,700	
ソフトブレーン	900	596.00	536,400	
電通国際情報サービス	1,000	4,290.00	4,290,000	
デジタルガレージ	3,000	4,170.00	12,510,000	
E Mシステムズ	1,200	2,143.00	2,571,600	
ウェザーニューズ	600	3,465.00	2,079,000	
C I J	1,200	1,009.00	1,210,800	
ビジネスエンジニアリング	200	3,225.00	645,000	
日本エンタープライズ	1,700	230.00	391,000	
WOWOW	800	2,773.00	2,218,400	
スカラ	1,200	780.00	936,000	
インテリジェント ウェイブ	600	754.00	452,400	
I M A G I C A G R O U P	1,400	614.00	859,600	
ネットワンシステムズ	6,300	3,170.00	19,971,000	
システムソフト	3,900	110.00	429,000	
アルゴグラフィックス	1,400	3,500.00	4,900,000	
マーベラス	2,500	760.00	1,900,000	
エイベックス	2,900	1,300.00	3,770,000	
日本ユニシス	5,200	3,685.00	19,162,000	
兼松エレクトロニクス	900	3,580.00	3,222,000	
東京放送ホールディングス	10,100	1,761.00	17,786,100	
日本テレビホールディングス	13,900	1,474.00	20,488,600	
朝日放送グループホールディングス	1,600	744.00	1,190,400	
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,958.00	9,006,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	10,900	471.00	5,133,900	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,347.00	3,285,800	
日本BS放送	600	1,083.00	649,800	
ビジョン	1,500	1,860.00	2,790,000	
スマートバリュー	500	820.00	410,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	600	1,191.00	714,600	
ワイヤレスゲート	800	671.00	536,800	
コネクシオ	900	1,607.00	1,446,300	
日本通信	12,800	239.00	3,059,200	

クロップス	300	800.00	240,000	
日本電信電話	111,000	5,582.00	619,602,000	
K D D I	123,800	3,200.00	396,160,000	
ソフトバンク	151,000	1,456.00	219,856,000	
光通信	1,700	26,450.00	44,965,000	
N T T ドコモ	122,700	3,012.00	369,572,400	
エムティーアイ	1,600	702.00	1,123,200	
G M O インターネット	6,500	2,248.00	14,612,000	
ファイバーゲート	300	1,447.00	434,100	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	715.00	357,500	
K A D O K A W A	4,500	1,910.00	8,595,000	
学研ホールディングス	600	7,350.00	4,410,000	
ゼンリン	3,300	1,933.00	6,378,900	
昭文社	800	411.00	328,800	
インプレスホールディングス	1,200	202.00	242,400	
アイネット	900	1,565.00	1,408,500	
松竹	1,100	16,150.00	17,765,000	
東宝	9,900	4,440.00	43,956,000	
東映	600	17,090.00	10,254,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,200	1,507.00	66,609,400	
ピー・シー・エー	200	4,700.00	940,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,345.00	703,500	
D T S	3,700	2,515.00	9,305,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,100	5,620.00	39,902,000	
シーイーシー	1,800	2,285.00	4,113,000	
カブコン	7,800	2,721.00	21,223,800	
アイ・エス・ビー	300	1,976.00	592,800	
ジャステック	1,100	1,113.00	1,224,300	
S C S K	3,800	5,890.00	22,382,000	
日本システムウエア	500	2,566.00	1,283,000	
アイネス	1,600	1,425.00	2,280,000	
T K C	1,400	5,200.00	7,280,000	
富士ソフト	2,100	4,255.00	8,935,500	
N S D	2,700	3,650.00	9,855,000	
コナミホールディングス	6,000	4,850.00	29,100,000	
福井コンピュータホールディングス	700	4,145.00	2,901,500	

J B C Cホールディングス	1,100	1,948.00	2,142,800	
ミロク情報サービス	1,500	3,455.00	5,182,500	
ソフトバンクグループ	131,800	4,295.00	566,081,000	
ハウスイ	100	876.00	87,600	
高千穂交易	600	1,104.00	662,400	
伊藤忠食品	400	5,140.00	2,056,000	
エレマテック	1,600	1,113.00	1,780,800	
J A L U X	500	2,530.00	1,265,000	
あらた	1,300	4,430.00	5,759,000	
トーメンデバイス	300	2,991.00	897,300	
東京エレクトロン デバイス	600	2,394.00	1,436,400	
フィールズ	1,200	532.00	638,400	
双日	92,100	360.00	33,156,000	
アルフレッサ ホールディングス	18,500	2,292.00	42,402,000	
横浜冷凍	4,700	1,067.00	5,014,900	
神栄	200	753.00	150,600	
ラサ商事	900	921.00	828,900	
ラクーンホールディングス	800	860.00	688,000	
アルコニックス	1,800	1,499.00	2,698,200	
神戸物産	5,800	3,580.00	20,764,000	
あい ホールディングス	2,400	1,980.00	4,752,000	
ディーブイエックス	600	899.00	539,400	
ダイワボウホールディングス	1,400	6,500.00	9,100,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,000	1,952.00	7,808,000	
ラクト・ジャパン	600	3,545.00	2,127,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,091.00	3,382,100	
八洲電機	1,300	898.00	1,167,400	
メディアスホールディングス	900	812.00	730,800	
レスターホールディングス	1,700	2,106.00	3,580,200	
ジュテックホールディングス	400	1,142.00	456,800	
大光	700	673.00	471,100	
O C H Iホールディングス	400	1,418.00	567,200	
T O K A Iホールディングス	8,800	1,115.00	9,812,000	
黒谷	300	453.00	135,900	
C o m i n i x	300	826.00	247,800	
三洋貿易	800	2,400.00	1,920,000	

ビューティガレージ	300	2,367.00	710,100
ウイン・パートナーズ	1,200	1,458.00	1,749,600
ミタチ産業	500	754.00	377,000
シップヘルスケアホールディングス	2,700	4,625.00	12,487,500
明治電機工業	500	1,645.00	822,500
デリカフーズホールディングス	600	699.00	419,400
スターティアホールディングス	300	634.00	190,200
コメダホールディングス	3,600	2,106.00	7,581,600
アセンテック	100	2,048.00	204,800
富士興産	500	739.00	369,500
協栄産業	200	1,558.00	311,600
小野建	1,500	1,383.00	2,074,500
南陽	400	1,857.00	742,800
佐島電機	1,200	923.00	1,107,600
エコートレーディング	300	549.00	164,700
伯東	1,000	1,355.00	1,355,000
コンドーテック	1,300	1,142.00	1,484,600
中山福	1,000	548.00	548,000
ナガイレーベン	2,400	2,588.00	6,211,200
三菱食品	1,800	3,065.00	5,517,000
松田産業	1,200	1,576.00	1,891,200
第一興商	2,500	5,510.00	13,775,000
メディバルホールディングス	18,000	2,392.00	43,056,000
S P K	300	2,834.00	850,200
萩原電気ホールディングス	600	2,849.00	1,709,400
アズワン	1,100	9,840.00	10,824,000
スズデン	600	1,514.00	908,400
尾家産業	400	1,354.00	541,600
シモジマ	1,000	1,237.00	1,237,000
ドウシシャ	1,600	1,856.00	2,969,600
小津産業	300	1,767.00	530,100
高速	1,000	1,180.00	1,180,000
たけびし	600	1,452.00	871,200
リックス	300	1,683.00	504,900
丸文	1,500	613.00	919,500
ハビネット	1,400	1,440.00	2,016,000

橋本総業ホールディングス	300	1,977.00	593,100
日本ライフライン	4,900	1,557.00	7,629,300
タカショー	800	501.00	400,800
エクセル	500	1,561.00	780,500
マルカ	600	2,339.00	1,403,400
I D O M	4,500	574.00	2,583,000
進和	1,000	2,449.00	2,449,000
エスケイジャパン	300	460.00	138,000
ダイトロン	700	1,837.00	1,285,900
シークス	2,100	1,549.00	3,252,900
田中商事	500	714.00	357,000
オーハシテクニカ	900	1,453.00	1,307,700
白銅	600	1,538.00	922,800
伊藤忠商事	116,600	2,457.50	286,544,500
丸紅	173,600	829.20	143,949,120
高島	300	1,763.00	528,900
長瀬産業	9,400	1,666.00	15,660,400
蝶理	1,100	2,131.00	2,344,100
豊田通商	18,600	3,865.00	71,889,000
三共生興	2,500	600.00	1,500,000
兼松	6,200	1,462.00	9,064,400
ツカモトコーポレーション	200	1,070.00	214,000
三井物産	146,600	1,968.00	288,508,800
日本紙パルプ商事	900	4,140.00	3,726,000
日立ハイテクノロジーズ	5,800	7,440.00	43,152,000
カメイ	2,200	1,258.00	2,767,600
東都水産	200	2,681.00	536,200
O U Gホールディングス	200	2,684.00	536,800
スターゼン	600	4,430.00	2,658,000
山善	6,500	1,054.00	6,851,000
椿本興業	300	4,075.00	1,222,500
住友商事	105,200	1,665.00	175,158,000
内田洋行	700	7,150.00	5,005,000
三菱商事	117,000	2,920.50	341,698,500
第一実業	800	3,825.00	3,060,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	2,586.00	12,412,800

西華産業	900	1,382.00	1,243,800
佐藤商事	1,400	964.00	1,349,600
菱洋エレクトロ	1,700	2,035.00	3,459,500
東京産業	1,500	601.00	901,500
ユアサ商事	1,600	3,775.00	6,040,000
神鋼商事	400	2,690.00	1,076,000
小林産業	1,000	305.00	305,000
阪和興業	3,100	2,889.00	8,955,900
正栄食品工業	1,100	3,430.00	3,773,000
カナデン	1,400	1,351.00	1,891,400
菱電商事	1,200	1,632.00	1,958,400
フルサト工業	900	1,674.00	1,506,600
岩谷産業	3,700	3,700.00	13,690,000
すてきナイスグループ	700	1,193.00	835,100
昭光通商	500	719.00	359,500
ニチモウ	300	2,007.00	602,100
極東貿易	500	2,248.00	1,124,000
イワキ	2,200	476.00	1,047,200
三愛石油	4,100	1,121.00	4,596,100
稲畑産業	3,700	1,630.00	6,031,000
G S Iクレオス	400	1,348.00	539,200
明和産業	1,500	621.00	931,500
クワザワ	600	614.00	368,400
ワキタ	3,600	1,100.00	3,960,000
東邦ホールディングス	5,300	2,495.00	13,223,500
サンゲツ	4,600	2,115.00	9,729,000
ミツウロコグループホールディングス	2,500	1,443.00	3,607,500
シナネンホールディングス	700	1,917.00	1,341,900
伊藤忠エネクス	3,700	930.00	3,441,000
サンリオ	4,700	2,222.00	10,443,400
サンワテクノス	1,200	1,203.00	1,443,600
リョーサン	1,800	2,845.00	5,121,000
新光商事	2,600	895.00	2,327,000
トーヨー	800	1,894.00	1,515,200
三信電気	900	1,758.00	1,582,200
東陽テクニカ	1,900	1,264.00	2,401,600

モスフードサービス	2,200	3,075.00	6,765,000
加賀電子	1,700	2,615.00	4,445,500
ソーダニッカ	1,700	611.00	1,038,700
立花エレテック	1,200	1,736.00	2,083,200
フォーバル	700	1,050.00	735,000
PALTA C	2,700	5,440.00	14,688,000
三谷産業	2,200	340.00	748,000
太平洋興発	600	806.00	483,600
西本Wismettacホールディングス	300	3,900.00	1,170,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,538.00	153,800
国際紙バルブ商事	3,900	306.00	1,193,400
ヤマタネ	800	1,534.00	1,227,200
丸紅建材リース	100	1,761.00	176,100
日鉄物産	1,200	5,160.00	6,192,000
泉州電業	500	3,175.00	1,587,500
トラスコ中山	3,500	2,924.00	10,234,000
オートバックスセブン	6,200	1,780.00	11,036,000
モリト	1,200	794.00	952,800
加藤産業	2,600	3,730.00	9,698,000
北恵	300	961.00	288,300
イノテック	1,000	1,073.00	1,073,000
イエローハット	3,100	2,031.00	6,296,100
J Kホールディングス	1,500	659.00	988,500
日伝	1,500	2,081.00	3,121,500
北沢産業	1,300	284.00	369,200
杉本商事	900	2,065.00	1,858,500
因幡電機産業	4,700	2,762.00	12,981,400
東テク	600	2,446.00	1,467,600
ミスミグループ本社	20,900	2,733.00	57,119,700
アルテック	1,300	230.00	299,000
タキヒヨー	500	1,957.00	978,500
蔵王産業	300	1,443.00	432,900
スズケン	7,100	4,785.00	33,973,500
ジェコス	1,100	1,021.00	1,123,100
グローセル	1,700	454.00	771,800
ローソン	4,200	5,960.00	25,032,000

サンエー	1,400	4,950.00	6,930,000
カワチ薬品	1,300	2,217.00	2,882,100
エービーシー・マート	2,600	7,520.00	19,552,000
ハードオフコーポレーション	600	826.00	495,600
アスクル	1,700	2,976.00	5,059,200
ゲオホールディングス	3,000	1,344.00	4,032,000
アダストリア	2,300	2,600.00	5,980,000
ジーフット	1,000	624.00	624,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	679.00	135,800
くら寿司	900	5,030.00	4,527,000
キャンドウ	800	1,657.00	1,325,600
パルグループホールディングス	900	3,560.00	3,204,000
エディオン	7,700	1,242.00	9,563,400
サーラコーポレーション	3,400	630.00	2,142,000
ワッツ	700	610.00	427,000
ハローズ	600	2,711.00	1,626,600
フジオフードシステム	700	3,650.00	2,555,000
あみやき亭	400	3,700.00	1,480,000
ひらまつ	3,100	301.00	933,100
大黒天物産	400	3,155.00	1,262,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,606.00	2,409,000
ファーマライズホールディングス	400	644.00	257,600
アルペン	1,300	1,890.00	2,457,000
ハブ	500	1,042.00	521,000
クオールホールディングス	2,500	1,562.00	3,905,000
ジンズホールディングス	900	7,020.00	6,318,000
ビックカメラ	9,900	1,282.00	12,691,800
D C Mホールディングス	9,000	1,073.00	9,657,000
ペッパーフードサービス	1,300	1,329.00	1,727,700
Monotaro	11,900	3,040.00	36,176,000
東京一番フーズ	400	622.00	248,800
DDホールディングス	700	1,549.00	1,084,300
きちりホールディングス	400	858.00	343,200
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,850.00	2,220,000
J．フロント リテイリング	19,900	1,482.00	29,491,800
ドトール・日レスホールディングス	2,700	2,197.00	5,931,900

マツモトキヨシホールディングス	6,900	4,210.00	29,049,000	
ブロンコビリー	900	2,762.00	2,485,800	
Z O Z O	11,500	2,118.00	24,357,000	
トレジャー・ファクトリー	500	1,122.00	561,000	
物語コーポレーション	400	8,640.00	3,456,000	
ココカラファイン	1,700	6,310.00	10,727,000	
三越伊勢丹ホールディングス	29,100	1,015.00	29,536,500	
H a m e e	500	1,342.00	671,000	
ウエルシアホールディングス	5,000	6,830.00	34,150,000	
クリエイティブSDホールディングス	2,500	2,747.00	6,867,500	
丸善C H Iホールディングス	1,900	375.00	712,500	
ミサワ	300	1,006.00	301,800	
ティーライフ	200	858.00	171,600	
エー・ピーカンパニー	300	533.00	159,900	
チムニー	500	2,326.00	1,163,000	
シュッピン	1,100	1,186.00	1,304,600	
ネクステージ	2,400	1,239.00	2,973,600	
ジョイフル本田	4,900	1,442.00	7,065,800	
鳥貴族	500	2,378.00	1,189,000	
麒麟堂ホールディングス	700	2,088.00	1,461,600	
ホットランド	1,100	1,394.00	1,533,400	
すかいらーくホールディングス	18,700	2,187.00	40,896,900	
S F Pホールディングス	700	2,238.00	1,566,600	
綿半ホールディングス	600	1,989.00	1,193,400	
ヨシックス	300	2,808.00	842,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	972.00	4,665,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	695.00	486,500	
B E E N O S	600	1,437.00	862,200	
あさひ	1,200	1,293.00	1,551,600	
日本調剤	500	3,845.00	1,922,500	
コスモス薬品	700	22,900.00	16,030,000	
トーエル	800	782.00	625,600	
オンリー	300	805.00	241,500	
セブン&アイ・ホールディングス	65,200	4,063.00	264,907,600	
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	4,500	1,815.00	8,167,500	

ツルハホールディングス	3,600	13,100.00	47,160,000	
サンマルクホールディングス	1,300	2,320.00	3,016,000	
フェリシモ	300	1,022.00	306,600	
トリドールホールディングス	2,100	2,827.00	5,936,700	
T O K Y O B A S E	1,500	702.00	1,053,000	
ウイルプラスホールディングス	300	979.00	293,700	
ジャパンミート	800	2,194.00	1,755,200	
サツドラホールディングス	200	1,775.00	355,000	
デファクトスタンダード	100	412.00	41,200	
アレンザホールディングス	800	914.00	731,200	
串カツ田中ホールディングス	300	2,151.00	645,300	
パロックジャパンリミテッド	1,200	973.00	1,167,600	
クスリのアオキホールディングス	1,700	8,280.00	14,076,000	
力の源ホールディングス	700	892.00	624,400	
スシログローバルホールディングス	1,800	8,710.00	15,678,000	
L I X I L ビバ	1,600	1,940.00	3,104,000	
メディカルシステムネットワーク	1,600	551.00	881,600	
はるやまホールディングス	800	847.00	677,600	
ノジマ	3,000	2,361.00	7,083,000	
カップ・クリエイト	2,300	1,538.00	3,537,400	
ライトオン	1,200	610.00	732,000	
ジーンズメイト	400	322.00	128,800	
良品計画	22,100	2,552.00	56,399,200	
三城ホールディングス	1,700	290.00	493,000	
アドヴァン	2,500	1,284.00	3,210,000	
アルビス	600	2,312.00	1,387,200	
コナカ	2,000	403.00	806,000	
ハウス オブ ローゼ	100	1,666.00	166,600	
G - 7ホールディングス	500	4,680.00	2,340,000	
イオン北海道	1,700	789.00	1,341,300	
コジマ	2,900	490.00	1,421,000	
ヒマラヤ	600	832.00	499,200	
コーナン商事	2,400	2,568.00	6,163,200	
エコス	600	1,682.00	1,009,200	
ワタミ	2,000	1,312.00	2,624,000	
マルシェ	400	779.00	311,600	

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	40,000	1,795.00	71,800,000	
西松屋チェーン	3,700	1,018.00	3,766,600	
ゼンショーホールディングス	8,000	2,459.00	19,672,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,127.00	2,339,700	
ハークスレイ	300	1,070.00	321,000	
サイゼリヤ	2,700	2,628.00	7,095,600	
V Tホールディングス	6,900	486.00	3,353,400	
魚力	500	1,556.00	778,000	
ポブラ	400	529.00	211,600	
フジ・コーポレーション	400	2,386.00	954,400	
ユナイテッドアローズ	1,700	3,355.00	5,703,500	
ハイデイ日高	2,400	2,215.00	5,316,000	
京都きもの友禅	1,100	358.00	393,800	
コロワイド	5,500	2,198.00	12,089,000	
ピーシーデポコーポレーション	2,200	518.00	1,139,600	
壱番屋	1,200	5,380.00	6,456,000	
トップカルチャー	500	334.00	167,000	
P L A N T	400	661.00	264,400	
スギホールディングス	3,300	6,140.00	20,262,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,490.00	1,743,000	
ヴィア・ホールディングス	2,000	667.00	1,334,000	
スクロール	2,600	365.00	949,000	
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,619.00	4,452,300	
ファミリーマート	13,300	2,541.00	33,795,300	
木曽路	2,200	2,945.00	6,479,000	
S R Sホールディングス	2,000	1,037.00	2,074,000	
千趣会	3,000	468.00	1,404,000	
タカキュー	1,100	194.00	213,400	
ケーヨー	3,400	538.00	1,829,200	
上新電機	2,000	2,555.00	5,110,000	
日本瓦斯	2,600	3,530.00	9,178,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,543.00	7,374,700	
東天紅	100	1,262.00	126,200	
いなげや	2,100	1,511.00	3,173,100	
島忠	3,100	3,035.00	9,408,500	

チヨダ	1,700	1,626.00	2,764,200
ライフコーポレーション	1,300	2,502.00	3,252,600
リンガーハット	2,100	2,521.00	5,294,100
MrMaxHD	2,300	498.00	1,145,400
テンアライド	1,500	435.00	652,500
AOKIホールディングス	3,300	1,146.00	3,781,800
オークワ	2,600	1,463.00	3,803,800
コメリ	2,600	2,379.00	6,185,400
青山商事	3,400	1,613.00	5,484,200
しまむら	1,900	9,280.00	17,632,000
はせがわ	800	402.00	321,600
高島屋	12,100	1,304.00	15,778,400
松屋	3,400	891.00	3,029,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,900	1,266.00	10,001,400
近鉄百貨店	600	3,675.00	2,205,000
パルコ	1,600	1,347.00	2,155,200
丸井グループ	15,300	2,659.00	40,682,700
アクシアル リテイリング	1,400	3,985.00	5,579,000
井筒屋	900	253.00	227,700
イオン	64,200	2,231.50	143,262,300
イズミ	3,400	4,220.00	14,348,000
平和堂	3,400	2,099.00	7,136,600
フジ	2,000	1,939.00	3,878,000
ヤオコー	1,900	5,430.00	10,317,000
ゼビオホールディングス	2,000	1,312.00	2,624,000
ケースホールディングス	16,100	1,441.00	23,200,100
Olympicグループ	800	649.00	519,200
日産東京販売ホールディングス	2,500	283.00	707,500
Genky DrugStores	800	2,550.00	2,040,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,324.00	397,200
総合メディカルホールディングス	1,500	2,073.00	3,109,500
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,087.00	1,087,000
アインホールディングス	2,200	6,480.00	14,256,000
元気寿司	400	2,978.00	1,191,200
ヤマダ電機	50,800	572.00	29,057,600
アークランドサカモト	2,600	1,265.00	3,289,000

ニトリホールディングス	7,200	17,400.00	125,280,000	
グルメ杵屋	1,200	1,199.00	1,438,800	
愛眼	1,300	240.00	312,000	
ケーユーホールディングス	900	948.00	853,200	
吉野家ホールディングス	5,500	2,782.00	15,301,000	
松屋フーズホールディングス	800	4,570.00	3,656,000	
サガミホールディングス	2,200	1,381.00	3,038,200	
関西スーパーマーケット	1,400	1,077.00	1,507,800	
王将フードサービス	1,200	6,570.00	7,884,000	
プレナス	1,900	1,936.00	3,678,400	
ミニストップ	1,200	1,462.00	1,754,400	
アークス	3,400	2,307.00	7,843,800	
バローホールディングス	3,700	2,081.00	7,699,700	
藤久	100	792.00	79,200	
ベルク	800	5,200.00	4,160,000	
大庄	900	1,611.00	1,449,900	
ファーストリテイリング	2,200	64,040.00	140,888,000	
サンドラッグ	6,300	3,980.00	25,074,000	
サックスパー ホールディングス	1,400	910.00	1,274,000	
ヤマザワ	400	1,674.00	669,600	
やまや	300	2,269.00	680,700	
ベルーナ	3,600	718.00	2,584,800	
島根銀行	300	669.00	200,700	
じもとホールディングス	11,300	108.00	1,220,400	
めぶきフィナンシャルグループ	86,800	282.00	24,477,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,546.00	3,555,800	
九州フィナンシャルグループ	27,400	488.00	13,371,200	
ゆうちょ銀行	47,300	1,071.00	50,658,300	
富山第一銀行	4,000	346.00	1,384,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,200	450.00	44,190,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,400	870.00	9,918,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	9,800	716.00	7,016,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,699.00	2,548,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	3,080.00	8,932,000	
新生銀行	12,300	1,659.00	20,405,700	
あおぞら銀行	9,900	2,847.00	28,185,300	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,149,500	586.80	674,526,600	
りそなホールディングス	183,300	483.30	88,588,890	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,600	4,210.00	133,036,000	
三井住友フィナンシャルグループ	115,500	4,009.00	463,039,500	
千葉銀行	57,400	634.00	36,391,600	
群馬銀行	32,800	388.00	12,726,400	
武蔵野銀行	2,500	1,979.00	4,947,500	
千葉興業銀行	4,600	344.00	1,582,400	
筑波銀行	6,900	235.00	1,621,500	
七十七銀行	5,600	1,827.00	10,231,200	
青森銀行	1,300	2,789.00	3,625,700	
秋田銀行	1,100	2,180.00	2,398,000	
山形銀行	1,900	1,625.00	3,087,500	
岩手銀行	1,100	2,999.00	3,298,900	
東邦銀行	14,900	277.00	4,127,300	
東北銀行	800	1,029.00	823,200	
みちのく銀行	1,100	1,549.00	1,703,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,100	2,128.00	30,004,800	
静岡銀行	41,400	841.00	34,817,400	
十六銀行	2,100	2,640.00	5,544,000	
スルガ銀行	17,100	547.00	9,353,700	
八十二銀行	40,300	475.00	19,142,500	
山梨中央銀行	1,900	1,166.00	2,215,400	
大垣共立銀行	3,300	2,476.00	8,170,800	
福井銀行	1,400	1,758.00	2,461,200	
北國銀行	1,700	3,695.00	6,281,500	
清水銀行	700	2,129.00	1,490,300	
富山銀行	300	2,526.00	757,800	
滋賀銀行	3,300	2,772.00	9,147,600	
南都銀行	2,800	2,743.00	7,680,400	
百五銀行	15,000	346.00	5,190,000	
京都銀行	6,000	4,640.00	27,840,000	
紀陽銀行	5,900	1,668.00	9,841,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,100	1,138.00	12,631,800	
広島銀行	24,700	539.00	13,313,300	
山陰合同銀行	9,900	680.00	6,732,000	

中国銀行	14,400	1,082.00	15,580,800	
鳥取銀行	600	1,360.00	816,000	
伊予銀行	23,800	619.00	14,732,200	
百十四銀行	1,800	2,204.00	3,967,200	
四国銀行	2,500	1,052.00	2,630,000	
阿波銀行	2,700	2,618.00	7,068,600	
大分銀行	1,000	2,783.00	2,783,000	
宮崎銀行	1,100	2,712.00	2,983,200	
佐賀銀行	1,000	1,796.00	1,796,000	
沖縄銀行	1,500	3,610.00	5,415,000	
琉球銀行	3,900	1,222.00	4,765,800	
セブン銀行	55,800	352.00	19,641,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,269,100	170.90	387,789,190	
高知銀行	600	925.00	555,000	
山口フィナンシャルグループ	20,800	760.00	15,808,000	
長野銀行	500	1,665.00	832,500	
名古屋銀行	1,400	3,355.00	4,697,000	
北洋銀行	25,200	240.00	6,048,000	
愛知銀行	600	3,745.00	2,247,000	
中京銀行	700	2,219.00	1,553,300	
大光銀行	600	1,664.00	998,400	
愛媛銀行	2,300	1,183.00	2,720,900	
トマト銀行	600	1,071.00	642,600	
京葉銀行	7,100	628.00	4,458,800	
栃木銀行	8,100	235.00	1,903,500	
北日本銀行	500	2,155.00	1,077,500	
東和銀行	2,900	884.00	2,563,600	
福島銀行	1,400	287.00	401,800	
大東銀行	800	631.00	504,800	
トモニホールディングス	12,900	441.00	5,688,900	
フィデアホールディングス	16,200	130.00	2,106,000	
池田泉州ホールディングス	19,200	215.00	4,128,000	
F P G	5,200	1,064.00	5,532,800	
マーキュリアインベストメント	700	771.00	539,700	
S B Iホールディングス	18,700	2,305.00	43,103,500	
日本アジア投資	1,400	297.00	415,800	

ジャフコ	2,600	4,205.00	10,933,000	
大和証券グループ本社	134,000	549.00	73,566,000	
野村ホールディングス	293,800	565.00	165,997,000	
岡三証券グループ	14,200	400.00	5,680,000	
丸三証券	5,000	540.00	2,700,000	
東洋証券	6,000	164.00	984,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,200	334.00	6,412,800	
光世証券	400	661.00	264,400	
水戸証券	4,800	244.00	1,171,200	
いちよし証券	3,100	675.00	2,092,500	
松井証券	9,500	891.00	8,464,500	
だいこう証券ビジネス	800	640.00	512,000	
マネックスグループ	12,600	276.00	3,477,600	
極東証券	2,200	777.00	1,709,400	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,300.00	2,080,000	
藍澤證券	3,000	752.00	2,256,000	
マネーパートナーズグループ	1,700	246.00	418,200	
スパークス・グループ	5,800	254.00	1,473,200	
小林洋行	300	257.00	77,100	
かんぽ生命保険	5,900	1,932.00	11,398,800	
S O M P Oホールディングス	31,400	4,410.00	138,474,000	
アニコム ホールディングス	1,400	3,435.00	4,809,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	43,700	3,641.00	159,111,700	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,700	2,604.00	35,674,800	
第一生命ホールディングス	94,500	1,825.50	172,509,750	
東京海上ホールディングス	59,700	6,171.00	368,408,700	
T & Dホールディングス	51,600	1,362.00	70,279,200	
アドバンスクリエイト	400	1,839.00	735,600	
全国保証	4,700	4,510.00	21,197,000	
ジェイリース	500	319.00	159,500	
イントラスト	600	732.00	439,200	
日本モーゲージサービス	300	1,596.00	478,800	
C a s a	600	1,280.00	768,000	
アルヒ	2,700	2,463.00	6,650,100	
プレミアグループ	900	2,395.00	2,155,500	

クレディセゾン	11,700	1,823.00	21,329,100
芙蓉総合リース	1,800	7,280.00	13,104,000
みずほリース	2,600	3,345.00	8,697,000
東京センチュリー	3,400	5,920.00	20,128,000
日本証券金融	7,400	552.00	4,084,800
アイフル	25,500	245.00	6,247,500
リコーリース	1,300	4,145.00	5,388,500
イオンフィナンシャルサービス	10,200	1,691.00	17,248,200
アコム	33,600	470.00	15,792,000
ジャックス	1,800	2,776.00	4,996,800
オリエントコーポレーション	45,200	159.00	7,186,800
日立キャピタル	3,900	2,710.00	10,569,000
アプラスフィナンシャル	8,000	90.00	720,000
オリックス	104,400	1,850.50	193,192,200
三菱UFJリース	42,400	710.00	30,104,000
九州リースサービス	800	600.00	480,000
日本取引所グループ	47,900	1,945.00	93,165,500
イー・ギャランティ	1,800	1,389.00	2,500,200
アサックス	800	663.00	530,400
NECキャピタルソリューション	700	2,500.00	1,750,000
いちご	21,200	452.00	9,582,400
日本駐車場開発	18,300	163.00	2,982,900
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,669.00	1,502,100
ヒューリック	35,700	1,287.00	45,945,900
三栄建築設計	700	1,604.00	1,122,800
野村不動産ホールディングス	10,100	2,690.00	27,169,000
三重交通グループホールディングス	3,400	606.00	2,060,400
サムティ	2,400	2,078.00	4,987,200
ディア・ライフ	2,100	574.00	1,205,400
コーセーアールイー	500	843.00	421,500
エー・ディー・ワークス	31,000	31.00	961,000
日本商業開発	1,100	1,610.00	1,771,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,783.00	4,814,100
ユニゾホールディングス	2,500	4,805.00	12,012,500
THEグローバル社	900	484.00	435,600
ハウスコム	200	1,488.00	297,600

日本管理センター	1,100	1,300.00	1,430,000	
サンセイランディック	500	908.00	454,000	
エストラスト	200	806.00	161,200	
フージャースホールディングス	3,300	739.00	2,438,700	
オープンハウス	4,800	3,080.00	14,784,000	
東急不動産ホールディングス	45,400	753.00	34,186,200	
飯田グループホールディングス	13,900	1,944.00	27,021,600	
イーランド	300	815.00	244,500	
ムゲンエステート	1,200	806.00	967,200	
ビーロッド	400	2,027.00	810,800	
ファーストブラザーズ	400	1,282.00	512,800	
ハウスドゥ	900	1,562.00	1,405,800	
シーアールイー	400	1,079.00	431,600	
プロパティエージェント	300	1,141.00	342,300	
ケイアイスター不動産	500	2,072.00	1,036,000	
アグレ都市デザイン	200	540.00	108,000	
グッドコムアセット	400	1,889.00	755,600	
ジェイ・エス・ビー	200	4,820.00	964,000	
テンポイノベーション	400	1,071.00	428,400	
グローバル・リンク・マネジメント	300	656.00	196,800	
パーク24	9,000	2,539.00	22,851,000	
パラカ	400	2,024.00	809,600	
三井不動産	83,400	2,692.50	224,554,500	
三菱地所	117,000	2,022.00	236,574,000	
平和不動産	3,100	2,837.00	8,794,700	
東京建物	18,200	1,682.00	30,612,400	
ダイビル	4,300	1,172.00	5,039,600	
京阪神ビルディング	2,700	1,478.00	3,990,600	
住友不動産	37,500	3,913.00	146,737,500	
テーオーシー	3,300	903.00	2,979,900	
東京楽天地	300	6,360.00	1,908,000	
レオパレス21	21,900	315.00	6,898,500	
スターツコーポレーション	2,300	2,730.00	6,279,000	
フジ住宅	1,900	700.00	1,330,000	
空港施設	1,700	547.00	929,900	
明和地所	900	630.00	567,000	

ゴールドクレスト	1,300	2,189.00	2,845,700	
エスリード	700	2,204.00	1,542,800	
日神不動産	2,500	548.00	1,370,000	
日本エスコン	3,000	1,001.00	3,003,000	
タカラレーベン	7,600	510.00	3,876,000	
サンヨーハウジング名古屋	900	1,000.00	900,000	
イオンモール	8,400	1,824.00	15,321,600	
毎日コムネット	300	844.00	253,200	
ファースト住建	700	1,322.00	925,400	
ランド	90,900	13.00	1,181,700	
カチタス	2,100	4,650.00	9,765,000	
トーセイ	2,300	1,534.00	3,528,200	
穴吹興産	200	3,500.00	700,000	
サンフロンティア不動産	2,300	1,318.00	3,031,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	1,090.00	1,635,000	
インテリックス	400	714.00	285,600	
ランドビジネス	700	749.00	524,300	
日本社宅サービス	400	1,151.00	460,400	
グランディハウス	1,200	485.00	582,000	
日本空港ビルデング	5,300	5,830.00	30,899,000	
日本工営	1,100	3,645.00	4,009,500	
L I F U L L	5,600	559.00	3,130,400	
ジェイエシーリクルートメント	1,100	2,134.00	2,347,400	
日本M&Aセンター	12,200	3,755.00	45,811,000	
メンバーズ	500	2,313.00	1,156,500	
中広	100	533.00	53,300	
アイティメディア	500	762.00	381,000	
タケエイ	1,500	1,318.00	1,977,000	
E・Jホールディングス	200	1,572.00	314,400	
トラスト・テック	1,800	1,352.00	2,433,600	
コシダカホールディングス	3,900	1,537.00	5,994,300	
アルトナー	400	814.00	325,600	
パソナグループ	2,000	1,698.00	3,396,000	
C D S	400	1,523.00	609,200	
リンクアンドモチベーション	3,600	673.00	2,422,800	
G C A	1,900	974.00	1,850,600	

エス・エム・エス	5,000	3,055.00	15,275,000
サニーサイドアップ	400	1,102.00	440,800
パーソルホールディングス	16,200	2,001.00	32,416,200
リニカル	800	1,235.00	988,000
クックパッド	5,600	377.00	2,111,200
エスクリ	500	805.00	402,500
アイ・ケイ・ケイ	800	717.00	573,600
学情	600	2,055.00	1,233,000
スタジオアリス	800	1,938.00	1,550,400
シミックホールディングス	900	1,874.00	1,686,600
エプコ	300	1,499.00	449,700
N J S	400	1,828.00	731,200
総合警備保障	6,400	5,880.00	37,632,000
カカクコム	12,100	2,707.00	32,754,700
アイロムグループ	600	1,553.00	931,800
セントケア・ホールディング	1,000	504.00	504,000
サイネックス	200	692.00	138,400
ルネサンス	900	1,764.00	1,587,600
ディップ	2,300	3,290.00	7,567,000
オプトホールディング	900	1,772.00	1,594,800
新日本科学	1,800	802.00	1,443,600
ツクイ	3,800	564.00	2,143,200
キャリアデザインセンター	400	1,329.00	531,600
ベネフィット・ワン	4,400	2,353.00	10,353,200
エムスリー	35,700	3,085.00	110,134,500
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	627.00	627,000
プラス	200	744.00	148,800
アウトソーシング	9,300	1,227.00	11,411,100
ウェルネット	1,500	806.00	1,209,000
ワールドホールディングス	500	1,945.00	972,500
ディー・エヌ・エー	7,900	1,777.00	14,038,300
博報堂D Yホールディングス	22,500	1,761.00	39,622,500
ぐるなび	2,800	1,024.00	2,867,200
タカミヤ	1,700	720.00	1,224,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,190.00	1,309,000
ファンコミュニケーションズ	4,400	510.00	2,244,000

ライク	600	1,640.00	984,000	
ビジネス・ブレイクスルー	700	340.00	238,000	
エスプール	3,100	741.00	2,297,100	
WDBホールディングス	700	2,559.00	1,791,300	
ティア	900	601.00	540,900	
CDG	200	1,419.00	283,800	
バリューコマース	900	2,192.00	1,972,800	
インフォマート	8,900	2,004.00	17,835,600	
JPホールディングス	5,100	295.00	1,504,500	
エコナックホールディングス	2,700	132.00	356,400	
EPSホールディングス	2,400	1,463.00	3,511,200	
レグス	400	1,640.00	656,000	
プレステージ・インターナショナル	6,100	971.00	5,923,100	
アミューズ	900	3,000.00	2,700,000	
ドリームインキュベータ	500	1,582.00	791,000	
クイック	1,000	1,675.00	1,675,000	
TAC	900	243.00	218,700	
ケネディクス	15,400	593.00	9,132,200	
電通	16,700	4,030.00	67,301,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,389.00	833,400	
ぴあ	400	4,770.00	1,908,000	
イオンファンタジー	600	3,055.00	1,833,000	
シーティーエス	1,800	815.00	1,467,000	
ネクシィーズグループ	600	1,836.00	1,101,600	
みらかホールディングス	4,500	2,691.00	12,109,500	
アルプス技研	1,400	1,975.00	2,765,000	
サニックス	2,800	363.00	1,016,400	
ダイオーズ	300	1,330.00	399,000	
日本空調サービス	1,700	792.00	1,346,400	
オリエンタルランド	17,200	14,815.00	254,818,000	
ダスキン	4,200	3,085.00	12,957,000	
明光ネットワークジャパン	1,900	1,034.00	1,964,600	
ファルコホールディングス	900	1,752.00	1,576,800	
秀英予備校	300	450.00	135,000	
田谷	200	608.00	121,600	
ラウンドワン	4,500	1,114.00	5,013,000	

