

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年3月10日提出
【計算期間】	第4期(自 2019年12月11日至 2020年12月10日)
【ファンド名】	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
【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
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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。

## &lt; F W りそな国内株式インデックスファンド &gt;

## 1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
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。

<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) 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	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 (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))
		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。

#### <FWりそな先進国株式インデックスファンド>

##### 1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		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 りそな新興国株式インデックスファンド >

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年5回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ( )	中南米	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))
		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(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。

#### <FW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		日経225
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回	北米	ファミリーファンド	TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		
	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)			日経 225
	年2回	日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			
	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 (S&P 先進国 REIT 指数 (除く日 本、配当込み、 円換算ペー ス))
その他資産 (投資信託証券(不 動産投信))	その他 ( )	アフリカ			
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

「FW専用ファンド(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。

- 「FW専用ファンド(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

「FW専用ファンド(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書等を含みます。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

**FWりそな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。

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）または不動産投資信託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。

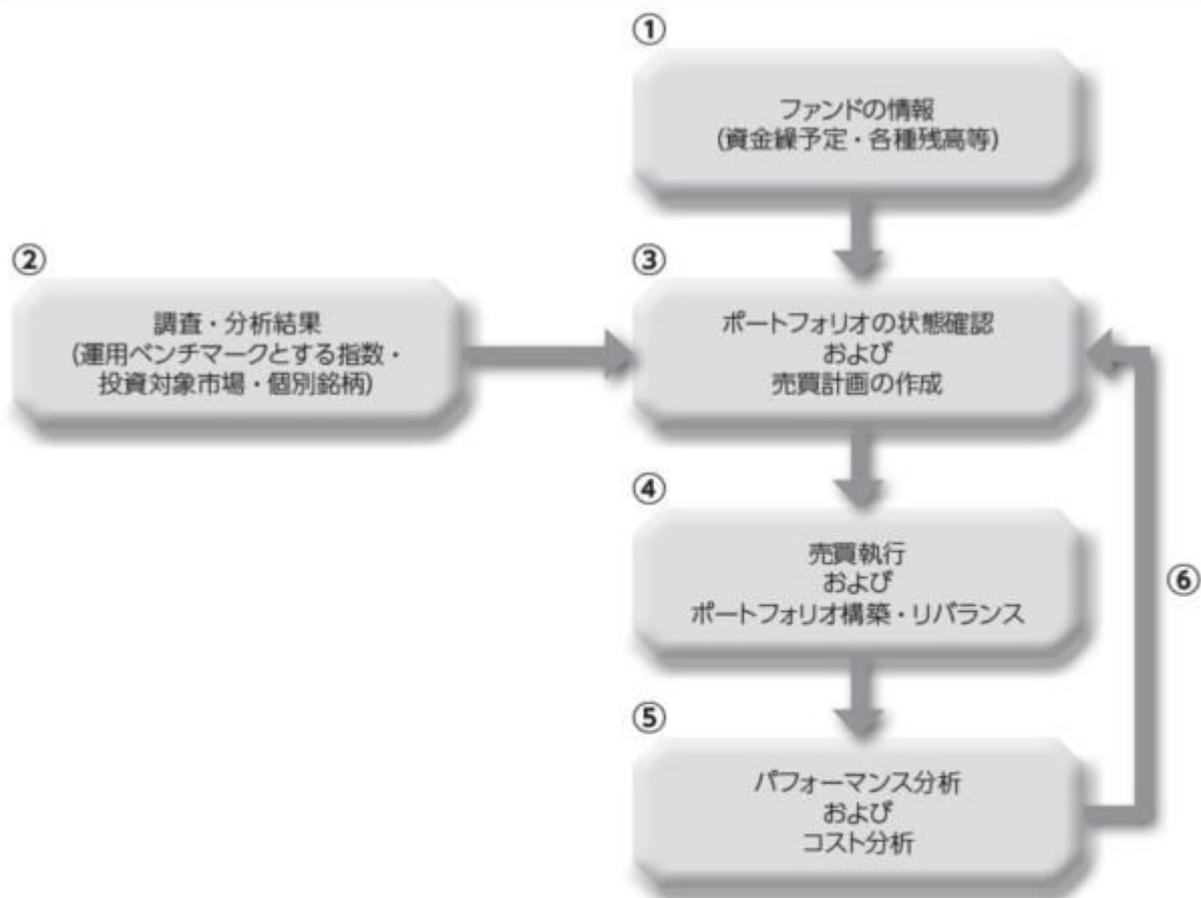
2. RAM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券\*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）への投資を行います。