リゾートトラスト	7,400	1,931.00	14,289,400
ビー・エム・エル	2,100	3,195.00	6,709,500
ワタベウェディング	200	598.00	119,600
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,456.00	4,222,400
リソー教育	7,400	402.00	2,974,800
早稲田アカデミー	500	958.00	479,000
ユー・エス・エス	18,100	2,102.00	38,046,200
東京個別指導学院	600	747.00	448,200
サイバーエージェント	9,300	3,745.00	34,828,500
楽天	75,400	919.00	69,292,600
クリーク・アンド・リバー社	800	1,145.00	916,000
テー・オー・ダブリュー	1,400	968.00	1,355,200
山田コンサルティンググループ	800	1,797.00	1,437,600
セントラルスポーツ	600	3,220.00	1,932,000
フルキャストホールディングス	1,600	2,431.00	3,889,600
エン・ジャパン	2,900	5,170.00	14,993,000
リソルホールディングス	100	4,100.00	410,000
テクノプロ・ホールディングス	3,200	7,670.00	24,544,000
アトラ	300	387.00	116,100
インターワークス	300	541.00	162,300
アイ・アールジャパンホールディングス	700	4,480.00	3,136,000
Keeper 技研	600	1,302.00	781,200
ファーストロジック	300	645.00	193,500
三機サービス	300	1,090.00	327,000
Gunosy	1,100	1,555.00	1,710,500
デザインワン・ジャパン	200	343.00	68,600
イー・ガーディアン	800	2,080.00	1,664,000
リブセンス	1,000	318.00	318,000
ジャパンマテリアル	5,000	1,541.00	7,705,000
ベクトル	2,000	1,076.00	2,152,000
ウチヤマホールディングス	800	555.00	444,000
チャーム・ケア・コーポレーション	600	1,989.00	1,193,400
ライクキッズ	400	865.00	346,000
キャリアリンク	500	573.00	286,500
I B J	1,100	1,141.00	1,255,100
アサンテ	600	2,050.00	1,230,000

N・フィールド	1,100	707.00	777,700	
バリューHR	300	3,575.00	1,072,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	4,350.00	4,785,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2,054.00	1,232,400	
E R Iホールディングス	400	784.00	313,600	
アピスト	300	2,641.00	792,300	
シグマクシス	1,100	2,245.00	2,469,500	
ウィルグループ	1,100	1,242.00	1,366,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	234.00	514,800	
リクルートホールディングス	115,900	4,010.00	464,759,000	
エラン	1,000	1,666.00	1,666,000	
土木管理総合試験所	600	483.00	289,800	
ネットマーケティング	600	1,009.00	605,400	
日本郵政	132,600	1,047.00	138,832,200	
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,711.00	4,619,700	
鎌倉新書	1,200	1,751.00	2,101,200	
S M N	200	893.00	178,600	
一蔵	200	759.00	151,800	
L I T A L I C O	600	2,528.00	1,516,800	
グローバルキッズCOMPANY	200	745.00	149,000	
エボラブルアジア	700	2,110.00	1,477,000	
アトラエ	400	3,640.00	1,456,000	
ストライク	600	4,335.00	2,601,000	
ソラスト	4,500	1,295.00	5,827,500	
セラク	500	784.00	392,000	
インソース	800	3,450.00	2,760,000	
ベйкаレント・コンサルティング	1,000	5,510.00	5,510,000	
Orchestra Holdings	300	1,136.00	340,800	
アイモバイル	500	731.00	365,500	
キャリアインデックス	600	472.00	283,200	
MS - J a p a n	500	1,639.00	819,500	
船場	300	1,189.00	356,700	
グレイステクノロジー	700	2,862.00	2,003,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,903.00	4,935,100	
フルテック	200	1,413.00	282,600	

グリーンズ	600	1,192.00	715,200	
ツナググループ・ホールディングス	200	638.00	127,600	
GameWith	300	836.00	250,800	
ソウルドアウト	200	2,042.00	408,400	
MS&Consulting	200	1,045.00	209,000	
日総工産	1,100	1,049.00	1,153,900	
キュービーネットホールディングス	1,000	2,397.00	2,397,000	
RPAホールディングス	900	1,214.00	1,092,600	
スプリックス	500	1,288.00	644,000	
マネジメントソリューションズ	200	2,209.00	441,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	982.00	785,600	
リログループ	8,800	3,010.00	26,488,000	
東祥	1,000	2,532.00	2,532,000	
エイチ・アイ・エス	2,500	3,120.00	7,800,000	
ラックランド	300	2,505.00	751,500	
共立メンテナンス	2,700	5,020.00	13,554,000	
イチネンホールディングス	1,800	1,511.00	2,719,800	
建設技術研究所	1,100	2,184.00	2,402,400	
スペース	1,000	1,321.00	1,321,000	
長大	600	1,296.00	777,600	
燦ホールディングス	700	1,382.00	967,400	
スバル興業	100	8,900.00	890,000	
東京テアトル	600	1,393.00	835,800	
タナベ経営	300	1,281.00	384,300	
ナガワ	500	7,650.00	3,825,000	
よみうりランド	400	4,640.00	1,856,000	
東京都競馬	1,100	3,450.00	3,795,000	
常磐興産	600	1,663.00	997,800	
カナモト	2,600	3,050.00	7,930,000	
東京ドーム	6,600	1,018.00	6,718,800	
西尾レントオール	1,600	3,245.00	5,192,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	9,300	34.00	316,200	
トランス・コスモス	1,500	2,904.00	4,356,000	
乃村工藝社	6,900	1,493.00	10,301,700	
藤田観光	700	2,888.00	2,021,600	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,506.00	1,506,000	

日本管財	1,700	1,993.00	3,388,100	
トーカイ	1,600	3,010.00	4,816,000	
白洋舎	200	2,909.00	581,800	
セコム	17,200	9,600.00	165,120,000	
セントラル警備保障	800	6,400.00	5,120,000	
丹青社	3,100	1,325.00	4,107,500	
メイテック	2,000	6,040.00	12,080,000	
応用地質	1,700	1,483.00	2,521,100	
船井総研ホールディングス	3,300	2,550.00	8,415,000	
進学会ホールディングス	600	529.00	317,400	
オオバ	1,300	932.00	1,211,600	
いであ	300	3,365.00	1,009,500	
学究社	500	1,362.00	681,000	
ベネッセホールディングス	5,400	2,898.00	15,649,200	
イオンディライト	2,000	3,865.00	7,730,000	
ナック	900	1,045.00	940,500	
ニチイ学館	2,300	1,553.00	3,571,900	
ダイセキ	2,700	3,340.00	9,018,000	
ステップ	600	1,545.00	927,000	
合 計	19,939,800		41,117,141,140	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2019年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	58,617,110
コール・ローン	121,656,085
国債証券	28,716,362,349
派生商品評価勘定	38,087
未収入金	67,041,000
未収利息	172,390,744
前払費用	16,557,004
流動資産合計	29,152,662,379
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	347,451
未払金	210,277,472
未払解約金	110,000
未払利息	329
その他未払費用	205
流動負債合計	210,735,457
負債合計	210,735,457
純資産の部	
元本等	
元本	28,823,773,873
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	118,153,049
元本等合計	28,941,926,922
純資産合計	28,941,926,922
負債純資産合計	29,152,662,379

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	34,054,275,259円
期中追加設定元本額	11,453,231,290円
期中一部解約元本額	16,683,732,676円
期末元本額	28,823,773,873円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,164,991,586円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	421,982,794円
りそなラップ型ファンド(成長型)	197,318,206円
DCりそな グローバルバランス	63,511,235円
つみたてバランスファンド	242,091,816円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	340,170,997円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	64,934,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	13,623,183円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,503,602円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	544,740円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	71,704円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	276,652,082円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	276,219,247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)	23,334,831,058円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	154,589,119円
Smart-i 8資産バランス 安定型	87,613,518円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,828,002円
Smart-i 8資産バランス 成長型	27,805,813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)	548,861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)	92,942,281円
2. 計算日における受益権の総数	28,823,773,873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	1.0041円
(10,000口当たり純資産額)	(10,041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12月10日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2.時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		940,082,622
合計		940,082,622

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	177,078,099	-	176,768,735	309,364
	米ドル	83,863,113	-	83,861,299	1,814
	ユーロ	47,753,619	-	47,547,010	206,609
	英ポンド	21,667,476	-	21,686,148	18,672
	ポーランドズロチ	11,106,574	-	11,017,464	89,110
	オーストラリアドル	12,687,317	-	12,656,814	30,503
合計		177,078,099	-	176,768,735	309,364

(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	500,000.00	501,669.90	
		US TREASURY N/B	680,000.00	679,840.60	
		US TREASURY N/B	740,000.00	747,847.99	
		US TREASURY N/B	400,000.00	400,898.40	
		US TREASURY N/B	800,000.00	800,828.08	
		US TREASURY N/B	260,000.00	262,275.00	
		US TREASURY N/B	440,000.00	441,632.79	
		US TREASURY N/B	400,000.00	398,703.11	
		US TREASURY N/B	630,000.00	644,273.40	
		US TREASURY N/B	460,000.00	463,144.51	
		US TREASURY N/B	650,000.00	645,683.54	
		US TREASURY N/B	850,000.00	858,433.53	
		US TREASURY N/B	480,000.00	484,124.97	
		US TREASURY N/B	250,000.00	248,627.92	
		US TREASURY N/B	600,000.00	604,382.76	
		US TREASURY N/B	800,000.00	807,328.08	
		US TREASURY N/B	600,000.00	597,503.88	
		US TREASURY N/B	800,000.00	806,218.72	
		US TREASURY N/B	580,000.00	591,701.90	
		US TREASURY N/B	620,000.00	628,222.25	
		US TREASURY N/B	480,000.00	482,259.36	
		US TREASURY N/B	550,000.00	547,561.52	

US TREASURY N/B	590,000.00	598,308.38
US TREASURY N/B	820,000.00	813,113.23
US TREASURY N/B	700,000.00	699,466.74
US TREASURY N/B	540,000.00	548,036.71
US TREASURY N/B	970,000.00	961,322.96
US TREASURY N/B	950,000.00	951,187.50
US TREASURY N/B	550,000.00	554,081.99
US TREASURY N/B	890,000.00	905,696.66
US TREASURY N/B	320,000.00	317,037.47
US TREASURY N/B	620,000.00	618,232.00
US TREASURY N/B	710,000.00	723,256.97
US TREASURY N/B	500,000.00	495,117.40
US TREASURY N/B	600,000.00	604,804.68
US TREASURY N/B	750,000.00	766,435.50
US TREASURY N/B	410,000.00	406,892.93
US TREASURY N/B	380,000.00	378,968.33
US TREASURY N/B	810,000.00	815,537.07
US TREASURY N/B	570,000.00	583,092.15
US TREASURY N/B	270,000.00	270,522.04
US TREASURY N/B	600,000.00	602,601.54
US TREASURY N/B	500,000.00	509,785.15
US TREASURY N/B	560,000.00	563,860.92
US TREASURY N/B	600,000.00	610,453.08
US TREASURY N/B	250,000.00	249,277.32
US TREASURY N/B	490,000.00	492,296.87
US TREASURY N/B	970,000.00	977,255.98
US TREASURY N/B	470,000.00	471,119.91
US TREASURY N/B	650,000.00	653,211.91
US TREASURY N/B	700,000.00	711,607.40
US TREASURY N/B	290,000.00	290,770.29
US TREASURY N/B	460,000.00	462,389.83
US TREASURY N/B	500,000.00	506,914.05
US TREASURY N/B	470,000.00	471,257.57
US TREASURY N/B	700,000.00	703,800.72
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,484,306.94

US TREASURY N/B	510,000.00	512,988.24
US TREASURY N/B	850,000.00	852,324.15
US TREASURY N/B	320,000.00	320,987.48
US TREASURY N/B	390,000.00	394,798.79
US TREASURY N/B	410,000.00	411,233.19
US TREASURY N/B	450,000.00	451,212.88
US TREASURY N/B	360,000.00	363,367.94
US TREASURY N/B	230,000.00	231,388.07
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,049,712.82
US TREASURY N/B	390,000.00	392,414.64
US TREASURY N/B	480,000.00	479,868.72
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,386.70
US TREASURY N/B	520,000.00	521,574.19
US TREASURY N/B	350,000.00	352,310.52
US TREASURY N/B	300,000.00	297,738.27
US TREASURY N/B	330,000.00	332,114.04
US TREASURY N/B	410,000.00	414,123.98
US TREASURY N/B	290,000.00	289,841.39
US TREASURY N/B	670,000.00	676,804.65
US TREASURY N/B	720,000.00	730,335.88
US TREASURY N/B	400,000.00	401,281.24
US TREASURY N/B	560,000.00	572,359.36
US TREASURY N/B	650,000.00	657,122.05
US TREASURY N/B	610,000.00	607,164.41
US TREASURY N/B	590,000.00	607,941.95
US TREASURY N/B	170,000.00	169,209.75
US TREASURY N/B	90,000.00	92,466.20
US TREASURY N/B	680,000.00	679,481.97
US TREASURY N/B	450,000.00	466,189.42
US TREASURY N/B	640,000.00	642,037.44
US TREASURY N/B	770,000.00	769,308.15
US TREASURY N/B	400,000.00	414,671.84
US TREASURY N/B	470,000.00	465,538.66
US TREASURY N/B	550,000.00	568,379.84
US TREASURY N/B	490,000.00	483,013.62

US TREASURY N/B	620,000.00	643,649.59
US TREASURY N/B	160,000.00	164,781.24
US TREASURY N/B	600,000.00	593,812.74
US TREASURY N/B	730,000.00	758,458.53
US TREASURY N/B	540,000.00	534,304.89
US TREASURY N/B	480,000.00	501,356.20
US TREASURY N/B	540,000.00	539,251.12
US TREASURY N/B	650,000.00	679,351.53
US TREASURY N/B	710,000.00	739,037.86
US TREASURY N/B	440,000.00	447,717.16
US TREASURY N/B	600,000.00	627,656.22
US TREASURY N/B	490,000.00	501,053.66
US TREASURY N/B	650,000.00	674,222.64
US TREASURY N/B	420,000.00	429,679.65
US TREASURY N/B	690,000.00	719,783.16
US TREASURY N/B	490,000.00	498,871.64
US TREASURY N/B	800,000.00	822,718.72
US TREASURY N/B	670,000.00	682,483.97
US TREASURY N/B	670,000.00	679,199.36
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,065,929.28
US TREASURY N/B	880,000.00	892,392.16
US TREASURY N/B	390,000.00	395,499.58
US TREASURY N/B	620,000.00	621,949.59
US TREASURY N/B	500,000.00	509,902.30
US TREASURY N/B	500,000.00	501,582.00
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,226,885.24
US TREASURY N/B	400,000.00	403,476.56
US TREASURY N/B	600,000.00	588,527.34
US TREASURY N/B	420,000.00	428,490.21
US TREASURY N/B	560,000.00	555,296.84
US TREASURY N/B	520,000.00	533,853.11
US TREASURY N/B	350,000.00	347,108.37
US TREASURY N/B	970,000.00	995,708.78
US TREASURY N/B	400,000.00	408,343.72
US TREASURY N/B	400,000.00	410,890.60

US TREASURY N/B	430,000.00	447,124.40	
US TREASURY N/B	620,000.00	629,348.41	
US TREASURY N/B	550,000.00	579,014.64	
US TREASURY N/B	830,000.00	868,922.43	
US TREASURY N/B	450,000.00	477,061.51	
US TREASURY N/B	710,000.00	725,350.91	
US TREASURY N/B	440,000.00	466,769.51	
US TREASURY N/B	890,000.00	938,932.55	
US TREASURY N/B	340,000.00	361,176.92	
US TREASURY N/B	390,000.00	395,850.00	
US TREASURY N/B	570,000.00	601,873.19	
US TREASURY N/B	530,000.00	567,193.12	
US TREASURY N/B	570,000.00	610,423.20	
US TREASURY N/B	450,000.00	463,069.29	
US TREASURY N/B	480,000.00	511,059.36	
US TREASURY N/B	500,000.00	525,478.50	
US TREASURY N/B	600,000.00	630,761.70	
US TREASURY N/B	460,000.00	456,765.60	
US TREASURY N/B	660,000.00	689,351.91	
US TREASURY N/B	850,000.00	875,483.34	
US TREASURY N/B	450,000.00	467,024.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	992,343.70	
US TREASURY N/B	470,000.00	480,749.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,755.85	
US TREASURY N/B	590,000.00	594,378.86	
US TREASURY N/B	890,000.00	875,329.24	
US TREASURY N/B	500,000.00	487,871.05	
US TREASURY N/B	400,000.00	396,492.16	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,263.67	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,066,344.72	
US TREASURY N/B	840,000.00	867,546.03	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,125,667.90	
US TREASURY N/B	750,000.00	775,371.07	
US TREASURY N/B	930,000.00	961,859.75	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,265,780.45	

US TREASURY N/B	900,000.00	975,462.84
US TREASURY N/B	120,000.00	155,561.71
US TREASURY N/B	890,000.00	966,049.78
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,185,171.26
US TREASURY N/B	310,000.00	400,087.67
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,377,276.49
US TREASURY N/B	840,000.00	879,719.48
US TREASURY N/B	890,000.00	873,521.02
US TREASURY N/B	320,000.00	317,700.00
US TREASURY N/B	120,000.00	170,294.52
US TREASURY N/B	270,000.00	365,981.80
US TREASURY N/B	200,000.00	269,265.62
US TREASURY N/B	90,000.00	129,482.22
US TREASURY N/B	130,000.00	175,845.30
US TREASURY N/B	100,000.00	137,427.73
US TREASURY N/B	70,000.00	85,428.70
US TREASURY N/B	240,000.00	321,595.29
US TREASURY N/B	190,000.00	262,678.70
US TREASURY N/B	200,000.00	272,718.74
US TREASURY N/B	260,000.00	366,158.18
US TREASURY N/B	260,000.00	355,880.06
US TREASURY N/B	250,000.00	321,118.15
US TREASURY N/B	180,000.00	242,792.56
US TREASURY N/B	380,000.00	546,272.22
US TREASURY N/B	250,000.00	343,403.30
US TREASURY N/B	230,000.00	291,241.98
US TREASURY N/B	130,000.00	150,520.69
US TREASURY N/B	180,000.00	208,462.50
US TREASURY N/B	480,000.00	545,362.46
US TREASURY N/B	300,000.00	327,498.03
US TREASURY N/B	410,000.00	447,388.47
US TREASURY N/B	590,000.00	684,065.76
US TREASURY N/B	360,000.00	401,153.89
US TREASURY N/B	480,000.00	601,565.61
US TREASURY N/B	570,000.00	728,475.56

	US TREASURY N/B	740,000.00	929,870.68	
	US TREASURY N/B	330,000.00	399,532.02	
	US TREASURY N/B	760,000.00	884,865.56	
	US TREASURY N/B	340,000.00	388,025.00	
	US TREASURY N/B	680,000.00	710,706.21	
	US TREASURY N/B	520,000.00	594,475.75	
	US TREASURY N/B	730,000.00	817,001.10	
	US TREASURY N/B	710,000.00	813,310.53	
	US TREASURY N/B	280,000.00	292,818.73	
	US TREASURY N/B	660,000.00	690,408.97	
	US TREASURY N/B	480,000.00	478,068.71	
	US TREASURY N/B	500,000.00	561,728.50	
	US TREASURY N/B	670,000.00	770,971.07	
	US TREASURY N/B	400,000.00	460,140.60	
	US TREASURY N/B	800,000.00	879,374.96	
	US TREASURY N/B	670,000.00	736,895.27	
	US TREASURY N/B	460,000.00	530,150.00	
	US TREASURY N/B	830,000.00	979,481.00	
	US TREASURY N/B	630,000.00	727,231.61	
	US TREASURY N/B	460,000.00	568,692.94	
	US TREASURY N/B	840,000.00	971,610.86	
	US TREASURY N/B	620,000.00	701,048.01	
	US TREASURY N/B	640,000.00	637,887.48	
	US TREASURY N/B	260,000.00	266,276.55	
	米ドル 小計	121,850,000.00	127,455,089.51 (13,850,544,577)	
カナダドル	GOV OF CANADA	250,000.00	247,072.50	
	GOV OF CANADA	230,000.00	230,211.60	
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,821.60	
	GOV OF CANADA	160,000.00	159,558.40	
	GOV OF CANADA	380,000.00	374,110.00	
	GOV OF CANADA	210,000.00	208,404.00	
	GOV OF CANADA	100,000.00	99,679.00	
	GOV OF CANADA	480,000.00	467,990.40	
	GOV OF CANADA	220,000.00	225,885.00	

	GOV OF CANADA	70,000.00	68,806.50
	GOV OF CANADA	240,000.00	240,861.60
	GOV OF CANADA	190,000.00	189,255.20
	GOV OF CANADA	230,000.00	233,174.00
	GOV OF CANADA	230,000.00	236,124.90
	GOV OF CANADA	160,000.00	166,200.00
	GOV OF CANADA	170,000.00	169,252.00
	GOV OF CANADA	80,000.00	78,625.60
	GOV OF CANADA	250,000.00	258,607.50
	GOV OF CANADA	160,000.00	159,105.60
	GOV OF CANADA	160,000.00	153,246.40
	GOV OF CANADA	60,000.00	86,714.40
	GOV OF CANADA	210,000.00	216,610.80
	GOV OF CANADA	120,000.00	163,270.80
	GOV OF CANADA	250,000.00	264,625.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	116,002.80
	GOV OF CANADA	160,000.00	239,027.20
	GOV OF CANADA	190,000.00	284,563.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	281,934.00
	GOV OF CANADA	210,000.00	288,817.20
	GOV OF CANADA	210,000.00	260,589.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	129,366.00
	GOV OF CANADA	70,000.00	93,661.40
	カナダドル 小計	6,060,000.00	6,565,173.40 (538,738,129)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,250,000.00	3,238,820.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,330,000.00	3,359,037.60
	UNITED MEXICAN STATE	3,690,000.00	3,668,893.20
	UNITED MEXICAN STATE	800,000.00	799,504.00
	UNITED MEXICAN STATE	4,720,000.00	4,917,579.20
	UNITED MEXICAN STATE	3,810,000.00	4,321,225.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,250,000.00	2,135,452.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,950,000.00	4,087,697.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,880,000.00	3,194,611.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,090,000.00	2,217,594.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,460,000.00	1,556,841.80

	UNITED MEXICAN STATE	1,310,000.00	1,685,498.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,000,000.00	2,277,000.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,870,000.00	3,045,758.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,770,000.00	1,938,682.94
	メキシコペソ 小計	40,180,000.00	42,444,196.94 (239,809,712)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,748.48
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	176,185.92
	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	91,458.09
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	67,094.34
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	173,310.75
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	228,654.40
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	30,651.45
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	154,413.56
	GOV OF AUSTRIA	240,000.00	262,237.92
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	212,551.04
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	117,881.39
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	189,761.22
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	194,527.97
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	107,488.40
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	115,914.28
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	144,930.06
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	348,242.58
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	163,826.80
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	125,374.00
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	129,636.00
	GOV OF AUSTRIA	74,000.00	125,270.75
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	39,671.70
	GOV OF BELGIUM	270,000.00	293,957.91
	GOV OF BELGIUM	100,000.00	110,694.24
	GOV OF BELGIUM	280,000.00	318,374.61
	GOV OF BELGIUM	160,000.00	175,988.96
	GOV OF BELGIUM	140,000.00	143,742.22
	GOV OF BELGIUM	210,000.00	239,177.40
	GOV OF BELGIUM	150,000.00	156,579.81

GOV OF BELGIUM	270,000.00	287,184.52
GOV OF BELGIUM	160,000.00	208,620.32
GOV OF BELGIUM	190,000.00	205,815.79
GOV OF BELGIUM	170,000.00	182,478.68
GOV OF BELGIUM	290,000.00	426,922.10
GOV OF BELGIUM	190,000.00	204,527.81
GOV OF BELGIUM	160,000.00	174,014.56
GOV OF BELGIUM	220,000.00	242,253.00
GOV OF BELGIUM	120,000.00	176,575.20
GOV OF BELGIUM	40,000.00	45,404.64
GOV OF BELGIUM	140,000.00	194,374.40
GOV OF BELGIUM	240,000.00	407,053.80
GOV OF BELGIUM	90,000.00	104,909.85
GOV OF BELGIUM	130,000.00	162,305.65
GOV OF BELGIUM	260,000.00	450,537.88
GOV OF BELGIUM	160,000.00	275,272.80
GOV OF BELGIUM	120,000.00	145,930.08
GOV OF BELGIUM	90,000.00	111,299.40
GOV OF BELGIUM	70,000.00	99,179.15
GOV OF BELGIUM	70,000.00	99,588.30
GOV OF FINLAND	100,000.00	105,611.50
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,152.00
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,571.81
GOV OF FINLAND	90,000.00	96,284.34
GOV OF FINLAND	20,000.00	20,409.14
GOV OF FINLAND	90,000.00	99,839.16
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,046.40
GOV OF FINLAND	80,000.00	99,914.48
GOV OF FINLAND	30,000.00	32,148.45
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,123.60
GOV OF FINLAND	90,000.00	94,870.62
GOV OF FINLAND	60,000.00	74,969.76
GOV OF FINLAND	60,000.00	63,297.66
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,368.96
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,757.52

GOV OF FINLAND	60,000.00	68,029.08	
GOV OF FINLAND	70,000.00	105,149.85	
GOV OF FINLAND	50,000.00	62,114.45	
GOV OF FRANCE	550,000.00	554,120.60	
GOV OF FRANCE	590,000.00	625,687.33	
GOV OF FRANCE	290,000.00	292,616.67	
GOV OF FRANCE	480,000.00	515,262.72	
GOV OF FRANCE	270,000.00	273,528.83	
GOV OF FRANCE	800,000.00	869,369.60	
GOV OF FRANCE	190,000.00	192,916.50	
GOV OF FRANCE	670,000.00	725,440.49	
GOV OF FRANCE	600,000.00	611,623.20	
GOV OF FRANCE	620,000.00	670,245.42	
GOV OF FRANCE	640,000.00	760,247.04	
GOV OF FRANCE	190,000.00	194,060.11	
GOV OF FRANCE	660,000.00	741,366.78	
GOV OF FRANCE	640,000.00	709,865.60	
GOV OF FRANCE	480,000.00	489,508.32	
GOV OF FRANCE	510,000.00	534,932.88	
GOV OF FRANCE	340,000.00	467,818.92	
GOV OF FRANCE	460,000.00	496,761.36	
GOV OF FRANCE	630,000.00	784,523.69	
GOV OF FRANCE	380,000.00	399,390.64	
GOV OF FRANCE	430,000.00	444,770.07	
GOV OF FRANCE	530,000.00	577,620.50	
GOV OF FRANCE	670,000.00	826,554.88	
GOV OF FRANCE	420,000.00	451,200.12	
GOV OF FRANCE	560,000.00	601,501.60	
GOV OF FRANCE	620,000.00	945,565.27	
GOV OF FRANCE	490,000.00	514,672.48	
GOV OF FRANCE	710,000.00	893,260.08	
GOV OF FRANCE	380,000.00	440,582.26	
GOV OF FRANCE	580,000.00	995,175.02	
GOV OF FRANCE	270,000.00	307,030.50	
GOV OF FRANCE	350,000.00	584,300.50	

GOV OF FRANCE	380,000.00	431,951.70
GOV OF FRANCE	480,000.00	789,839.90
GOV OF FRANCE	240,000.00	296,235.60
GOV OF FRANCE	490,000.00	883,595.33
GOV OF FRANCE	370,000.00	593,825.58
GOV OF FRANCE	360,000.00	475,668.00
GOV OF FRANCE	310,000.00	368,602.40
GOV OF FRANCE	280,000.00	549,699.13
GOV OF FRANCE	170,000.00	349,090.58
GOV OF FRANCE	180,000.00	233,595.72
GOV OF GERMANY	200,000.00	201,323.35
GOV OF GERMANY	320,000.00	331,219.52
GOV OF GERMANY	210,000.00	211,764.00
GOV OF GERMANY	180,000.00	181,568.84
GOV OF GERMANY	100,000.00	100,992.25
GOV OF GERMANY	280,000.00	297,230.47
GOV OF GERMANY	250,000.00	262,664.25
GOV OF GERMANY	50,000.00	50,572.30
GOV OF GERMANY	310,000.00	313,741.70
GOV OF GERMANY	110,000.00	111,426.72
GOV OF GERMANY	120,000.00	126,736.92
GOV OF GERMANY	350,000.00	355,438.30
GOV OF GERMANY	490,000.00	520,429.98
GOV OF GERMANY	250,000.00	264,935.75
GOV OF GERMANY	170,000.00	173,193.99
GOV OF GERMANY	270,000.00	288,732.60
GOV OF GERMANY	100,000.00	102,184.10
GOV OF GERMANY	320,000.00	343,801.28
GOV OF GERMANY	210,000.00	230,654.55
GOV OF GERMANY	340,000.00	348,341.90
GOV OF GERMANY	180,000.00	198,004.63
GOV OF GERMANY	370,000.00	379,639.24
GOV OF GERMANY	210,000.00	229,830.30
GOV OF GERMANY	400,000.00	430,148.95
GOV OF GERMANY	320,000.00	328,934.46

GOV OF GERMANY	380,000.00	401,307.36	
GOV OF GERMANY	240,000.00	261,393.84	
GOV OF GERMANY	460,000.00	489,596.40	
GOV OF GERMANY	260,000.00	268,778.90	
GOV OF GERMANY	510,000.00	536,978.38	
GOV OF GERMANY	140,000.00	215,012.70	
GOV OF GERMANY	270,000.00	290,048.58	
GOV OF GERMANY	170,000.00	254,518.22	
GOV OF GERMANY	250,000.00	269,141.25	
GOV OF GERMANY	130,000.00	188,331.26	
GOV OF GERMANY	430,000.00	454,167.72	
GOV OF GERMANY	440,000.00	464,509.32	
GOV OF GERMANY	170,000.00	175,132.98	
GOV OF GERMANY	210,000.00	351,551.55	
GOV OF GERMANY	250,000.00	412,709.00	
GOV OF GERMANY	200,000.00	344,502.93	
GOV OF GERMANY	250,000.00	424,219.25	
GOV OF GERMANY	260,000.00	476,729.50	
GOV OF GERMANY	220,000.00	434,310.09	
GOV OF GERMANY	270,000.00	462,399.84	
GOV OF GERMANY	330,000.00	520,401.09	
GOV OF GERMANY	340,000.00	548,102.44	
GOV OF GERMANY	300,000.00	388,727.70	
GOV OF GERMANY	60,000.00	56,107.08	
GOV OF IRELAND	80,000.00	82,382.88	
GOV OF IRELAND	80,000.00	81,128.96	
GOV OF IRELAND	120,000.00	137,522.40	
GOV OF IRELAND	150,000.00	174,594.30	
GOV OF IRELAND	120,000.00	156,140.40	
GOV OF IRELAND	140,000.00	150,879.77	
GOV OF IRELAND	100,000.00	108,105.60	
GOV OF IRELAND	120,000.00	132,162.41	
GOV OF IRELAND	120,000.00	148,654.08	
GOV OF IRELAND	100,000.00	113,075.00	
GOV OF IRELAND	60,000.00	67,670.94	

GOV OF IRELAND	90,000.00	107,739.72	
GOV OF IRELAND	120,000.00	155,485.32	
GOV OF IRELAND	50,000.00	58,377.60	
GOV OF ITALY	310,000.00	325,010.35	
GOV OF ITALY	50,000.00	50,120.79	
GOV OF ITALY	400,000.00	421,542.08	
GOV OF ITALY	80,000.00	80,630.96	
GOV OF ITALY	390,000.00	414,251.63	
GOV OF ITALY	420,000.00	454,574.40	
GOV OF ITALY	280,000.00	291,831.96	
GOV OF ITALY	140,000.00	140,945.00	
GOV OF ITALY	350,000.00	364,969.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	233,121.84	
GOV OF ITALY	120,000.00	123,095.04	
GOV OF ITALY	90,000.00	92,617.74	
GOV OF ITALY	250,000.00	255,647.50	
GOV OF ITALY	640,000.00	653,045.63	
GOV OF ITALY	230,000.00	263,580.92	
GOV OF ITALY	120,000.00	124,308.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	391,978.86	
GOV OF ITALY	210,000.00	208,788.93	
GOV OF ITALY	240,000.00	245,261.67	
GOV OF ITALY	180,000.00	183,976.59	
GOV OF ITALY	390,000.00	444,896.47	
GOV OF ITALY	340,000.00	393,962.62	
GOV OF ITALY	220,000.00	236,921.96	
GOV OF ITALY	200,000.00	202,396.80	
GOV OF ITALY	460,000.00	536,523.76	
GOV OF ITALY	170,000.00	179,869.21	
GOV OF ITALY	200,000.00	210,558.04	
GOV OF ITALY	370,000.00	423,960.13	
GOV OF ITALY	180,000.00	187,243.41	
GOV OF ITALY	380,000.00	414,003.92	
GOV OF ITALY	290,000.00	353,806.96	
GOV OF ITALY	200,000.00	207,407.06	

GOV OF ITALY	320,000.00	332,634.56	
GOV OF ITALY	220,000.00	240,939.38	
GOV OF ITALY	360,000.00	384,709.68	
GOV OF ITALY	390,000.00	475,858.11	
GOV OF ITALY	250,000.00	261,250.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	225,448.02	
GOV OF ITALY	330,000.00	336,814.50	
GOV OF ITALY	40,000.00	39,552.32	
GOV OF ITALY	310,000.00	335,901.12	
GOV OF ITALY	470,000.00	503,996.04	
GOV OF ITALY	350,000.00	492,325.75	
GOV OF ITALY	220,000.00	235,514.62	
GOV OF ITALY	390,000.00	505,537.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	238,553.70	
GOV OF ITALY	330,000.00	381,490.23	
GOV OF ITALY	510,000.00	695,114.70	
GOV OF ITALY	370,000.00	445,000.85	
GOV OF ITALY	470,000.00	692,643.70	
GOV OF ITALY	280,000.00	283,992.80	
GOV OF ITALY	320,000.00	473,347.20	
GOV OF ITALY	180,000.00	196,468.20	
GOV OF ITALY	350,000.00	493,622.50	
GOV OF ITALY	150,000.00	179,829.30	
GOV OF ITALY	120,000.00	126,292.80	
GOV OF ITALY	480,000.00	620,037.60	
GOV OF ITALY	100,000.00	113,765.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	599,250.09	
GOV OF ITALY	130,000.00	149,659.90	
GOV OF ITALY	270,000.00	395,124.75	
GOV OF ITALY	220,000.00	320,731.40	
GOV OF ITALY	260,000.00	309,128.56	
GOV OF ITALY	260,000.00	282,163.44	
GOV OF ITALY	290,000.00	355,644.69	
GOV OF ITALY	120,000.00	156,460.54	
GOV OF ITALY	120,000.00	126,125.16	

GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	212,501.00	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	151,920.90	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	279,647.81	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	295,612.37	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	184,530.88	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	132,943.85	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	324,028.89	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	187,099.20	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	254,334.24	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	259,521.12	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	324,077.71	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	152,167.12	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	197,751.43	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	253,081.90	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	366,534.30	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	116,768.65	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	338,488.99	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	349,064.10	
GOV OF SPAIN	330,000.00	331,814.01	
GOV OF SPAIN	280,000.00	303,133.60	
GOV OF SPAIN	300,000.00	305,831.40	
GOV OF SPAIN	280,000.00	282,332.68	
GOV OF SPAIN	330,000.00	374,259.60	
GOV OF SPAIN	250,000.00	254,517.75	
GOV OF SPAIN	230,000.00	235,031.48	
GOV OF SPAIN	340,000.00	400,658.04	
GOV OF SPAIN	350,000.00	356,873.65	
GOV OF SPAIN	310,000.00	365,128.54	
GOV OF SPAIN	250,000.00	301,162.50	
GOV OF SPAIN	280,000.00	327,891.20	
GOV OF SPAIN	180,000.00	182,717.10	
GOV OF SPAIN	250,000.00	284,466.70	
GOV OF SPAIN	330,000.00	358,226.55	
GOV OF SPAIN	400,000.00	503,348.40	
GOV OF SPAIN	230,000.00	257,996.98	

	GOV OF SPAIN	230,000.00	256,686.90	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	551,479.20	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	247,688.95	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	349,588.80	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	436,379.04	
	GOV OF SPAIN	360,000.00	391,717.80	
	GOV OF SPAIN	140,000.00	152,365.46	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	453,233.60	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	511,210.40	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	317,403.26	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	263,720.28	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	287,076.00	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	666,890.91	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	206,020.46	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	206,321.40	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	397,939.58	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	549,555.20	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	356,118.00	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	462,629.50	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	287,073.01	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	265,739.80	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	285,081.12	
	ユーロ 小計	74,484,000.00	89,387,146.24 (10,747,016,592)	
英bond	UK TREASURY	340,000.00	343,143.52	
	UK TREASURY	320,000.00	337,623.04	
	UK TREASURY	180,000.00	193,881.70	
	UK TREASURY	270,000.00	269,767.39	
	UK TREASURY	440,000.00	454,481.80	
	UK TREASURY	290,000.00	291,983.60	
	UK TREASURY	290,000.00	308,211.42	
	UK TREASURY	380,000.00	387,060.40	
	UK TREASURY	140,000.00	154,287.28	
	UK TREASURY	250,000.00	307,207.32	
	UK TREASURY	240,000.00	259,864.32	

	UK TREASURY	240,000.00	254,522.40
	UK TREASURY	180,000.00	188,523.00
	UK TREASURY	240,000.00	308,173.63
	UK TREASURY	360,000.00	389,391.98
	UK TREASURY	170,000.00	249,114.17
	UK TREASURY	230,000.00	232,417.30
	UK TREASURY	240,000.00	340,053.60
	UK TREASURY	130,000.00	181,240.80
	UK TREASURY	320,000.00	472,574.72
	UK TREASURY	250,000.00	367,700.00
	UK TREASURY	300,000.00	327,966.00
	UK TREASURY	250,000.00	404,181.50
	UK TREASURY	190,000.00	292,807.10
	UK TREASURY	220,000.00	343,715.90
	UK TREASURY	320,000.00	528,889.60
	UK TREASURY	310,000.00	437,937.00
	UK TREASURY	310,000.00	458,943.03
	UK TREASURY	330,000.00	555,415.01
	UK TREASURY	220,000.00	231,963.16
	UK TREASURY	160,000.00	178,799.36
	UK TREASURY	240,000.00	419,330.40
	UK TREASURY	200,000.00	336,370.40
	UK TREASURY	110,000.00	122,886.50
	UK TREASURY	280,000.00	531,662.76
	UK TREASURY	230,000.00	270,907.80
	UK TREASURY	260,000.00	497,585.40
	UK TREASURY	210,000.00	311,083.50
	UK TREASURY	220,000.00	412,386.74
	UK TREASURY	140,000.00	167,932.80
	英bond 小計	10,000,000.00	13,121,987.35 (1,874,869,552)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,350,000.00	1,420,402.50
	GOV OF SWEDEN	1,650,000.00	1,808,754.75
	GOV OF SWEDEN	1,180,000.00	1,265,068.44
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	1,070,232.84
	GOV OF SWEDEN	1,030,000.00	1,113,221.94

	GOV OF SWEDEN	660,000.00	705,864.45	
	GOV OF SWEDEN	750,000.00	803,381.25	
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	1,037,746.11	
	スウェーデンクローナ 小計	8,210,000.00	9,224,672.28	(105,161,263)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,310,000.00	1,356,362.99	
	GOV OF NORWAY	1,100,000.00	1,125,256.00	
	GOV OF NORWAY	810,000.00	867,402.42	
	GOV OF NORWAY	450,000.00	460,489.50	
	GOV OF NORWAY	620,000.00	627,130.00	
	GOV OF NORWAY	490,000.00	502,779.20	
	GOV OF NORWAY	640,000.00	669,760.00	
	GOV OF NORWAY	430,000.00	441,713.20	
	ノルウェークローネ 小計	5,850,000.00	6,050,893.31	(71,945,121)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,030,000.00	1,104,925.08	
	GOV OF DENMARK	930,000.00	1,008,942.12	
	GOV OF DENMARK	920,000.00	1,045,759.58	
	GOV OF DENMARK	1,300,000.00	1,396,068.70	
	GOV OF DENMARK	660,000.00	711,994.80	
	GOV OF DENMARK	1,810,000.00	3,463,789.76	
	デンマーククローネ 小計	6,650,000.00	8,731,480.04	(140,489,513)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	170,000.00	171,589.50	
	GOV OF POLAND	360,000.00	353,332.72	
	GOV OF POLAND	350,000.00	352,010.40	
	GOV OF POLAND	180,000.00	194,466.60	
	GOV OF POLAND	570,000.00	580,349.83	
	GOV OF POLAND	310,000.00	345,313.65	
	GOV OF POLAND	580,000.00	596,000.10	
	GOV OF POLAND	270,000.00	293,657.40	
	GOV OF POLAND	510,000.00	526,650.99	
	GOV OF POLAND	100,000.00	102,346.75	
	GOV OF POLAND	480,000.00	517,017.60	
	GOV OF POLAND	330,000.00	342,740.37	