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

### ● FWりそな先進国株式インデックスファンド

### ● FWりそな新興国株式インデックスファンド

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

### ● FWりそな国内リートインデックスファンド

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

### ● FWりそな先進国リートインデックスファンド

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

## ■ 分配方針

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

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

### ● RAM国内債券マザーファンド

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

### ● RAM国内株式マザーファンド

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

### ● RAM先進国債券マザーファンド

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

### ● RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ● RAM新興国債券マザーファンド

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

### ● RAM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

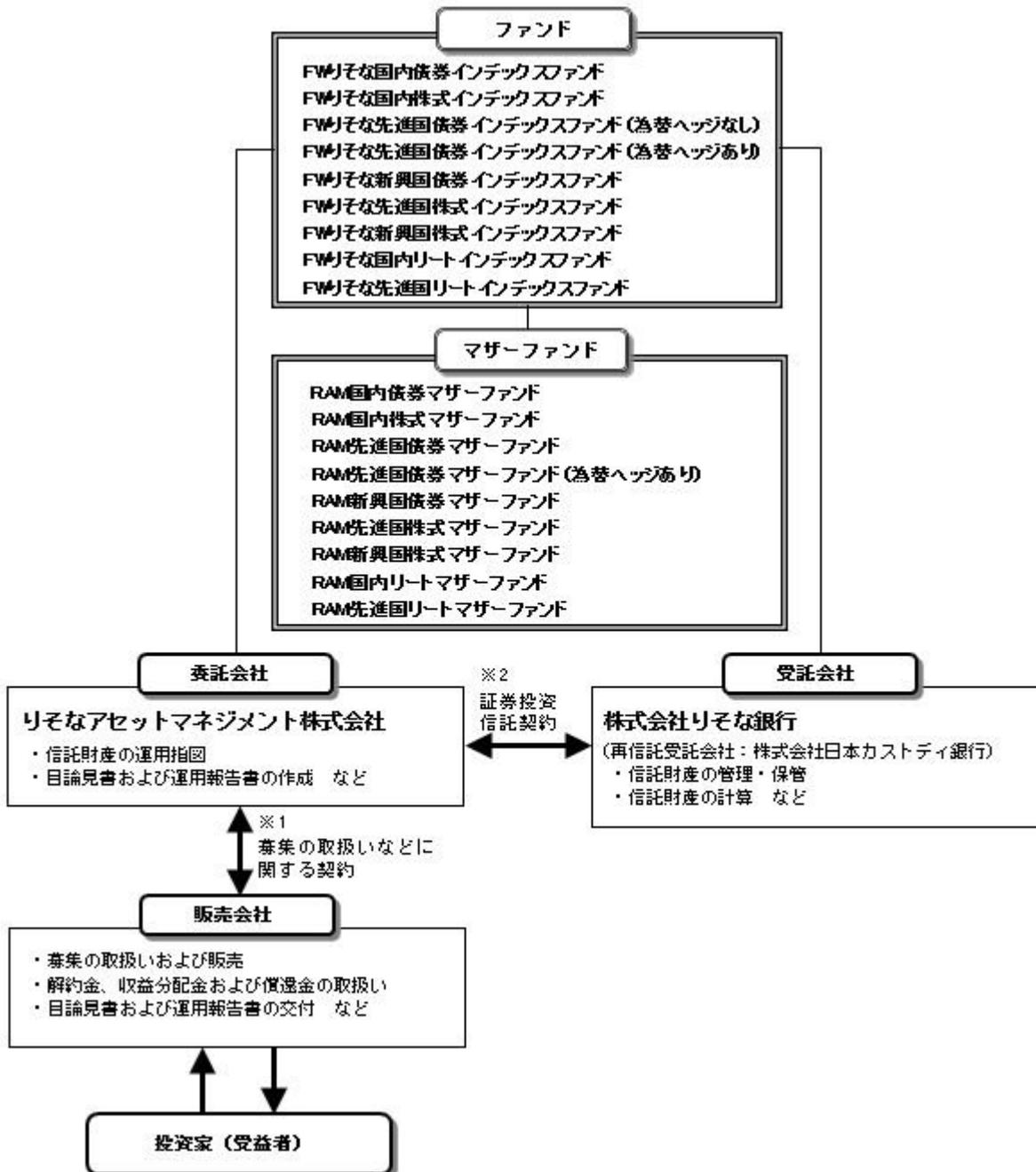
- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2021年3月11日

- ・ ファンド総称変更  
新総称：F W専用ファンド(スタンダードコース)  
旧総称：りそなファンドラップ(スタンダードコース)

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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。
- 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12月末現在）

- 資本金  
1,000百万円
- 沿革  
2015年8月3日：りそなアセットマネジメント株式会社設立  
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
- 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（T O P I X、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（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。なお、東証株価指数（T O P I X、配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。