	GOV OF POLAND	530,000.00	551,415.23
	GOV OF POLAND	380,000.00	402,825.08
	GOV OF POLAND	170,000.00	227,570.50
	GOV OF POLAND	280,000.00	299,126.15
	ポーランドズロチ 小計	5,570,000.00	5,856,412.87 (164,155,252)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	374,799.74
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	184,535.64
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	463,041.24
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	188,078.92
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	428,651.51
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	444,922.57
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	472,940.79
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	602,234.10
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	505,866.24
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	530,181.05
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	338,627.26
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	534,612.12
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	450,874.21
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	436,980.38
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	407,248.12
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	227,284.75
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	237,481.38
	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	166,405.19
	GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	148,179.41
	GOV OF AUSTRALIA	150,000.00	192,448.77
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	83,813.13
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	228,548.55
	オーストラリアドル 小計	6,630,000.00	7,647,755.07 (567,463,426)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	90,953.03
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	129,335.70
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,150.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	135,499.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	70,434.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	83,280.00

	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	61,002.40
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,392.50
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	72,709.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,425.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	123,497.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,942.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	76,936.30
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	99,747.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	94,913.60
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,485.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,955.69
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	79,345.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	102,238.65
	シンガポールドル 小計	1,450,000.00	1,546,240.87 (123,544,645)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	111,937.30
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	223,889.33
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	202,266.88
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,448.32
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,213.46
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	132,448.52
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	161,758.38
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,857.17
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	122,489.28
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	171,613.02
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	207,906.24
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	103,515.53
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	102,828.24
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	154,919.08
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	201,054.29
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	82,635.07
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	247,226.56
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,520.32
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	237,379.01
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	265,142.15

	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	196,745.66	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	270,160.02	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	222,168.74	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	345,263.74	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	43,915.29	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	74,342.54	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	203,836.53	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	137,139.07	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	159,782.29	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	89,477.12	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	172,833.82	
	マレーシアリングット 小計	4,910,000.00	5,130,712.97	(133,962,915)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	940,000.00	940,940.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,010,000.00	1,023,220.90	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,200,000.00	3,555,840.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,340,000.00	2,158,090.03	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,621,840.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,340,000.00	1,215,587.70	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,835,756.49	
	GOV OF SOUTH AFRICA	930,000.00	659,099.46	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,743,028.26	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,421,818.61	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,060,000.00	727,467.40	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,950,000.00	1,686,803.04	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,270,000.00	2,822,337.00	
	南アフリカランド 小計	23,540,000.00	21,411,828.89	(158,661,652)
合計			28,716,362,349	(28,716,362,349)

(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 221銘柄	100.0%	48.1%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 296銘柄	100.0%	37.4%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	6.5%
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 8銘柄	100.0%	0.3%
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 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M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12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	77,205,134
コール・ローン	2,175,593,728
国債証券	149,419,877,324
派生商品評価勘定	749,511,704

2019年12月10日現在

未収入金	6,865,723
未収利息	737,418,417
前払費用	227,289,975
流動資産合計	153,393,762,005
資産合計	153,393,762,005
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,305,246
未払金	4,314,729
未払解約金	2,113,779,000
未払利息	5,900
その他未払費用	747
流動負債合計	2,237,405,622
負債合計	2,237,405,622
純資産の部	
元本等	
元本	147,652,755,545
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,503,600,838
元本等合計	151,156,356,383
純資産合計	151,156,356,383
負債純資産合計	153,393,762,005

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日

期首元本額	60,557,036,701円
期中追加設定元本額	121,787,503,426円
期中一部解約元本額	34,691,784,582円
期末元本額	147,652,755,545円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	11,991,173,808円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,369,239,943円
りそなラップ型ファンド(成長型)	135,170,659円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	614,922,923円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	116,219,710円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	25,581,793円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,704,568円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,016,824円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	128,106円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,129円
FWりそな円建債券アクティブファンド	930,646,700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)	59,076,650,602円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	458,897,320円
Smart-i 8資産バランス 安定型	153,582,467円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	118,018,190円
Smart-i 8資産バランス 成長型	48,025,341円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	4,745,711,671円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	14,898,799,812円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	26,684,453,123円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	14,980,054,135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)	7,297,036,779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)	4,715,942円
2. 計算日における受益権の総数	147,652,755,545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	1.0237円
(10,000口当たり純資産額)	(10,237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12月10日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2019年12月10日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,793,010,293
合計		1,793,010,293

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	151,615,597,128	-	150,985,390,670	630,206,458
	米ドル	73,092,679,519	-	72,547,184,100	545,495,419
	カナダドル	2,881,370,378	-	2,869,508,000	11,862,378
	メキシコペソ	1,337,162,635	-	1,345,311,020	8,148,385
	ユーロ	56,890,854,600	-	56,715,708,520	175,146,080
	英ポンド	9,754,249,827	-	9,858,721,780	104,471,953
	スウェーデンクローナ	530,361,917	-	527,421,000	2,940,917
	ノルウェークローネ	356,880,072	-	355,354,560	1,525,512
	デンマーククローネ	772,488,023	-	769,842,140	2,645,883
	ポーランドズロチ	839,584,500	-	842,968,000	3,383,500
	オーストラリアドル	2,959,195,777	-	2,962,440,800	3,245,023
	シンガポールドル	645,677,433	-	643,430,560	2,246,873
	マレーシアリンギット	670,037,508	-	666,604,800	3,432,708
	南アフリカランド	885,054,939	-	880,895,390	4,159,549
	合計		151,615,597,128	-	150,985,390,670

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	4,380,000.00	4,394,628.32	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,749,121.00	
		US TREASURY N/B	4,970,000.00	5,022,708.83	
		US TREASURY N/B	2,920,000.00	2,926,558.32	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,342,422.13	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,320,125.00	
		US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,234,564.40	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,149,754.64	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,646,476.48	
		US TREASURY N/B	2,650,000.00	2,668,115.13	
		US TREASURY N/B	5,910,000.00	5,870,753.46	
		US TREASURY N/B	3,220,000.00	3,251,948.19	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,319,765.51	
		US TREASURY N/B	3,270,000.00	3,252,053.25	

US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,488,042.36	
US TREASURY N/B	5,960,000.00	6,014,594.19	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,214,924.55	
US TREASURY N/B	4,220,000.00	4,252,803.74	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,897,526.80	
US TREASURY N/B	4,240,000.00	4,296,229.60	
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,517,107.57	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,787,585.92	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,535,205.00	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,554,485.91	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,996,952.80	
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,968,872.63	
US TREASURY N/B	6,730,000.00	6,669,797.45	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,003,750.00	
US TREASURY N/B	7,650,000.00	7,706,776.77	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,526,455.05	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,991,391.62	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,988,593.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,037,343.60	
US TREASURY N/B	3,660,000.00	3,624,259.36	
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,794,253.88	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,328,488.20	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,858,174.78	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,991,855.30	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,470,351.39	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,329,859.31	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,063,983.01	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,239,669.05	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,141,097.63	
US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,755,716.48	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,627,874.88	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,343,206.85	
US TREASURY N/B	5,510,000.00	5,535,828.12	
US TREASURY N/B	3,260,000.00	3,284,386.10	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,185,194.50	

US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,125,534.36	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,626,531.20	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,306,109.26	
US TREASURY N/B	5,270,000.00	5,297,379.23	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,041,484.30	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,403,745.98	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,156,244.04	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,758,002.77	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,007,519.30	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,804,921.74	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,604,937.44	
US TREASURY N/B	3,870,000.00	3,917,618.80	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,908,722.62	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,704,582.01	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,056,132.40	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,156,940.36	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,749,247.87	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,354,487.87	
US TREASURY N/B	4,210,000.00	4,208,848.56	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,092,412.07	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,289,929.54	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,214,523.30	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,468,842.13	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,958,834.22	
US TREASURY N/B	6,310,000.00	6,373,469.13	
US TREASURY N/B	1,980,000.00	1,978,917.13	
US TREASURY N/B	4,780,000.00	4,828,546.63	
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,475,027.17	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,367,559.31	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,890,830.05	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,153,338.41	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,289,308.44	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,060,820.20	
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,930,981.91	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,496,602.30	

US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,017,699.36	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,288,942.71	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,207,003.70	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,058,149.09	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,866,023.28	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,408,172.58	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,294,187.73	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,823,622.88	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,688,794.25	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,224,546.84	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,296,075.92	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	2,129,917.81	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,137,219.56	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,133,476.30	
US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,085,714.78	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,703,202.90	
US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,685,517.87	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,462,444.38	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,196,796.77	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,826,476.12	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,541,300.72	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,488,589.58	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,899,995.92	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,395,958.62	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,249,738.94	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,449,685.48	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,554,600.60	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,491,391.34	
US TREASURY N/B	2,810,000.00	2,849,570.42	
US TREASURY N/B	3,880,000.00	3,934,713.82	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,507,861.25	
US TREASURY N/B	4,480,000.00	4,568,724.60	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,507,910.00	
US TREASURY N/B	3,350,000.00	3,453,836.60	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,301,211.90	

US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,923,019.11	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,570,941.29	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,966,406.00	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,484,470.25	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,173,562.24	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,064,955.44	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,327,117.09	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,184,402.15	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,204,427.30	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,517,393.68	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,421,333.97	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,601,748.58	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,844,637.85	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,583,512.55	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,288,603.38	
US TREASURY N/B	1,970,000.00	2,078,311.38	
US TREASURY N/B	4,750,000.00	5,045,854.22	
US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,694,600.00	
US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,593,242.86	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,247,368.97	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,356,019.38	
US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,278,990.07	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,726,474.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,576,435.50	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,913,310.49	
US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,465,460.76	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,864,548.62	
US TREASURY N/B	4,080,000.00	4,202,320.03	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,438,905.20	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,431,242.06	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,534,306.50	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,735,524.95	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,712,617.06	
US TREASURY N/B	4,130,000.00	4,061,921.08	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,756,335.78	

US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,667,552.48	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,972,636.70	
US TREASURY N/B	4,360,000.00	4,427,869.50	
US TREASURY N/B	4,730,000.00	4,885,110.41	
US TREASURY N/B	4,920,000.00	5,128,042.69	
US TREASURY N/B	4,020,000.00	4,155,988.96	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,171,289.00	
US TREASURY N/B	5,450,000.00	5,846,189.37	
US TREASURY N/B	6,120,000.00	6,633,147.31	
US TREASURY N/B	220,000.00	285,196.47	
US TREASURY N/B	5,120,000.00	5,557,499.90	
US TREASURY N/B	5,280,000.00	5,848,321.77	
US TREASURY N/B	530,000.00	684,020.86	
US TREASURY N/B	5,760,000.00	6,149,699.71	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,812,432.30	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,201,866.79	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,886,343.75	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,106,914.38	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,287,713.79	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,534,814.03	
US TREASURY N/B	630,000.00	906,375.58	
US TREASURY N/B	690,000.00	933,332.77	
US TREASURY N/B	520,000.00	714,624.19	
US TREASURY N/B	560,000.00	683,429.65	
US TREASURY N/B	840,000.00	1,125,583.53	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,852,576.13	
US TREASURY N/B	600,000.00	818,156.21	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,520,964.75	
US TREASURY N/B	1,950,000.00	2,669,100.52	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,515,677.66	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,443,266.93	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,796,948.12	
US TREASURY N/B	2,080,000.00	2,857,115.45	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,367,571.06	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,204,165.56	

US TREASURY N/B	590,000.00	683,293.75	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,272,343.60	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,353,658.52	
US TREASURY N/B	2,660,000.00	2,902,569.12	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,785,527.59	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,836,133.17	
US TREASURY N/B	2,510,000.00	3,145,686.86	
US TREASURY N/B	2,560,000.00	3,271,749.88	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	3,317,376.48	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,825,821.79	
US TREASURY N/B	3,650,000.00	4,249,683.32	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,396,625.00	
US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,929,787.31	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,515,729.27	
US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,458,264.96	
US TREASURY N/B	2,070,000.00	2,371,201.14	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,426,212.38	
US TREASURY N/B	3,390,000.00	3,546,191.53	
US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,842,556.52	
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,066,914.34	
US TREASURY N/B	2,740,000.00	3,152,926.49	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	2,312,206.51	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,352,328.01	
US TREASURY N/B	4,090,000.00	4,498,360.73	
US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,731,425.00	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	4,413,565.02	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,693,874.88	
US TREASURY N/B	4,350,000.00	5,377,857.15	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,967,411.02	
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,674,848.45	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	3,996,763.79	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,433,796.84	
	米ドル 小計	634,180,000.00	662,284,188.32 (71,970,422,744)
カナダドル	GOV OF CANADA	1,070,000.00	1,076,302.30

	GOV OF CANADA	1,220,000.00	1,205,713.80
	GOV OF CANADA	1,190,000.00	1,191,094.80
	GOV OF CANADA	870,000.00	889,557.60
	GOV OF CANADA	990,000.00	987,267.60
	GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,240,470.00
	GOV OF CANADA	830,000.00	823,692.00
	GOV OF CANADA	770,000.00	767,528.30
	GOV OF CANADA	1,300,000.00	1,267,474.00
	GOV OF CANADA	1,060,000.00	1,088,355.00
	GOV OF CANADA	1,600,000.00	1,572,720.00
	GOV OF CANADA	1,280,000.00	1,284,595.20
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,105,648.80
	GOV OF CANADA	870,000.00	882,006.00
	GOV OF CANADA	1,290,000.00	1,324,352.70
	GOV OF CANADA	900,000.00	934,875.00
	GOV OF CANADA	830,000.00	826,348.00
	GOV OF CANADA	810,000.00	796,084.20
	GOV OF CANADA	840,000.00	868,921.20
	GOV OF CANADA	940,000.00	934,745.40
	GOV OF CANADA	1,510,000.00	1,446,262.90
	GOV OF CANADA	990,000.00	1,021,165.20
	GOV OF CANADA	850,000.00	1,156,501.50
	GOV OF CANADA	890,000.00	942,065.00
	GOV OF CANADA	550,000.00	531,679.50
	GOV OF CANADA	810,000.00	1,210,075.20
	GOV OF CANADA	880,000.00	1,317,976.00
	GOV OF CANADA	1,050,000.00	1,480,153.50
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,622,877.60
	GOV OF CANADA	1,090,000.00	1,352,581.00
	GOV OF CANADA	720,000.00	776,196.00
	GOV OF CANADA	360,000.00	481,687.20
	カナダドル 小計	31,910,000.00	34,406,972.50 (2,823,436,163)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	17,990,000.00	17,928,114.40
	UNITED MEXICAN STATE	15,600,000.00	15,736,032.00
	UNITED MEXICAN STATE	22,070,000.00	21,943,759.60

	UNITED MEXICAN STATE	3,300,000.00	3,297,954.00
	UNITED MEXICAN STATE	25,340,000.00	26,400,732.40
	UNITED MEXICAN STATE	4,000,000.00	4,192,678.40
	UNITED MEXICAN STATE	19,370,000.00	21,969,066.60
	UNITED MEXICAN STATE	12,260,000.00	11,635,843.40
	UNITED MEXICAN STATE	22,480,000.00	23,263,652.80
	UNITED MEXICAN STATE	17,010,000.00	18,868,172.40
	UNITED MEXICAN STATE	10,180,000.00	10,801,489.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,360,000.00	7,848,188.80
	UNITED MEXICAN STATE	6,750,000.00	8,684,820.00
	UNITED MEXICAN STATE	10,870,000.00	12,375,495.00
	UNITED MEXICAN STATE	14,910,000.00	15,823,088.40
	UNITED MEXICAN STATE	9,910,000.00	10,854,433.89
	メキシコペソ 小計	219,400,000.00	231,623,521.09 (1,308,672,894)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,094,362.08
	GOV OF AUSTRIA	430,000.00	473,499.66
	GOV OF AUSTRIA	710,000.00	721,502.71
	GOV OF AUSTRIA	730,000.00	816,314.47
	GOV OF AUSTRIA	620,000.00	632,074.50
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,023,500.66
	GOV OF AUSTRIA	400,000.00	408,686.00
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	772,067.80
	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,114,511.16
	GOV OF AUSTRIA	620,000.00	823,635.28
	GOV OF AUSTRIA	890,000.00	953,767.61
	GOV OF AUSTRIA	600,000.00	632,537.40
	GOV OF AUSTRIA	620,000.00	927,748.78
	GOV OF AUSTRIA	820,000.00	881,404.88
	GOV OF AUSTRIA	630,000.00	663,872.69
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	645,597.54
	GOV OF AUSTRIA	1,040,000.00	1,724,629.92
	GOV OF AUSTRIA	490,000.00	802,751.32
	GOV OF AUSTRIA	540,000.00	677,019.60
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	561,756.00

GOV OF AUSTRIA	420,000.00	710,996.16
GOV OF AUSTRIA	200,000.00	264,478.00
GOV OF BELGIUM	1,220,000.00	1,328,254.26
GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,073,734.22
GOV OF BELGIUM	1,180,000.00	1,341,721.59
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,077,932.38
GOV OF BELGIUM	730,000.00	749,513.04
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	1,150,329.40
GOV OF BELGIUM	830,000.00	866,408.28
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,340,194.46
GOV OF BELGIUM	640,000.00	834,481.28
GOV OF BELGIUM	1,290,000.00	1,397,380.89
GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,062,669.96
GOV OF BELGIUM	1,190,000.00	1,751,852.78
GOV OF BELGIUM	1,430,000.00	1,539,340.94
GOV OF BELGIUM	1,020,000.00	1,109,342.82
GOV OF BELGIUM	870,000.00	958,000.50
GOV OF BELGIUM	620,000.00	912,305.20
GOV OF BELGIUM	460,000.00	522,153.36
GOV OF BELGIUM	560,000.00	777,497.60
GOV OF BELGIUM	1,410,000.00	2,391,441.06
GOV OF BELGIUM	370,000.00	431,296.05
GOV OF BELGIUM	640,000.00	799,043.20
GOV OF BELGIUM	1,240,000.00	2,148,719.12
GOV OF BELGIUM	710,000.00	1,221,523.05
GOV OF BELGIUM	820,000.00	997,188.88
GOV OF BELGIUM	410,000.00	507,030.60
GOV OF BELGIUM	390,000.00	552,569.55
GOV OF BELGIUM	390,000.00	554,849.11
GOV OF FINLAND	510,000.00	538,618.65
GOV OF FINLAND	330,000.00	334,752.00
GOV OF FINLAND	380,000.00	403,525.42
GOV OF FINLAND	350,000.00	374,439.10
GOV OF FINLAND	400,000.00	408,182.80
GOV OF FINLAND	360,000.00	399,356.64

GOV OF FINLAND	300,000.00	306,278.40	
GOV OF FINLAND	500,000.00	624,465.50	
GOV OF FINLAND	250,000.00	267,903.75	
GOV OF FINLAND	340,000.00	357,525.30	
GOV OF FINLAND	390,000.00	411,106.02	
GOV OF FINLAND	390,000.00	487,303.44	
GOV OF FINLAND	310,000.00	327,037.91	
GOV OF FINLAND	280,000.00	295,291.36	
GOV OF FINLAND	320,000.00	345,373.44	
GOV OF FINLAND	360,000.00	408,174.48	
GOV OF FINLAND	340,000.00	510,727.86	
GOV OF FINLAND	270,000.00	335,418.03	
GOV OF FRANCE	1,970,000.00	1,984,759.24	
GOV OF FRANCE	2,900,000.00	3,075,412.30	
GOV OF FRANCE	1,770,000.00	1,785,970.71	
GOV OF FRANCE	3,050,000.00	3,274,065.20	
GOV OF FRANCE	2,240,000.00	2,269,276.35	
GOV OF FRANCE	3,080,000.00	3,347,072.96	
GOV OF FRANCE	2,480,000.00	2,518,068.00	
GOV OF FRANCE	2,880,000.00	3,118,311.36	
GOV OF FRANCE	3,020,000.00	3,078,503.44	
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	3,513,383.25	
GOV OF FRANCE	3,570,000.00	4,240,753.02	
GOV OF FRANCE	2,350,000.00	2,400,217.15	
GOV OF FRANCE	2,510,000.00	2,819,440.33	
GOV OF FRANCE	3,080,000.00	3,416,228.20	
GOV OF FRANCE	2,060,000.00	2,100,806.54	
GOV OF FRANCE	2,480,000.00	2,601,242.24	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,123,379.26	
GOV OF FRANCE	2,500,000.00	2,699,790.00	
GOV OF FRANCE	2,580,000.00	3,212,811.30	
GOV OF FRANCE	2,770,000.00	2,911,347.56	
GOV OF FRANCE	2,560,000.00	2,647,933.44	
GOV OF FRANCE	2,310,000.00	2,517,553.50	
GOV OF FRANCE	3,060,000.00	3,775,011.84	

GOV OF FRANCE	2,520,000.00	2,707,200.72	
GOV OF FRANCE	2,130,000.00	2,287,854.30	
GOV OF FRANCE	2,780,000.00	4,239,792.71	
GOV OF FRANCE	2,400,000.00	2,520,844.80	
GOV OF FRANCE	840,000.00	839,080.20	
GOV OF FRANCE	3,080,000.00	3,874,987.42	
GOV OF FRANCE	3,420,000.00	3,965,240.34	
GOV OF FRANCE	2,450,000.00	4,203,756.55	
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	2,069,613.00	
GOV OF FRANCE	2,190,000.00	3,656,051.70	
GOV OF FRANCE	2,280,000.00	2,591,710.20	
GOV OF FRANCE	1,910,000.00	3,142,904.61	
GOV OF FRANCE	1,490,000.00	1,839,129.35	
GOV OF FRANCE	2,660,000.00	4,796,660.42	
GOV OF FRANCE	1,860,000.00	2,985,177.24	
GOV OF FRANCE	1,940,000.00	2,563,322.00	
GOV OF FRANCE	1,840,000.00	2,187,833.60	
GOV OF FRANCE	1,230,000.00	2,414,749.75	
GOV OF FRANCE	920,000.00	1,889,196.08	
GOV OF FRANCE	850,000.00	1,103,090.90	
GOV OF GERMANY	1,330,000.00	1,338,800.33	
GOV OF GERMANY	860,000.00	890,152.46	
GOV OF GERMANY	1,120,000.00	1,129,408.00	
GOV OF GERMANY	1,170,000.00	1,180,197.48	
GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,413,891.50	
GOV OF GERMANY	1,950,000.00	2,069,997.93	
GOV OF GERMANY	1,200,000.00	1,260,788.40	
GOV OF GERMANY	460,000.00	465,265.16	
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	1,295,449.60	
GOV OF GERMANY	400,000.00	405,188.08	
GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,478,597.40	
GOV OF GERMANY	1,370,000.00	1,391,287.06	
GOV OF GERMANY	1,660,000.00	1,763,089.32	
GOV OF GERMANY	1,510,000.00	1,600,211.93	
GOV OF GERMANY	1,210,000.00	1,232,733.70	

GOV OF GERMANY	1,070,000.00	1,144,236.60	
GOV OF GERMANY	1,170,000.00	1,195,553.97	
GOV OF GERMANY	1,340,000.00	1,439,667.86	
GOV OF GERMANY	1,480,000.00	1,625,565.40	
GOV OF GERMANY	1,130,000.00	1,157,724.55	
GOV OF GERMANY	1,970,000.00	2,167,050.82	
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,641,683.20	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,422,759.00	
GOV OF GERMANY	1,560,000.00	1,677,580.94	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,336,296.25	
GOV OF GERMANY	1,670,000.00	1,763,640.24	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,677,277.14	
GOV OF GERMANY	1,790,000.00	1,905,168.60	
GOV OF GERMANY	1,910,000.00	1,974,491.15	
GOV OF GERMANY	1,890,000.00	1,989,978.72	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,551,163.05	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	1,858,459.42	
GOV OF GERMANY	930,000.00	1,392,364.38	
GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,830,160.50	
GOV OF GERMANY	710,000.00	1,028,578.42	
GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,795,546.80	
GOV OF GERMANY	1,610,000.00	1,699,681.83	
GOV OF GERMANY	1,430,000.00	1,473,177.42	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,238,800.70	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,898,461.40	
GOV OF GERMANY	1,490,000.00	2,566,546.90	
GOV OF GERMANY	1,630,000.00	2,765,909.51	
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	1,998,596.75	
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	2,191,291.83	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,729,717.92	
GOV OF GERMANY	2,080,000.00	3,280,103.84	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,336,976.62	
GOV OF GERMANY	1,290,000.00	1,671,529.11	
GOV OF GERMANY	380,000.00	355,344.84	
GOV OF IRELAND	490,000.00	504,595.14	

GOV OF IRELAND	350,000.00	354,939.24
GOV OF IRELAND	560,000.00	641,771.20
GOV OF IRELAND	540,000.00	628,539.48
GOV OF IRELAND	890,000.00	1,158,041.30
GOV OF IRELAND	850,000.00	916,055.76
GOV OF IRELAND	590,000.00	637,823.04
GOV OF IRELAND	560,000.00	616,757.95
GOV OF IRELAND	620,000.00	768,046.08
GOV OF IRELAND	510,000.00	576,682.50
GOV OF IRELAND	290,000.00	327,076.21
GOV OF IRELAND	410,000.00	490,814.28
GOV OF IRELAND	650,000.00	842,212.15
GOV OF IRELAND	280,000.00	326,914.56
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,813,767.46
GOV OF ITALY	990,000.00	992,391.64
GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,169,779.27
GOV OF ITALY	1,820,000.00	1,834,354.34
GOV OF ITALY	2,240,000.00	2,379,291.48
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,807,474.40
GOV OF ITALY	1,270,000.00	1,323,666.39
GOV OF ITALY	910,000.00	916,142.50
GOV OF ITALY	1,090,000.00	1,136,619.30
GOV OF ITALY	1,190,000.00	1,321,023.76
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,323,271.68
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,389,266.10
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,769,080.70
GOV OF ITALY	1,580,000.00	1,612,206.40
GOV OF ITALY	810,000.00	928,263.24
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,740,312.00
GOV OF ITALY	1,360,000.00	1,567,915.44
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,491,349.50
GOV OF ITALY	1,850,000.00	1,890,558.84
GOV OF ITALY	1,480,000.00	1,512,696.44
GOV OF ITALY	1,900,000.00	2,167,444.38
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,738,070.40

GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,356,916.68	
GOV OF ITALY	750,000.00	758,988.00	
GOV OF ITALY	1,760,000.00	2,052,786.56	
GOV OF ITALY	1,420,000.00	1,502,436.96	
GOV OF ITALY	800,000.00	842,232.16	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,959,383.32	
GOV OF ITALY	840,000.00	873,802.60	
GOV OF ITALY	1,150,000.00	1,252,906.60	
GOV OF ITALY	970,000.00	952,185.95	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	2,049,640.32	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,275,553.41	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,392,907.22	
GOV OF ITALY	970,000.00	1,062,323.63	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,741,879.94	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	2,098,656.28	
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,410,752.70	
GOV OF ITALY	1,990,000.00	2,136,388.38	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,520,768.50	
GOV OF ITALY	400,000.00	395,523.20	
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,397,782.08	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,026,707.48	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,264,698.45	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,316,740.83	
GOV OF ITALY	1,970,000.00	2,553,612.50	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,601,717.70	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,780,287.74	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,848,607.30	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	2,068,652.60	
GOV OF ITALY	700,000.00	698,506.90	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	3,080,053.90	
GOV OF ITALY	1,580,000.00	1,602,530.80	
GOV OF ITALY	1,360,000.00	2,011,725.60	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,287,958.20	
GOV OF ITALY	2,360,000.00	3,328,426.00	
GOV OF ITALY	970,000.00	1,162,896.14	

GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,062,964.40	
GOV OF ITALY	1,830,000.00	2,363,893.35	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,695,098.50	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	2,367,768.66	
GOV OF ITALY	590,000.00	679,225.70	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,297,577.25	
GOV OF ITALY	1,250,000.00	1,822,337.50	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,450,526.32	
GOV OF ITALY	1,280,000.00	1,389,112.32	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,508,424.03	
GOV OF ITALY	940,000.00	1,225,607.62	
GOV OF ITALY	680,000.00	714,709.24	
GOV OF NETHERLANDS	1,140,000.00	1,211,255.70	
GOV OF NETHERLANDS	1,340,000.00	1,357,160.04	
GOV OF NETHERLANDS	970,000.00	1,043,301.44	
GOV OF NETHERLANDS	970,000.00	1,102,861.56	
GOV OF NETHERLANDS	1,300,000.00	1,411,118.54	
GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	1,288,532.70	
GOV OF NETHERLANDS	1,000,000.00	1,117,341.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	1,216,144.80	
GOV OF NETHERLANDS	1,070,000.00	1,133,906.82	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,211,098.56	
GOV OF NETHERLANDS	790,000.00	1,163,733.59	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,304,289.60	
GOV OF NETHERLANDS	960,000.00	999,165.12	
GOV OF NETHERLANDS	930,000.00	1,238,769.30	
GOV OF NETHERLANDS	1,180,000.00	1,965,956.70	
GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	583,843.26	
GOV OF NETHERLANDS	1,070,000.00	1,906,227.47	
GOV OF NETHERLANDS	1,110,000.00	1,845,053.10	
GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,508,245.50	
GOV OF SPAIN	1,770,000.00	1,916,237.40	
GOV OF SPAIN	1,590,000.00	1,620,906.42	
GOV OF SPAIN	1,530,000.00	1,542,746.43	
GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,417,650.00	

GOV OF SPAIN	1,910,000.00	1,944,515.61	
GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,318,220.04	
GOV OF SPAIN	1,720,000.00	2,026,858.32	
GOV OF SPAIN	1,430,000.00	1,458,083.77	
GOV OF SPAIN	1,390,000.00	1,637,189.26	
GOV OF SPAIN	1,200,000.00	1,445,580.00	
GOV OF SPAIN	1,270,000.00	1,487,220.80	
GOV OF SPAIN	1,270,000.00	1,289,170.65	
GOV OF SPAIN	1,830,000.00	2,082,296.24	
GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,899,686.25	
GOV OF SPAIN	1,560,000.00	1,963,058.76	
GOV OF SPAIN	1,570,000.00	1,761,109.82	
GOV OF SPAIN	1,450,000.00	1,618,243.50	
GOV OF SPAIN	1,630,000.00	2,247,277.74	
GOV OF SPAIN	1,640,000.00	1,766,129.93	
GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,463,903.10	
GOV OF SPAIN	1,820,000.00	1,985,524.63	
GOV OF SPAIN	1,570,000.00	1,708,324.85	
GOV OF SPAIN	1,570,000.00	1,708,669.93	
GOV OF SPAIN	1,330,000.00	1,883,752.15	
GOV OF SPAIN	1,830,000.00	2,751,514.80	
GOV OF SPAIN	1,720,000.00	1,882,529.68	
GOV OF SPAIN	1,310,000.00	1,328,744.52	
GOV OF SPAIN	1,750,000.00	2,009,532.00	
GOV OF SPAIN	1,530,000.00	2,488,641.68	
GOV OF SPAIN	1,390,000.00	1,684,520.28	
GOV OF SPAIN	850,000.00	974,295.50	
GOV OF SPAIN	1,490,000.00	2,280,499.97	
GOV OF SPAIN	1,330,000.00	2,284,088.80	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	2,611,532.00	
GOV OF SPAIN	1,000,000.00	1,850,518.00	
GOV OF SPAIN	1,400,000.00	1,913,820.16	
GOV OF SPAIN	810,000.00	1,076,246.19	
GOV OF SPAIN	890,000.00	1,409,567.76	
ゴロ小計	391,400,000.00	466,070,452.82	

英債券	UK TREASURY	1,760,000.00	1,776,272.43
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,215,651.20
	UK TREASURY	650,000.00	700,128.39
	UK TREASURY	1,840,000.00	1,838,414.83
	UK TREASURY	2,190,000.00	2,262,079.90
	UK TREASURY	1,920,000.00	1,933,132.80
	UK TREASURY	1,180,000.00	1,254,101.64
	UK TREASURY	1,950,000.00	1,986,231.00
	UK TREASURY	970,000.00	1,068,990.44
	UK TREASURY	1,330,000.00	1,634,342.96
	UK TREASURY	830,000.00	831,373.15
	UK TREASURY	470,000.00	508,900.96
	UK TREASURY	950,000.00	1,007,484.50
	UK TREASURY	1,190,000.00	1,246,346.50
	UK TREASURY	980,000.00	1,258,375.66
	UK TREASURY	1,970,000.00	2,130,839.46
	UK TREASURY	700,000.00	1,025,764.25
	UK TREASURY	970,000.00	980,194.70
	UK TREASURY	1,060,000.00	1,501,903.40
	UK TREASURY	1,140,000.00	1,589,342.40
	UK TREASURY	1,070,000.00	1,580,171.72
	UK TREASURY	1,850,000.00	2,720,980.00
	UK TREASURY	1,540,000.00	1,683,558.80
	UK TREASURY	1,090,000.00	1,762,231.34
	UK TREASURY	1,010,000.00	1,556,500.90
	UK TREASURY	1,230,000.00	1,921,684.35
	UK TREASURY	1,440,000.00	2,380,003.20
	UK TREASURY	1,730,000.00	2,443,971.00
	UK TREASURY	1,600,000.00	2,368,738.23
	UK TREASURY	1,520,000.00	2,558,275.21
	UK TREASURY	1,510,000.00	1,592,110.78
	UK TREASURY	640,000.00	715,197.44
	UK TREASURY	1,070,000.00	1,869,514.70
UK TREASURY	1,230,000.00	2,068,677.96	
	650,000.00	726,147.50	

	UK TREASURY			
	UK TREASURY	1,220,000.00	2,316,530.63	
	UK TREASURY	1,220,000.00	1,436,989.20	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,913,790.00	
	UK TREASURY	1,480,000.00	2,192,398.00	
	UK TREASURY	1,320,000.00	2,474,320.45	
	UK TREASURY	670,000.00	803,678.40	
	英ポンド 小計	52,240,000.00	67,835,340.38 (9,692,313,433)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	7,410,000.00	7,796,431.50	
	GOV OF SWEDEN	7,710,000.00	8,451,817.65	
	GOV OF SWEDEN	5,850,000.00	6,271,737.61	
	GOV OF SWEDEN	5,170,000.00	5,949,573.96	
	GOV OF SWEDEN	4,240,000.00	4,582,583.52	
	GOV OF SWEDEN	3,580,000.00	3,828,779.92	
	GOV OF SWEDEN	3,340,000.00	3,577,724.50	
	GOV OF SWEDEN	3,470,000.00	5,456,028.82	
	スウェーデンクローナ 小計	40,770,000.00	45,914,677.48 (523,427,323)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,410,000.00	6,636,860.14	
	GOV OF NORWAY	5,300,000.00	5,421,688.00	
	GOV OF NORWAY	3,800,000.00	4,069,295.35	
	GOV OF NORWAY	2,540,000.00	2,599,207.40	
	GOV OF NORWAY	2,690,000.00	2,720,935.00	
	GOV OF NORWAY	2,850,000.00	2,924,328.00	
	GOV OF NORWAY	2,680,000.00	2,804,620.00	
	GOV OF NORWAY	2,160,000.00	2,218,838.40	
	ノルウェークローネ 小計	28,430,000.00	29,395,772.29 (349,515,732)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,350,000.00	5,739,173.98	
	GOV OF DENMARK	1,430,000.00	1,469,442.83	
	GOV OF DENMARK	4,780,000.00	5,185,745.52	
	GOV OF DENMARK	4,850,000.00	5,512,971.72	
	GOV OF DENMARK	6,440,000.00	6,915,909.56	
	GOV OF DENMARK	3,300,000.00	3,559,974.00	
	GOV OF DENMARK	9,990,000.00	19,117,823.04	

	デンマーククローネ 小計	36,140,000.00	47,501,040.65 (764,291,744)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,400,000.00	1,413,090.00
	GOV OF POLAND	650,000.00	637,961.87
	GOV OF POLAND	2,580,000.00	2,594,819.52
	GOV OF POLAND	1,710,000.00	1,847,432.70
	GOV OF POLAND	2,230,000.00	2,270,491.44
	GOV OF POLAND	1,440,000.00	1,604,037.60
	GOV OF POLAND	1,840,000.00	1,890,758.97
	GOV OF POLAND	2,240,000.00	2,436,268.80
	GOV OF POLAND	1,700,000.00	1,755,503.30
	GOV OF POLAND	1,630,000.00	1,668,252.02
	GOV OF POLAND	2,210,000.00	2,380,435.20
	GOV OF POLAND	2,540,000.00	2,638,062.28
	GOV OF POLAND	2,060,000.00	2,143,236.56
	GOV OF POLAND	2,210,000.00	2,342,745.86
	GOV OF POLAND	640,000.00	856,736.00
	GOV OF POLAND	1,250,000.00	1,335,384.62
		ポーランドズロチ 小計	28,330,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,920,000.00	2,056,044.28
	GOV OF AUSTRALIA	1,360,000.00	1,394,269.28
	GOV OF AUSTRALIA	1,690,000.00	1,908,633.42
	GOV OF AUSTRALIA	1,350,000.00	1,410,591.91
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	2,027,405.79
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	2,333,130.55
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,330,922.46
	GOV OF AUSTRALIA	2,480,000.00	2,987,081.13
	GOV OF AUSTRALIA	2,110,000.00	2,668,444.41
	GOV OF AUSTRALIA	1,980,000.00	2,233,528.70
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,261,156.22
	GOV OF AUSTRALIA	1,900,000.00	2,161,197.94
	GOV OF AUSTRALIA	1,970,000.00	2,337,426.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,000,000.00	2,299,896.80
	GOV OF AUSTRALIA	1,850,000.00	2,092,802.88

	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,033,112.58
	GOV OF AUSTRALIA	1,090,000.00	1,522,674.73
	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	606,190.33
	GOV OF AUSTRALIA	990,000.00	1,333,614.73
	GOV OF AUSTRALIA	620,000.00	795,454.91
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	431,038.97
	GOV OF AUSTRALIA	960,000.00	1,218,925.63
	オーストラリアドル 小計	34,180,000.00	39,443,544.51 (2,926,711,002)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	550,000.00	555,824.11
	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	686,474.10
	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	221,100.00
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	385,651.00
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	503,100.00
	GOV OF SINGAPORE	470,000.00	489,270.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	294,844.94
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	573,885.00
	GOV OF SINGAPORE	240,000.00	249,288.00
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	236,555.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	707,301.00
	GOV OF SINGAPORE	360,000.00	385,416.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	318,736.10
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	321,407.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	581,345.80
	GOV OF SINGAPORE	270,000.00	283,419.00
	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	236,256.32
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	396,725.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	556,632.65
	シンガポールドル 小計	7,490,000.00	7,983,231.02 (637,860,158)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	1,080,000.00	1,099,020.85
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	875,203.76
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,193,374.59
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	691,891.84
	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	564,853.85
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	967,893.06

	GOV OF MALAYSIA	940,000.00	950,330.50	
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	621,328.73	
	GOV OF MALAYSIA	900,000.00	918,669.60	
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	767,211.18	
	GOV OF MALAYSIA	550,000.00	571,742.16	
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	693,554.05	
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	822,625.92	
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	702,299.85	
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	328,035.95	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,229,196.69	
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,040,411.80	
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	90,468.28	
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,393,311.64	
	GOV OF MALAYSIA	1,380,000.00	1,407,292.94	
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	983,728.32	
	GOV OF MALAYSIA	460,000.00	497,094.44	
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	856,936.58	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,533,377.21	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,207,670.64	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	286,749.80	
	GOV OF MALAYSIA	650,000.00	736,076.38	
	GOV OF MALAYSIA	1,340,000.00	1,531,386.30	
	GOV OF MALAYSIA	290,000.00	330,977.60	
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	548,047.36	
	GOV OF MALAYSIA	1,140,000.00	1,313,537.07	
	マレーシアリングット 小計	25,560,000.00	26,754,298.94 (698,554,745)	
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	3,660,000.00	3,663,660.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	9,130,000.00	9,249,511.70	
	GOV OF SOUTH AFRICA	17,040,000.00	18,934,848.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	10,530,000.00	9,711,405.17	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,420,000.00	7,039,120.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	10,300,000.00	9,343,696.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,110,000.00	5,636,418.17	
	GOV OF SOUTH AFRICA	9,140,000.00	6,477,601.17	

	GOV OF SOUTH AFRICA	9,270,000.00	8,119,533.67	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,050,000.00	7,244,075.86	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,010,000.00	5,497,182.90	
	GOV OF SOUTH AFRICA	10,170,000.00	8,797,326.62	
	GOV OF SOUTH AFRICA	17,890,000.00	15,440,859.00	
	南アフリカランド 小計	127,720,000.00	115,155,238.76 (853,300,319)	
	合計		149,419,877,324 (149,419,877,324)	

(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 221銘柄	100.0%	48.1%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 299銘柄	100.0%	37.4%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.5%
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 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7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 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	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%	0.6%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2019年12月10日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	42,074,255
コール・ローン	17,904,297
投資信託受益証券	5,542,494,632
未収入金	53,034,000
流動資産合計	5,655,507,184
資産合計	5,655,507,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,262
未払金	60,595,403
未払解約金	4,730,000
未払利息	48
その他未払費用	10
流動負債合計	65,346,723
負債合計	65,346,723
純資産の部	
元本等	
元本	5,094,482,726
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	495,677,735
元本等合計	5,590,160,461
純資産合計	5,590,160,461
負債純資産合計	5,655,507,184

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	2,646,201,057円
期中追加設定元本額	3,732,687,591円
期中一部解約元本額	1,284,405,922円
期末元本額	5,094,482,726円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	521,618,184円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	389,490,237円
りそなラップ型ファンド(成長型)	182,268,008円
DCりそな グローバルバランス	7,658,365円
つみたてバランスファンド	224,400,145円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	88,751,965円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	40,402,495円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	23,948,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	647,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	557,691円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	269,245円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	243,174円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	117,351,826円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	2,097,175,741円
Smart-i 8資産バランス 安定型	9,978,955円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	28,457,062円
Smart-i 8資産バランス 成長型	32,047,104円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	102,835,485円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	323,359,686円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	577,601,665円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	324,912,778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)	507,550円
2. 計算日における受益権の総数	5,094,482,726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	1.0973円
(10,000口当たり純資産額)	(10,973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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		63,950,428
合計		63,950,428

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	56,926,504	-	56,905,242	21,262
	米ドル	56,926,504	-	56,905,242	21,262
	合計	56,926,504	-	56,905,242	21,262

(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
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	9,235	558,717.50	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	1,518,034	50,444,269.82	
		米ドル 小計	1,527,269	51,002,987.32 (5,542,494,632)	
合計				5,542,494,632 (5,542,494,632)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2019年12月10日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	6,579,391,590
コール・ローン	264,768,783
株式	40,302,156,374
投資証券	1,142,467,615
派生商品評価勘定	244,758,571
未収入金	50,000
未収配当金	63,065,086
差入委託証拠金	1,032,575,036
流動資産合計	49,629,233,055
資産合計	
49,629,233,055	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	329,570
未払解約金	208,111,000
未払利息	718
その他未払費用	266
流動負債合計	208,441,554
負債合計	
208,441,554	
純資産の部	
元本等	
元本	36,779,158,435
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,641,633,066
元本等合計	49,420,791,501
純資産合計	49,420,791,501
負債純資産合計	49,629,233,055

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
--------------------	----

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	9,858,639,925円
期中追加設定元本額	37,857,223,240円
期中一部解約元本額	10,936,704,730円
期末元本額	36,779,158,435円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,498,978,929円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,696,343,422円
りそなラップ型ファンド(成長型)	3,255,679,208円
DCりそな グローバルバランス	12,367,883円
つみたてバランスファンド	729,981,336円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	400,871,484円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	182,570,755円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	107,108,667円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,804,971円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,480,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,186,828円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,064,518円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	18,040,003円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	1,735,361円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	12,965,604,902円
Smart-i 先進国株式インデックス	1,498,652,323円
Smart-i 8資産バランス 安定型	41,253,108円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	122,802,728円
Smart-i 8資産バランス 成長型	147,492,546円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,001,762,714円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,127,364,513円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	5,648,545,884円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	3,171,342,755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）	3,900,207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）	139,222,413円
2. 計算日における受益権の総数	36,779,158,435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	1.3437円
(10,000口当たり純資産額)	(13,437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）

金融商品の状況に関する事項

2019年12月10日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお

ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		3,558,603,845
投資証券		77,791,472
合計		3,636,395,317

（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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,757,176,919	-	8,001,558,105	244,381,186
	合計	7,757,176,919	-	8,001,558,105	244,381,186

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	96,725,125	-	96,772,940	47,815
	米ドル	58,537,573	-	58,560,110	22,537
	カナダドル	4,509,731	-	4,512,200	2,469
	ユーロ	12,731,394	-	12,743,320	11,926
	英ポンド	9,424,076	-	9,428,760	4,684
	スイスフラン	4,392,382	-	4,398,400	6,018
	スウェーデンク ローナ	1,368,036	-	1,368,000	36
	ノルウェークロー ネ	118,857	-	118,800	57
	デンマーククロー ネ	1,125,537	-	1,126,300	763
	オーストラリアド ル	3,338,343	-	3,338,100	243
	香港ドル	1,179,196	-	1,178,950	246
	合計	96,725,125	-	96,772,940	47,815

(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	APACHE CORP	2,974	20.63	61,353.62	
	BAKER HUGHES COMPANY	6,688	22.25	148,808.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	4,462	16.11	71,882.82	
	CHENIERE ENERGY INC	2,413	60.02	144,828.26	
	CHEVRON CORP	18,034	117.30	2,115,388.20	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	76.58	137,614.26	
	CONOCOPHILLIPS	10,963	61.83	677,842.29	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	33.17	12,637.77	
	DEVON ENERGY CORP	3,284	23.15	76,024.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	83.78	138,823.46	
	EOG RESOURCES INC	5,698	74.51	424,557.98	
	EXXON MOBIL CORP	40,849	69.66	2,845,541.34	
	HALLIBURTON CO	7,683	22.57	173,405.31	
	HESS CORP	2,840	61.75	175,370.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	49.41	84,342.87	
KINDER MORGAN INC	20,081	19.94	400,415.14		

MARATHON OIL CORP	6,470	12.59	81,457.30
MARATHON PETROLEUM CORP	6,558	58.43	383,183.94
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	23.05	70,371.65
NOBLE ENERGY INC	5,029	21.81	109,682.49
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,884	37.34	331,728.56
ONEOK INC	4,138	72.20	298,763.60
PHILLIPS 66	4,437	111.96	496,766.52
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,751	133.19	233,215.69
SCHLUMBERGER LTD	13,564	37.16	504,038.24
TARGA RESOURCES CORP	1,839	36.39	66,921.21
TECHNIPFMC PLC	3,213	18.85	60,565.05
VALERO ENERGY CORP	4,114	92.52	380,627.28
WILLIAMS COS INC	12,256	22.90	280,662.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,136	230.82	493,031.52
ALBEMARLE CORP	669	64.72	43,297.68
AMCOR PLC	17,320	10.43	180,647.60
AVERY DENNISON CORP	757	130.09	98,478.13
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	30.22	50,950.92
BALL CORP	2,772	64.13	177,768.36
CELANESE CORP	1,133	123.86	140,333.38
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	45.40	70,597.00
CORTEVA INC	6,565	25.77	169,180.05
CROWN HOLDINGS INC	1,469	73.82	108,441.58
DOW INC	7,349	53.27	391,481.23
DUPONT DE NEMOURS INC	7,311	63.84	466,734.24
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	77.41	96,220.63
ECOLAB INC	2,525	185.20	467,630.00
FMC CORP	1,380	99.19	136,882.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	13,013	12.10	157,457.30
INTERNATIONAL PAPER CO	3,372	47.42	159,900.24
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	909	133.81	121,633.29
LINDE PLC	5,170	205.33	1,061,556.10
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,702	92.02	248,638.04
MARTIN MARIETTA MATERIALS	557	270.84	150,857.88
MOSAIC CO/THE	3,288	18.74	61,617.12

NEWMONT GOLDCORP CORP	8,135	39.72	323,122.20
NUCOR CORP	3,180	57.75	183,645.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	113.54	96,281.92
PPG INDUSTRIES INC	2,351	132.98	312,635.98
RPM INTERNATIONAL INC	1,390	74.41	103,429.90
SEALED AIR CORP	1,397	38.93	54,385.21
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	809	576.57	466,445.13
STEEL DYNAMICS INC	2,352	35.07	82,484.64
VULCAN MATERIALS CO	1,164	142.46	165,823.44
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	68.87	11,294.68
WESTROCK CO	2,274	40.89	92,983.86
3M CO	5,548	169.83	942,216.84
ACUITY BRANDS INC	445	133.01	59,189.45
AERCAP HOLDINGS NV	853	60.72	51,794.16
ALLEGION PLC	839	124.09	104,111.51
AMETEK INC	1,991	98.33	195,775.03
ARCONIC INC	3,134	30.79	96,495.86
BOEING CO/THE	5,202	351.21	1,826,994.42
CATERPILLAR INC	5,474	142.83	781,851.42
CUMMINS INC	1,575	181.04	285,138.00
DEERE & CO	2,917	167.90	489,764.30
DOVER CORP	1,297	112.50	145,912.50
EATON CORP PLC	4,146	92.76	384,582.96
EMERSON ELECTRIC CO	5,983	75.16	449,682.28
FASTENAL CO	5,025	36.11	181,452.75
FLOWSERVE CORP	1,171	47.85	56,032.35
FORTIVE CORP	2,633	74.14	195,210.62
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	64.10	70,766.40
GENERAL DYNAMICS CORP	2,389	183.17	437,593.13
GENERAL ELECTRIC CO	83,141	10.99	913,719.59
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	40.00	60,960.00
HEICO CORP	242	122.98	29,761.16
HEICO CORP-CLASS A	819	95.05	77,845.95
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	6,910	174.49	1,205,725.90
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	432	253.23	109,395.36

IDEX CORP	788	162.82	128,302.16
ILLINOIS TOOL WORKS	3,147	174.43	548,931.21
INGERSOLL-RAND PLC	2,385	131.31	313,174.35
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	85.84	92,621.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	55.00	121,000.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	31.33	72,059.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,843	42.00	329,406.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,153	193.62	416,863.86
LENNOX INTERNATIONAL INC	367	260.59	95,636.53
LOCKHEED MARTIN CORP	2,426	383.34	929,982.84
MASCO CORP	3,055	45.98	140,468.90
MIDDLEBY CORP	299	110.62	33,075.38
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,558	343.05	534,471.90
OWENS CORNING	860	65.06	55,951.60
PACCAR INC	3,453	81.07	279,934.71
PARKER HANNIFIN CORP	1,114	201.47	224,437.58
PENTAIR PLC	1,289	45.05	58,069.45
RAYTHEON COMPANY	2,697	216.53	583,981.41
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,038	198.76	206,312.88
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,019	344.33	350,872.27
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	51.36	86,387.52
SMITH (A.O.) CORP	762	45.38	34,579.56
SNAP-ON INC	437	165.74	72,428.38
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,077	83.88	90,338.76
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,320	158.59	209,338.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	390	342.39	133,532.10
TEXTRON INC	2,450	44.41	108,804.50
TRANSDIGM GROUP INC	477	564.01	269,032.77
UNITED RENTALS INC	621	155.86	96,789.06
UNITED TECHNOLOGIES CORP	7,786	146.22	1,138,468.92
WABCO HOLDINGS INC	536	134.75	72,226.00
WABTEC CORP	1,937	75.01	145,294.37
WW GRAINGER INC	490	324.31	158,911.90
XYLEM INC	1,606	75.40	121,092.40
CINTAS CORP	937	253.81	237,819.97

COPART INC	1,839	88.20	162,199.80
COSTAR GROUP INC	321	594.92	190,969.32
EQUIFAX INC	966	137.66	132,979.56
IHS MARKIT LTD	3,294	73.11	240,824.34
MANPOWERGROUP INC	288	94.74	27,285.12
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	19.99	54,632.67
REPUBLIC SERVICES INC	2,301	88.68	204,052.68
ROBERT HALF INTL INC	673	60.03	40,400.19
ROLLINS INC	1,190	34.61	41,185.90
TRANSUNION	1,685	85.34	143,797.90
VERISK ANALYTICS INC	1,353	147.47	199,526.91
WASTE CONNECTIONS INC	2,708	90.39	244,776.12
WASTE MANAGEMENT INC	4,184	111.77	467,645.68
AMERCO	106	357.80	37,926.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	27.49	5,443.02
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	973	76.27	74,210.71
CSX CORP	7,564	70.41	532,581.24
DELTA AIR LINES INC	1,316	55.80	73,432.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,790	74.38	133,140.20
FEDEX CORP	2,427	156.51	379,849.77
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	114.49	84,035.66
KANSAS CITY SOUTHERN	1,094	151.37	165,598.78
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	37.76	39,421.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,634	188.96	497,720.64
OLD DOMINION FREIGHT LINE	521	186.86	97,354.06
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,459	55.47	80,930.73
UBER TECHNOLOGIES INC	1,082	27.68	29,949.76
UNION PACIFIC CORP	6,759	171.36	1,158,222.24
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	364	87.61	31,890.04
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	6,747	118.14	797,090.58
XPO LOGISTICS INC	977	82.55	80,651.35
APTIV PLC	2,746	92.96	255,268.16
AUTOLIV INC	743	81.87	60,829.41
BORGWARNER INC	2,199	43.35	95,326.65
FORD MOTOR CO	38,960	9.01	351,029.60

GENERAL MOTORS CO	12,516	35.38	442,816.08
HARLEY-DAVIDSON INC	1,270	36.72	46,634.40
LEAR CORP	352	125.40	44,140.80
TESLA INC	1,283	339.53	435,616.99
CAPRI HOLDINGS LTD	1,619	38.49	62,315.31
DR HORTON INC	3,205	54.89	175,922.45
GARMIN LTD	1,217	97.00	118,049.00
HANESBRANDS INC	4,021	15.27	61,400.67
HASBRO INC	1,095	100.70	110,266.50
LEGGETT & PLATT INC	1,466	52.15	76,451.90
LENNAR CORP-A	2,614	59.40	155,271.60
LULULEMON ATHLETICA INC	984	230.88	227,185.92
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	138.88	78,328.32
NEWELL RUBBERMAID INC	4,193	19.13	80,212.09
NIKE INC -CL B	11,985	96.63	1,158,110.55
NVR INC	36	3,804.10	136,947.60
POLARIS INC	641	96.30	61,728.30
PULTEGROUP INC	2,237	40.16	89,837.92
PVH CORP	792	102.27	80,997.84
RALPH LAUREN CORP	478	113.25	54,133.50
TAPESTRY INC	2,976	25.80	76,780.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	19.27	7,881.43
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,055	17.69	18,662.95
VF CORP	3,495	90.85	317,520.75
WHIRLPOOL CORP	686	146.22	100,306.92
ARAMARK	2,216	42.28	93,692.48
CARNIVAL CORP	3,704	45.41	168,198.64
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	231	827.03	191,043.93
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	118.10	130,264.30
DOMINO'S PIZZA INC	290	286.37	83,047.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,797	104.75	292,985.75
LAS VEGAS SANDS CORP	2,934	64.17	188,274.78
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,835	141.35	400,727.25
MCDONALD'S CORP	7,287	194.68	1,418,633.16
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	21.14	23,254.00

MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	31.86	146,173.68
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	1,591	54.86	87,282.26
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	121.82	191,013.76
STARBUCKS CORP	11,629	86.28	1,003,350.12
VAIL RESORTS INC	293	230.83	67,633.19
WYNN RESORTS LTD	1,017	120.39	122,436.63
YUM! BRANDS INC	3,160	98.98	312,776.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	7,611	54.39	413,962.29
ALPHABET INC-CL A	2,894	1,342.99	3,886,613.06
ALPHABET INC-CL C	3,019	1,343.56	4,056,207.64
ALTICE USA INC- A	872	25.72	22,427.84
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,532	468.66	717,987.12
COMCAST CORP-CLASS A	43,060	43.89	1,889,903.40
DISCOVERY INC - A	1,722	32.02	55,138.44
DISCOVERY INC-C	3,336	29.93	99,846.48
DISH NETWORK CORP-A	2,183	33.51	73,152.33
ELECTRONIC ARTS INC	3,020	102.03	308,130.60
FACEBOOK INC-A	23,195	201.34	4,670,081.30
FOX CORP - CLASS A	3,760	35.62	133,931.20
FOX CORP- CLASS B	1,836	34.79	63,874.44
IAC/INTERACTIVECORP	827	215.30	178,053.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	22.39	82,596.71
LIBERTY BROADBAND-C	1,134	120.05	136,136.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	21.58	28,183.48
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	20.60	72,161.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	44.80	96,454.40
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	47.29	83,088.53
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	47.42	44,859.32
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	69.05	107,994.20
MATCH GROUP INC	610	67.81	41,364.10
NETFLIX INC	4,182	302.50	1,265,055.00
NEWS CORP - CLASS A	2,810	13.23	37,176.30
OMNICOM GROUP	1,964	80.06	157,237.84
PINTEREST INC- CLASS A	1,570	18.21	28,589.70
ROKU INC	751	145.54	109,300.54

SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,406	6.87	105,839.22
SNAP INC - A	6,244	14.23	88,852.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,194	120.06	143,351.64
TRIPADVISOR INC	467	28.84	13,468.28
TWITTER INC	7,784	30.21	235,154.64
VIACOMCBS INC - CLASS B	4,599	38.64	177,705.36
WALT DISNEY CO/THE	17,399	146.21	2,543,907.79
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	40.78	57,418.24
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	151.57	88,971.59
AMAZON.COM INC	4,041	1,749.51	7,069,769.91
AUTOZONE INC	214	1,169.00	250,166.00
BEST BUY CO INC	2,167	82.57	178,929.19
BOOKING HOLDINGS INC	415	1,905.79	790,902.85
BURLINGTON STORES INC	580	223.65	129,717.00
CARMAX INC	1,734	96.69	167,660.46
DOLLAR GENERAL CORP	2,530	154.82	391,694.60
DOLLAR TREE INC	2,390	93.20	222,748.00
EBAY INC	8,264	34.57	285,686.48
EXPEDIA GROUP INC	1,470	108.80	159,936.00
GAP INC/THE	2,396	16.38	39,246.48
GENUINE PARTS CO	1,255	103.88	130,369.40
GRUBHUB INC	988	39.57	39,095.16
HOME DEPOT INC	10,388	216.53	2,249,313.64
KOHL'S CORP	1,564	48.71	76,182.44
LKQ CORP	2,845	35.62	101,338.90
LOWE'S COS INC	7,598	117.87	895,576.26
MERCADOLIBRE INC	468	584.56	273,574.08
NORDSTROM INC	1,281	38.91	49,843.71
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	774	439.73	340,351.02
ROSS STORES INC	3,602	115.06	414,446.12
TARGET CORP	4,939	126.45	624,536.55
TIFFANY & CO	1,146	133.48	152,968.08
TJX COMPANIES INC	11,659	60.36	703,737.24
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,093	97.53	106,600.29
ULTA BEAUTY INC	498	252.64	125,814.72

WAYFAIR INC- CLASS A	341	88.18	30,069.38
COSTCO WHOLESALE CORP	4,204	295.16	1,240,852.64
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	5.95	595.00
KROGER CO	7,202	27.84	200,503.68
SYSCO CORP	4,854	83.13	403,513.02
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,653	58.71	449,307.63
WALMART INC	13,652	119.36	1,629,502.72
ALTRIA GROUP INC	17,753	50.53	897,059.09
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,846	44.07	213,563.22
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,048	63.75	194,310.00
BUNGE LTD	1,423	53.40	75,988.20
CAMPBELL SOUP CO	1,739	48.24	83,889.36
COCA-COLA CO/THE	39,225	54.07	2,120,895.75
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,132	49.57	105,683.24
CONAGRA BRANDS INC	3,745	29.30	109,728.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,697	181.27	307,615.19
GENERAL MILLS INC	6,121	53.16	325,392.36
HERSHEY CO/THE	1,287	149.54	192,457.98
HORMEL FOODS CORP	2,963	45.36	134,401.68
INGREDION INC	744	86.38	64,266.72
JM SMUCKER CO/THE	1,011	106.53	107,701.83
KELLOGG CO	2,259	66.54	150,313.86
KRAFT HEINZ CO/THE	6,634	31.93	211,823.62
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	84.16	109,408.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,212	172.74	209,360.88
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,463	51.53	75,388.39
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	13,703	54.17	742,291.51
MONSTER BEVERAGE CORP	4,007	60.49	242,383.43
PEPSICO INC	13,215	137.16	1,812,569.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	14,706	83.59	1,229,274.54
TYSON FOODS INC-CL A	2,541	89.67	227,851.47
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,420	70.35	170,247.00
CLOROX COMPANY	1,326	152.75	202,546.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,768	68.60	532,884.80
COTY INC-CL A	2,506	11.82	29,620.92

ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,098	198.70	416,872.60
KIMBERLY-CLARK CORP	3,284	136.98	449,842.32
PROCTER & GAMBLE CO/THE	24,161	124.87	3,016,984.07
ABBOTT LABORATORIES	16,786	83.87	1,407,841.82
ABIOMED INC	526	181.69	95,568.94
ALIGN TECHNOLOGY INC	758	273.46	207,282.68
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,599	86.39	138,137.61
ANTHEM INC	2,451	282.33	691,990.83
BAXTER INTERNATIONAL INC	4,690	81.55	382,469.50
BECTON DICKINSON AND CO	2,577	257.90	664,608.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	13,316	43.71	582,042.36
CARDINAL HEALTH INC	3,013	54.34	163,726.42
CENTENE CORP	4,078	59.17	241,295.26
CERNER CORP	2,794	71.44	199,603.36
CIGNA CORP	3,616	195.95	708,555.20
COOPER COS INC/THE	433	302.26	130,878.58
CVS HEALTH CORP	12,334	74.99	924,926.66
DANAHER CORP	6,122	147.53	903,178.66
DAVITA INC	908	72.11	65,475.88
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	57.32	117,391.36
DEXCOM INC	908	221.00	200,668.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,003	234.29	469,282.87
HCA HEALTHCARE INC	2,653	142.84	378,954.52
HENRY SCHEIN INC	1,305	68.68	89,627.40
HOLOGIC INC	2,830	52.10	147,443.00
HUMANA INC	1,301	342.28	445,306.28
IDEXX LABORATORIES INC	917	249.02	228,351.34
INSULET CORP	650	180.66	117,429.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,103	573.17	632,206.51
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	994	169.08	168,065.52
MCKESSON CORP	1,937	142.88	276,758.56
MEDTRONIC PLC	13,090	111.13	1,454,691.70
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,176	105.23	123,750.48
RESMED INC	1,425	149.32	212,781.00
STERIS PLC	740	152.54	112,879.60

STRYKER CORP	3,212	200.40	643,684.80
TELEFLEX INC	404	357.01	144,232.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,178	277.54	2,547,262.12
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	143.72	93,849.16
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	716	138.99	99,516.84
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,277	143.55	183,313.35
WELLCARE HEALTH PLANS INC	536	317.74	170,308.64
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	780	144.73	112,889.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,004	146.72	294,026.88
ABBVIE INC	14,069	86.44	1,216,124.36
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,714	81.62	221,516.68
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,213	112.48	248,918.24
ALLERGAN PLC	3,137	185.27	581,191.99
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,123	120.71	135,557.33
AMGEN INC	5,768	232.82	1,342,905.76
BEIGENE LTD-ADR	500	182.55	91,275.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	230	357.61	82,250.30
BIOGEN INC	1,859	295.55	549,427.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,903	78.90	150,146.70
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,201	61.28	1,360,477.28
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	2,430	26.85	65,245.50
ELI LILLY & CO	8,292	120.24	997,030.08
EXACT SCIENCES CORP	1,138	84.19	95,808.22
GILEAD SCIENCES INC	12,101	66.93	809,919.93
ILLUMINA INC	1,416	326.59	462,451.44
INCYTE CORP	1,948	94.79	184,650.92
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,483	63.24	93,784.92
IQVIA HOLDINGS INC	1,437	146.40	210,376.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	575	151.34	87,020.50
JOHNSON & JOHNSON	25,444	140.50	3,574,882.00
MERCK & CO. INC.	24,814	88.72	2,201,498.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	249	756.98	188,488.02
MYLAN NV	4,542	19.02	86,388.84
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	930	113.75	105,787.50
PERKINELMER INC	1,125	93.66	105,367.50

PERRIGO CO PLC	998	52.99	52,884.02
PFIZER INC	53,643	38.32	2,055,599.76
REGENERON PHARMACEUTICALS	855	365.63	312,613.65
SAREPTA THERAPEUTICS INC	791	105.75	83,648.25
SEATTLE GENETICS INC	1,145	114.13	130,678.85
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,561	9.82	93,889.02
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,787	316.43	1,198,320.41
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,456	219.37	538,772.72
WATERS CORP	535	226.63	121,247.05
ZOETIS INC	4,586	121.23	555,960.78
BANK OF AMERICA CORP	84,974	33.51	2,847,478.74
CITIGROUP INC	21,819	75.33	1,643,625.27
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	38.95	140,999.00
COMERICA INC	1,325	70.75	93,743.75
EAST WEST BANCORP INC	1,540	46.19	71,132.60
FIFTH THIRD BANCORP	7,261	30.23	219,500.03
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,674	112.78	188,793.72
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	15.28	137,397.76
JPMORGAN CHASE & CO	30,480	134.41	4,096,816.80
KEYCORP	8,597	19.64	168,845.08
M & T BANK CORP	1,286	166.74	214,427.64
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	16.50	56,479.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,304	153.70	661,524.80
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	17.07	148,082.25
SIGNATURE BANK	590	126.14	74,422.60
SVB FINANCIAL GROUP	416	236.36	98,325.76
TRUIST FINANCIAL CORP	12,977	54.72	710,101.44
US BANCORP	14,362	60.00	861,720.00
WELLS FARGO & CO	40,213	53.92	2,168,284.96
ZIONS BANCORPORATION	1,842	49.66	91,473.72
ALLY FINANCIAL INC	3,571	31.60	112,843.60
AMERICAN EXPRESS CO	6,840	120.46	823,946.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,113	164.82	183,444.66
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	4,443	24.52	108,942.36
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,531	49.70	423,990.70

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	12,710	221.38	2,813,739.80
BLACKROCK INC	1,139	497.07	566,162.73
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	6,800	54.14	368,152.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,632	102.21	473,436.72
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,220	119.66	145,985.20
CME GROUP INC	3,467	204.99	710,700.33
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	84.21	235,788.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	45.54	88,484.22
EATON VANCE CORP	1,192	46.92	55,928.64
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	269.85	92,828.40
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	27.02	73,980.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,198	221.81	709,348.38
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,520	92.88	512,697.60
INVESCO LTD	2,612	16.66	43,515.92
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,716	21.00	57,036.00
KKR & CO INC -A	4,300	28.99	124,657.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	339	367.02	124,419.78
MOODY'S CORP	1,709	230.55	394,009.95
MORGAN STANLEY	12,326	49.60	611,369.60
MSCI INC	709	263.53	186,842.77
NASDAQ INC	1,056	104.64	110,499.84
NORTHERN TRUST CORP	2,155	109.14	235,196.70
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	89.47	94,211.91
S&P GLOBAL INC	2,399	272.06	652,671.94
SCHWAB (CHARLES) CORP	11,839	48.95	579,519.05
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,314	64.43	84,661.02
STATE STREET CORP	3,261	77.67	253,281.87
SYNCHRONY FINANCIAL	5,445	37.56	204,514.20
T ROWE PRICE GROUP INC	2,440	124.50	303,780.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,487	51.09	127,060.83
VOYA FINANCIAL INC	845	58.21	49,187.45
AFLAC INC	7,299	53.05	387,211.95
ALLEGHANY CORP	153	792.09	121,189.77
ALLSTATE CORP	3,237	111.32	360,342.84
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	110.79	85,973.04

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,391	51.58	432,807.78
AON PLC	2,353	205.51	483,565.03
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,543	41.45	146,857.35
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,873	94.15	176,342.95
ASSURANT INC	506	130.93	66,250.58
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	44.22	56,159.40
BROWN & BROWN INC	2,556	38.22	97,690.32
CHUBB LTD	4,418	153.00	675,954.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,571	106.26	166,934.46
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	168.63	24,619.98
EVEREST RE GROUP LTD	313	271.56	84,998.28
FNF GROUP	2,799	47.42	132,728.58
GLOBE LIFE INC	921	103.91	95,701.11
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,122	61.04	190,566.88
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	57.92	119,315.20
LOEWS CORP	2,419	50.33	121,748.27
MARKEL CORP	141	1,131.68	159,566.88
MARSH & MCLENNAN COS	4,991	108.34	540,724.94
METLIFE INC	7,927	49.57	392,941.39
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	53.25	130,409.25
PROGRESSIVE CORP	5,771	73.34	423,245.14
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,987	92.80	369,993.60
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	164.42	77,277.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	357	192.59	68,754.63
TRAVELERS COS INC/THE	2,614	135.45	354,066.30
UNUM GROUP	1,141	29.61	33,785.01
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,307	194.79	254,590.53
WR BERKLEY CORP	1,291	70.15	90,563.65
CBRE GROUP INC - A	2,702	58.28	157,472.56
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,000	5.53	71,890.00
JONES LANG LASALLE INC	468	168.98	79,082.64
ACCENTURE PLC-CL A	6,093	202.03	1,230,968.79
ADOBE INC	4,638	307.05	1,424,097.90
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,691	84.11	142,230.01
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	105.41	27,301.19

ANSYS INC	731	255.08	186,463.48
AUTODESK INC	2,179	178.83	389,670.57
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,210	169.07	711,784.70
BLACK KNIGHT INC	1,600	63.08	100,928.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,500	70.94	106,410.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,021	121.19	123,734.99
CADENCE DESIGN SYS INC	2,442	66.03	161,245.26
CDK GLOBAL INC	1,236	54.01	66,756.36
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,040	113.47	118,008.80
CITRIX SYSTEMS INC	1,337	110.33	147,511.21
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,640	61.88	349,003.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	547	119.51	65,371.97
DOCUSIGN INC	1,080	75.46	81,496.80
DROPBOX INC-CLASS A	1,047	18.09	18,940.23
DXC TECHNOLOGY CO	2,725	36.36	99,081.00
EPAM SYSTEMS INC	480	208.81	100,228.80
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	5,905	136.96	808,748.80
FISERV INC	5,506	114.75	631,813.50
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	917	302.62	277,502.54
FORTINET INC	1,474	103.85	153,074.90
GARTNER INC	792	157.56	124,787.52
GLOBAL PAYMENTS INC	2,910	175.18	509,773.80
GODADDY INC - CLASS A	1,543	66.80	103,072.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	880	108.19	95,207.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,443	133.92	1,130,686.56
INTUIT INC	2,474	255.77	632,774.98
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	784	148.87	116,714.08
LEIDOS HOLDINGS INC	1,229	90.10	110,732.90
MASTERCARD INC-CLASS A	8,739	289.06	2,526,095.34
MICROSOFT CORP	69,685	151.36	10,547,521.60
MONGODB INC	444	131.01	58,168.44
NORTONLIFELOCK INC	6,279	25.40	159,486.60
OKTA INC	956	121.02	115,695.12
ORACLE CORP	22,635	55.31	1,251,941.85
PALO ALTO NETWORKS INC	829	225.86	187,237.94

PAYCHEX INC	3,176	84.69	268,975.44
PAYCOM SOFTWARE INC	437	268.80	117,465.60
PAYPAL HOLDINGS INC	10,577	103.78	1,097,681.06
PTC INC	1,110	76.09	84,459.90
RINGCENTRAL INC-CLASS A	770	165.82	127,681.40
SABRE CORP	2,780	22.43	62,355.40
SALESFORCE.COM INC	7,866	157.48	1,238,737.68
SERVICENOW INC	1,774	269.70	478,447.80
SPLUNK INC	1,310	149.75	196,172.50
SQUARE INC - A	3,596	67.06	241,147.76
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	59.18	118,419.18
SYNOPSYS INC	1,297	132.24	171,515.28
TWILIO INC - A	1,132	98.99	112,056.68
TYLER TECHNOLOGIES INC	410	285.35	116,993.50
VERISIGN INC	927	188.56	174,795.12
VISA INC-CLASS A SHARES	16,661	182.92	3,047,630.12
VMWARE INC-CLASS A	730	149.43	109,083.90
WESTERN UNION CO	3,785	26.93	101,930.05
WIX.COM LTD	437	118.64	51,845.68
WORKDAY INC-CLASS A	1,681	163.63	275,062.03
AMPHENOL CORP-CL A	2,939	104.46	307,007.94
APPLE INC	43,411	266.92	11,587,264.12
ARISTA NETWORKS INC	478	190.32	90,972.96
ARROW ELECTRONICS INC	902	82.18	74,126.36
CDW CORP/DE	1,294	134.34	173,835.96
CISCO SYSTEMS INC	40,568	43.90	1,780,935.20
COGNEX CORP	1,763	50.15	88,414.45
CORNING INC	6,803	28.51	193,953.53
DELL TECHNOLOGIES -C	1,389	47.65	66,185.85
F5 NETWORKS INC	613	137.28	84,152.64
FLEX LTD	4,584	11.18	51,249.12
FLIR SYSTEMS INC	1,041	53.18	55,360.38
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	11,709	15.89	186,056.01
HP INC	14,962	20.47	306,272.14
IPG PHOTONICS CORP	405	137.38	55,638.90

JUNIPER NETWORKS INC	3,271	23.92	78,242.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,002	101.72	203,643.44
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,630	161.50	263,245.00
NETAPP INC	2,203	60.53	133,347.59
SEAGATE TECHNOLOGY	2,560	57.12	146,227.20
TE CONNECTIVITY LTD	3,312	91.56	303,246.72
TRIMBLE INC	2,244	40.63	91,173.72
WESTERN DIGITAL CORP	3,193	48.06	153,455.58
XEROX HOLDINGS CORP	2,113	37.31	78,836.03
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	481	253.79	122,072.99
AT&T INC	70,632	38.04	2,686,841.28
CENTURYLINK INC	10,298	14.17	145,922.66
SPRINT CORP	4,378	5.40	23,641.20
T-MOBILE US INC	3,430	75.87	260,234.10
VERIZON COMMUNICATIONS INC	40,015	61.01	2,441,315.15
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,826	34.26	62,558.76
AES CORP	4,924	18.79	92,521.96
ALLIANT ENERGY CORP	2,420	52.88	127,969.60
AMEREN CORPORATION	2,557	74.95	191,647.15
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,773	91.86	438,447.78
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,575	122.48	192,906.00
AQUA AMERICA INC	2,300	45.37	104,351.00
ATMOS ENERGY CORP	921	106.31	97,911.51
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	25.04	98,958.08
CMS ENERGY CORP	2,881	61.28	176,547.68
CONSOLIDATED EDISON INC	3,461	86.56	299,584.16
DOMINION ENERGY INC	7,683	79.92	614,025.36
DTE ENERGY COMPANY	1,855	125.30	232,431.50
DUKE ENERGY CORP	6,979	89.28	623,085.12
EDISON INTERNATIONAL	3,602	71.01	255,778.02
ENTERGY CORP	2,089	118.18	246,878.02
EVERGY INC	2,180	62.26	135,726.80
EVERSOURCE ENERGY	3,272	80.72	264,115.84
EXELON CORP	9,399	44.93	422,297.07
FIRSTENERGY CORP	5,462	48.12	262,831.44

NEXTERA ENERGY INC	4,545	234.27	1,064,757.15	
NISOURCE INC	2,749	26.72	73,453.28	
NRG ENERGY INC	2,735	38.56	105,461.60	
OGE ENERGY CORP	2,132	42.53	90,673.96	
PINNACLE WEST CAPITAL	828	85.55	70,835.40	
PPL CORP	7,350	33.71	247,768.50	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,130	57.89	296,975.70	
SEMPRA ENERGY	2,664	145.83	388,491.12	
SOUTHERN CO/THE	9,965	61.44	612,249.60	
UGI CORP	1,566	43.40	67,964.40	
VISTRA ENERGY CORP	2,849	23.67	67,435.83	
WEC ENERGY GROUP INC	3,247	88.77	288,236.19	
XCEL ENERGY INC	5,255	61.73	324,391.15	
ADVANCED MICRO DEVICES	10,120	38.93	393,971.60	
ANALOG DEVICES INC	3,550	114.62	406,901.00	
APPLIED MATERIALS INC	8,927	56.60	505,268.20	
BROADCOM INC	3,889	314.38	1,222,623.82	
INTEL CORP	42,106	56.53	2,380,252.18	
KLA CORP	1,635	160.88	263,038.80	
LAM RESEARCH CORP	1,439	268.02	385,680.78	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,363	23.52	126,137.76	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,332	57.18	133,343.76	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,513	99.02	248,837.26	
MICRON TECHNOLOGY INC	10,573	46.45	491,115.85	
NVIDIA CORP	5,465	212.17	1,159,509.05	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,801	117.85	330,097.85	
ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	21.83	69,834.17	
QORVO INC	1,187	108.44	128,718.28	
QUALCOMM INC	11,499	84.92	976,495.08	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,715	103.23	177,039.45	
TERADYNE INC	1,820	63.52	115,606.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	8,870	122.00	1,082,140.00	
XILINX INC	2,482	91.08	226,060.56	
米ドル 小計	2,855,542		256,032,313.16	(27,823,031,471)