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 E T F（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 E T F（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、J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバースファイド（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。

#### <FW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-KOKUSA I指数(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI-KOKUSA I指数(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。

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。

#### <FW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。

#### <FW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。

#### <FWりそな先進国リートインデックスファンド>

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

## （２）【投資対象】

### < F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

#### 投資の対象とする資産の種類

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

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

#### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 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「R A M国内株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 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す。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ) 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

## 金融商品の指図範囲

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

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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、 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す。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から7) までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 16) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2

項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

#### < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

価証券にかかるものに限ります。）

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、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す。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ) 為替手形

#### 有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

R A M新興国株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の株式（D R（預

託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。)および新興国株式の指数を対象指数としたETF(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「RAM新興国株式マザーファンド」の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

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

### 金融商品の指図範囲

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

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

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

### その他の投資対象と指図範囲

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

### < F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

#### 投資の対象とする資産の種類

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

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

#### 有価証券の指図範囲

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

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

## &lt; F Wりそな先進国リートインデックスファンド &gt;

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

## 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ) 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

## 金融商品の指図範囲

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

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

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

ことができます。

その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RAM国内債券マザーファンド >

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

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

### < R A M国内株式マザーファンド >

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

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

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

< R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R A M新興国債券マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M先進国株式マザーファンド &gt;

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

投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入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>
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; RAM新興国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M国内リートマザーファンド &gt;

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

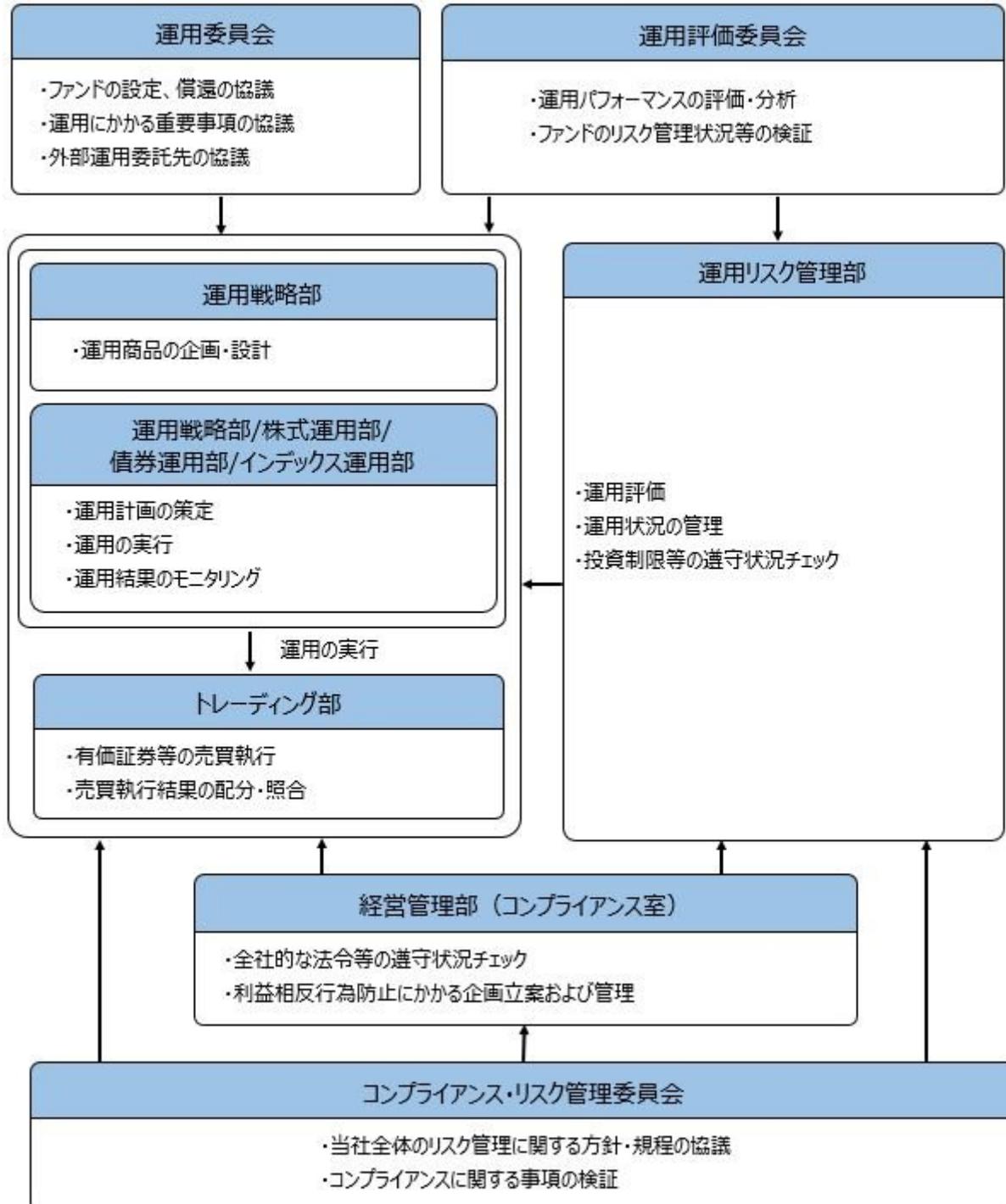
## &lt; R A M先進国リートマザーファンド &gt;