カナダドル	CAMECO CORP	2,464	12.07	29,740.48
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	12,036	39.10	470,607.60
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	12.18	125,904.66
	ENBRIDGE INC	19,566	51.35	1,004,714.10
	ENCANA CORP	8,507	5.41	46,022.87
	HUSKY ENERGY INC	1,391	9.49	13,200.59
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	33.17	95,430.09
	INTER PIPELINE LTD	3,471	22.32	77,472.72
	KEYERA CORP	2,259	32.65	73,756.35
	PARKLAND FUEL CORP	1,790	46.10	82,519.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	4,689	46.79	219,398.31
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	14.35	7,418.95
	SUNCOR ENERGY INC	15,448	42.00	648,816.00
	TC ENERGY CORP	9,133	67.53	616,751.49
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,566	78.48	201,379.68
	BARRICK GOLD CORP	17,954	22.28	400,015.12
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	57.02	95,394.46
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	13.52	57,960.24
	FRANCO-NEVADA CORP	1,646	128.52	211,543.92
	KINROSS GOLD CORP	10,281	5.61	57,676.41
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,324	53.77	124,961.48
	LUNDIN MINING CORP	7,300	7.45	54,385.00
	METHANEX CORP	131	48.23	6,318.13
	NUTRIEN LTD	5,955	62.06	369,567.30
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,095	20.81	126,836.95
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	55.02	18,431.70
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,359	35.85	156,270.15
	BOMBARDIER INC-B	8,071	1.94	15,657.74
	CAE INC	3,196	34.20	109,303.20
	WSP GLOBAL INC	1,265	86.50	109,422.50
	THOMSON REUTERS CORP	1,932	93.79	181,202.28
	AIR CANADA	840	48.87	41,050.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,986	117.79	822,880.94	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,397	324.65	453,536.05	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,323	70.41	233,972.43	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	38.81	69,858.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	2,857	87.33	249,501.81
STARS GROUP INC/THE	2,811	31.75	89,249.25
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.06	42,118.44
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,836	26.95	103,380.20
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	144.50	72,250.00
DOLLARAMA INC	3,427	44.53	152,604.31
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,787	43.42	381,531.54
EMPIRE CO LTD 'A'	864	35.66	30,810.24
LOBLAW COMPANIES LTD	1,439	71.96	103,550.44
METRO INC	2,618	57.42	150,325.56
WESTON (GEORGE) LTD	817	108.36	88,530.12
SAPUTO INC	2,462	40.00	98,480.00
AURORA CANNABIS INC	4,385	3.46	15,172.10
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	38.62	126,557.74
CANOPY GROWTH CORP	1,137	28.17	32,029.29
CRONOS GROUP INC	1,000	9.22	9,220.00
BANK OF MONTREAL	6,195	99.72	617,765.40
BANK OF NOVA SCOTIA	11,730	74.96	879,280.80
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,352	109.44	476,282.88
NATIONAL BANK OF CANADA	3,581	71.98	257,760.38
ROYAL BANK OF CANADA	13,639	104.45	1,424,593.55
TORONTO-DOMINION BANK	17,409	72.88	1,268,767.92
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	8,688	76.64	665,848.32
CI FINANCIAL CORP	775	21.90	16,972.50
IGM FINANCIAL INC	81	38.46	3,115.26
ONEX CORPORATION	908	79.45	72,140.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	253	598.57	151,438.21
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	33.16	61,213.36
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	68.64	86,074.56
INTACT FINANCIAL CORP	1,310	137.40	179,994.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	19,343	25.42	491,699.06
POWER CORP OF CANADA	3,492	31.70	110,696.40
POWER FINANCIAL CORP	2,751	33.18	91,278.18
SUN LIFE FINANCIAL INC	5,940	58.84	349,509.60

	FIRST CAPITAL REALTY INC	1,901	21.67	41,194.67
	BLACKBERRY LTD	1,407	7.20	10,130.40
	CGI INC	2,082	108.90	226,729.80
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	182	1,304.47	237,413.54
	OPEN TEXT CORP	2,603	56.12	146,080.36
	SHOPIFY INC - CLASS A	985	489.94	482,590.90
	BCE INC	1,698	64.45	109,436.10
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,406	64.02	218,052.12
	TELUS CORP	320	51.36	16,435.20
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,200	18.89	117,118.00
	ALTAGAS LTD	2,930	20.00	58,600.00
	ATCO LTD -CLASS I	863	50.96	43,978.48
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	39.87	39,351.69
	EMERA INC	2,389	55.32	132,159.48
	FORTIS INC	3,685	53.12	195,747.20
	HYDRO ONE LTD	3,481	26.20	91,202.20
	カナダドル 小計	368,358		18,545,339.85 (1,521,830,588)
ユーロ	ENI SPA	25,126	13.62	342,366.87
	GALP ENERGIA SGPS SA	4,618	14.51	67,007.18
	NESTE OYJ	3,878	28.46	110,367.88
	OMV AG	1,475	50.44	74,399.00
	REPSOL SA	12,998	14.46	187,951.08
	TENARIS SA	5,062	9.94	50,346.65
	TOTAL SA	22,816	47.58	1,085,699.36
	VOPAK	762	48.86	37,231.32
	AIR LIQUIDE SA	4,619	122.65	566,520.35
	AKZO NOBEL	2,036	89.69	182,608.84
	ARCELORMITTAL	7,467	16.12	120,382.97
	ARKEMA	810	96.30	78,003.00
	BASF SE	8,946	67.84	606,896.64
	COVESTRO AG	1,966	41.88	82,336.08
	CRH PLC	7,290	34.90	254,421.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	26.71	47,891.03
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	40.12	2,246.72

HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	67.06	92,676.92
KONINKLIJKE DSM NV	1,614	116.55	188,111.70
LANXESS AG	745	60.18	44,834.10
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	31.64	72,329.04
SOLVAY SA	860	102.90	88,494.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	12.04	67,592.56
SYMRISE AG	1,247	86.94	108,414.18
THYSSENKRUPP AG	2,040	11.46	23,378.40
UMICORE	2,263	41.43	93,756.09
UPM-KYMMENE OYJ	4,811	30.55	146,976.05
VOESTALPINE AG	712	24.83	17,678.96
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	34.86	100,222.50
AIRBUS SE	5,630	124.94	703,412.20
ALSTOM	1,911	40.56	77,510.16
ANDRITZ AG	352	36.32	12,784.64
BOUYGUES SA	1,779	37.55	66,801.45
BRENTAG AG	1,535	49.04	75,276.40
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	9.47	90,836.48
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,270	37.47	197,466.90
DASSAULT AVIATION SA	11	1,146.00	12,606.00
EIFFAGE	782	99.20	77,574.40
FERROVIAL SA	5,159	27.11	139,860.49
GEA GROUP AG	1,676	29.26	49,039.76
HOCHTIEF AG	17	112.60	1,914.20
KINGSPAN GROUP PLC	1,730	50.20	86,846.00
KION GROUP AG	740	62.68	46,383.20
KNORR-BREMSE AG	297	85.99	25,539.03
KONE OYJ-B	3,591	57.24	205,548.84
LEGRAND SA	2,388	73.38	175,231.44
LEONARDO SPA	3,148	10.38	32,676.24
METSO OYJ	751	34.06	25,579.06
MTU AERO ENGINES AG	522	264.80	138,225.60
PRYSMIAN SPA	1,283	20.92	26,840.36
SAFRAN SA	3,201	148.00	473,748.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,378	90.26	485,418.28

SIEMENS AG-REG	7,372	115.84	853,972.48
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	14.48	5,794.00
THALES SA	1,208	87.44	105,627.52
VINCI SA	4,974	97.94	487,153.56
WARTSILA OYJ ABP	2,705	9.27	25,086.17
BUREAU VERITAS SA	3,496	23.35	81,631.60
EDENRED	2,300	44.12	101,476.00
RANDSTAD NV	1,305	54.08	70,574.40
TELEPERFORMANCE	644	212.40	136,785.60
WOLTERS KLUWER	2,888	64.38	185,929.44
ADP	314	175.80	55,201.20
AENA SME SA	718	166.30	119,403.40
ATLANTIA SPA	5,155	20.30	104,646.50
BOLLORE	3,240	3.83	12,409.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	16.92	23,813.47
DEUTSCHE POST AG-REG	9,978	34.10	340,249.80
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	77.90	29,991.50
GETLINK	4,655	15.27	71,081.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,974	73.28	217,934.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	57.45	35,561.55
CONTINENTAL AG	1,037	116.76	121,080.12
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	8,964	49.11	440,266.86
FAURECIA	800	47.27	37,816.00
FERRARI NV	1,274	147.90	188,424.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	9,665	13.14	127,075.42
MICHELIN (CGDE)	1,535	108.05	165,856.75
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	24.06	10,177.38
PEUGEOT SA	5,130	21.11	108,294.30
PIRELLI & C SPA	1,734	5.10	8,843.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,723	67.10	115,613.30
RENAULT SA	1,817	41.86	76,068.70
VALEO SA	2,418	35.65	86,201.70
VOLKSWAGEN AG	194	174.70	33,891.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,863	176.48	328,782.24
ADIDAS AG	1,783	274.80	489,968.40

ESSILORLUXOTTICA	2,808	137.30	385,538.40
HERMES INTERNATIONAL	325	664.20	215,865.00
KERING	743	544.10	404,266.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,648	399.25	1,057,214.00
MONCLER SPA	2,163	41.79	90,391.77
PUMA SE	750	66.65	49,987.50
SEB SA	151	136.40	20,596.40
ACCOR SA	1,867	38.72	72,290.24
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	901	102.75	92,577.75
SODEXO	1,030	103.95	107,068.50
ALTICE EUROPE NV	7,300	5.13	37,449.00
AXEL SPRINGER SE	35	63.50	2,222.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	14.76	6,036.84
JC DECAUX SA	60	26.22	1,573.20
PUBLICIS GROUPE	1,962	40.00	78,480.00
SES	2,232	11.80	26,337.60
TELENET GROUP HOLDING NV	192	38.80	7,449.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	860	56.84	48,882.40
VIVENDI	8,098	24.90	201,640.20
DELIVERY HERO SE	1,124	49.17	55,267.08
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	10,800	28.73	310,284.00
PROSUS NV	4,810	60.05	288,840.50
ZALANDO SE	800	41.38	33,104.00
CARREFOUR SA	6,545	15.02	98,305.90
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	45.28	28,300.00
COLRUYT SA	290	47.30	13,717.00
JERONIMO MARTINS	2,258	14.75	33,316.79
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	11,576	23.50	272,036.00
METRO AG	1,970	14.37	28,318.75
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	7,452	71.33	531,551.16
DANONE	6,048	74.02	447,672.96
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,500	8.16	28,577.50
HEINEKEN HOLDING NV	1,177	88.05	103,634.85
HEINEKEN NV	2,526	95.50	241,233.00
KERRY GROUP PLC-A	1,336	117.00	156,312.00

PERNOD RICARD SA	2,112	162.70	343,622.40
REMY COINTREAU	18	115.70	2,082.60
BEIERSDORF AG	1,070	103.75	111,012.50
HENKEL AG & CO KGAA	966	86.40	83,462.40
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,842	94.50	174,069.00
L'OREAL	2,449	254.20	622,535.80
UNILEVER NV	13,786	54.47	750,923.42
BIOMERIEUX	110	82.10	9,031.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	114.10	27,954.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	1,986	65.04	129,169.44
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,728	49.63	185,039.28
KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,927	42.75	381,629.25
SARTORIUS AG-VORZUG	339	193.80	65,698.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	42.96	67,146.48
BAYER AG-REG	9,071	68.88	624,810.48
EUROFINS SCIENTIFIC	127	496.20	63,017.40
GALAPAGOS NV	510	196.00	99,960.00
GRIFOLS SA	2,882	31.19	89,889.58
IPSEN	158	79.75	12,600.50
MERCK KGAA	1,207	103.10	124,441.70
ORION OYJ-CLASS B	1,261	40.02	50,465.22
QIAGEN N.V.	2,180	37.52	81,793.60
RECORDATI SPA	830	35.43	29,406.90
SANOFI	10,784	81.86	882,778.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	144.70	43,120.60
UCB SA	1,046	72.68	76,023.28
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	15.30	58,231.80
AIB GROUP PLC	2,000	3.19	6,396.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	66,716	4.75	317,301.29
BANCO DE SABADELL SA	54,337	1.03	56,456.14
BANCO SANTANDER SA	163,676	3.58	587,433.16
BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,400	4.80	49,982.40
BANKIA SA	1,600	1.79	2,866.40
BANKINTER SA	2,829	6.50	18,394.15
BNP PARIBAS	10,925	50.77	554,662.25

CAIXABANK S.A	35,123	2.72	95,639.92
COMMERZBANK AG	5,632	5.20	29,331.45
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	12.61	128,067.16
ERSTE GROUP BANK AG	3,374	32.28	108,912.72
FINECOBANK SPA	6,723	11.09	74,558.07
ING GROEP NV-CVA	37,414	10.47	392,023.89
INTESA SANPAOLO	144,520	2.29	331,962.44
KBC GROEP NV	2,188	66.40	145,283.20
MEDIOBANCA SPA	6,857	9.91	67,952.87
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	21.60	26,265.60
SOCIETE GENERALE SA	8,630	29.33	253,117.90
UNICREDIT SPA	20,509	12.74	261,366.69
AMUNDI SA	618	69.10	42,703.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	20,858	6.55	136,724.19
DEUTSCHE BOERSE AG	1,937	136.80	264,981.60
EURAZEO	403	61.35	24,724.05
EXOR NV	1,164	68.20	79,384.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	824	93.22	76,813.28
NATIXIS	3,105	3.75	11,656.17
WENDEL	294	121.70	35,779.80
AEGON NV	16,557	4.06	67,320.76
AGEAS	1,697	54.26	92,079.22
ALLIANZ SE-REG	4,075	216.20	881,015.00
ASSICURAZIONI GENERALI	9,850	18.19	179,220.75
AXA SA	18,933	24.80	469,538.40
CNP ASSURANCES	1,015	17.99	18,259.85
HANNOVER RUECK SE	485	169.70	82,304.50
MAPFRE SA	942	2.59	2,444.49
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,436	260.30	373,790.80
NN GROUP NV	2,804	34.07	95,532.28
POSTE ITALIANE SPA	5,374	10.18	54,734.19
SAMPO OYJ-A SHS	4,689	37.05	173,727.45
SCOR SE	1,565	38.03	59,516.95
AROUNDTOWN SA	10,475	7.71	80,762.25
DEUTSCHE WOHNEN SE	3,506	35.67	125,059.02

VONOVIA SE	5,210	46.50	242,265.00
ADYEN NV	107	697.00	74,579.00
AMADEUS IT GROUP SA	3,957	72.48	286,803.36
ATOS SE	1,004	76.38	76,685.52
CAPGEMINI SA	1,651	106.30	175,501.30
DASSAULT SYSTEMES SA	1,357	145.35	197,239.95
SAP SE	9,394	122.02	1,146,255.88
WIRECARD AG	1,119	113.75	127,286.25
WORLDLINE SA	566	57.80	32,714.80
INGENICO GROUP	414	95.00	39,330.00
NOKIA OYJ	59,734	3.12	186,698.61
CELLNEX TELECOM SA	2,767	39.03	107,996.01
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	32,678	15.07	492,457.46
ELISA OYJ	1,241	49.06	60,883.46
ILIAD SA	98	114.75	11,245.50
KONINKLIJKE KPN NV	37,869	2.74	103,874.66
ORANGE	19,967	13.46	268,755.82
PROXIMUS	918	26.35	24,189.30
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.54	39,490.75
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.54	38,687.90
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	2.78	1,726.70
TELEFONICA SA	47,198	6.76	319,105.67
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,460	30.46	44,471.60
E.ON SE	23,556	9.13	215,136.94
EDF	6,102	9.35	57,102.51
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	18,329	3.66	67,120.79
ENAGAS SA	1,292	22.50	29,070.00
ENDESA SA	3,177	24.28	77,137.56
ENEL SPA	78,269	6.67	522,602.11
ENGIE	18,405	14.44	265,768.20
FORTUM OYJ	3,981	21.39	85,153.59
IBERDROLA SA	58,441	8.79	513,930.15
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,416	22.96	78,431.36
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,384	17.45	76,522.72
RWE AG	5,848	26.11	152,691.28

	SNAM SPA	20,377	4.30	87,784.11
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	13.07	29,353.37
	TERNA SPA	14,453	5.54	80,156.33
	UNIPER SE	2,177	29.64	64,526.28
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	5,023	23.15	116,282.45
	VERBUND AG	797	45.64	36,375.08
	ASML HOLDING NV	4,019	251.95	1,012,587.05
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	12,870	19.89	255,984.30
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	23.11	140,139.04
	ユーロ 小計	1,836,145		39,335,345.81 (4,729,288,626)
英bond	BP PLC	193,712	4.71	912,867.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	41,461	21.76	902,398.66
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	35,775	21.58	772,024.50
	ANGLO AMERICAN PLC	10,602	20.77	220,256.55
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	9.04	39,087.36
	BHP GROUP PLC	20,668	17.15	354,497.53
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,282	48.68	62,407.76
	EVRAZ PLC	3,072	3.61	11,089.92
	GLENCORE PLC	109,009	2.19	238,893.22
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	27.91	50,321.73
	MONDI PLC	5,338	16.47	87,916.86
	RIO TINTO PLC	10,996	42.56	468,044.74
	ASHTED GROUP PLC	4,977	23.66	117,755.82
	BAE SYSTEMS PLC	33,568	5.56	186,705.21
	BUNZL PLC	3,344	21.07	70,458.08
	DCC PLC	823	63.78	52,490.94
	FERGUSON PLC	2,384	67.12	160,014.08
	MEGGITT PLC	7,023	6.48	45,537.13
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	2.27	101,512.23
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	18,000	7.25	130,500.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	574,724	0.00	574.72
	SMITHS GROUP PLC	3,824	16.07	61,451.68
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	802	87.85	70,455.70
	WEIR GROUP PLC/THE	2,572	14.46	37,191.12

EXPERIAN PLC	9,330	24.59	229,424.70
G4S PLC	17,548	2.10	36,885.89
INTERTEK GROUP PLC	1,723	54.24	93,455.52
RELX PLC	18,927	18.22	344,944.57
RENTOKIL INITIAL PLC	17,290	4.29	74,312.42
EASYJET PLC	130	13.63	1,771.90
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,392	6.70	69,647.18
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,360	45.98	62,532.80
BURBERRY GROUP PLC	3,298	21.01	69,290.98
PERSIMMON PLC	3,047	25.27	76,997.69
TAYLOR WIMPEY PLC	36,389	1.77	64,699.64
CARNIVAL PLC	1,722	32.30	55,620.60
COMPASS GROUP PLC	15,613	18.27	285,327.57
GVC HOLDINGS PLC	6,950	8.53	59,283.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	48.05	80,243.50
TUI AG-DI	4,120	9.57	39,461.36
WHITBREAD PLC	983	46.29	45,503.07
AUTO TRADER GROUP PLC	10,377	5.61	58,277.23
INFORMA PLC	11,550	7.81	90,251.70
ITV PLC	42,960	1.43	61,604.64
PEARSON PLC	7,332	6.39	46,910.13
WPP PLC	11,423	9.67	110,506.10
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.06	39,977.60
KINGFISHER PLC	12,732	2.14	27,246.48
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	2.08	19,044.86
NEXT PLC	1,278	69.34	88,616.52
OCADO GROUP PLC	2,823	12.04	34,003.03
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.23	21,395.65
TESCO PLC	96,904	2.43	235,573.62
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	2.03	46,890.30
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	25.23	82,779.63
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	21,830	30.00	654,900.00
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	25.11	46,101.96
DIAGEO PLC	22,570	30.76	694,253.20
IMPERIAL BRANDS PLC	8,282	16.95	140,396.46

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6,767	59.42	402,095.14
UNILEVER PLC	10,572	45.44	480,444.54
NMC HEALTH PLC	438	25.47	11,155.86
SMITH & NEPHEW PLC	8,847	16.75	148,231.48
ASTRAZENECA PLC	12,437	72.22	898,200.14
GLAXOSMITHKLINE PLC	47,362	17.28	818,604.80
BARCLAYS PLC	167,483	1.71	287,534.81
HSBC HOLDINGS PLC	191,346	5.60	1,072,302.98
LLOYDS BANKING GROUP PLC	681,695	0.62	423,537.10
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	42,392	2.30	97,501.60
STANDARD CHARTERED PLC	28,731	6.78	194,911.10
3I GROUP PLC	8,862	10.65	94,380.30
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,573	18.60	29,265.66
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,252	67.78	220,420.56
M&G PLC	21,579	2.21	47,775.90
SCHRODERS PLC	1,161	32.56	37,802.16
ST JAMES'S PLACE PLC	5,722	10.93	62,541.46
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	3.10	58,137.80
ADMIRAL GROUP PLC	1,104	21.42	23,647.68
AVIVA PLC	34,259	4.04	138,543.39
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	3.00	22,415.84
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	62,981	2.85	179,495.85
PRUDENTIAL PLC	24,850	13.15	326,901.75
RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	5.45	51,283.36
AVEVA GROUP PLC	700	45.26	31,682.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,601	11.02	17,655.82
SAGE GROUP PLC/THE	12,303	7.25	89,245.96
HALMA PLC	4,070	21.14	86,039.80
BT GROUP PLC	76,563	1.92	147,322.52
VODAFONE GROUP PLC	260,244	1.43	374,387.01
CENTRICA PLC	60,998	0.81	49,530.37
NATIONAL GRID PLC	33,301	8.90	296,645.30
SEVERN TRENT PLC	2,533	22.80	57,752.40
SSE PLC	9,313	13.18	122,745.34
UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,711	8.70	40,985.70

	英ポンド 小計	3,452,339		16,783,708.82 (2,398,056,316)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	20.70	12,006.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	621.00	48,438.00	
	GIVAUDAN-REG	81	2,915.00	236,115.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4,295	51.82	222,566.90	
	SIKA AG-REG	1,079	172.75	186,397.25	
	ABB LTD-REG	18,072	22.30	403,005.60	
	GEBERIT AG-REG	335	544.20	182,307.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	239.40	51,471.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	386	248.60	95,959.60	
	ADECCO SA-REG	1,516	61.52	93,264.32	
	SGS SA-REG	55	2,604.00	143,220.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	530	161.95	85,833.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,126	75.02	384,552.52	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	304	275.10	83,630.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	51.50	12,926.50	
	DUFREY AG-REG	465	97.26	45,225.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	33	2,028.00	66,924.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	11	7,570.00	83,270.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	84,200.00	84,200.00	
	NESTLE SA-REG	28,885	103.88	3,000,573.80	
	ALCON INC	4,228	54.83	231,821.24	
	SONOVA HOLDING AG-REG	419	221.40	92,766.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	107	942.20	100,815.40	
	LONZA GROUP AG-REG	751	337.00	253,087.00	
	NOVARTIS AG-REG	20,760	91.18	1,892,896.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	6,646	303.40	2,016,396.40	
	VIFOR PHARMA AG	491	176.55	86,686.05	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	25,328	13.02	329,897.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,813	46.73	84,721.49	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	79.55	2,306.95	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	174	859.80	149,605.20		
UBS GROUP AG-REG	37,635	11.93	448,985.55		
BALOISE HOLDING AG - REG	517	175.00	90,475.00		

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	344	494.40	170,073.60
	SWISS RE AG	3,067	108.20	331,849.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,477	395.60	584,301.20
	SWISS PRIME SITE-REG	823	106.50	87,649.50
	TEMENOS GROUP AG-REG	622	151.70	94,357.40
	SWISSCOM AG-REG	251	522.20	131,072.20
	スイスフラン 小計	167,780		12,701,651.47 (1,396,673,595)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,099	296.50	325,853.50
	BOLIDEN AB	3,164	248.40	785,937.60
	ALFA LAVAL AB	3,608	232.30	838,138.40
	ASSA ABLOY AB-B	8,918	223.80	1,995,848.40
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,182	362.80	2,605,629.60
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,770	316.30	1,192,451.00
	EPIROC AB-A	5,706	113.45	647,345.70
	EPIROC AB-B	1,290	109.40	141,126.00
	SANDVIK AB	11,964	180.30	2,157,109.20
	SKANSKA AB-B SHS	3,780	212.20	802,116.00
	SKF AB-B SHARES	2,513	187.05	470,056.65
	VOLVO AB-B SHS	15,715	143.90	2,261,388.50
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	161.05	617,304.65
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	255.90	392,038.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	74.82	212,264.34
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	7,503	193.90	1,454,831.70
	ICA GRUPPEN AB	510	422.60	215,526.00
	SWEDISH MATCH AB	1,870	449.40	840,378.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	5,328	294.50	1,569,096.00
	NORDEA BANK ABP	33,101	69.03	2,284,962.03
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	14,454	83.92	1,212,979.68
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,392	93.92	1,539,536.64
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,995	124.80	1,247,376.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	219.10	138,690.30
	INVESTOR AB-B SHS	4,717	513.20	2,420,764.40
	KINNEVIK AB - B	2,331	225.40	525,407.40
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	385.40	34,686.00

	ERICSSON LM-B SHS	31,297	87.28	2,731,602.16	
	HEXAGON AB-B SHS	2,433	535.40	1,302,628.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	144	442.00	63,648.00	
	TELE2 AB-B SHS	5,409	138.85	751,039.65	
	TELIA CO AB	26,824	40.83	1,095,223.92	
	スウェーデンクローナ 小計	239,942		34,872,984.42	(397,552,022)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	242	260.60	63,065.20	
	EQUINOR ASA	9,420	170.25	1,603,755.00	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	31.99	259,310.94	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	344.70	588,402.90	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	246.60	136,123.20	
	MOWI ASA	5,068	231.50	1,173,242.00	
	ORKLA ASA	9,407	91.40	859,799.80	
	DNB ASA	8,949	155.15	1,388,437.35	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	180.45	119,457.90	
	TELENOR ASA	8,534	164.70	1,405,549.80	
	ノルウェークローネ 小計	52,647		7,597,144.09	(90,330,043)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,198	530.80	635,898.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,039	334.30	681,637.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,653	663.00	1,095,939.00	
	ISS A/S	982	155.10	152,308.20	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	9,465.00	369,135.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	67	10,100.00	676,700.00	
	DSV PANALPINA A S	2,034	745.00	1,515,330.00	
	PANDORA A/S	1,082	265.20	286,946.40	
	CARLSBERG AS-B	1,119	987.00	1,104,453.00	
	COLOPLAST-B	1,265	787.00	995,555.00	
	DEMANT A/S	550	208.80	114,840.00	
	GENMAB A/S	622	1,582.00	984,004.00	
	H LUNDBECK A/S	120	256.10	30,732.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	17,094	384.65	6,575,207.10	
	DANSKE BANK A/S	6,042	96.46	582,811.32	
TRYG A/S	694	196.10	136,093.40		

	ORSTED A/S	2,053	630.20	1,293,800.60
	デンマーククローネ 小計	38,653		17,231,391.12 (277,253,083)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	3,012	34.50	103,914.00
	OIL SEARCH LTD	14,702	7.23	106,295.46
	ORIGIN ENERGY LTD	14,373	8.70	125,045.10
	SANTOS LTD	14,669	8.23	120,725.87
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	22.11	7,893.27
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	8,447	34.35	290,154.45
	WORLEY LTD	1,064	15.03	15,991.92
	ALUMINA LTD	25,748	2.27	58,447.96
	BHP GROUP LTD	28,547	38.05	1,086,213.35
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	15.28	95,591.68
	BORAL LTD	12,991	4.57	59,368.87
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	16,229	10.25	166,347.25
	INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.14	16,773.88
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	28.52	111,256.52
	NEWCREST MINING LTD	7,037	28.77	202,454.49
	ORICA LTD	2,316	22.78	52,758.48
	RIO TINTO LTD	3,895	97.42	379,450.90
	SOUTH32 LTD	58,587	2.66	155,841.42
	CIMIC GROUP LTD	682	33.43	22,799.26
	BRAMBLES LTD	15,390	12.43	191,297.70
	SEEK LTD	3,309	22.14	73,261.26
	AURIZON HOLDINGS LTD	21,433	5.57	119,381.81
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	7.25	63,075.00
	SYDNEY AIRPORT	12,027	9.10	109,445.70
	TRANSURBAN GROUP	27,401	15.21	416,769.21
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,291	33.60	211,377.60
CROWN RESORTS LTD	773	12.26	9,476.98	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	43.11	1,896.84	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	4.70	99,795.10	
REA GROUP LTD	563	104.46	58,810.98	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	4.29	1,896.18	
WESFARMERS LTD	11,400	40.83	465,462.00	

	COLES GROUP LTD	11,355	15.30	173,731.50	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	12,572	38.28	481,256.16	
	COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	11.27	58,254.63	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	17.12	120,696.00	
	COCHLEAR LTD	589	230.61	135,829.29	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	71.46	101,544.66	
	SONIC HEALTHCARE LTD	4,402	29.33	129,110.66	
	CSL LTD	4,365	277.95	1,213,251.75	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	27,973	24.58	687,576.34	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,272	9.82	32,131.04	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	17,042	79.26	1,350,748.92	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	27,562	25.40	700,074.80	
	WESTPAC BANKING CORP	33,478	24.35	815,189.30	
	AMP LTD	36,656	1.89	69,279.84	
	ASX LTD	1,467	79.64	116,831.88	
	CHALLENGER LTD	1,796	7.98	14,332.08	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,348	135.73	454,424.04	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	800	53.50	42,800.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	25,707	7.86	202,057.02	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	3.25	52,598.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	13,868	12.43	172,379.24	
	SUNCORP GROUP LTD	11,553	13.02	150,420.06	
	LENDLEASE GROUP	6,799	18.73	127,345.27	
	COMPUTERSHARE LTD	2,732	17.12	46,771.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	25.65	41,040.00	
	TELSTRA CORP LTD	32,785	3.72	121,960.20	
	TPG TELECOM LTD	287	6.90	1,980.30	
	AGL ENERGY LTD	6,692	20.55	137,520.60	
	APA GROUP	11,910	10.93	130,176.30	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.66	2,392.60	
	オーストラリアドル 小計	689,032		12,882,974.81 (955,916,730)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	10,115	5.20	52,598.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	9.02	73,210.80	
	A2 MILK CO LTD	7,579	14.62	110,804.98	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,361	21.08	134,089.88	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	15.67	25,024.99	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	21,747	4.40	95,686.80	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.90	35,280.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	5.01	47,104.02	
	ニュージーランドドル 小計	72,113		573,799.47	(40,860,260)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,500	69.95	1,993,575.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	10.58	105,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,500	60.55	756,875.00	
	MTR CORP	19,500	44.35	864,825.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	22.70	11,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	21,000	52.00	1,092,000.00	
	SANDS CHINA LTD	22,600	36.90	833,940.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.17	16,340.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	17.16	89,232.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	10,000	28.75	287,500.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	6,000	28.45	170,700.00	
	WH GROUP LTD	120,500	7.98	961,590.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.70	63,720.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	34,500	26.35	909,075.00	
	HANG SENG BANK LTD	7,000	158.40	1,108,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	12,100	246.80	2,986,280.00	
	AIA GROUP LTD	115,800	77.60	8,986,080.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	24,500	51.70	1,266,650.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	16.40	213,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	19,916	37.75	751,829.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	25.50	12,750.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	80,000	10.24	819,200.00	
	SINO LAND CO	18,000	11.36	204,480.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	17,200	114.10	1,962,520.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	70.55	296,310.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	24.60	123,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14,000	42.40	593,600.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	9,400	49.15	462,010.00	

	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.32	373,560.00	
	PCCW LTD	4,000	4.64	18,560.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	53.05	233,420.00	
	CLP HOLDINGS LTD	18,000	79.70	1,434,600.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.55	3,775.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	93,880	14.74	1,383,791.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	55.30	801,850.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	106.80	170,880.00	
	香港ドル 小計	806,896		32,363,667.20 (449,207,700)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	15,900	6.72	106,848.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	800	2.20	1,760.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	4.05	48,600.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	1.09	1,635.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	19,100	2.40	45,840.00	
	SATS LTD	1,200	4.96	5,952.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,400	8.97	66,378.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.91	73,932.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	2.13	28,116.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	30.08	3,008.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	23,900	4.10	97,990.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	17,800	25.01	445,178.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,200	10.64	363,888.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	11,000	25.46	280,060.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	10,900	8.99	97,991.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	3.68	78,016.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	6,700	10.55	70,685.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.90	16,590.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	15.76	20,488.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	86,800	3.43	297,724.00	
	シンガポールドル 小計	367,900		2,150,679.00 (171,839,252)	
イスラエルシ ュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,122	15.84	65,292.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	263	572.20	150,488.60	
	BANK HAPOLIM BM	9,996	27.35	273,390.60	

BANK LEUMI LE-ISRAEL	16,884	24.38	411,631.92
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	15.96	120,003.24
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	95.99	135,729.86
AZRIELI GROUP	234	270.10	63,203.40
NICE SYSTEMS LTD	745	518.50	386,282.50
イスラエルシュケル 小計	41,177		1,606,022.60 (50,316,688)
合 計	10,988,524		40,302,156,374 (40,302,156,374)

(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	4,823	83,582.59	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	961	156,066.40	
		AMERICAN TOWER CORP	4,224	898,233.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,662	147,692.66	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,390	300,114.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,367	191,202.29	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	701	77,453.49	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,027	547,188.76	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,101	249,430.72	
		DUKE REALTY CORP	3,781	132,902.15	
		EQUINIX INC	820	459,790.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	112,307.40	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,681	311,228.55	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	580	180,501.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,155	123,157.65	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	82,017.81	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4,041	138,161.79	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	116,818.60	
		INVITATION HOMES INC	5,744	173,124.16	
		IRON MOUNTAIN INC	2,044	67,452.00	

	KIMCO REALTY CORP	3,824	81,183.52	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,416	87,154.80	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,450	116,575.50	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,033	139,455.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	80,465.66	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	99,537.60	
	PROLOGIS INC	6,108	558,149.04	
	PUBLIC STORAGE	1,557	332,201.52	
	REALTY INCOME CORP	2,774	210,130.50	
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	97,804.40	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,173	278,880.75	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,017	451,916.43	
	SL GREEN REALTY CORP	468	41,464.80	
	SUN COMMUNITIES INC	788	125,615.08	
	UDR INC	2,553	122,161.05	
	VENTAS INC	3,668	210,910.00	
	VEREIT INC	11,100	106,893.00	
	VICI PROPERTIES INC	4,920	122,606.40	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	83,031.05	
	WELLTOWER INC	4,008	333,225.12	
	WEYERHAEUSER CO	7,592	223,052.96	
	WP CAREY INC	1,458	119,264.40	
	米ドル 小計	135,259	8,570,106.30 (931,313,451)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	52,525.50	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,474.94	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	42,472.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,683.28	
	カナダドル 小計	2,647	99,156.52 (8,136,784)	
ユーロ	COVIVIO	522	53,244.00	
	GECINA SA	474	74,607.60	
	ICADE	30	2,808.00	
	KLEPIERRE	2,365	78,541.65	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	169,353.60	

		ユーロ 小計	4,587	378,554.85 (45,513,649)
英ポンド		BRITISH LAND CO PLC	9,933	60,491.97
		LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	63,488.40
		SEGREO PLC	12,304	108,078.33
		英ポンド 小計	28,885	232,058.70 (33,156,547)
オーストラリアドル		DEXUS	10,906	132,726.02
		GOODMAN GROUP	15,409	223,430.50
		GPT GROUP	15,542	93,562.84
		MIRVAC GROUP	32,387	110,439.67
		SCENTRE GROUP	50,466	196,817.40
		STOCKLAND	28,650	144,109.50
		VICINITY CENTRES	42,168	111,323.52
		オーストラリアドル 小計	195,528	1,012,409.45 (75,120,781)
香港ドル		LINK REIT	23,000	1,857,250.00
		香港ドル 小計	23,000	1,857,250.00 (25,778,630)
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	38,800	117,564.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	51,000.00
		CAPITALAND MALL TRUST	22,000	55,440.00
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	53,820.00
		SUNTEC REIT	8,500	15,640.00
		シンガポールドル 小計	117,800	293,464.00 (23,447,773)
		合計		1,142,467,615 (1,142,467,615)

(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	609銘柄	96.8%		67.0%
	投資証券	42銘柄		3.2%	2.2%
カナダドル	株式	86銘柄	99.5%		3.7%
	投資証券	4銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式	236銘柄	99.0%		11.4%
	投資証券	5銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式	94銘柄	98.6%		5.8%
	投資証券	3銘柄		1.4%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%		3.4%
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%		0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%		0.7%
オーストラリアドル	株式	62銘柄	92.7%		2.3%
	投資証券	7銘柄		7.3%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	36銘柄	94.6%		1.1%
	投資証券	1銘柄		5.4%	0.1%
シンガポールドル	株式	20銘柄	88.0%		0.4%
	投資証券	5銘柄		12.0%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2019年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,072,430,299
コール・ローン	71,817,442
株式	7,078,375,539
投資証券	16,877,304
派生商品評価勘定	59,392,504
未収入金	43,443,697
未収配当金	2,528,355
差入委託証拠金	337,097,491
流動資産合計	9,681,962,631
資産合計	9,681,962,631
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,497,236
未払解約金	108,025,000
未払利息	194
その他未払費用	95
流動負債合計	109,522,525
負債合計	109,522,525
純資産の部	
元本等	
元本	7,385,223,056
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,187,217,050
元本等合計	9,572,440,106
純資産合計	9,572,440,106
負債純資産合計	9,681,962,631

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	原則として、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。
	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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	4,383,035,281円
期中追加設定元本額	6,665,594,737円
期中一部解約元本額	3,663,406,962円
期末元本額	7,385,223,056円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	443,584,646円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	661,855,383円
りそなラップ型ファンド(成長型)	761,131,384円
DCりそな グローバルバランス	7,176,064円
つみたてバランスファンド	189,475,939円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	146,617,358円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	67,089,682円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	39,606,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	1,032,867円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	901,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	439,715円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	385,403円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	11,625,873円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,167,281,496円
Smart-i 新興国株式インデックス	540,621,439円
Smart-i 8資産バランス 安定型	12,787,064円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	42,471,301円
Smart-i 8資産バランス 成長型	54,457,648円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	173,644,731円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	542,030,622円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	974,114,695円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	546,084,849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)	806,548円
2. 計算日における受益権の総数	7,385,223,056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	1.2962円
(10,000口当たり純資産額)	(12,962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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	278,557,541	
投資証券	538,354	
合計	278,019,187	

(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12月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,434,776,344	-	2,492,678,980	57,902,636
合計		2,434,776,344	-	2,492,678,980	57,902,636

（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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引					
	買建	23,679,458	-	23,672,088	7,370	
	米ドル	15,211,690	-	15,210,988	702	
	香港ドル	7,356,718	-	7,351,100	5,618	
	南アフリカランド	1,111,050	-	1,110,000	1,050	
	売建	1,390	-	1,388	2	
	オフショア人民元	1,390	-	1,388	2	
合計		23,680,848	-	23,673,476	7,368	

(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	60,112	7.72	464,545.53	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	13,200	0.75	9,952.80	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,416	96.74	427,203.84	

NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,057	199.40	210,765.80
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	14,717	7.01	103,166.17
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,010	6.79	95,127.90
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,078	70.86	218,107.08
YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	10.16	19,304.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,690	14.77	39,731.30
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	7.91	24,916.50
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	7,524	28.90	217,443.60
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,951	20.90	40,775.90
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,651	12.24	20,208.24
POLYUS PJSC-REG S-GDR	603	53.35	32,170.05
SEVERSTAL - GDR REG S	3,201	13.91	44,525.91
SOUTHERN COPPER CORP	885	39.38	34,851.30
51JOB INC-ADR	300	79.30	23,790.00
BEST INC - ADR	1,500	5.75	8,625.00
DP WORLD PLC	1,903	12.35	23,502.05
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,700	20.84	77,108.00
NIO INC - ADR	7,400	2.22	16,428.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,500	33.89	50,835.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,550	120.94	187,457.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,400	45.47	200,068.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	4,050	45.28	183,384.00
58.COM INC-ADR	1,060	58.82	62,349.20
AUTOHOME INC-ADR	720	69.94	50,356.80
BAIDU INC - SPON ADR	3,050	115.06	350,933.00
HUYA INC-ADR	900	18.08	16,272.00
IQIYI INC-ADR	1,300	20.20	26,260.00
MOMO INC-SPON ADR	1,750	36.15	63,262.50
NETEASE INC-ADR	782	308.04	240,887.28
SINA CORP	630	35.23	22,194.90
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,000	12.19	12,190.00
WEIBO CORP-SPON ADR	530	43.77	23,198.10
YY INC-ADR	620	56.91	35,284.20
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	18,830	198.74	3,742,274.20
BAOZUN INC-SPN ADR	500	34.28	17,140.00