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

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

### （３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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12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

##### <FWりそな国内債券インデックスファンド>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のものに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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リ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、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
    - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
    - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、8)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
  2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合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。

八)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、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。

八)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の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。

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

9)スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみな

した額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

#### 11) 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。

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

2) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一のものに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 7) 投資する株式の範囲

1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

#### 8) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

#### 9) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

います。)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 I 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、)の行使により取得可能な株券

へ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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。

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

#### 14) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### 15) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

#### 16) 資金の借入れ

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

#### < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の

20%以下とします。

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

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

八) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、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。

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

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

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、

信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

#### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

ではありません。

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

#### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

#### 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産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ます。）の行使により取得可能な株券
  - ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 先物取引等の運用指図および範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
    - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
    - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有

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

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

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

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

#### 12) 金利先渡取引の運用指図および範囲

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

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

3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマ

ザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

#### 13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

#### 14) 資金の借入れ

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

#### < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

八)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、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。

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

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

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
  3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 14) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限  
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 15) 外国為替予約取引の指図および範囲  
委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 16) 資金の借入れ
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
  3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
  4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

##### <FWりそな国内債券インデックスファンド>

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

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

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

##### 市場リスク

##### ・金利(債券価格)変動リスク

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

##### 信用リスク

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

### 流動性リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてNOMURA - BPI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りそな国内株式インデックスファンド >

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・ 株価変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

落する要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

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

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

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

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

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

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

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

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

市場リスク

- ・ 金利（債券価格）変動リスク

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

- ・ 為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

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

#### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### (その他の留意点)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・金利(債券価格)変動リスク

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

##### ・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることとしていますが、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。

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・ダイバーシファイド（円換算ベース）（以下、当項目において「指数」といいます。）に連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は指数の動きから乖離する場合があります。

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

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

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

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

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

#### < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・株価変動リスク

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

###### ・為替変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCI-KOUSA 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。

#### < 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

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

##### 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りそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

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

##### 市場リスク

###### ・ リートの価格変動リスク

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

###### ・ 為替変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

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

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

る有価証券等の時価と一致しない場合があること。

- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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

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

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

## （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。

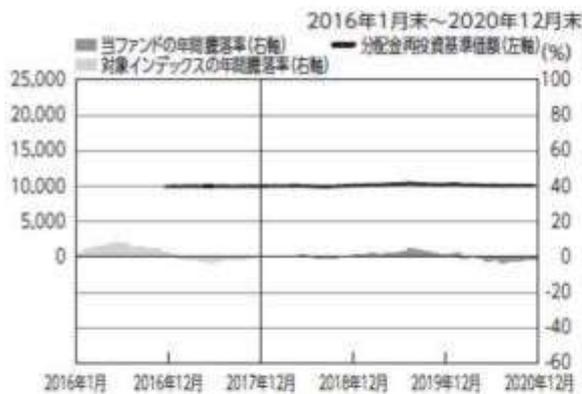
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

上記体制は2020年12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、2016年1月から2020年12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	11.4
最小値	△3.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3
平均値	1.1	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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。

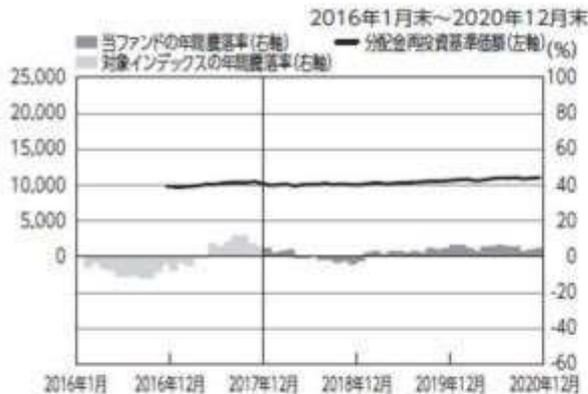


当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	32.2	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4
最小値	△22.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3
平均値	3.4	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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。

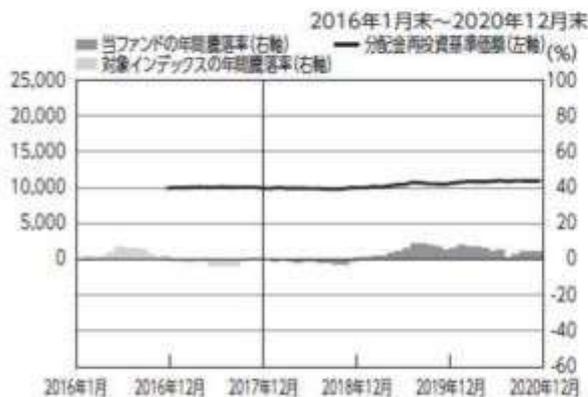


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	11.3	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△11.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.7	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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	8.7	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△3.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.0	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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	11.4	19.3
最小値	△17.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	△1.0	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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	11.4	19.3
最小値	△18.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	6.3	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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

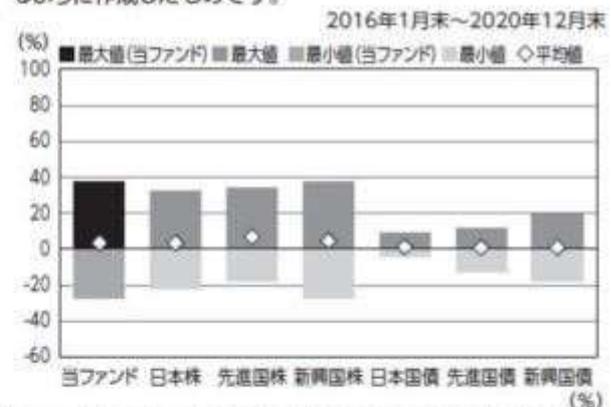


- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2016年1月から2020年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

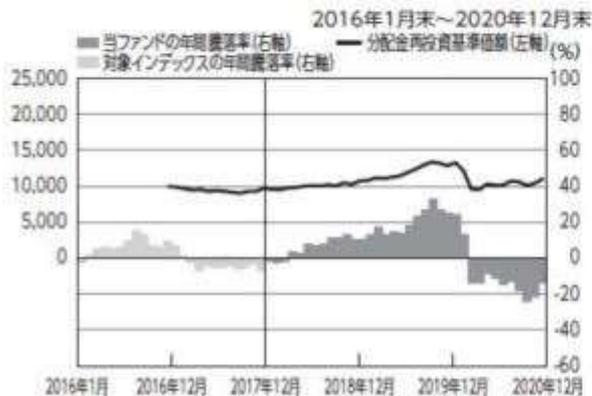


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	37.6	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△27.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.6	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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	33.1	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△24.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.8	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、2016年1月から2020年12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	20.7	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△25.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	0.1	3.6	6.8	4.6	1.4	1.0	1.0

- \* 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。
- \* 2016年1月から2020年12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、適時性を含め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控除について、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とした指数です。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）<sup>\*</sup>については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

す。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）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

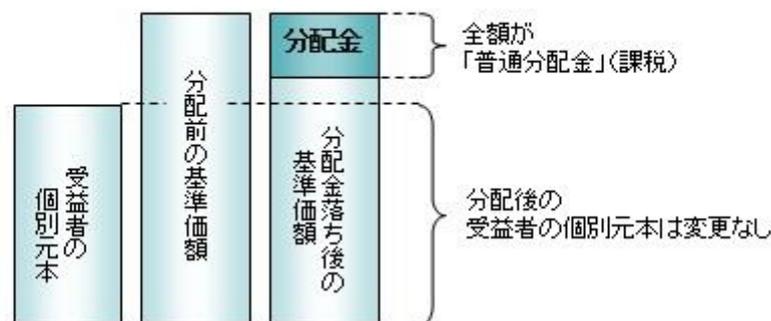
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