	JD.COM INC-ADR	8,320	33.25	276,640.00	
	PINDUODUO INC-ADR	2,200	37.52	82,544.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	5,350	32.07	171,574.50	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,000	13.30	66,500.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,788	11.30	54,104.40	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,645	33.25	54,696.25	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	23.17	13,902.00	
	BANCO MACRO SA-ADR	450	28.58	12,861.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	17,261	4.64	80,091.04	
	CREDICORP LTD	744	207.58	154,439.52	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	1,210	14.05	17,000.50	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	30,206	14.86	449,012.19	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.40	31,009.10	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	400	28.95	11,580.00	
	QUDIAN INC-SPON ADR	3,000	4.79	14,370.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.94	9,525.60	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	700	47.15	33,005.00	
	GLOBANT SA	440	101.84	44,809.60	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,700	9.41	53,637.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	10.34	8,995.80	
	米ドル 小計	313,186		9,076,892.65	(986,385,924)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	173,900	6.86	1,192,954.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	39,800	49.45	1,968,110.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	195.81	269,238.75	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	10,000	40.99	409,900.00	
	ALFA S.A.B. -A	28,900	15.22	439,858.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	5,600	66.13	370,328.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	4,200	190.94	801,948.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,415	327.22	790,236.30	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	185.75	510,812.50	
	ALSEA SAB DE CV	6,000	51.37	308,220.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	27,300	41.34	1,128,582.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	3,600	74.23	267,228.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,100	93.87	197,127.00	

	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	58,400	53.44	3,120,896.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	101.69	437,267.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,100	112.05	683,505.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	21,900	176.47	3,864,693.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,455	182.64	448,381.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,600	32.93	513,708.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	18,100	37.27	674,587.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	28,900	100.57	2,906,473.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	27,300	22.47	613,431.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	378,800	14.47	5,481,236.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	5,300	82.28	436,084.00	
	メキシコペソ 小計	875,095		27,834,803.75	(157,266,641)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,400	65.86	92,204.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	82,400	30.21	2,489,304.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,100	21.38	151,798.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	29.04	66,792.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	13.16	96,068.00	
	GERDAU SA-PREF	12,600	17.18	216,468.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,900	17.97	141,963.00	
	SUZANO SA	6,207	37.78	234,500.46	
	VALE SA	35,700	51.44	1,836,408.00	
	EMBRAER SA	8,100	18.50	149,850.00	
	WEG SA	9,450	31.91	301,549.50	
	CCR SA	13,900	17.42	242,138.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	6,200	45.14	279,868.00	
	RUMO SA	12,500	25.20	315,000.00	
	COGNA EDUCACAO	16,900	10.99	185,731.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,300	60.73	139,679.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,600	25.07	215,602.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,700	52.90	460,230.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,900	45.85	362,215.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,100	26.65	215,865.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	4,700	19.64	92,308.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1,800	83.51	150,318.00	

	RAIA DROGASIL SA	2,600	102.79	267,254.00	
	AMBEV SA	52,900	18.44	975,476.00	
	BRF SA	6,500	36.85	239,525.00	
	JBS SA	12,400	26.53	328,972.00	
	NATURA COSMETICOS SA	4,700	34.08	160,176.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,000	55.80	111,600.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	3,900	58.74	229,086.00	
	HYPERA SA	4,300	32.05	137,815.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	57,500	34.60	1,989,500.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	9,400	48.62	457,028.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	44.50	195,800.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	53,600	36.55	1,959,080.00	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	48,700	13.68	666,216.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	23,000	47.65	1,095,950.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	76.50	198,900.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,900	36.62	289,298.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,900	36.82	290,878.00	
	PORTO SEGURO SA	1,200	59.63	71,556.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	2,700	51.81	139,887.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	9,300	16.48	153,264.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,500	30.49	106,715.00	
	CIELO SA	11,700	8.14	95,238.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,800	56.93	273,264.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,600	14.42	138,432.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,500	37.20	204,600.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,600	12.88	136,528.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,900	59.70	232,830.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,100	49.98	104,958.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,375	47.50	112,812.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	9,500	21.92	208,240.00	
	ブラジルリアル 小計	653,132		20,006,737.46 (525,176,858)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,614	6,894.00	31,808,916.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,459	1,900.00	27,472,100.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,121	19,320.00	21,657,720.00	

	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	8,550.00	25,316,550.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	9,554	3,290.00	31,432,660.00	
	CENCOSUD SA	13,424	1,055.00	14,162,320.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,479	7,400.00	10,944,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	2,175.60	6,200,460.00	
	BANCO DE CHILE	490,670	84.22	41,324,227.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	575	38,220.00	21,976,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	752,457	43.60	32,807,125.20	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	4.18	7,858,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	5,280.80	5,286,080.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	40,006	320.50	12,821,923.00	
	COLBUN SA	83,944	128.89	10,819,542.16	
	ENEL AMERICAS SA	453,880	161.80	73,437,784.00	
	ENEL CHILE SA	352,178	70.14	24,701,764.92	
	チリペソ 小計	4,105,173		400,028,673.48 (56,044,017)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	51,116	3,280.00	167,660,480.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	17,400.00	50,460,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,691	42,000.00	155,022,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,129	43,620.00	180,106,980.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	43,000	1,415.00	60,845,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	32,500.00	84,110,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,790	18,780.00	108,736,200.00	
	コロンビアペソ 小計	113,214		806,940,660.00 (25,660,712)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	20.40	15,993.60	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	370	18.14	6,711.80	
	OPAP SA	2,215	10.93	24,209.95	
	JUMBO SA	1,191	17.82	21,223.62	
	ALPHA BANK AE	14,218	1.77	25,194.29	
	EUROBANK ERGASIAS SA	30,708	0.85	26,193.92	
	NATIONAL BANK OF GREECE	6,654	2.81	18,704.39	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,734	13.31	36,389.54	
	ユーロ 小計	58,874		174,621.11 (20,994,696)	

トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,417	122.60	173,724.20	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	13,819	8.31	114,835.89	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,600	19.55	70,380.00	
	KOC HOLDING AS	9,413	19.96	187,883.48	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	27.36	41,040.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	13.80	75,900.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	64.40	28,980.00	
	ARCELIK AS	1,000	19.88	19,880.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,831	45.06	217,684.86	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	21.80	41,856.00	
	AKBANK T.A.S.	34,653	7.67	265,788.51	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	27,862	10.32	287,535.84	
	TURKIYE IS BANKASI-C	17,700	6.13	108,501.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,597	9.42	118,663.74	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	13,358	13.54	180,867.32	
トルコリラ 小計		149,620		1,933,520.84	(36,176,174)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	803.50	601,821.50	
	MONETA MONEY BANK AS	6,489	82.50	535,342.50	
	CEZ AS	1,907	505.00	963,035.00	
チェココルナ 小計		9,145		2,100,199.00	(9,891,937)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,529	2,892.00	13,097,868.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,582	5,875.00	9,294,250.00	
	OTP BANK PLC	2,519	15,110.00	38,062,090.00	
ハンガリーフォリント 小計		8,630		60,454,208.00	(21,908,604)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	1,113	82.00	91,266.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	3,275	81.78	267,829.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	20,397	4.31	88,033.45	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,613	93.36	150,589.68	
	CCC SA	371	107.80	39,993.80	
	LPP SA	13	8,605.00	111,865.00	
	AMREST HOLDINGS SE	830	47.20	39,176.00	
	CD PROJEKT SA	760	263.90	200,564.00	

	CYFROWY POLSAT SA	2,915	27.70	80,745.50	
	DINO POLSKA SA	510	136.50	69,615.00	
	BANK MILLENNIUM SA	8,345	5.70	47,566.50	
	BANK PEKAO SA	1,972	95.20	187,734.40	
	MBANK SA	165	355.00	58,575.00	
	PKO BANK POLSKI SA	9,977	33.79	337,122.83	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	345	275.00	94,875.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	6,759	37.79	255,422.61	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	6.94	29,169.00	
	PGE SA	9,929	8.18	81,298.65	
	ポーランドズロチ 小計	73,489		2,231,441.92	(62,547,317)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	35,000	2.94	102,900.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	22,000	10.52	231,440.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	292,000	4.40	1,284,800.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	40,000	15.26	610,400.00	
	CNOOC LTD	201,000	11.32	2,275,320.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.33	33,300.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	236,000	3.63	856,680.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	28,000	6.82	190,960.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	48,000	2.46	118,080.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	14,500	51.75	750,375.00	
	BBMG CORP-H	25,000	2.20	55,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	4.22	54,860.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	45,000	2.91	130,950.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	46,000	7.38	339,480.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	30,000	9.04	271,200.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	3.06	52,632.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.38	140,700.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	19,000	5.76	109,440.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	24,000	3.02	72,480.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	17,000	8.06	137,020.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	2.23	75,820.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,000	8.01	96,120.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	3.12	180,960.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	3.60	93,600.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	80.05	176,110.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	54,000	6.03	325,620.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	26,000	5.19	134,940.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	19,000	31.30	594,700.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	15,000	8.50	127,500.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	19,500	7.97	155,415.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	48,000	4.57	219,360.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	26,000	6.42	166,920.00	
CITIC LTD	68,000	9.99	679,320.00	
CRRC CORP LTD - H	54,000	5.18	279,720.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	31,000	10.56	327,360.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	19.90	159,200.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	1.63	52,160.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	38,000	2.39	90,820.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	7,000	14.22	99,540.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	4.70	82,250.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,500	14.16	134,520.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	20,000	14.38	287,600.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	8.63	51,780.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	5,300	25.85	137,005.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,400	5.82	112,908.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	5,250	25.55	134,137.50	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	44,000	5.91	260,040.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	14,000	25.95	363,300.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	8.58	85,800.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	7.20	129,600.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	18,000	7.33	131,940.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	26,000	3.86	100,360.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	12.04	168,560.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	22,000	4.88	107,360.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	34,500	2.86	98,670.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	6.18	111,240.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	10.48	125,760.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	10,000	10.84	108,400.00	

SHENZHEN INTL HOLDINGS	9,500	16.82	159,790.00	
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	2.45	36,750.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.83	122,940.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	23,500	4.45	104,575.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	38,000	8.31	315,780.00	
BYD CO LTD-H	8,000	37.25	298,000.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	26,000	0.26	6,890.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	34,000	7.70	261,800.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	23.30	121,160.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	58,000	14.84	860,720.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	36,000	5.79	208,440.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	36,000	8.79	316,440.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	6.80	74,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	12,000	73.95	887,400.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	42,000	3.43	144,060.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	15,000	21.30	319,500.00	
LI NING CO LTD	23,000	25.40	584,200.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,700	108.40	943,080.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	15.34	92,040.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	8,000	10.36	82,880.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	4,000	33.60	134,400.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.36	190,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,400	30.35	103,190.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	63,900	336.20	21,483,180.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	118,000	0.68	80,240.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	11,300	103.30	1,167,290.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	28.80	187,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	23,500	8.95	210,325.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	24,000	4.12	98,880.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	32,000	30.90	988,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	16,000	41.60	665,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	23,000	5.80	133,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	24,000	12.62	302,880.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	50.05	200,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	17,000	7.97	135,490.00	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	59,000	7.02	414,180.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	47.15	282,900.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	8,500	51.70	439,450.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	42,000	8.74	367,080.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	4,300	54.45	234,135.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	8.94	214,560.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,000	14.84	163,240.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	14,400	26.35	379,440.00	
3SBIO INC	13,000	10.70	139,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	17,000	11.20	190,400.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	17,500	7.12	124,600.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.39	81,360.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	54,000	17.02	919,080.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	19.70	197,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	6,000	22.70	136,200.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	9,500	27.90	265,050.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	16,500	5.56	91,740.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	5,500	21.95	120,725.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	80,500	10.12	814,660.00	
SSY GROUP LTD	22,000	5.95	130,900.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	1,960	95.65	187,474.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	6,500	91.40	594,100.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	329,000	3.20	1,052,800.00	
BANK OF CHINA LTD-H	890,000	3.15	2,803,500.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	96,000	5.19	498,240.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	106,000	4.32	457,920.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,071,000	6.30	6,747,300.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	40,000	3.46	138,400.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	44,500	37.35	1,662,075.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	84,100	5.59	470,119.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	29,000	3.85	111,650.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	735,000	5.57	4,093,950.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	94,000	5.21	489,740.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	98,000	1.57	153,860.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	8,000	23.10	184,800.00	

CHINA EVERBRIGHT LTD	10,000	12.58	125,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	37,000	4.13	152,810.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.10	113,300.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,200	13.70	235,640.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	25,000	15.06	376,500.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	7.14	207,060.00
GF SECURITIES CO LTD-H	19,200	8.59	164,928.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	12.50	95,000.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	8.05	254,380.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	21,000	12.26	257,460.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	84,000	20.10	1,688,400.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	30,000	28.05	841,500.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	1.22	67,100.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	18,800	18.30	344,040.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	9,700	30.70	297,790.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	97,000	3.14	304,580.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	78,000	9.18	716,040.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	63,000	89.50	5,638,500.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,900	27.60	107,640.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	11.06	199,080.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	11.78	164,920.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	22,000	19.74	434,280.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	62,000	5.48	339,760.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	44,000	27.75	1,221,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	35.90	1,148,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	17,500	29.80	521,500.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	26,000	6.14	159,640.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	87,000	11.32	984,840.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	13.34	154,744.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	3.25	104,000.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,500	9.91	143,695.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	16,000	11.68	186,880.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	20,500	32.60	668,300.00
SEAZEN GROUP LTD	20,000	9.08	181,600.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	40,000	3.13	125,200.00

SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	13,500	29.60	399,600.00
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.68	47,040.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	40,500	2.94	119,070.00
SOHO CHINA LTD	12,000	2.64	31,680.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	28,000	42.80	1,198,400.00
WHARF HOLDINGS LTD	13,000	18.04	234,520.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	74,000	1.69	125,060.00
YUZHOU PROPERTIES CO	12,000	3.92	47,040.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	21,000	5.33	111,930.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	26,000	8.10	210,600.00
KINGSOFT CORP LTD	9,000	18.80	169,200.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	19.22	172,980.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	8,000	61.70	493,600.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	7,500	15.36	115,200.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	4.22	63,300.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	8,000	22.35	178,800.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	15,500	8.97	139,035.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	16.46	55,964.00
LENOVO GROUP LTD	86,000	5.01	430,860.00
SUNNY OPTICAL TECH	7,800	140.30	1,094,340.00
XIAOMI CORP-CLASS B	89,800	9.32	836,936.00
ZTE CORP-H	9,000	21.65	194,850.00
CHINA MOBILE LTD	69,000	60.00	4,140,000.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	162,000	3.00	486,000.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	482,000	1.59	766,380.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	72,000	6.87	494,640.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	5,000	34.55	172,750.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	56,000	3.85	215,600.00
CGN POWER CO LTD-H	131,000	2.02	264,620.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	21,200	27.90	591,480.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	4.62	147,840.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.61	94,990.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	10,000	41.90	419,000.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	24,000	10.22	245,280.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	1.41	45,120.00

	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	9,100	80.15	729,365.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	34,000	16.28	553,520.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	2.86	57,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	48,000	3.91	187,680.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	58,000	3.02	175,160.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	40,000	6.83	273,200.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	5.17	56,870.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	17.40	52,200.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	36,500	10.82	394,930.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	36,000	5.44	195,840.00	
	香港ドル 小計	10,304,010		107,915,257.50 (1,497,863,774)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	43,000	3.40	146,200.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	22.16	64,264.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	28,000	7.05	197,400.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	17,400	4.57	79,518.00	
	GAMUDA BHD	23,300	3.66	85,278.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	6,800	9.85	66,980.00	
	IJM CORP BHD	23,600	2.05	48,380.00	
	SIME DARBY BERHAD	36,000	2.38	85,680.00	
	AIRASIA GROUP BHD	22,600	1.68	37,968.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,500	8.04	108,540.00	
	MISC BHD	14,000	8.29	116,060.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.17	28,356.00	
	GENTING BHD	20,400	5.73	116,892.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	28,900	3.14	90,746.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	1,800	15.60	28,080.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,700	34.12	58,004.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.60	31,800.00	
	IOI CORP BHD	19,700	4.53	89,241.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,300	24.82	106,726.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	800	145.20	116,160.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,820	18.40	107,088.00	
	QL RESOURCES BHD	8,200	7.47	61,254.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	24,400	5.30	129,320.00	

	HARTELEGA HOLDINGS BHD	13,600	5.17	70,312.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	26,200	5.25	137,550.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	14,600	4.33	63,218.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	19,000	3.82	72,580.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	53,600	5.18	277,648.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,500	16.78	109,070.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	3,200	16.40	52,480.00	
	MALAYAN BANKING BHD	44,500	8.56	380,920.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	35,300	19.02	671,406.00	
	RHB BANK BHD	19,700	5.62	110,714.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,000	4.19	134,080.00	
	DIGI.COM BHD	36,100	4.53	163,533.00	
	MAXIS BHD	22,900	5.13	117,477.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	14,100	3.80	53,580.00	
	PETRONAS GAS BHD	7,100	15.60	110,760.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	35,700	13.22	471,954.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.83	16,182.30	
	マレーシアリングット 小計	760,400		5,013,399.30	(130,899,855)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	53,000	11.50	609,500.00	
	IRPC PCL - NVDR	137,700	3.38	465,426.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,700	118.50	1,860,450.00	
	PTT PCL-NVDR	125,700	42.25	5,310,825.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	66.75	881,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	32.75	540,375.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	26,200	52.50	1,375,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	9,000	365.00	3,285,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	49,000	73.00	3,577,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	78,900	10.90	860,010.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	76,000	14.10	1,071,600.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	32,500	37.50	1,218,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	69,000	16.20	1,117,800.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	64.25	212,025.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	12,000	43.00	516,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	66,900	73.25	4,900,425.00	

	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	44,900	26.00	1,167,400.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	39.75	258,375.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	34,000	13.10	445,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	107,900	24.50	2,643,550.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	4,300	137.50	591,250.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	174.00	713,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	22,800	148.00	3,374,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	41,400	15.90	658,260.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,800	118.00	1,156,400.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.49	320,350.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,800	58.50	456,300.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	7,000	61.00	427,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	25,700	60.50	1,554,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	98,500	9.75	960,375.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	13,800	214.00	2,953,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	57.75	1,062,600.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	9,200	53.25	489,900.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	142,100	4.40	625,240.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	7,200	52.00	374,400.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,400	337.00	1,145,800.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	19,800	42.75	846,450.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,000	83.50	584,500.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	6,200	168.00	1,041,600.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	7,000	69.75	488,250.00	
	タイパーツ 小計	1,648,400		52,141,036.00 (186,664,908)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,860	51.40	1,226,404.00	
	AYALA CORPORATION	3,280	813.00	2,666,640.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,190	900.00	1,071,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	33,290	78.60	2,616,594.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,785	1,060.00	2,952,100.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,460	119.50	1,130,470.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	206.60	929,700.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,300	140.50	1,447,150.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	9,800	89.00	872,200.00	

	BDO UNIBANK INC	22,750	160.00	3,640,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	21,712	68.20	1,480,758.40	
	SECURITY BANK CORP	1,400	199.60	279,440.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.54	513,300.00	
	AYALA LAND INC	83,800	44.70	3,745,860.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	4.18	409,640.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	25.50	624,750.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	114,700	41.00	4,702,700.00	
	GLOBE TELECOM INC	430	1,937.00	832,910.00	
	PLDT INC	870	1,035.00	900,450.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	34.50	552,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,740	326.00	893,240.00	
	フィリピンベソ 小計	630,367		33,487,306.40 (71,662,835)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,420.00	214,278,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	2,590.00	103,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	20,100	21,350.00	429,135,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	313,500	1,410.00	442,035,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	7,750.00	208,475,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	21,500	20,550.00	441,825,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	11,300.00	169,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	34,700	12,450.00	432,015,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	5,025.00	92,962,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	231,000	6,675.00	1,541,925,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,485.00	74,250,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	84,600	7,000.00	592,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,700	53,850.00	253,095,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	2,100.00	191,310,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	27,300	11,375.00	310,537,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	50,900	8,025.00	408,472,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	17,700	42,275.00	748,267,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	252,700	1,565.00	395,475,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	111,400	31,975.00	3,562,015,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	212,900	7,250.00	1,543,525,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	86,900	7,575.00	658,267,500.00	

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	628,700	4,180.00	2,627,966,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	2,190.00	56,940,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	1,280.00	84,480,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	585.00	56,745,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	558,100	4,070.00	2,271,467,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	3,270.00	91,560,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	2,140.00	281,410,000.00	
	インドネシアルピア 小計	3,397,600		18,283,734,000.00 (142,613,125)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	49,150.00	24,083,500.00	
	S-OIL CORP	438	89,400.00	39,157,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	588	145,500.00	85,554,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	1,250	17,550.00	21,937,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	30,700.00	24,160,900.00	
	KOREA ZINC CO LTD	95	404,000.00	38,380,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	71,800.00	15,652,400.00	
	LG CHEM LTD	564	295,000.00	166,380,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	196	212,000.00	41,552,000.00	
	OCI CO LTD	198	61,200.00	12,117,600.00	
	POSCO	883	233,000.00	205,739,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	291	46,700.00	13,589,700.00	
	CJ CORP	181	90,800.00	16,434,800.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	362	86,500.00	31,313,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	3,044	4,470.00	13,606,680.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	26,200.00	13,466,800.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	32,700.00	18,966,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	801	30,400.00	24,350,400.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	26,700.00	7,449,300.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	990	40,750.00	40,342,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	127	339,000.00	43,053,000.00	
	KCC CORP	65	217,000.00	14,105,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	938	35,050.00	32,876,900.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	487	121,000.00	58,927,000.00	
	LG CORP	1,145	72,600.00	83,127,000.00	
	LOTTE CORP	242	34,450.00	8,336,900.00	

POSCO INTERNATIONAL CORP	500	19,050.00	9,525,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,002	99,800.00	99,999,600.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	19,000.00	30,476,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,370	6,940.00	37,267,800.00	
SK HOLDINGS CO LTD	418	260,000.00	108,680,000.00	
S-1 CORPORATION	208	94,900.00	19,739,200.00	
CJ LOGISTICS	135	151,500.00	20,452,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	230	146,000.00	33,580,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	594	26,150.00	15,533,100.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	4,235.00	13,878,095.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	837	33,050.00	27,662,850.00	
HANON SYSTEMS	2,230	10,850.00	24,195,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	749	252,000.00	188,748,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,962	119,500.00	234,459,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	81,400.00	19,536,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,990	43,350.00	129,616,500.00	
FILA KOREA LTD	546	51,900.00	28,337,400.00	
HLB INC	359	97,400.00	34,966,600.00	
LG ELECTRONICS INC	1,180	69,100.00	81,538,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	577	90,400.00	52,160,800.00	
KANGWON LAND INC	1,365	29,400.00	40,131,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	820	24,150.00	19,803,000.00	
KAKAO CORP	552	151,500.00	83,628,000.00	
NAVER CORP	1,576	175,000.00	275,800,000.00	
NCSOFT CORP	190	540,000.00	102,600,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	263	86,500.00	22,749,500.00	
PEARL ABYSS CORP	70	189,500.00	13,265,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	149,400.00	16,882,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	360	80,700.00	29,052,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	183	83,600.00	15,298,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	140	126,000.00	17,640,000.00	
SHINSEGAE INC	79	284,500.00	22,475,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	160,000.00	9,120,000.00	
E-MART INC	200	126,500.00	25,300,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	471	37,550.00	17,686,050.00	

CJ CHEILJEDANG CORP	85	239,500.00	20,357,500.00	
KT&G CORP	1,282	95,500.00	122,431,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	275	105,500.00	29,012,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	529,000.00	6,877,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	386	186,000.00	71,796,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	381	77,000.00	29,337,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	120	1,267,000.00	152,040,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	533	46,350.00	24,704,550.00	
CELLTRION INC	1,006	168,000.00	169,008,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	66	320,000.00	21,120,000.00	
HELIXMITH CO LTD	222	80,900.00	17,959,800.00	
MEDY-TOX INC	46	292,000.00	13,432,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	184	388,000.00	71,392,000.00	
YUHAN CORP	99	219,500.00	21,730,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	7,380.00	18,782,100.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,166	36,750.00	116,350,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	11,900.00	30,832,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,298	48,050.00	206,518,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,872	44,100.00	214,855,200.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,913	11,450.00	56,253,850.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	484	67,000.00	32,428,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	4,174	3,590.00	14,984,660.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,701	7,300.00	34,317,300.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	12,250.00	18,865,000.00	
SAMSUNG CARD CO	380	37,950.00	14,421,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	698	36,200.00	25,267,600.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	55,800.00	26,895,600.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	2,265.00	9,338,595.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	720	28,350.00	20,412,000.00	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	200	28,800.00	5,760,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	347	236,000.00	81,892,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	818	73,000.00	59,714,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	401	192,500.00	77,192,500.00	
KMW CO LTD	170	51,200.00	8,704,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	2,274	16,100.00	36,611,400.00	

	LG INNOTEK CO LTD	110	130,500.00	14,355,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	574	117,500.00	67,445,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	56,470	51,200.00	2,891,264,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	5,200	41,900.00	217,880,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	590	223,000.00	131,570,000.00	
	LG UPLUS CORP	1,336	13,800.00	18,436,800.00	
	SK TELECOM	230	239,000.00	54,970,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,957	28,600.00	84,570,200.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	37,950.00	8,538,750.00	
	SK HYNIX INC	6,106	80,700.00	492,754,200.00	
	韓国ウォン 小計	169,593		8,879,820,980.00 (810,727,655)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	95.40	1,335,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	46.35	1,019,700.00	
	CHINA STEEL CORP	132,000	23.40	3,088,800.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	86.50	3,373,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	50,000	96.70	4,835,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	58,000	70.90	4,112,200.00	
	TAIWAN CEMENT	55,121	42.05	2,317,838.05	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	443.50	443,500.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	32,000	29.25	936,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	267.00	563,637.00	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	9.04	153,680.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	13.95	363,020.85	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,550	12.20	140,910.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	35.70	785,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	19,000	40.85	776,150.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	391.00	789,820.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	192.00	652,800.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	33.85	338,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	202.00	606,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	280.00	560,000.00	
	POU CHEN	23,000	39.05	898,150.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	74.00	177,600.00	
	TATUNG CO LTD	21,000	21.60	453,600.00	

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	615.00	1,845,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	304.00	1,824,000.00	
STANDARD FOODS CORP	3,120	68.60	214,032.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	54,000	72.40	3,909,600.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	62,554	22.80	1,426,231.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	208,000	21.85	4,544,800.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	117,425	27.25	3,199,831.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	112,551	23.00	2,588,673.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	89,778	21.75	1,952,671.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	122,000	30.15	3,678,300.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	120,995	12.85	1,554,785.75	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	108,785	14.30	1,555,625.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	60,545	12.40	750,758.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	102,626	20.80	2,134,620.80	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	38,000	50.30	1,911,400.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,536	134.50	1,820,592.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	113,000	19.90	2,248,700.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	87,000	41.30	3,593,100.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	139,000	9.66	1,342,740.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	25.45	669,844.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	74,000	45.45	3,363,300.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	99,835	10.25	1,023,308.75	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	10,000	46.30	463,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	45.75	289,140.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	164.50	987,000.00	
ACER INC	31,000	17.90	554,900.00	
ADVANTECH CO LTD	4,000	300.00	1,200,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	230.50	1,844,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	9.03	776,580.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	254.00	1,778,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	7,015	92.30	647,484.50	
COMPAL ELECTRONICS	49,000	18.90	926,100.00	
DELTA ELECTRONICS INC	22,000	143.00	3,146,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	10,000	67.90	679,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	138,800	91.00	12,630,800.00	

	INNOLUX CORP	91,000	8.04	731,640.00	
	INVENTEC CORP	27,000	23.15	625,050.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	1,500	4,820.00	7,230,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	22,000	49.55	1,090,100.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	85.10	595,700.00	
	PEGATRON CORP	21,000	68.40	1,436,400.00	
	QUANTA COMPUTER INC	30,000	61.50	1,845,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	37.00	629,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	184.00	552,000.00	
	WISTRON CORP	33,951	29.20	991,369.20	
	WIWYNN CORP	1,000	579.00	579,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	15,960	38.20	609,672.00	
	YAGEO CORPORATION	3,198	372.50	1,191,255.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	136.50	819,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	42,000	112.00	4,704,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	15,000	72.80	1,092,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	18,000	114.00	2,052,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	39,000	80.00	3,120,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	361.50	723,000.00	
	MEDIATEK INC	17,000	426.50	7,250,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	76.00	912,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	225.50	1,578,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	300.50	601,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	8,000	94.50	756,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	230.50	1,152,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	275,000	316.00	86,900,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	130,000	16.25	2,112,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	10,000	76.70	767,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	294.50	1,178,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	34,000	18.70	635,800.00	
	新台湾ドル 小計	3,614,439		236,255,310.35	(841,068,904)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,346	499.65	3,670,428.90	
	COAL INDIA LTD	13,201	191.65	2,529,971.65	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,166	268.90	1,926,937.40	

INDIAN OIL CORP LTD	20,764	125.50	2,605,882.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,649	126.30	3,492,068.70
PETRONET LNG LTD	6,627	272.65	1,806,851.55
RELIANCE INDUSTRIES LTD	31,700	1,572.60	49,851,420.00
AMBUJA CEMENTS LTD	7,399	199.70	1,477,580.30
ASIAN PAINTS LTD	3,257	1,726.35	5,622,721.95
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,509	497.45	1,248,102.05
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,382	766.30	2,591,626.60
HINDALCO INDUSTRIES LTD	11,115	198.85	2,210,217.75
JSW STEEL LTD	7,943	258.85	2,056,045.55
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,482	1,327.10	1,966,762.20
SHREE CEMENT LTD	99	20,321.15	2,011,793.85
TATA STEEL LTD	3,407	406.70	1,385,626.90
ULTRATECH CEMENT LTD	1,145	4,151.45	4,753,410.25
UPL LTD	6,089	563.55	3,431,455.95
VEDANTA LTD	21,197	142.60	3,022,692.20
ASHOK LEYLAND LTD	13,960	77.35	1,079,806.00
HAVELLS INDIA LTD	2,904	658.40	1,911,993.60
LARSEN & TOUBRO LTD	5,399	1,276.00	6,889,124.00
SIEMENS LTD	766	1,474.80	1,129,696.80
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,972	373.60	2,604,739.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,410	559.25	1,347,792.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	850	1,327.80	1,128,630.00
BAJAJ AUTO LTD	970	3,225.55	3,128,783.50
BHARAT FORGE LTD	2,548	445.20	1,134,369.60
BOSCH LTD	73	15,218.40	1,110,943.20
EICHER MOTORS LTD	154	20,997.15	3,233,561.10
HERO MOTOCORP LTD	1,135	2,381.75	2,703,286.25
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	8,530	513.65	4,381,434.50
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,199	6,994.75	8,386,705.25
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	11,300	134.40	1,518,720.00
TATA MOTORS LTD	18,355	160.50	2,945,977.50
PAGE INDUSTRIES LTD	54	21,937.95	1,184,649.30
TITAN CO LTD	3,557	1,178.05	4,190,323.85
INFO EDGE INDIA LTD	664	2,485.60	1,650,438.40

ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	8,077	284.15	2,295,079.55	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,191	1,780.55	2,120,635.05	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	655	3,058.40	2,003,252.00	
ITC LTD	38,619	241.45	9,324,557.55	
NESTLE INDIA LTD	261	14,232.50	3,714,682.50	
UNITED SPIRITS LTD	3,303	586.05	1,935,723.15	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,466.80	1,026,760.00	
DABUR INDIA LTD	6,140	465.35	2,857,249.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,140	658.05	2,724,327.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	7,331	2,008.15	14,721,747.65	
MARICO LTD	4,549	340.75	1,550,071.75	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,579	448.30	1,156,165.70	
CIPLA LTD	3,351	447.90	1,500,912.90	
DIVI'S LABORATORIES LTD	700	1,806.30	1,264,410.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,316	2,908.75	3,827,915.00	
LUPIN LTD	2,600	755.95	1,965,470.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	800	1,647.80	1,318,240.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	9,619	427.00	4,107,313.00	
AXIS BANK LTD	23,522	732.00	17,218,104.00	
BANDHAN BANK LTD	4,494	543.20	2,441,140.80	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	18,395	2,311.40	42,518,203.00	
ICICI BANK LTD	53,005	526.50	27,907,132.50	
LIC HOUSING FINANCE LTD	3,542	433.40	1,535,102.80	
STATE BANK OF INDIA	20,286	316.70	6,424,576.20	
BAJAJ FINANCE LTD	1,979	3,944.85	7,806,858.15	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	475	2,984.20	1,417,495.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	3,822	338.30	1,292,982.60	
REC LTD	7,000	129.70	907,900.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,008	1,093.40	2,195,547.20	
BAJAJ FINSERV LTD	424	8,929.00	3,785,896.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	5,000	572.50	2,862,500.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,609	1,371.15	2,206,180.35	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,770	489.65	1,845,980.50	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,852	942.00	3,628,584.00	
DLF LTD	6,420	217.15	1,394,103.00	

	HCL TECHNOLOGIES LTD	12,260	552.05	6,768,133.00
	INFOSYS LTD	37,724	717.25	27,057,539.00
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,129	2,060.45	20,870,298.05
	TECH MAHINDRA LTD	5,249	750.35	3,938,587.15
	WIPRO LTD	13,013	240.40	3,128,325.20
	BHARTI AIRTEL LTD	23,045	445.85	10,274,613.25
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	260.40	624,960.00
	GAIL INDIA LTD	14,950	116.20	1,737,190.00
	NTPC LTD	27,098	112.70	3,053,944.60
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	20,817	187.95	3,912,555.15
	TATA POWER CO LTD	14,068	52.45	737,866.60
	インドルピー 小計	701,564		418,229,380.20 (644,073,245)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	5,400	22.65	122,310.00
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.55	123,930.00
	INDUSTRIES QATAR	21,013	10.27	215,803.51
	COMMERCIAL BANK PQSC	22,400	4.46	99,904.00
	MASRAF AL RAYAN	43,202	3.91	168,919.82
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	8,438	9.69	81,764.22
	QATAR ISLAMIC BANK	12,010	15.20	182,552.00
	QATAR NATIONAL BANK	51,178	19.31	988,247.18
	QATAR INSURANCE CO	11,300	3.08	34,804.00
	BARWA REAL ESTATE CO	21,430	3.45	73,933.50
	OORED00 QPSC	9,487	7.23	68,591.01
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,415	16.22	104,051.30
	カタールリアル 小計	260,873		2,264,810.54 (67,287,521)
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	2,451	135.54	332,208.54
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	621	1,267.88	787,353.48
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,713	275.67	1,299,232.71
	GOLD FIELDS LTD	9,532	85.04	810,601.28
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,788	127.00	1,116,076.00
	KUMBA IRON ORE LTD	771	415.74	320,535.54
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,885	112.80	438,228.00
	SASOL LTD	6,375	263.09	1,677,198.75

SIBANYE GOLD LTD	24,891	30.85	767,887.35
BIDVEST GROUP LTD	3,332	192.27	640,643.64
MULTICHOICE GROUP LTD	4,992	116.26	580,369.92
MR PRICE GROUP LTD	2,412	181.76	438,405.12
NASPERS LTD-N SHS	4,864	2,052.28	9,982,289.92
PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	17.55	174,640.05
THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	151.92	357,315.84
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	9,500	48.50	460,750.00
BID CORP LTD	3,796	334.00	1,267,864.00
CLICKS GROUP LTD	2,931	252.65	740,517.15
PICK N PAY STORES LTD	4,165	66.88	278,555.20
SHOPRITE HOLDINGS LTD	5,362	134.37	720,491.94
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,219	199.69	443,112.11
TIGER BRANDS LTD	1,537	205.41	315,715.17
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	23.69	302,355.47
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,567	111.25	508,078.75
ABSA GROUP LTD	7,686	146.07	1,122,694.02
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	484	1,380.00	667,920.00
NEDBANK GROUP LTD	3,933	215.76	848,584.08
STANDARD BANK GROUP LTD	14,223	162.57	2,312,233.11
FIRSTRAND LTD	38,316	62.21	2,383,638.36
INVESTEC LTD	3,650	82.56	301,344.00
PSG GROUP LTD	1,851	229.52	424,841.52
REINET INVESTMENTS SCA	1,778	283.07	503,298.46
REMGRO LTD	6,142	191.73	1,177,605.66
RMB HOLDINGS LTD	9,165	79.50	728,617.50
DISCOVERY LTD	4,432	112.55	498,821.60
LIBERTY HOLDINGS LTD	800	111.40	89,120.00
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	21.05	212,226.10
OLD MUTUAL LTD	54,790	18.70	1,024,573.00
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	8,594	28.97	248,968.18
SANLAM LTD	21,283	77.60	1,651,560.80
NEPI ROCKCASTLE PLC	4,359	127.14	554,203.26
MTN GROUP LTD	19,135	86.06	1,646,758.10
TELKOM SA SOC LTD	2,500	42.64	106,600.00

	VODACOM GROUP LTD	7,288	114.85	837,026.80	
	南アフリカランド 小計	357,261		42,101,060.48 (311,968,858)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	29,639	7.40	219,328.60	
	DUBAI ISLAMIC BANK	19,940	5.31	105,881.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	31,076	15.20	472,355.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	45,017	2.18	98,137.06	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.89	57,973.86	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	40,305	4.05	163,235.25	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	18,405	16.32	300,369.60	
	アラブディルハム 小計	215,056		1,417,280.97 (41,994,035)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.78	13,560.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	19,800	4.95	98,010.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	17.49	26,235.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	3.37	3,707.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	6.72	3,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	5.65	28,815.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	8.63	21,575.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.96	2,088.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	8.40	31,080.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	5.81	2,324.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	32.19	28,971.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.51	9,424.41	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.35	7,035.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	3.14	2,449.20	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,200	48.19	154,208.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	5.63	45,040.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.31	2,979.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	23.91	28,692.00	
	BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	2,000	5.74	11,480.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	9.51	27,579.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	3.74	25,432.00		
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	10.23	5,115.00		
GEM CO LTD-A	3,500	4.21	14,735.00		

GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	5,000	8.77	43,850.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	14.48	52,417.60
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,500	13.26	19,890.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.55	3,825.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	22.25	24,475.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.61	16,135.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.31	23,449.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	3.01	10,535.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	56.70	17,010.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	14.50	4,350.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	28.32	5,664.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	7.33	2,932.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	12.85	21,845.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,200	9.23	11,076.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.80	1,960.00
NANJING IRON & STEEL CO-A	3,700	3.30	12,210.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.83	20,376.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	12.13	4,852.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	8.77	18,417.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	420	31.11	13,066.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	17.47	24,458.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.16	21,600.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	24.00	19,200.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	9.09	19,998.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	4.06	19,488.00
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	3,800	3.30	12,540.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,500	8.49	12,735.00
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	4.11	2,055.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	7,400	1.44	10,656.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.87	2,322.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	14.96	16,456.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	27.72	5,544.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	13.14	19,710.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.17	3,255.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	6.87	8,931.00

WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,500	50.70	126,750.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	41.68	16,672.00	
WESTERN MINING CO -A	2,000	5.57	11,140.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	12.20	14,640.00	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	1,800	6.53	11,754.00	
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	3,300	4.04	13,332.00	
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	2,700	4.96	13,392.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	12.74	21,658.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	42.90	25,740.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	1,400	10.04	14,056.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	31.60	8,216.00	
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	1,200	9.86	11,832.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	6.93	15,939.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	13.35	5,340.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	7.98	3,192.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,800	3.85	6,930.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	13.08	13,080.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	200	20.29	4,058.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	16.11	6,444.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	6.91	20,730.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	30.03	3,003.00	
AVICOPTER PLC-A	500	46.20	23,100.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	22.68	31,752.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	5.88	13,524.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	13.71	1,371.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	9.11	2,733.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.23	3,115.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	240	9.89	2,373.60	
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	12.67	11,403.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	6.23	3,115.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3,800	9.78	37,164.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	18,000	5.70	102,600.00	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	1,900	10.36	19,684.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	7,900	5.25	41,475.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	20.58	2,058.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION -A	32,600	5.23	170,498.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,800	92.89	167,202.00	
CRRG CORP LTD-A	15,400	6.95	107,030.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	9.04	5,424.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	800	50.00	40,000.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	298	11.13	3,316.74	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	12.36	12,360.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	38.28	22,968.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	29.56	35,472.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.37	14,518.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	700	44.91	31,437.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	8.14	21,164.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.73	4,914.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,439	20.82	29,959.98	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	4.09	16,360.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	2,500	15.55	38,875.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.52	19,712.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	4.74	3,792.00	
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	700	16.26	11,382.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.94	1,782.00	
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	700	16.92	11,844.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	27.66	19,362.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	13.75	17,875.00	
SINOCHEM INTL CORP-A	2,300	5.15	11,845.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	18.61	24,193.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	7.83	3,132.00	
TBEA CO LTD-A	400	6.40	2,560.00	
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	3,500	3.04	10,640.00	
WEICHAO POWER CO LTD-A	800	14.01	11,208.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	4.65	5,115.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	8.45	2,535.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.88	4,752.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	23.38	4,676.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	300	66.35	19,905.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,300	14.98	34,454.00	

ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	11.89	15,457.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.21	2,842.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	45.01	22,505.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	6.03	5,427.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.54	19,604.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	14.18	19,852.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	49.62	39,696.00	
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	200	8.76	1,752.00	
AIR CHINA LTD-A	800	8.57	6,856.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	5.12	6,656.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	6.67	7,337.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.50	3,750.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.89	5,868.00	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	24,000	2.00	48,000.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	5,100	7.89	40,239.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	2.99	2,990.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	3,500	17.58	61,530.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	4,000	13.33	53,320.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.66	20,130.00	
S F HOLDING CO LTD-A	200	36.61	7,322.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	77.46	23,238.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	5.62	5,620.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	9.52	18,088.00	
SINOTRANS LIMITED-A	12,000	4.21	50,520.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	41.00	4,100.00	
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	19,000	2.52	47,880.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	900	29.51	26,559.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	5.86	18,752.00	
BYD CO LTD -A	200	43.38	8,676.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	85.40	17,080.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	200	21.53	4,306.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	8.13	4,065.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	22.24	4,448.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	11.43	2,286.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,000	24.52	24,520.00	

NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	15.95	19,140.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	5,010	22.68	113,626.80
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	20.76	2,076.00
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	5.15	2,060.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	18.93	1,893.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	7.08	14,160.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	62.15	87,010.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	16.88	33,760.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	31.70	3,170.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	2,200	56.81	124,982.00
NAVINFO CO LTD-A	3,500	16.40	57,400.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	100.19	10,019.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	2,600	17.43	45,318.00
TCL CORP-A	1,900	4.09	7,771.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.63	3,852.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	900	76.20	68,580.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	18.17	14,536.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	1,600	85.30	136,480.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	25.26	15,156.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.10	7,810.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	600	28.60	17,160.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	5,400	10.30	55,620.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	15.05	3,010.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	11.49	2,298.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.20	1,220.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.38	1,690.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,700	5.61	9,537.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	100	306.14	30,614.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.68	3,536.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	510	32.48	16,564.80
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	5,200	11.18	58,136.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.00	2,700.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	37.70	3,770.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	3,800	16.06	61,028.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	200	24.32	4,864.00

YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	2,700	18.24	49,248.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	3.35	1,675.00
HLA CORP LTD -A	200	7.65	1,530.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	14.05	2,810.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.73	38,650.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	9.96	32,868.00
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	2,000	20.01	40,020.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.10	30,600.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	65.30	13,060.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	300	73.56	22,068.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.18	22,258.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	28.74	20,118.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	122.35	36,705.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	54.65	27,325.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	4.26	2,130.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	49.08	29,448.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.25	15,000.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	50.86	20,344.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	26.98	18,886.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,300	107.50	139,750.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	24.43	21,987.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	31.78	41,314.00
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVE-A	1,500	28.35	42,525.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	9.45	23,625.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	400	29.10	11,640.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	3,700	30.85	114,145.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	31.34	31,340.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	700	99.94	69,958.00
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	2,000	15.25	30,500.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	1,000	39.22	39,220.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	1,000	43.95	43,950.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,158.70	926,960.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	500	82.36	41,180.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	1,200	88.70	106,440.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	20.74	53,924.00

SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	100	87.61	8,761.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	56.00	22,400.00
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	1,000	12.13	12,130.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	42.17	21,085.00
TONGWEI CO LTD-A	400	13.56	5,424.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	51.36	5,136.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	4,200	34.82	146,244.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,800	130.49	365,372.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	12.97	14,267.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	15.29	19,877.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	29.93	17,958.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1,170	39.99	46,788.30
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	500	97.08	48,540.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	1,100	42.22	46,442.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	1,900	23.92	45,448.00
CHINA REFORM HEALTH MANAGE-A	2,600	17.18	44,668.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	23.23	5,575.20
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	700	67.66	47,362.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	2,500	19.32	48,300.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	13.51	2,702.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	30.95	21,665.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	14.36	6,892.80
OVCTEK CHINA INC-A	900	49.00	44,100.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	17.67	3,534.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	200	181.90	36,380.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	500	102.82	51,410.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	3,200	15.21	48,672.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	123.12	24,624.00
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	900	12.63	11,367.00
BEIJING Tiantan Biological-A	900	26.48	23,832.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	25.62	5,124.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	67.01	20,103.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	60.30	18,090.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	428.98	42,898.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	37.89	22,734.00

CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	900	12.42	11,178.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	29.13	2,913.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	500	45.98	22,990.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	35.87	3,587.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	32.64	6,528.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	900	50.83	45,747.00
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	1,200	8.53	10,236.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	62.80	18,840.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,200	32.49	38,988.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	22.30	15,610.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	2,500	83.62	209,050.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.69	15,690.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	18.02	16,218.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	9.42	15,072.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	29.92	14,960.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	500	42.05	21,025.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.93	5,181.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	25.12	5,024.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	18.30	16,470.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	81.35	24,405.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	18.11	1,811.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	11.09	11,090.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	22.07	4,414.00
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	14.86	2,972.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.38	2,476.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	30.34	18,204.00
WUXI APPTec CO LTD-A	1,400	90.50	126,700.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	14.92	14,920.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	86.24	94,864.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	100	100.24	10,024.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	6.14	13,508.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,100	17.19	18,909.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	22.36	39,800.80
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	46.30	18,520.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	41,700	3.61	150,537.00

BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	5.57	41,775.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	8.54	12,810.00	
BANK OF CHINA LTD-A	23,400	3.62	84,708.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	26,200	5.50	144,100.00	
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	280	9.35	2,618.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	8.80	4,400.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	7.07	22,624.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	8.33	19,992.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	27.05	91,970.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	9.25	81,492.50	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.96	3,576.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	7.09	21,270.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	25,600	4.17	106,752.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	13,900	36.27	504,153.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	24,600	6.21	152,766.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	7.44	32,736.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	31,400	5.74	180,236.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	18.91	259,067.00	
PING AN BANK CO LTD-A	10,200	15.41	157,182.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	16,800	11.90	199,920.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	3.96	1,980.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.54	4,086.00	
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	3.49	34,900.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	9.73	14,595.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	6.31	5,048.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	1,900	17.12	32,528.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,300	22.25	140,175.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	3,400	22.70	77,180.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.96	2,192.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	2,700	14.20	38,340.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	11.70	4,680.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.94	3,970.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	800	6.69	5,352.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	800	13.97	11,176.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	11.63	6,978.00	

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	2,500	17.56	43,900.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.42	4,210.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,800	14.18	39,704.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	97.60	19,520.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	6.08	2,432.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	7,100	17.94	127,374.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.44	2,832.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	6.31	4,417.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	7,000	7.61	53,270.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	7.94	23,820.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	600	9.94	5,964.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	16,000	3.40	54,400.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	11.45	6,870.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	10,000	4.67	46,700.00
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	5,000	8.78	43,900.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.56	3,024.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.86	73,872.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	8.37	2,511.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.67	2,601.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.41	16,758.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.79	4,395.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	8.57	51,420.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	800	33.23	26,584.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	3,500	34.81	121,835.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	6.65	3,990.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	700	45.79	32,053.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	7,700	83.65	644,105.00
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	7.70	16,940.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.35	14,790.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,100	27.48	30,228.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	6,500	19.06	123,890.00
CHINA VANKE CO LTD -A	5,500	28.17	154,935.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	8.00	3,200.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	36.60	29,280.00
GEMDALE CORP-A	600	12.72	7,632.00

GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	6.82	18,414.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.69	8,028.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.09	28,179.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.19	5,033.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.23	5,076.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	7,200	15.54	111,888.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.97	5,382.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	14.48	13,032.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	6.91	17,275.00
TAHOE GROUP CO LTD-A	2,100	5.83	12,243.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.93	4,716.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	7.83	26,622.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	800	3.91	3,128.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	21.40	6,420.00
AISINO CORP-A	200	21.15	4,230.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	37.17	3,717.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	2,000	19.94	39,880.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	800	81.60	65,280.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	2,000	17.37	34,740.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	10.39	4,156.00
GLODON CO LTD-A	1,800	33.30	59,940.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	130	74.29	9,657.70
IFLYTEK CO LTD - A	300	32.54	9,762.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	2,000	15.59	31,180.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	500	115.00	57,500.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	3.12	2,433.60
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,000	35.20	35,200.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	2,000	19.64	39,280.00
VENUSTECH GROUP INC-A	1,500	31.31	46,965.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	9.11	8,199.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	260	29.36	7,633.60
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	28.95	17,370.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	39.35	35,415.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	4.12	84,460.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	20.56	14,392.00

CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	16.34	42,484.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	800	35.40	28,320.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	25.26	27,786.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	1,200	17.53	21,036.00
GOERTEK INC -A	500	20.54	10,270.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	8.29	18,238.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	5,200	10.80	56,160.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.40	3,120.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	7,200	30.69	220,968.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	15.72	3,144.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.27	14,756.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	12.88	11,592.00
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	1,700	9.05	15,385.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	1,200	31.85	38,220.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	13.89	18,057.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.38	14,674.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	3,080	36.36	111,988.80
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	400	88.64	35,456.00
NINESTAR CORP-A	100	30.00	3,000.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	14.00	5,600.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,100	23.44	49,224.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	300	146.88	44,064.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	42.90	38,610.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	20.97	14,679.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.62	4,686.00
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	4.80	3,840.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	49.78	24,890.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	140	29.70	4,158.00
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	16.59	21,567.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	25.45	20,360.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	800	19.92	15,936.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	23.11	36,976.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	40.39	16,156.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	500	74.86	37,430.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	17.28	6,912.00

	ZTE CORP-A	1,300	31.60	41,080.00	
	CHINA UNITED NETWORK-A	18,500	5.66	104,710.00	
	CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.53	11,325.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.93	21,199.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	15,900	17.92	284,928.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.29	6,412.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.71	4,823.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	800	5.83	4,664.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	4.20	2,520.00	
	INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.70	13,230.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.80	9,680.00	
	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.63	16,786.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.94	4,158.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	6.09	3,045.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.85	6,895.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	6.19	26,617.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	400	196.85	78,740.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	16.00	32,000.00	
	JIANGSU CHANGJIANG ELECTRO-A	1,300	22.90	29,770.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,200	25.22	30,264.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	300	17.40	5,220.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	213.95	53,487.50	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	10.79	24,817.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	16.20	17,820.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	500	145.86	72,930.00	
	オフショア人民元 小計	1,178,528		16,160,565.93 (249,519,137)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,027	19.72	59,692.44	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,224	48.00	58,752.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	11.90	45,005.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	16.26	56,910.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	1,897	73.50	139,429.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,879	41.80	203,942.20	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	8,438	93.00	784,734.00	
	SAUDI CEMENT	865	70.00	60,550.00	

SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,544	20.88	53,118.72	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,000	10.24	81,920.00	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,200	51.00	112,200.00	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	90.60	38,233.20	
JARIR MARKETING CO	629	159.80	100,514.20	
ALMARAI CO	2,821	50.00	141,050.00	
SAVOLA	2,962	31.45	93,154.90	
AL RAJHI BANK	13,807	63.50	876,744.50	
ALINMA BANK	8,420	24.16	203,427.20	
ARAB NATIONAL BANK	6,732	27.80	187,149.60	
BANK AL-JAZIRA	3,554	14.18	50,395.72	
BANK ALBILAD	4,268	26.80	114,382.40	
BANQUE SAUDI FRANSI	6,201	34.45	213,624.45	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	13,550	48.65	659,207.50	
RIYAD BANK	13,644	23.38	318,996.72	
SAMBA FINANCIAL GROUP	11,127	31.80	353,838.60	
SAUDI BRITISH BANK	8,027	35.10	281,747.70	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	298	102.00	30,396.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	73.90	48,847.90	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	5,942	10.70	63,579.40	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	9.10	39,084.50	
ETIHAD ETISALAT CO	4,227	22.82	96,460.14	
SAUDI TELECOM CO	4,487	98.50	441,969.50	
SAUDI ELECTRICITY CO	9,459	20.16	190,693.44	
サウジアラビアリアル 小計	165,889		6,199,752.23 (179,978,807)	
合 計	29,763,538		7,078,375,539 (7,078,375,539)	

(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	35,500	1,015,300.00	

メキシコペソ 小計		35,500	1,015,300.00 (5,736,445)
南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	240,185.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	33,820	763,655.60
	REDEFINE PROPERTIES LTD	62,770	499,649.20
南アフリカランド 小計		108,690	1,503,489.80 (11,140,859)
合計			16,877,304 (16,877,304)

(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 58銘柄	100.0%		13.9%
メキシコペソ	株式 24銘柄	96.5%		2.2%
	投資証券 1銘柄		3.5%	0.1%
ブラジルリアル	株式 52銘柄	100.0%		7.4%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%		0.8%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.0%		0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%		0.3%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%		0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	100.0%		0.9%
香港ドル	株式 208銘柄	100.0%		21.2%
マレーシアリングット	株式 40銘柄	100.0%		1.8%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.0%		2.6%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%		1.0%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%		2.0%
韓国ウォン	株式 106銘柄	100.0%		11.4%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		11.9%
インドルピー	株式 84銘柄	100.0%		9.1%

カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	96.6%		4.4%
	投資証券	3銘柄		3.4%	0.2%
アラブディルハム	株式	7銘柄	100.0%		0.6%
オフショア人民元	株式	468銘柄	100.0%		3.5%
サウジアラビアリアル	株式	32銘柄	100.0%		2.5%

(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国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2019年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	302,049,464
投資証券	21,758,225,320
派生商品評価勘定	821,730
未収入金	64,119,360
未収配当金	121,728,202
差入委託証拠金	6,699,000
流動資産合計	22,253,643,076
資産合計	22,253,643,076
負債の部	
流動負債	
前受金	1,185,800
未払解約金	185,747,000
未払利息	819
その他未払費用	2,570
流動負債合計	186,936,189
負債合計	186,936,189
純資産の部	
元本等	
元本	15,058,754,099

2019年12月10日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,007,952,788
元本等合計	22,066,706,887
純資産合計	22,066,706,887
負債純資産合計	22,253,643,076

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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	12,246,315,328円
期中追加設定元本額	14,752,666,370円
期中一部解約元本額	11,940,227,599円
期末元本額	15,058,754,099円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	387,179,592円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	289,757,109円
りそなラップ型ファンド(成長型)	263,118,153円
DCりそな グローバルバランス	5,968,597円
つみたてバランスファンド	331,815,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	80,767,591円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	36,910,908円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	21,068,863円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	541,645円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	498,580円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	234,493円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	209,251円

FWりそな国内リートインデックスオープン	4,273,584,602円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,291,784,987円
Smart-i Jリートインデックス	2,317,012,545円
Smart-i 8資産バランス 安定型	7,404,257円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	26,451,680円
Smart-i 8資産バランス 成長型	28,623,366円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	75,170,191円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	237,169,520円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	423,754,910円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	237,422,108円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,721,235,833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)	1,069,559円
2. 計算日における受益権の総数	15,058,754,099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	1.4654円
(10,000口当たり純資産額)	(14,654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12月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,907,905,273
合計		1,907,905,273

(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12月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	314,934,270	-	315,756,000	821,730
	合計	314,934,270	-	315,756,000	821,730

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	202	25,290,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	285	35,454,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	653	441,428,000	
	MCUBS Mid City 投資法人	2,522	292,804,200	
	森ヒルズリート投資法人	2,262	395,397,600	
	産業ファンド投資法人	2,419	401,795,900	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,864	636,556,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,223	261,232,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	985	534,855,000	
	GLP 投資法人	4,896	678,096,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	818	279,756,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,824	807,664,000	
	星野リゾート・リート投資法人	299	168,935,000	
	One リート投資法人	306	104,346,000	
	イオンリート投資法人	2,121	317,301,600	
	ヒューリックリート投資法人	1,672	325,705,600	
	日本リート投資法人	639	304,164,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,629	263,693,520	
	日本ヘルスケア投資法人	95	20,187,500	
	積水ハウス・リート投資法人	5,748	543,186,000	
トーセイ・リート投資法人	428	56,881,200		

ケネディクス商業リート投資法人	759	212,444,100
ヘルスケア&メディカル投資法人	419	54,805,200
サムティ・レジデンシャル投資法人	393	45,705,900
野村不動産マスターファンド投資法人	6,131	1,190,027,100
いちごホテルリート投資法人	326	43,781,800
ラサールロジポート投資法人	1,828	303,630,800
スターアジア不動産投資法人	652	75,566,800
マリモ地方創生リート投資法人	169	22,139,000
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	484	231,110,000
大江戸温泉リート投資法人	334	31,262,400
さくら総合リート投資法人	425	40,077,500
投資法人みらい	2,132	128,559,600
森トラスト・ホテルリート投資法人	461	67,306,000
三菱地所物流リート投資法人	387	134,095,500
C R E ロジスティクスファンド投資法人	276	37,784,400
ザイマックス・リート投資法人	285	38,674,500
タカラレーベン不動産投資法人	558	67,239,000
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	304	35,720,000
日本ビルファンド投資法人	1,904	1,534,624,000
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,966	1,454,840,000
日本リテールファンド投資法人	3,715	902,745,000
オリックス不動産投資法人	3,917	924,020,300
日本プライムリアルティ投資法人	1,244	607,072,000
プレミア投資法人	1,776	281,140,800
東急リアル・エステート投資法人	1,318	270,849,000
グローバル・ワン不動産投資法人	1,365	192,055,500
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,414	928,705,600
森トラスト総合リート投資法人	1,405	274,256,000
インヴィンシブル投資法人	8,623	560,495,000
フロンティア不動産投資法人	698	333,644,000
平和不動産リート投資法人	1,224	168,055,200
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,284	351,302,400
福岡リート投資法人	1,017	189,568,800
ケネディクス・オフィス投資法人	608	491,264,000
いちごオフィスリート投資法人	1,522	171,225,000
大和証券オフィス投資法人	454	366,378,000
阪急阪神リート投資法人	888	151,315,200
スターツプロシード投資法人	306	61,077,600
大和ハウスリート投資法人	2,650	784,400,000
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,333	550,337,700
日本賃貸住宅投資法人	2,211	232,818,300
ジャパンエクセレント投資法人	1,760	321,376,000

合計	113,815	21,758,225,320	
----	---------	----------------	--

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2019年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	66,793,777
コール・ローン	18,788,815
投資証券	21,028,048,584
派生商品評価勘定	15,753
未収入金	105,223,756
未収配当金	23,513,278
流動資産合計	21,242,383,963
資産合計	21,242,383,963
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	402
未払金	36,309,848
未払解約金	104,320,000
未払利息	50
その他未払費用	20
流動負債合計	140,630,320
負債合計	140,630,320
純資産の部	
元本等	
元本	17,798,066,656
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,303,686,987
元本等合計	21,101,753,643
純資産合計	21,101,753,643
負債純資産合計	21,242,383,963

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	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12月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	8,033,074,914円
期中追加設定元本額	13,357,919,165円
期中一部解約元本額	3,592,927,423円
期末元本額	17,798,066,656円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	483,584,418円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,869,320,545円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,469,914,338円
DCりそな グローバルバランス	7,101,856円
つみたてバランスファンド	205,342,194円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	111,341,488円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	51,074,545円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	29,890,292円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	749,972円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	724,987円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	333,596円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	295,363円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	6,881,104,156円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,447,993,590円

Smart-i 先進国リートインデックス	704,030,696円
Smart-i 8資産バランス 安定型	9,229,355円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	32,962,517円
Smart-i 8資産バランス 成長型	41,613,499円
りそな・リスクコントロールファンド2019-03	190,122,098円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	591,829,525円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,068,636,469円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	599,107,082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）	1,764,075円
2. 計算日における受益権の総数	17,798,066,656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	1.1856円
(10,000口当たり純資産額)	(11,856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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2019年12月10日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,377,921,525
合計		1,377,921,525

（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12月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	49,804,363	-	49,818,050	13,687

	米ドル	38,669,637	-	38,679,400	9,763
	ユーロ	5,285,503	-	5,289,680	4,177
	オーストラリアドル	2,893,293	-	2,893,410	117
	シンガポールドル	2,955,930	-	2,955,560	370
	売建	17,065,984	-	17,064,320	1,664
	カナダドル	17,065,984	-	17,064,320	1,664
	合計	66,870,347	-	66,882,370	15,351

(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
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	12,700	337,312.00	
		AGREE REALTY CORP	5,968	434,410.72	
		ALEXANDER'S INC	329	106,799.98	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,288	2,645,171.20	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,768	322,562.88	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,549	944,412.19	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	14,969	219,445.54	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,434	962,221.94	
AMERICOLD REALTY TRUST	27,739	1,003,319.63	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	21,285	1,120,655.25	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	29,924	477,287.80	
ARA US HOSPITALITY TRUST	62,000	53,320.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,694	32,626.26	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,100	4,339,791.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	42,100.20	
BOSTON PROPERTIES INC	20,617	2,883,699.79	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	47,535.41	
BRANDYWINE REALTY TRUST	24,847	383,140.74	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	42,843	937,404.84	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	10,124	188,964.46	
BRT APARTMENTS CORP	877	15,917.55	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,844	1,529,623.56	
CARETRUST REIT INC	13,649	294,681.91	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	18,997.65	
CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	44,098.40	
CHATHAM LODGING TRUST	6,036	110,639.88	
CITY OFFICE REIT INC	7,606	100,475.26	
CLIPPER REALTY INC	1,350	12,285.00	
COLONY CAPITAL INC	69,890	337,568.70	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16,607	346,920.23	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	2,643	124,961.04	
CORECIVIC INC	16,769	257,739.53	
COREPOINT LODGING INC	4,800	48,960.00	
CORESITE REALTY CORP	5,255	594,077.75	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15,865	462,306.10	
COUSINS PROPERTIES INC	21,423	869,345.34	
CUBESMART	28,088	877,750.00	
CYRUSONE INC	16,481	1,046,213.88	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28,857	303,575.64	
DIGITAL REALTY TRUST INC	29,921	3,552,221.12	

DOUGLAS EMMETT INC	23,720	1,062,656.00	
DUKE REALTY CORP	52,085	1,830,787.75	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	9,995	232,983.45	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,317	723,377.85	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	20,313	285,600.78	
EPR PROPERTIES	11,036	777,817.28	
EQUINIX INC	12,150	6,812,748.00	
EQUITY COMMONWEALTH	17,750	580,425.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,032	1,888,621.60	
EQUITY RESIDENTIAL	50,008	4,228,176.40	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	11,380	293,945.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,428	2,934,087.88	
EXTRA SPACE STORAGE INC	18,453	1,967,643.39	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	21,574.58	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,048	1,335,680.64	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,218	767,159.98	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,178	284,271.54	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,048	140,580.48	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,075	92,824.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	29,507	1,262,604.53	
GEO GROUP INC/THE	17,028	239,924.52	
GETTY REALTY CORP	4,920	164,672.40	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,336	99,120.96	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	33,959.75	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,293	60,745.95	
GLOBAL NET LEASE INC	12,971	266,554.05	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	18,367	614,376.15	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	29,969	929,039.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	70,780	2,419,968.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,293	75,107.67	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,869	708,210.47	
HOST HOTELS & RESORTS INC	104,917	1,883,260.15	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,569	824,896.95	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	12,806	189,656.86	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	8,860	188,009.20	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,582	115,201.24	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,725	131,134.50	
INVITATION HOMES INC	76,822	2,315,415.08	
IRON MOUNTAIN INC	41,305	1,363,065.00	
JBG SMITH PROPERTIES	16,741	666,626.62	
KILROY REALTY CORP	13,386	1,128,841.38	
KIMCO REALTY CORP	60,816	1,291,123.68	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,163	231,705.15	
LEXINGTON REALTY TRUST	36,225	403,908.75	
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,644	1,393,738.20	
LIFE STORAGE INC	6,647	730,638.24	
LTC PROPERTIES INC	5,890	277,006.70	
MACERICH CO/THE	15,751	433,310.01	
MACK-CALI REALTY CORP	13,067	279,895.14	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	205,900	210,018.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	71,311	1,525,342.29	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,307	2,201,445.00	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	13,429	205,597.99	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,738	1,350,447.42	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,636	301,569.12	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,109	502,526.34	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	94,877.10	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,044	147,725.32	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,799	234,633.49	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	31,166	1,331,411.52	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,220	61,782.60	
PARAMOUNT GROUP INC	28,591	398,272.63	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34,457	843,507.36	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18,776	502,070.24	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	45,027.45	
PHYSICIANS REALTY TRUST	26,264	504,006.16	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,859	399,505.83	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	39,354.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,028	84,271.44	

PROLOGIS INC	90,745	8,292,278.10	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,841	497,487.51	
PUBLIC STORAGE	21,511	4,589,586.96	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	8,153	435,533.26	
REALTY INCOME CORP	45,659	3,458,669.25	
REGENCY CENTERS CORP	24,145	1,559,767.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,132	292,473.16	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	30,473	422,965.24	
RETAIL VALUE INC	2,378	84,942.16	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,753	738,973.23	
RLJ LODGING TRUST	24,349	419,046.29	
RPT REALTY	11,329	165,629.98	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,459	664,373.13	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,784	593,801.28	
SAFEHOLD INC	1,750	73,220.00	
SAUL CENTERS INC	1,742	90,584.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	33,686	262,077.08	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,894	200,115.66	
SERVICE PROPERTIES TRUST	23,927	567,309.17	
SIMON PROPERTY GROUP INC	44,131	6,610,382.49	
SITE CENTERS CORP	21,803	311,782.90	
SL GREEN REALTY CORP	11,881	1,052,656.60	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,418	761,414.58	
STAG INDUSTRIAL INC	18,074	559,571.04	
STORE CAPITAL CORP	30,171	1,192,056.21	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,535	190,459.10	
SUN COMMUNITIES INC	12,964	2,066,591.24	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,451	456,585.57	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,381	226,932.18	
TAUBMAN CENTERS INC	8,733	278,058.72	
TERRENO REALTY CORP	9,348	532,742.52	
UDR INC	41,871	2,003,527.35	
UMH PROPERTIES INC	5,542	87,175.66	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,863	227,025.18	
URBAN EDGE PROPERTIES	16,699	342,162.51	

	URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,901	96,432.72
	VENTAS INC	53,428	3,072,110.00
	VEREIT INC	151,553	1,459,455.39
	VICI PROPERTIES INC	66,511	1,657,454.12
	VORNADO REALTY TRUST	22,786	1,502,736.70
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	24,973	96,645.51
	WASHINGTON REIT	11,021	340,218.27
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,112	536,632.32
	WELLTOWER INC	58,049	4,826,193.86
	WHITESTONE REIT	5,894	81,101.44
	WP CAREY INC	24,523	2,005,981.40
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,306	350,742.06
	米ドル 小計	3,440,854	142,730,270.27 (15,510,498,470)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,276	439,041.80
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,399	126,035.88
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,044	148,395.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,340	626,988.60
	CHOICE PROPERTIES REIT	20,827	290,328.38
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,239	178,567.01
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,405	103,568.85
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,185	158,376.75
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	14,614	244,784.50
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	8,081	111,436.99
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,668	114,368.24
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,614	247,486.72
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,004	434,286.84
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,695	141,467.65
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,249	143,530.20
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,685	63,178.05
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,747	51,368.90
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,233	128,556.21
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	8,725	111,069.25
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,605	599,754.80
	SLATE OFFICE REIT	4,169	24,763.86

	SLATE RETAIL REIT - U	2,120	27,411.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,619	305,499.44
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,141	117,187.62
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	35,712.00
	カナダドル 小計	218,484	4,973,165.14 (408,097,931)
ユーロ	AEDIFICA	3,543	396,816.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	22,573	381,032.24
	ALTAREA	459	91,249.20
	BEFIMMO	3,244	183,934.80
	COFINIMMO	3,511	465,558.60
	COVIVIO	6,282	640,764.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	6,000	153,600.00
	GECINA SA	7,859	1,237,006.60
	HAMBORNER REIT AG	11,095	107,532.74
	HIBERNIA REIT PLC	103,689	151,385.94
	ICADE	3,990	373,464.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,320	45,676.80
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	35,026	403,149.26
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,311	88,569.25
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	67,357	123,263.31
	KLEPIERRE	29,975	995,469.75
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	9,624	72,949.92
	MERCIALYS	3,481	42,259.34
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	53,126	685,325.40
	MONTEA	1,654	133,147.00
	NSI NV	2,415	100,705.50
	RETAIL ESTATES	1,568	133,436.80
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,701	2,789,661.60
	VASTNED RETAIL NV	2,377	63,465.90
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,706	432,960.00
	WERELDHAVE NV	5,912	128,763.36
	ユーロ 小計	417,798	10,421,147.31 (1,252,934,541)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	18,660.00
	ASSURA PLC	346,515	274,786.39

	BIG YELLOW GROUP PLC	21,314	245,111.00	
	BRITISH LAND CO PLC	133,382	812,296.38	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	46,200	12,889.80	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	95,927	84,415.76	
	DERWENT LONDON PLC	15,300	584,460.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	78,846	76,086.39	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	37,968	325,841.37	
	HAMMERSON PLC	110,854	340,876.05	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	61,038	64,700.28	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	42,070.78	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,485	1,036,031.75	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	123,689	292,153.41	
	LXI REIT PLC	74,342	96,347.23	
	NEWRIVER REIT PLC	41,666	84,581.98	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	87,000	81,084.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	177,813	270,275.76	
	RDI REIT PLC	40,782	52,200.96	
	REGIONAL REIT LTD	63,560	69,026.16	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	29,058	226,071.24	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	86,640	47,825.28	
	SEGRO PLC	156,125	1,371,402.00	
	SHAFTESBURY PLC	32,016	308,314.08	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	47,121	41,937.69	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	246,045	366,853.09	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	126,619	108,512.48	
	UNITE GROUP PLC	53,177	657,799.49	
	WORKSPACE GROUP PLC	18,011	210,188.37	
	英ボンド 小計	2,597,042	8,202,799.17 (1,172,015,945)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	51,226	194,658.80	
	APN INDUSTRIA REIT	11,379	33,795.63	
	ARENA REIT	42,342	125,755.74	
	BWP TRUST	71,025	301,146.00	
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	43,500	137,025.00	
	CHARTER HALL GROUP	66,088	693,924.00	

	CHARTER HALL LONG WALE REIT	47,605	279,917.40
	CHARTER HALL RETAIL REIT	54,211	246,117.94
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	36,680	122,878.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	260,913	315,704.73
	DEXUS	156,102	1,899,761.34
	GDI PROPERTY GROUP	78,244	120,886.98
	GOODMAN GROUP	230,113	3,336,638.50
	GPT GROUP	272,107	1,638,084.14
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	43,404	190,109.52
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	23,020	74,815.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	35,077	157,495.73
	MIRVAC GROUP	570,551	1,945,578.91
	NATIONAL STORAGE REIT	113,471	218,999.03
	RURAL FUNDS GROUP	36,734	66,304.87
	SCENTRE GROUP	765,152	2,984,092.80
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	123,977	331,018.59
	STOCKLAND	349,425	1,757,607.75
	VICINITY CENTRES	455,994	1,203,824.16
	VIVA ENERGY REIT	70,923	196,456.71
	オーストラリアドル 小計	4,009,263	18,572,597.27 (1,378,086,717)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	127,750	178,211.25
	GOODMAN PROPERTY TRUST	160,089	348,994.02
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	220,014	336,621.42
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	151,114	275,783.05
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	51,700	137,005.00
	ニュージーランドドル 小計	710,667	1,276,614.74 (90,907,735)
香港ドル	CHAMPION REIT	276,000	1,371,720.00
	FORTUNE REIT	199,000	1,787,020.00
	LINK REIT	302,400	24,418,800.00
	PROSPERITY REIT	180,000	540,000.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	133,000	670,320.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	210,000	1,085,700.00
	香港ドル 小計	1,300,400	29,873,560.00 (414,645,012)

シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	50,800	72,136.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	128,300	143,696.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	430,000	1,302,900.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	171,800	235,366.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	159,000	114,480.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	403,500	807,000.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	414,400	1,044,288.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	114,800	182,532.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	116,800	190,384.00	
	ESR REIT	294,300	160,393.50	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	104,300	76,139.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	89,100	90,882.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	109,800	300,852.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	86,100	143,787.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	82,800	58,374.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	233,400	287,082.00	
	KEPPEL DC REIT	168,800	342,664.00	
	KEPPEL REIT	279,500	349,375.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	218,800	52,512.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	310,900	727,506.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	219,800	571,480.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	413,500	711,220.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	292,400	339,184.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	376,200	208,791.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	60,400	194,488.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	137,400	65,265.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	59,500	52,955.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	52,972.50	
	SPH REIT	114,700	121,582.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	212,500	154,062.50	
SUNTEC REIT	330,400	607,936.00		
	シンガポールドル 小計	6,284,900	9,762,284.50	(780,006,531)
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	31,529,000.00	
	韓国ウォン 小計	4,100	31,529,000.00	

				(2,878,597)
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	26,165	573,798.45
		イスラエルシュケル 小計	26,165	573,798.45 (17,977,105)
	合計			21,028,048,584 (21,028,048,584)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 156銘柄	100.0%	73.7%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	6.0%
英ポンド	投資証券 29銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 31銘柄	100.0%	3.7%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシュケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

【中間財務諸表】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2019年12月11日から2020年 6月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	123,687,640	136,268,782
親投資信託受益証券	40,672,964,303	53,277,378,386
流動資産合計	40,796,651,943	53,413,647,168
資産合計	40,796,651,943	53,413,647,168
負債の部		
流動負債		
未払解約金	36,488,718	33,863,986
未払受託者報酬	6,810,717	7,601,720
未払委託者報酬	49,945,206	55,745,852
未払利息	335	369
その他未払費用	2,270,667	2,155,191
流動負債合計	95,515,643	99,367,118
負債合計	95,515,643	99,367,118
純資産の部		
元本等		
元本	39,949,947,999	52,762,969,920
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	751,188,301	551,310,130
(分配準備積立金)	549,091,662	484,209,262
元本等合計	40,701,136,300	53,314,280,050
純資産合計	40,701,136,300	53,314,280,050
負債純資産合計	40,796,651,943	53,413,647,168

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,166,291,876	319,985,917
営業収益合計	1,166,291,876	319,985,917
営業費用		
支払利息	63,227	48,136
受託者報酬	7,413,474	7,601,720
委託者報酬	54,365,386	55,745,852
その他費用	2,475,155	2,175,333
営業費用合計	64,317,242	65,571,041
営業利益又は営業損失()	1,101,974,634	385,556,958
経常利益又は経常損失()	1,101,974,634	385,556,958
中間純利益又は中間純損失()	1,101,974,634	385,556,958
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()	107,265,191	7,262,730
期首剰余金又は期首欠損金()	96,884,233	751,188,301
剰余金増加額又は欠損金減少額	93,422,319	295,204,134
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	93,422,319	295,204,134
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,215,890	102,262,617
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,215,890	102,262,617
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,160,800,105	551,310,130

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 47,514,995,849円	期首元本額 39,949,947,999円
期中追加設定元本額 13,059,303,045円	期中追加設定元本額 18,256,502,938円
期中一部解約元本額 20,624,350,895円	期中一部解約元本額 5,443,481,017円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 39,949,947,999口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 52,762,969,920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 1.0188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 1.0104円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,188円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,104円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM国内債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,124,091	58,738,121
親投資信託受益証券	24,173,864,663	9,654,497,128
未収入金	-	155,300,000
流動資産合計	24,242,988,754	9,868,535,249
資産合計	24,242,988,754	9,868,535,249
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,827,987	180,200,946
未払受託者報酬	3,341,321	2,828,085
未払委託者報酬	30,071,859	25,452,774
未払利息	187	159
その他未払費用	1,113,997	801,727
流動負債合計	57,355,351	209,283,691
負債合計	57,355,351	209,283,691
純資産の部		
元本等		
元本	20,690,309,942	8,648,243,763
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	3,495,323,461	1,011,007,795
(分配準備積立金)	1,540,495,805	460,521,425
元本等合計	24,185,633,403	9,659,251,558
純資産合計	24,185,633,403	9,659,251,558
負債純資産合計	24,242,988,754	9,868,535,249

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	169,586,362	3,919,267,535
営業収益合計	169,586,362	3,919,267,535
営業費用		
支払利息	26,213	22,216
受託者報酬	2,876,324	2,828,085
委託者報酬	25,886,853	25,452,774
その他費用	960,382	808,967
営業費用合計	29,749,772	29,112,042
営業利益又は営業損失（ ）	199,336,134	3,948,379,577
経常利益又は経常損失（ ）	199,336,134	3,948,379,577
中間純利益又は中間純損失（ ）	199,336,134	3,948,379,577
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（ ）	18,350,649	3,920,302,213
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	909,935,817	3,495,323,461
剰余金増加額又は欠損金減少額	189,728,060	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	189,728,060	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	139,662,061	2,456,238,302
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	139,662,061	2,443,580,068
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	12,658,234
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	779,016,331	1,011,007,795

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 15,924,914,167円	期首元本額 20,690,309,942円
期中追加設定元本額 8,880,522,314円	期中追加設定元本額 6,480,946,189円
期中一部解約元本額 4,115,126,539円	期中一部解約元本額 18,523,012,368円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 20,690,309,942口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 8,648,243,763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 1.1689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 1.1169円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,689円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,169円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM国内株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

（ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,145,484	72,210,156
親投資信託受益証券	23,430,503,865	23,462,087,796
流動資産合計	23,494,649,349	23,534,297,952
資産合計	23,494,649,349	23,534,297,952
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,716,253	10,874,356
未払受託者報酬	3,427,023	3,885,152
未払委託者報酬	36,554,750	41,441,608
未払利息	173	195
その他未払費用	1,142,469	1,101,478
流動負債合計	49,840,668	57,302,789
負債合計	49,840,668	57,302,789
純資産の部		
元本等		
元本	22,462,375,014	21,689,338,643
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	982,433,667	1,787,656,520
（分配準備積立金）	716,911,508	552,536,710
元本等合計	23,444,808,681	23,476,995,163
純資産合計	23,444,808,681	23,476,995,163
負債純資産合計	23,494,649,349	23,534,297,952

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	246,593,085	904,283,931
営業収益合計	246,593,085	904,283,931
営業費用		
支払利息	23,805	23,190
受託者報酬	3,013,570	3,885,152
委託者報酬	32,144,677	41,441,608
その他費用	1,005,865	1,111,535
営業費用合計	36,187,917	46,461,485
営業利益又は営業損失（ ）	210,405,168	857,822,446
経常利益又は経常損失（ ）	210,405,168	857,822,446
中間純利益又は中間純損失（ ）	210,405,168	857,822,446
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	28,348,538	123,777,343
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	272,068,541	982,433,667
剰余金増加額又は欠損金減少額	56,596,930	333,065,332
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	56,596,930	333,065,332
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,385,504	261,887,582
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,385,504	261,887,582
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	514,033,673	1,787,656,520