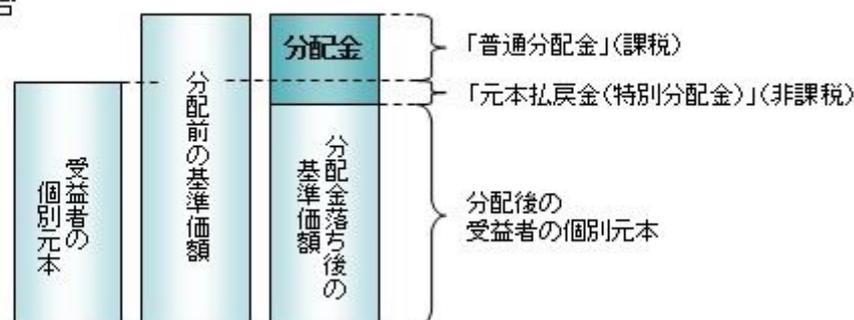
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <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12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12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	47,509,119,816	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		32,888,769	0.07
合計(純資産総額)		47,542,008,585	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	45,147,885,410	1.0541	47,594,177,458	1.0523	47,509,119,816	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	46,501	46,501	1.0102	1.0102
2019年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	
7月末日	48,485		1.0113	
8月末日	49,404		1.0064	
9月末日	51,009		1.0091	
10月末日	45,064		1.0072	
11月末日	45,975		1.0083	
12月末日	47,542		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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.84

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	29,799,407,229	23,715,579,475

(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12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	22,380,054,563	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		10,987,228	0.05
合計(純資産総額)		22,391,041,791	100.00

#### (2) 【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M国内株式マザーファンド	17,311,304,582	1.2709	22,001,572,895	1.2928	22,380,054,563	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	21,542	21,542	1.2313	1.2313
2019年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	
7月末日	11,824		1.0296	
8月末日	13,084		1.1133	
9月末日	13,630		1.1274	
10月末日	18,663		1.0951	
11月末日	21,126		1.2167	
12月末日	22,391		1.2524	

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.34

(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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	16,155,770,869	19,351,002,239

(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12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	20,375,381,402	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,953,628	0.06
合計(純資産総額)		20,387,335,030	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	19,099,532,623	1.0651	20,344,424,390	1.0668	20,375,381,402	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	20,009	20,009	1.1028	1.1028
2019年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	
7月末日	19,084		1.0987	
8月末日	19,504		1.0970	
9月末日	20,113		1.1017	
10月末日	19,159		1.0849	
11月末日	19,689		1.0956	
12月末日	20,387		1.1043	

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	5.66

(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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	9,148,589,469	13,467,741,798

(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12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	109,922,723,720	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		64,340,471	0.06
合計（純資産総額）		109,987,064,191	100.00

#### （２）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	102,406,114,888	1.0723	109,811,094,898	1.0734	109,922,723,720	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	107,828	107,828	1.0929	1.0929
2019年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	
7月末日	90,428		1.0993	
8月末日	91,494		1.0853	
9月末日	95,015		1.0967	
10月末日	104,936		1.0943	
11月末日	106,963		1.0950	
12月末日	109,987		1.0938	

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	4.33

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	56,096,556,318	15,203,108,711

(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12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	1,040,076,664	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		621,832	0.06
合計（純資産総額）		1,040,698,496	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	955,425,927	1.0829	1,034,635,687	1.0886	1,040,076,664	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,024	1,024	0.9926	0.9926
2019年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	
7月末日	1,779		0.9457	
8月末日	1,808		0.9500	
9月末日	1,791		0.9271	
10月末日	937		0.9222	
11月末日	997		0.9711	
12月末日	1,040		0.9975	

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1.92

(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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	748,245,689	1,991,499,982

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 【FWりそな先進国株式インデックスファンド】

以下の運用状況は2020年12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	32,788,967,779	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,823,167	0.04
合計(純資産総額)		32,802,790,946	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	21,443,311,608	1.5094	32,367,223,408	1.5291	32,788,967,779	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)	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	31,822	31,822	1.4153	1.4153
2019年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	
7月末日	27,279		1.2470	
8月末日	30,037		1.3427	
9月末日	29,574		1.2885	
10月末日	27,382		1.2520	
11月末日	31,102		1.3942	
12月末日	32,802		1.4335	

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	11.82

(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	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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	18,203,027,051	9,489,999,213

(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12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	3,109,119,237	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,222,692	0.04
合計（純資産総額）		3,110,341,929	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	2,063,940,014	1.4981	3,092,102,567	1.5064	3,109,119,237	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	3,068	3,068	1.3227	1.3227
2019年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	
7月末日	1,984		1.1445	

8月末日	2,099		1.1981
9月末日	2,030		1.1445
10月末日	2,708		1.1845
11月末日	2,990		1.2945
12月末日	3,110		1.3293

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.82

(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	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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,443,169,223	1,563,370,580

(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12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	1,800,833,412	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		827,404	0.05
合計（純資産総額）		1,801,660,816	100.00

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	1,436,300,377	1.1873	1,705,352,142	1.2538	1,800,833,412	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	1,675	1,675	1.0464	1.0464
2019年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
7月末日	2,647		1.0152
8月末日	2,851		1.0722
9月末日	2,880		1.0616
10月末日	1,569		1.0078
11月末日	1,655		1.0428
12月末日	1,801		1.1052