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 19,541,836,461円	期首元本額 22,462,375,014円
期中追加設定元本額 8,262,356,144円	期中追加設定元本額 4,976,839,585円
期中一部解約元本額 5,341,817,591円	期中一部解約元本額 5,749,875,956円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 22,462,375,014口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 21,689,338,643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 1.0437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 1.0824円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,437円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,824円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM先進国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	177,840,660	210,022,351
親投資信託受益証券	60,476,767,221	79,605,843,653
流動資産合計	60,654,607,881	79,815,866,004
資産合計	60,654,607,881	79,815,866,004
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,476,383	23,979,314
未払受託者報酬	9,963,176	11,387,626
未払委託者報酬	106,273,821	121,467,940
未払利息	482	569
その他未払費用	3,321,588	3,228,754
流動負債合計	141,035,450	160,064,203
負債合計	141,035,450	160,064,203
純資産の部		
元本等		
元本	57,768,211,684	74,121,985,831
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,745,360,747	5,533,815,970
（分配準備積立金）	2,195,849,034	1,854,865,184
元本等合計	60,513,572,431	79,655,801,801
純資産合計	60,513,572,431	79,655,801,801
負債純資産合計	60,654,607,881	79,815,866,004

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,313,203,165	1,740,276,432
営業収益合計	2,313,203,165	1,740,276,432
営業費用		
支払利息	61,490	64,007
受託者報酬	7,973,671	11,387,626
委託者報酬	85,052,420	121,467,940
その他費用	2,661,422	3,257,575
営業費用合計	95,749,003	136,177,148
営業利益又は営業損失（ ）	2,217,454,162	1,604,099,284
経常利益又は経常損失（ ）	2,217,454,162	1,604,099,284
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,217,454,162	1,604,099,284
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（ ）	63,629,242	287,413,011
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	484,601,722	2,745,360,747
剰余金増加額又は欠損金減少額	167,418,100	1,984,662,306
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,805,299	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	111,612,801	1,984,662,306
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	512,893,356
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	512,893,356
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,836,641,298	5,533,815,970

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 48,045,026,028円	期首元本額 57,768,211,684円
期中追加設定元本額 25,565,889,158円	期中追加設定元本額 26,747,681,411円
期中一部解約元本額 15,842,703,502円	期中一部解約元本額 10,393,907,264円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 57,768,211,684口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 74,121,985,831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 1.0475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 1.0747円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,475円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,747円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,033,315	10,880,082
親投資信託受益証券	2,301,230,940	1,743,695,502
未収入金	-	4,630,000
流動資産合計	2,309,264,255	1,759,205,584
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,309,920	8,028,841
未払受託者報酬	282,200	338,327
未払委託者報酬	4,891,425	5,864,371
未払利息	21	29
その他未払費用	93,996	95,873
流動負債合計	6,577,562	14,327,441
負債合計	6,577,562	14,327,441
純資産の部		
元本等		
元本	2,275,289,883	1,799,403,708
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	27,396,810	54,525,565
(分配準備積立金)	132,343,609	84,101,175
元本等合計	2,302,686,693	1,744,878,143
純資産合計	2,302,686,693	1,744,878,143
負債純資産合計	2,309,264,255	1,759,205,584

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	15,914,559	158,565,438
営業収益合計	15,914,559	158,565,438
営業費用		
支払利息	2,199	2,732
受託者報酬	230,420	338,327
委託者報酬	3,993,938	5,864,371
その他費用	76,837	96,998
営業費用合計	4,303,394	6,302,428
営業利益又は営業損失（ ）	11,611,165	164,867,866
経常利益又は経常損失（ ）	11,611,165	164,867,866
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,611,165	164,867,866
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（ ）	17,432	109,995,743
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	36,804,029	27,396,810
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,941,546	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,805,037	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	136,509	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	27,050,252
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,872,161
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	20,178,091
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,268,750	54,525,565

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,806,368,468円	期首元本額 2,275,289,883円
期中追加設定元本額 1,175,865,521円	期中追加設定元本額 481,940,587円
期中一部解約元本額 706,944,106円	期中一部解約元本額 957,826,762円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,275,289,883口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,799,403,708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 54,525,565円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0120円	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9697円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,120円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,697円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	48,079,551	76,143,050
親投資信託受益証券	17,421,883,306	17,912,197,516
未収入金	-	81,100,000
流動資産合計	17,469,962,857	18,069,440,566
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,338,966	110,755,095
未払受託者報酬	2,414,931	2,796,873
未払委託者報酬	29,784,081	34,494,754
未払利息	130	206
その他未払費用	805,048	792,929
流動負債合計	40,343,156	148,839,857
負債合計	40,343,156	148,839,857
純資産の部		
元本等		
元本	13,770,768,469	14,215,762,239
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	3,658,851,232	3,704,838,470
(分配準備積立金)	2,092,660,729	1,360,202,826
元本等合計	17,429,619,701	17,920,600,709
純資産合計	17,429,619,701	17,920,600,709
負債純資産合計	17,469,962,857	18,069,440,566

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,065,922,509	183,714,210
営業収益合計	1,065,922,509	183,714,210
営業費用		
支払利息	15,274	17,206
受託者報酬	1,875,215	2,796,873
委託者報酬	23,127,588	34,494,754
その他費用	626,083	799,548
営業費用合計	25,644,160	38,108,381
営業利益又は営業損失（ ）	1,040,278,349	145,605,829
経常利益又は経常損失（ ）	1,040,278,349	145,605,829
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,040,278,349	145,605,829
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（ ）	152,082,420	773,782,423
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	548,841,097	3,658,851,232
剰余金増加額又は欠損金減少額	589,205,266	536,400,613
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	589,205,266	536,400,613
剰余金減少額又は欠損金増加額	126,770,691	1,409,801,627
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	126,770,691	1,409,801,627
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,899,471,601	3,704,838,470

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 5,484,626,857円	期首元本額 13,770,768,469円
期中追加設定元本額 11,072,413,261円	期中追加設定元本額 6,651,048,881円
期中一部解約元本額 2,786,271,649円	期中一部解約元本額 6,206,055,111円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 13,770,768,469口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 14,215,762,239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 1.2657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 1.2606円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,657円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,606円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM先進国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,887,993	12,460,548
親投資信託受益証券	2,809,230,275	1,898,155,490
未収入金	-	12,200,000
流動資産合計	2,819,118,268	1,922,816,038
資産合計	2,819,118,268	1,922,816,038
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,662,633	15,889,436
未払受託者報酬	344,313	386,803
未払委託者報酬	6,541,952	7,349,124
未払利息	26	33
その他未払費用	114,711	109,603
流動負債合計	8,663,635	23,734,999
負債合計	8,663,635	23,734,999
純資産の部		
元本等		
元本	2,439,675,773	1,734,173,332
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	370,778,860	164,907,707
(分配準備積立金)	96,834,457	52,201,045
元本等合計	2,810,454,633	1,899,081,039
純資産合計	2,810,454,633	1,899,081,039
負債純資産合計	2,819,118,268	1,922,816,038

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	12,019,336	260,674,785
営業収益合計	12,019,336	260,674,785
営業費用		
支払利息	3,023	3,154
受託者報酬	290,219	386,803
委託者報酬	5,514,199	7,349,124
その他費用	96,841	110,855
営業費用合計	5,904,282	7,849,936
営業利益又は営業損失()	17,923,618	268,524,721
経常利益又は経常損失()	17,923,618	268,524,721
中間純利益又は中間純損失()	17,923,618	268,524,721
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	6,249,210	221,872,329
期首剰余金又は期首欠損金()	179,433,745	370,778,860
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,095,479	22,124,982
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,095,479	22,124,982
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,143,109	181,343,743
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,143,109	181,343,743
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	148,711,707	164,907,707

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,820,179,340円	期首元本額 2,439,675,773円
期中追加設定元本額 1,307,480,891円	期中追加設定元本額 643,042,458円
期中一部解約元本額 687,984,458円	期中一部解約元本額 1,348,544,899円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,439,675,773口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,734,173,332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 1.1520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 1.0951円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,520円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,951円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM新興国株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな国内リートインデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,091,877	11,137,965
親投資信託受益証券	3,358,381,719	2,541,550,513
未収入金	-	46,800,000
流動資産合計	3,367,473,596	2,599,488,478
資産合計	3,367,473,596	2,599,488,478
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,909,773	51,586,661
未払受託者報酬	439,866	494,161
未払委託者報酬	3,958,746	4,447,376
未払利息	24	30
その他未払費用	146,561	140,010
流動負債合計	7,454,970	56,668,238
負債合計	7,454,970	56,668,238
純資産の部		
元本等		
元本	2,592,201,841	2,383,396,086
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	767,816,785	159,424,154
(分配準備積立金)	548,420,068	381,971,469
元本等合計	3,360,018,626	2,542,820,240
純資産合計	3,360,018,626	2,542,820,240
負債純資産合計	3,367,473,596	2,599,488,478

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	165,924,734	829,731,206
営業収益合計	165,924,734	829,731,206
営業費用		
支払利息	2,917	3,060
受託者報酬	343,974	494,161
委託者報酬	3,095,736	4,447,376
その他費用	114,750	141,286
営業費用合計	3,557,377	5,085,883
営業利益又は営業損失（ ）	162,367,357	834,817,089
経常利益又は経常損失（ ）	162,367,357	834,817,089
中間純利益又は中間純損失（ ）	162,367,357	834,817,089
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（ ）	1,287,315	379,907,995
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	86,241,980	767,816,785
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,112,022	114,643,051
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,112,022	114,643,051
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,478,987	268,126,588
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,478,987	268,126,588
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	245,529,687	159,424,154

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 2,516,252,459円	期首元本額 2,592,201,841円
期中追加設定元本額 1,116,951,844円	期中追加設定元本額 763,572,554円
期中一部解約元本額 1,041,002,462円	期中一部解約元本額 972,378,309円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 2,592,201,841口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 2,383,396,086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 1.2962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 1.0669円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,962円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,669円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RAM国内リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,135,788	11,841,728
親投資信託受益証券	4,087,941,200	2,938,937,268
未収入金	-	21,400,000
流動資産合計	4,098,076,988	2,972,178,996
資産合計	4,098,076,988	2,972,178,996
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,079,358	24,121,978
未払受託者報酬	529,047	577,960
未払委託者報酬	6,524,797	7,128,050
未払利息	27	32
その他未払費用	176,283	163,776
流動負債合計	8,309,512	31,991,796
負債合計	8,309,512	31,991,796
純資産の部		
元本等		
元本	3,620,576,548	3,049,219,909
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	469,190,928	109,032,709
(分配準備積立金)	388,395,947	252,784,214
元本等合計	4,089,767,476	2,940,187,200
純資産合計	4,089,767,476	2,940,187,200
負債純資産合計	4,098,076,988	2,972,178,996

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第4期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	166,198,653	920,803,932
営業収益合計	166,198,653	920,803,932
営業費用		
支払利息	3,107	3,344
受託者報酬	395,845	577,960
委託者報酬	4,882,003	7,128,050
その他費用	132,060	165,202
営業費用合計	5,413,015	7,874,556
営業利益又は営業損失（ ）	160,785,638	928,678,488
経常利益又は経常損失（ ）	160,785,638	928,678,488
中間純利益又は中間純損失（ ）	160,785,638	928,678,488
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（ ）	19,672,410	538,624,770
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	49,828,648	469,190,928
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,895,782	188,169,919
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,170,513	167,008,619
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,725,269	21,161,300
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	177,046,094	109,032,709

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 1,837,841,788円	期首元本額 3,620,576,548円
期中追加設定元本額 2,308,663,405円	期中追加設定元本額 956,183,583円
期中一部解約元本額 525,928,645円	期中一部解約元本額 1,527,540,222円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 3,620,576,548口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 3,049,219,909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 109,032,709円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1296円	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9642円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,296円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,642円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期中間計算期間末 2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	928,015
コール・ローン	918,710,399
国債証券	71,052,021,980
地方債証券	4,247,502,300
特殊債券	4,789,361,797

2020年 6月10日現在

社債券	3,299,759,000
未収入金	159,000
未収利息	174,337,188
前払費用	29,149,385
流動資産合計	84,511,929,064
資産合計	84,511,929,064
負債の部	
流動負債	
未払金	389,235,500
未払解約金	17,401,000
未払利息	2,491
その他未払費用	15,033
流動負債合計	406,654,024
負債合計	406,654,024
純資産の部	
元本等	
元本	79,872,244,408
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,233,030,632
元本等合計	84,105,275,040
純資産合計	84,105,275,040
負債純資産合計	84,511,929,064

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	69,237,421,107円
期中追加設定元本額	44,278,184,305円
期中一部解約元本額	33,643,361,004円
期末元本額	79,872,244,408円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,770,882,002円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,873,849,443円
りそなラップ型ファンド(成長型)	401,485,942円
DCりそな グローバルバランス	387,923,989円
つみたてバランスファンド	1,309,039,407円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	971,642,710円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	193,954,162円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	44,605,400円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,972,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,294,662円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	461,196円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	108,988円
リスクコントロール・オープン	47,683,366円
FWりそな円建債券アクティブファンド	635,019,367円
FWりそな国内債券インデックスファンド	50,595,800,937円
Smart-i 国内債券インデックス	722,891,776円
Smart-i 8資産バランス 安定型	302,796,795円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	210,789,248円
Smart-i 8資産バランス 成長型	77,674,418円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,078,938,241円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,627,076,072円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	918,155,138円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	666,088,176円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	3,546,831,184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）	8,946,175円
りそなFT 国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	6,305,614,593円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	157,718,407円
2. 計算日における受益権の総数	79,872,244,408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	1.0530円
(10,000口当たり純資産額)	(10,530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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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）

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	449,673,857
株式	21,227,153,520
未収入金	69,505,744
未収配当金	152,088,101
差入委託証拠金	15,600,000
流動資産合計	21,914,021,222
資産合計	21,914,021,222
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,354,300
前受金	61,610,000
未払金	115,187,130
未払解約金	187,084,000
未払利息	1,219
その他未払費用	3,578
流動負債合計	366,240,227
負債合計	366,240,227
純資産の部	
元本等	
元本	18,726,222,686
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,821,558,309
元本等合計	21,547,780,995
純資産合計	21,547,780,995
負債純資産合計	21,914,021,222

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
--------------------	----

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	34,860,384,469円
期中追加設定元本額	15,858,023,110円
期中一部解約元本額	31,992,184,893円
期末元本額	18,726,222,686円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,209,762,687円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	940,474,510円
りそなラップ型ファンド(成長型)	946,426,970円
DCりそな グローバルバランス	23,564,228円
つみたてバランスファンド	1,865,788,518円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	633,092,089円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	306,797,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	180,733,616円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,590,623円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,493,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,909,395円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,778,496円
リスクコントロール・オープン	3,403,417円
FWりそな国内株式アクティブファンド	65,546,824円
FWりそな国内株式インデックスファンド	8,390,107,872円
Smart-i TOPIXインデックス	885,346,218円
Smart-i 8資産バランス 安定型	78,605,023円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	242,485,224円
Smart-i 8資産バランス 成長型	271,582,931円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	151,123,990円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	118,267,587円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	66,738,105円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	48,415,373円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	255,419,360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)	1,504,228円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	532,001,366円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	436,226,620円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,010,023,235円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	31,013,383円
2. 計算日における受益権の総数	18,726,222,686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	1.1507円
(10,000口当たり純資産額)	(11,507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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 6月10日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	422,254,300	-	419,900,000	2,354,300
	合計	422,254,300	-	419,900,000	2,354,300

(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先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	390,339,557
コール・ローン	423,686,352
国債証券	30,479,020,928
派生商品評価勘定	95,589
未収利息	163,903,443
前払費用	16,040,007
流動資産合計	31,473,085,876
資産合計	31,473,085,876
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	535,813
未払金	592,434,013
未払利息	1,149
その他未払費用	3,870
流動負債合計	592,974,845
負債合計	592,974,845
純資産の部	
元本等	
元本	29,595,753,284
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,284,357,747
元本等合計	30,880,111,031
純資産合計	30,880,111,031
負債純資産合計	31,473,085,876

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)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	28,823,773,873円
期中追加設定元本額	7,779,922,491円
期中一部解約元本額	7,007,943,080円
期末元本額	29,595,753,284円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,356,169,682円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	828,383,367円
りそなラップ型ファンド(成長型)	441,816,169円
DCりそな グローバルバランス	66,595,785円
つみたてバランスファンド	328,841,094円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	539,295,960円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	106,835,621円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	24,555,159円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	6,695,170円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,394,117円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	258,467円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	41,656円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	291,981,473円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	225,634,919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)	22,486,187,269円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	350,591,910円
Smart-i 8資産バランス 安定型	170,681,014円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	110,235,393円
Smart-i 8資産バランス 成長型	44,923,664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)	1,259,048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)	212,376,347円

2. 計算日における受益権の総数	29,595,753,284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	1.0434円
(10,000口当たり純資産額)	(10,434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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 6月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	224,865,745	-	224,425,521	440,224

米ドル	103,689,954	-	103,307,130	382,824
カナダドル	5,827,107	-	5,793,956	33,151
ユーロ	94,533,651	-	94,629,240	95,589
英ポンド	14,652,248	-	14,606,475	45,773
オーストラリアドル	6,162,785	-	6,088,720	74,065
合計	224,865,745	-	224,425,521	440,224

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

(単位：円)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,138,872,151
コール・ローン	1,643,286,599
国債証券	157,594,563,051
派生商品評価勘定	48,468,481
未収入金	1,471,000
未収利息	593,488,241
前払費用	332,049,979
流動資産合計	161,352,199,502
資産合計	
161,352,199,502	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,587,579,943
未払金	2,013,987,663
未払解約金	32,961,000
未払利息	4,457
その他未払費用	29,380
流動負債合計	4,634,562,443
負債合計	
4,634,562,443	

2020年 6月10日現在

純資産の部	
元本等	
元本	148,924,867,666
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,792,769,393
元本等合計	156,717,637,059
純資産合計	156,717,637,059
負債純資産合計	161,352,199,502

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	147,652,755,545円
期中追加設定元本額	131,840,489,327円
期中一部解約元本額	130,568,377,206円
期末元本額	148,924,867,666円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,445,418,017円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,812,893,445円
りそなラップ型ファンド(成長型)	952,080,187円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	969,354,813円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	192,861,323円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	44,338,166円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,962,778円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,284,695円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	458,429円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	109,074円
リスクコントロール・オープン	191,151,061円
FWりそな円建債券アクティブファンド	741,268,269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)	75,649,381,026円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	609,965,439円
Smart-i 8資産バランス 安定型	301,660,482円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	209,986,757円
Smart-i 8資産バランス 成長型	77,381,856円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	8,307,126,634円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	6,501,524,872円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	3,668,793,238円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	2,661,573,717円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	14,165,685,447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)	7,287,986,367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)	8,912,025円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	6,008,572,825円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	100,136,724円
2. 計算日における受益権の総数	148,924,867,666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	1.0523円
(10,000口当たり純資産額)	(10,523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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	951,941,390	-	946,424,297	5,517,093
	米ドル	428,365,727	-	425,073,542	3,292,185
	カナダドル	18,052,307	-	17,896,172	156,135
	メキシコペソ	7,937,499	-	7,782,948	154,551
	ユーロ	396,949,894	-	395,816,750	1,133,144
	英ポンド	70,526,767	-	70,097,365	429,402
	デンマーククローネ	8,774,147	-	8,678,880	95,267
	オーストラリアドル	21,335,049	-	21,078,640	256,409
	売建	157,236,133,411	-	159,769,727,780	2,533,594,369
	米ドル	72,028,114,120	-	72,234,580,950	206,466,830
	カナダドル	3,053,530,307	-	3,139,708,800	86,178,493
	メキシコペソ	1,299,108,395	-	1,320,834,200	21,725,805
	ユーロ	62,582,858,219	-	64,180,264,740	1,597,406,521
	英ポンド	10,525,800,156	-	10,881,792,930	355,992,774
	スウェーデンクローナ	432,247,218	-	447,954,340	15,707,122
	ノルウェークローネ	315,912,663	-	333,772,880	17,860,217
	デンマーククローネ	767,464,428	-	787,331,200	19,866,772
	ポーランドズロチ	926,964,612	-	953,315,000	26,350,388

オーストラリアドル	3,343,746,172	-	3,494,768,520	151,022,348
シンガポールドル	688,457,893	-	703,132,720	14,674,827
マレーシアリンギット	684,801,181	-	693,709,000	8,907,819
イスラエルシケル	587,128,047	-	598,562,500	11,434,453
合計	158,188,074,801	-	160,716,152,077	2,539,111,462

(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新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	16,801,934
コール・ローン	15,861,042
投資信託受益証券	4,358,052,991
流動資産合計	4,390,715,967
資産合計	4,390,715,967
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,060,000
未払利息	43
その他未払費用	327
流動負債合計	6,060,370
負債合計	6,060,370
純資産の部	
元本等	
元本	4,157,663,812
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	226,991,785

2020年 6月10日現在

元本等合計	4,384,655,597
純資産合計	4,384,655,597
負債純資産合計	4,390,715,967

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	5,094,482,726円
期中追加設定元本額	2,277,725,479円
期中一部解約元本額	3,214,544,393円
期末元本額	4,157,663,812円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	564,889,988円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	407,254,281円
りそなラップ型ファンド(成長型)	207,217,717円
DCりそな グローバルバランス	11,201,363円
つみたてバランスファンド	333,209,227円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	141,498,412円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	68,272,334円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	40,904,655円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,783,741円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,374,236円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	883,167円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,093,708円
リスクコントロール・オープン	912,029円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	247,977,722円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,653,418,834円
Smart-i 8資産バランス 安定型	20,998,302円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	54,889,232円
Smart-i 8資産バランス 成長型	56,321,714円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	80,111,740円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	62,711,279円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	35,387,869円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	25,672,732円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	136,819,760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）	859,770円
2. 計算日における受益権の総数	4,157,663,812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	1.0546円
(10,000口当たり純資産額)	(10,546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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
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先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,326,247,980
コール・ローン	151,382,645
株式	35,470,784,768
投資証券	939,944,163
派生商品評価勘定	1,106,733,853
未収入金	276,627
未収配当金	44,648,795
差入委託証拠金	1,119,145,646
流動資産合計	46,159,164,477
資産合計	46,159,164,477
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,129
未払解約金	174,048,000
未払利息	410
その他未払費用	4,772
流動負債合計	174,089,311
負債合計	174,089,311
純資産の部	
元本等	
元本	34,283,997,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,701,077,988
元本等合計	45,985,075,166
純資産合計	45,985,075,166
負債純資産合計	46,159,164,477

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
-------------------	---

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	36,779,158,435円
期中追加設定元本額	30,334,615,121円
期中一部解約元本額	32,829,776,378円
期末元本額	34,283,997,178円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,424,067,763円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,398,204,709円
りそなラップ型ファンド(成長型)	3,925,779,013円
DCりそな グローバルバランス	28,727,139円
つみたてバランスファンド	1,092,116,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	629,825,365円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	305,972,965円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	181,131,917円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,697,392円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,565,326円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,885,203円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,694,364円

リスクコントロール・オープン	18,786,011円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	6,732,327円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	4,587,551円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	13,354,355,861円
Smart-i 先進国株式インデックス	2,721,135,774円
Smart-i 8資産バランス 安定型	86,911,058円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	234,544,174円
Smart-i 8資産バランス 成長型	258,459,737円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	778,703,529円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	609,461,288円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	343,917,260円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	249,499,167円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,318,054,025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)	5,236,232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)	374,214,814円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	873,505,989円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	28,224,878円
2. 計算日における受益権の総数	34,283,997,178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	1.3413円
(10,000口当たり純資産額)	(13,413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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,610,521,805	-	9,717,215,947	1,106,694,142
	合計	8,610,521,805	-	9,717,215,947	1,106,694,142

（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）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	125,849,418	-	125,853,000	3,582
	米ドル	80,833,425	-	80,835,000	1,575
	カナダドル	8,678,415	-	8,678,880	465
	ユーロ	22,249,409	-	22,251,320	1,911
	英ポンド	9,599,611	-	9,599,800	189
	オーストラリアドル	4,488,558	-	4,488,000	558
	合計	125,849,418	-	125,853,000	3,582

（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)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,347,876,710
コール・ローン	41,796,752
株式	5,413,431,384
投資証券	4,802,100
派生商品評価勘定	334,453,318
未収入金	118,789
未収配当金	9,738,421
差入委託証拠金	614,863,263
流動資産合計	7,767,080,737
資産合計	7,767,080,737
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,158
未払解約金	38,889,000
未払利息	113
その他未払費用	1,142
流動負債合計	38,909,413
負債合計	38,909,413
純資産の部	
元本等	
元本	6,251,157,161
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,477,014,163
元本等合計	7,728,171,324
純資産合計	7,728,171,324
負債純資産合計	7,767,080,737

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	7,385,223,056円
期中追加設定元本額	4,622,865,139円
期中一部解約元本額	5,756,931,034円
期末元本額	6,251,157,161円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	509,352,411円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	863,405,187円
りそなラップ型ファンド(成長型)	913,468,153円
DCりそな グローバルバランス	10,102,477円
つみたてバランスファンド	299,837,531円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	244,430,916円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	120,520,653円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	71,365,582円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,952,459円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,136,690円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,549,031円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,818,690円
リスクコントロール・オープン	3,142,566円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	34,220,214円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,535,351,849円
Smart-i 新興国株式インデックス	822,323,719円
Smart-i 8資産バランス 安定型	28,434,664円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	86,542,273円
Smart-i 8資産バランス 成長型	100,907,658円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	140,236,755円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	109,745,633円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	61,929,019円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	44,927,340円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	237,912,674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）	543,017円
2. 計算日における受益権の総数	6,251,157,161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	1.2363円
(10,000口当たり純資産額)	(12,363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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,033,126,895	-	2,367,579,324	334,452,429
	合計	2,033,126,895	-	2,367,579,324	334,452,429

（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）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	62,413,497	-	62,395,148	18,349
	米ドル	41,508,077	-	41,508,808	731
	メキシコペソ	3,447,570	-	3,444,000	3,570
	ハンガリーフォリント	213,234	-	212,940	294
	ポーランドズロチ	826,050	-	825,000	1,050
	香港ドル	9,734,690	-	9,730,000	4,690
	南アフリカランド	6,683,876	-	6,674,400	9,476
	売建	13,586	-	13,506	80

	オフショア人民元	13,586	-	13,506	80
	合計	62,427,083	-	62,408,654	18,269

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	344,573,524
投資証券	16,647,958,550
派生商品評価勘定	3,781,800
未収入金	289,050
未収配当金	116,156,764
差入委託証拠金	48,510,000
流動資産合計	17,161,269,688
資産合計	17,161,269,688
負債の部	
流動負債	
前受金	3,256,000
未払解約金	104,721,000
未払利息	934
その他未払費用	4,352
流動負債合計	107,982,286
負債合計	107,982,286
純資産の部	
元本等	
元本	14,117,223,569
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,936,063,833
元本等合計	17,053,287,402
純資産合計	17,053,287,402
負債純資産合計	17,161,269,688

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)

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	15,058,754,099円
期中追加設定元本額	9,430,840,589円
期中一部解約元本額	10,372,371,119円
期末元本額	14,117,223,569円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	503,995,842円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	363,530,693円
りそなラップ型ファンド(成長型)	242,065,181円
DCりそな グローバルバランス	9,993,275円
つみたてバランスファンド	600,090,575円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	153,217,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	73,926,265円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	44,097,311円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	3,006,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,553,557円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	925,835円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,125,198円
リスクコントロール・オープン	816,893円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,263,147,794円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,103,932,544円
Smart-i リートインデックス	2,193,854,954円
Smart-i 8資産バランス 安定型	18,721,322円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,282,794円
Smart-i 8資産バランス 成長型	60,123,701円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	73,485,069円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	57,526,680円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	32,461,751円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	23,550,167円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	123,437,378円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,220,730,502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)	541,075円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	885,083,795円
2. 計算日における受益権の総数	14,117,223,569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	1.2080円
(10,000口当たり純資産額)	(12,080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

2020年 6月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2020年 6月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	378,688,200	-	382,470,000	3,781,800
	合計	378,688,200	-	382,470,000	3,781,800

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

RAM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 6月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,475,461
コール・ローン	51,906,053
投資証券	14,868,283,561
派生商品評価勘定	33,443
未収入金	255,160,835
未収配当金	11,897,937
流動資産合計	15,194,757,290
資産合計	15,194,757,290
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,161
未払金	13,678,085
未払解約金	53,301,000
未払利息	140
その他未払費用	1,211
流動負債合計	67,089,597
負債合計	67,089,597
純資産の部	
元本等	
元本	14,916,439,443
剰余金	
剰余金又は欠損金()	211,228,250
元本等合計	15,127,667,693
純資産合計	15,127,667,693
負債純資産合計	15,194,757,290

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）

2020年 6月10日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	17,798,066,656円
期中追加設定元本額	9,681,019,712円
期中一部解約元本額	12,562,646,925円
期末元本額	14,916,439,443円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	629,763,694円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	488,361,984円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,520,620,260円
DCりそな グローバルバランス	12,499,538円
つみたてバランスファンド	377,157,352円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	224,361,178円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	106,376,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	62,668,440円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,389,476円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,663,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,327,544円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,563,886円

リスクコントロール・オープン	3,837,039円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,457,438,448円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,897,788,669円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,136,111,918円
Smart-i 8資産バランス 安定型	23,792,124円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	77,538,391円
Smart-i 8資産バランス 成長型	88,512,205円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	174,421,477円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	136,498,227円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	77,025,598円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	55,879,353円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	294,675,479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)	1,490,107円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,058,676,733円
2. 計算日における受益権の総数	14,916,439,443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	1.0142円
(10,000口当たり純資産額)	(10,142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

2020年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2020年 6月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	7,585,500	-	7,480,000	105,500
	オーストラリアドル	7,585,500	-	7,480,000	105,500
	売建	260,810,382	-	260,780,600	29,782
	米ドル	199,637,850	-	199,608,560	29,290
	カナダドル	4,178,564	-	4,178,720	156
	ユーロ	10,818,682	-	10,820,010	1,328
	英ポンド	14,673,873	-	14,675,050	1,177
	オーストラリアドル	14,363,520	-	14,361,600	1,920
	ニュージーランドドル	3,082,508	-	3,082,640	132
	香港ドル	4,436,333	-	4,434,100	2,233
	シンガポールドル	9,619,052	-	9,619,920	868
合計		268,395,882	-	268,260,600	75,718

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 6月30日現在です。

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	55,088,531,202円
負債総額	45,774,182円
純資産総額（ - ）	55,042,757,020円
発行済口数	54,596,008,510口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0082円

【FWりそな国内株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	9,571,952,685円
負債総額	8,446,749円
純資産総額（ - ）	9,563,505,936円
発行済口数	8,912,478,618口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0730円

【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）】

【純資産額計算書】

資産総額	24,136,289,026円
負債総額	15,348,494円
純資産総額（ - ）	24,120,940,532円
発行済口数	22,159,559,201口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0885円

【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

【純資産額計算書】

資産総額	83,400,046,657円
負債総額	50,246,094円

純資産総額（ - ）	83,349,800,563円
発行済口数	76,550,985,895口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0888円

【FWりそな新興国債券インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	1,719,106,336円
負債総額	1,869,892円
純資産総額（ - ）	1,717,236,444円
発行済口数	1,815,004,425口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9461円

【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	17,266,961,667円
負債総額	9,100,985円
純資産総額（ - ）	17,257,860,682円
発行済口数	14,303,039,645口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2066円

【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	1,877,018,758円
負債総額	2,063,547円
純資産総額（ - ）	1,874,955,211円
発行済口数	1,737,637,324口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0790円

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	2,479,644,898円
------	----------------

負債総額	1,593,745円
純資産総額（ - ）	2,478,051,153円
発行済口数	2,446,817,456口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0128円

【FWりそな先進国リートインデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	2,610,491,818円
負債総額	1,273,942円
純資産総額（ - ）	2,609,217,876円
発行済口数	2,970,070,903口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8785円

（参考）

RAM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	89,045,580,353円
負債総額	405,375,420円
純資産総額（ - ）	88,640,204,933円
発行済口数	84,353,631,019口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0508円

RAM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	22,252,285,825円
負債総額	125,292,228円
純資産総額（ - ）	22,126,993,597円
発行済口数	20,011,242,044口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1057円

RAM先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,990,827,457円
負債総額	230,999,852円
純資産総額（ - ）	31,759,827,605円
発行済口数	30,262,880,598口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0495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	173,837,259,778円
負債総額	2,100,607,396円
純資産総額（ - ）	171,736,652,382円
発行済口数	161,037,011,447口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0664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	4,458,759,541円
負債総額	31,184,769円
純資産総額（ - ）	4,427,574,772円
発行済口数	4,301,432,246口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0293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	48,281,503,341円
負債総額	87,715,175円
純資産総額（ - ）	48,193,788,166円
発行済口数	37,529,988,231口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2841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	8,162,164,815円
負債総額	7,492,870円
純資産総額（ - ）	8,154,671,945円
発行済口数	6,691,999,986口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2186円

RAM国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	16,913,999,726円
負債総額	45,615,705円
純資産総額（ - ）	16,868,384,021円
発行済口数	14,707,580,236口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1469円

RAM先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	14,360,872,972円
負債総額	76,411,559円
純資産総額（ - ）	14,284,461,413円
発行済口数	15,455,591,554口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9242円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとしします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律

の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

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

2020年6月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 委託会社の機構（2020年6月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

経営会議は、経営に関する全般的な重要事項および重要な業務執行案件を協議します。

監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

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

CHECK：検証 ACTION：改善

- ・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

- ・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年6月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	78	750,109
単位型株式投資信託	6	123,490
合計	84	873,600

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5期事業年度（自2019年4月1日至2020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 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	1,344,092	2,211,091
前払費用	21,505	186,739
未収入金	238	247
未収委託者報酬	369,524	810,183
未収運用受託報酬	-	1,261,327
未収投資助言報酬	38,188	418,494
流動資産計	1,773,550	4,888,083
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 2,791	4,325
器具備品	1 9,167	11,668
有形固定資産計	11,958	15,993
無形固定資産		
ソフトウェア	29,501	18,733
無形固定資産計	29,501	18,733
投資その他の資産		
投資有価証券	599	7,975
長期前払費用	1,416	416
繰延税金資産	34,080	72,304

投資その他の資産計	36,097	80,969
固定資産計	77,557	115,424
資産合計	1,851,107	5,003,507

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	87,317	311,378
その他未払金	2 163,133	760,759
未払費用	23,612	85,094
未払法人税等	17,310	192,367
未払消費税等	39,930	287,966
預り金	444	1,648
賞与引当金	36,596	96,675
流動負債計	368,344	1,735,890
負債合計	368,344	1,735,890
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	7,236	1,778,051
利益剰余金計	7,236	1,778,051
株主資本計	1,482,763	3,268,051
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	433
評価・換算差額等計	0	433
純資産合計	1,482,762	3,267,617
負債・純資産合計	1,851,107	5,003,507

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,786,724	3,170,025
運用受託報酬	-	1,201,400
投資助言報酬	35,360	1,166,500
営業収益計	1,822,084	5,537,925
営業費用		
支払手数料	437,713	1,050,201
広告宣伝費	48,845	63,238
調査費		

調査費	192,459	500,578
委託調査費	199,514	128,044
委託計算費	149,138	188,413
営業雑経費		
印刷費	49,857	68,686
協会費	3,294	5,690
販売促進費	5,915	5,255
その他	42,522	55,169
営業費用計	1,129,261	2,065,279
一般管理費		
給料		
役員報酬	65,787	82,651
給料・手当	216,403	490,014
賞与	18,883	3,982
賞与引当金繰入額	36,596	132,198
旅費交通費	8,181	13,634
租税公課	14,129	48,964
不動産賃借料	23,852	48,771
固定資産減価償却費	15,147	16,096
諸経費	72,402	119,502
一般管理費計	471,383	955,815
営業利益	221,439	2,516,831
営業外収益		
受取配当金	-	23
投資有価証券売却益	176	73
雑収入	2	46
営業外収益計	179	142
営業外費用		
雑損失	-	13
営業外費用計	-	13
経常利益	221,618	2,516,960
税引前当期純利益	221,618	2,516,960
法人税、住民税及び事業税	1	49,931
法人税等調整額	7,606	38,032
法人税等計	57,538	731,672
当期純利益	164,079	1,785,287

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					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	7,236	7,236	1,482,763
当期変動額						
当期純利益				1,785,287	1,785,287	1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	1,785,287	1,785,287	1,785,287
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051

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

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し、認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	540千円	885千円
器具備品	6,957千円	11,323千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
流動負債		
その他未払金	44,766千円	616,704千円
(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。		

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する主な取引

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
法人税、住民税及び事業税	44,766千円	616,720千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式(株)	3,960,000	-	-	3,960,000

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。

未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、運用受託先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(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	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	2,211,091	2,211,091	-
未収委託者報酬	810,183	810,183	-
未収運用受託報酬	1,261,327	1,261,327	-
未収投資助言報酬	418,494	418,494	-
資産計	4,701,096	4,701,096	-
未払手数料	311,378	311,378	-
その他未払金	760,759	760,759	-
負債計	1,072,138	1,072,138	-

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

未払手数料、その他未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	11,202千円	29,592千円
未払事業所税	341千円	655千円
未払事業税	3,323千円	33,577千円
未確定債務	913千円	757千円
減価償却超過額	5,341千円	3,944千円
税務上の繰越欠損金(*1)	54,381千円	3,586千円
その他有価証券評価差額金	0千円	191千円
その他	1,399千円	-
繰延税金資産小計	76,903千円	72,304千円
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	42,822千円	-
繰延税金資産合計	34,080千円	72,304千円
繰延税金資産の純額	34,080千円	72,304千円

(*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(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

当事業年度（2020年3月31日）

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超	合計
税務上の 繰越欠損金	-	-	-	-	-	3,586千円	3,586千円
評価性引当額	-	-	-	-	-	-	-
繰延税金資産	-	-	-	-	-	3,586千円	3,586千円

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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 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>

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

法定実効税率	30.61%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.01%
住民税均等割	0.09%
その他	1.64%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.07%</u>

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

（1）取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関して有する権利義務の一部

事業の内容：法人・機関投資家向け資産運用サービスの提供

企業結合日

2020年1月1日

企業結合の法的形式

株式会社りそな銀行（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後の名称

りそなアセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

法人・機関投資家向けとリテール向けで分かれていた運用機能集約による運用サービスの向上を図ることを目的とし、法人・機関投資家向けに高品質の運用サービスを提供する株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を分割し、バランスファンド・ファンドラップ専用投資信託・インデックスファンド等を中心に、リテール向けに業容拡大を図ってきた当社へ、発展的に統合するものであります。

（２）実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

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

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

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 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(注1)	44,766	その他未払金	44,766

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	-	投資信託の販売委託投資助言投資一任	支払手数料(注3)	340,304	未払手数料	72,673
							委託調査費(注1)(注2)	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）

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	--------	-----	-----------------------	-----------	----------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

親会社	株式会社 りそなホールディングス	東京都 江東区	50,472	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税 に係る 個別帰属額 (注1)	616,720	その他 未払金	616,704
-----	---------------------	------------	--------	----------------------	--------------	------	------------------------------	---------	------------	---------

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	374円43銭	825円15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()	41円43銭	450円83銭

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()(千円)	164,079	1,785,287
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)	164,079	1,785,287
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
2020年1月1日付で株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を承継する吸収分割を行いました。
- (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 (2020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 : 株式会社日本カストディ銀行
 資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）
 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（株式会社日本カストディ銀行）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 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第5期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結

論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)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

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内債券インデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内債券インデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内株式インデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな新興国債券インデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな新興国債券インデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国株式インデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな新興国株式インデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな新興国株式インデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内リートインデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内リートインデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月30日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国リートインデックスファンドの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国リートインデックスファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内債券インデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな国内債券インデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wりそな国内株式インデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wりそな国内株式インデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R 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

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな新興国債券インデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな先進国株式インデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな新興国株式インデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内リートインデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな国内リートインデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月5日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国リートインデックスファンドの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国リートインデックスファンドの2020年6月10日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。