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	19.27

(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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	1,323,744,119	2,315,201,107

(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12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	4,132,728,473	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,756,489	0.04
合計（純資産総額）		4,134,484,962	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	4,041,788,238	1.0201	4,123,169,983	1.0225	4,132,728,473	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
第4計算期間末 (2020年12月10日)	4,075	4,075	0.9678	0.9678

2019年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
7月末日	3,975		0.8938
8月末日	4,176		0.9210
9月末日	4,084		0.8828
10月末日	3,517		0.8535
11月末日	4,021		0.9601
12月末日	4,134		0.9697

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	0.0000

## 【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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	14.32

(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
第4期	2019年12月11日～2020年12月10日	3,083,593,311	2,492,581,409

(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12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	67,990,745,800	82.62
地方債証券	日本	4,460,142,400	5.42
特殊債券	日本	5,636,704,428	6.85
社債券	日本	3,317,472,000	4.03
	フランス	100,299,000	0.12
	オーストラリア	99,966,000	0.12
	小計	3,517,737,000	4.27
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		692,950,055	0.84
合計(純資産総額)		82,298,279,683	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133回利付国債(5年)	1,280,000,000	100.66	1,288,557,000	100.39	1,285,043,200	0.100	2022/9/20	1.56
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	100.72	1,007,262,400	100.51	1,005,190,000	0.100	2023/3/20	1.22
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	934,000,000	103.01	962,128,300	102.46	956,995,080	0.400	2025/9/20	1.16
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	920,000,000	100.85	927,868,200	100.75	926,955,200	0.100	2024/3/20	1.13
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	910,000,000	100.80	917,369,000	100.57	915,268,900	0.100	2023/6/20	1.11
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	840,000,000	101.28	850,830,900	101.17	849,903,600	0.100	2029/9/20	1.03
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	830,000,000	100.60	835,010,900	100.46	833,826,300	0.100	2022/12/20	1.01
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	820,000,000	101.80	834,760,000	101.24	830,233,600	0.100	2027/3/20	1.01
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	750,000,000	100.81	756,123,000	100.65	754,890,000	0.100	2023/9/20	0.92
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	720,000,000	100.85	726,151,400	101.01	727,293,600	0.100	2030/3/20	0.88

日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	720,000,000	100.79	725,750,800	100.89	726,465,600	0.100	2030/6/20	0.88
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	700,000,000	101.01	707,128,000	100.98	706,895,000	0.100	2025/6/20	0.86
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	700,000,000	100.88	706,160,000	100.69	704,886,000	0.100	2023/12/20	0.86
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	670,000,000	100.96	676,498,300	100.79	675,346,600	0.100	2024/6/20	0.82
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	631,000,000	102.78	648,591,900	102.19	644,863,070	0.400	2025/3/20	0.78
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	630,000,000	101.42	639,000,000	101.35	638,549,100	0.100	2028/9/20	0.78
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	630,000,000	101.21	637,675,500	101.07	636,778,800	0.100	2029/12/20	0.77
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	590,000,000	101.27	597,528,800	101.23	597,262,900	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	590,000,000	101.26	597,471,400	101.19	597,068,200	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	570,000,000	101.31	577,517,200	101.32	577,524,000	0.100	2028/12/20	0.70
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	570,000,000	101.51	578,607,000	101.14	576,543,600	0.100	2026/9/20	0.70
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	560,000,000	100.97	565,477,500	100.95	565,325,600	0.100	2025/3/20	0.69
日本	国債証券	第413回利付国債(2年)	550,000,000	100.46	552,569,700	100.32	551,776,500	0.100	2022/6/1	0.67
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	532,000,000	102.98	547,859,440	102.15	543,453,960	0.600	2023/12/20	0.66
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	520,000,000	102.49	532,981,900	102.04	530,628,800	0.300	2025/12/20	0.64
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	520,000,000	101.77	529,204,000	101.34	526,973,200	0.100	2028/3/20	0.64
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	445,000,000	115.08	512,123,100	113.81	506,458,950	1.200	2034/12/20	0.62
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	490,000,000	101.38	496,803,800	101.12	495,512,500	0.100	2026/6/20	0.60
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	480,000,000	101.42	486,836,600	101.36	486,556,800	0.100	2027/12/20	0.59
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	480,000,000	101.09	485,232,000	100.89	484,296,000	0.100	2024/12/20	0.59

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.62
地方債証券	5.42
特殊債券	6.85
社債券	4.27
合計	99.16

## 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12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	44,208,592,810	98.38
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		730,180,608	1.62
合計（純資産総額）		44,938,773,418	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	830,070,000	1.85

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

## 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	197,400	7,259.55	1,433,036,356	7,957.00	1,570,711,800	3.50
日本	株式	ソニー	電気機器	110,800	8,115.12	899,155,612	10,285.00	1,139,578,000	2.54
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	137,700	5,867.61	807,971,184	8,058.00	1,109,586,600	2.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	44,365.20	709,843,211	58,000.00	928,000,000	2.07
日本	株式	任天堂	その他製品	10,800	49,845.84	538,335,080	65,830.00	710,964,000	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	232,000	2,586.63	600,099,041	2,645.50	613,756,000	1.37
日本	株式	日本電産	電気機器	42,600	8,686.61	370,049,794	12,980.00	552,948,000	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	147,200	3,929.28	578,391,104	3,755.00	552,736,000	1.23
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,193,500	476.74	568,995,451	456.10	544,355,350	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	151,900	2,826.12	429,288,340	3,535.00	536,966,500	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	29,700	13,534.22	401,966,397	18,040.00	535,788,000	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,100	4,041.06	489,373,574	4,321.00	523,273,100	1.16
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,500	17,900.72	402,766,341	22,920.00	515,700,000	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	35,100	11,439.27	401,518,403	14,270.00	500,877,000	1.11
日本	株式	村田製作所	電気機器	52,000	6,942.33	361,001,302	9,320.00	484,640,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,200	27,722.50	310,492,006	38,400.00	430,080,000	0.96

日本	株式	ファナック	電気機器	16,600	20,600.62	341,970,299	25,360.00	420,976,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	139,300	2,797.06	389,631,257	2,877.50	400,835,750	0.89
日本	株式	KDDI	情報・通信業	126,500	3,117.80	394,401,732	3,066.00	387,849,000	0.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	120,700	3,294.64	397,664,008	3,188.00	384,791,600	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	37,300	5,313.97	198,211,089	9,743.00	363,413,900	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	121,900	2,576.42	314,066,327	2,964.00	361,311,600	0.80
日本	株式	S M C	機械	5,600	54,629.64	305,925,984	62,950.00	352,520,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	85,000	3,879.70	329,775,133	4,065.00	345,525,000	0.77
日本	株式	花王	化学	42,400	8,417.42	356,898,979	7,970.00	337,928,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	61,700	5,266.71	324,956,052	5,308.00	327,503,600	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	237,100	1,414.10	335,284,075	1,307.50	310,008,250	0.69
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	18,000	14,920.84	268,575,224	17,040.00	306,720,000	0.68
日本	株式	中外製薬	医薬品	55,300	4,437.52	245,395,190	5,503.00	304,315,900	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	114,200	2,569.28	293,411,910	2,541.00	290,182,200	0.65

## 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	0.14
		建設業	2.31
		食料品	3.47
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.45
		医薬品	5.83
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.49
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.60
		機械	5.68
		電気機器	17.04
		輸送用機器	7.28
		精密機器	2.75
		その他製品	2.73
		電気・ガス業	1.28
陸運業	3.44		
海運業	0.19		
空運業	0.38		

	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	9.01
	卸売業	4.49
	小売業	4.70
	銀行業	4.38
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.88
	その他金融業	1.09
	不動産業	1.91
	サービス業	5.69
合 計		98.38

### 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	46	日本円	815,535,300	830,070,000	1.85

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

### 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12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	12,402,571,872	42.15
	カナダ	568,122,206	1.93
	メキシコ	251,270,680	0.85
	ドイツ	2,275,907,962	7.74
	イタリア	2,783,064,684	9.46
	フランス	3,110,749,675	10.57
	オランダ	577,388,000	1.96
	スペイン	1,773,075,934	6.03
	ベルギー	732,767,644	2.49
	オーストリア	445,664,063	1.51
	フィンランド	181,345,817	0.62
	アイルランド	244,684,688	0.83

	イギリス	1,950,959,947	6.63
	スウェーデン	95,738,360	0.33
	ノルウェー	61,210,260	0.21
	デンマーク	147,917,621	0.50
	ポーランド	178,144,627	0.61
	オーストラリア	796,209,620	2.71
	シンガポール	126,919,442	0.43
	マレーシア	140,337,734	0.48
	イスラエル	124,307,774	0.42
	小計	28,968,358,610	98.46
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		454,421,663	1.54
合計(純資産総額)		29,422,780,273	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,820,000	10,345.72	291,749,417	10,350.80	291,892,795	0.125	2022/11/30	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,266.08	165,284,023	10,071.84	162,156,684	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,510,000	10,316.37	155,777,332	10,304.31	155,595,141	0.500	2027/5/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,553.05	140,355,656	10,640.28	141,515,782	1.625	2022/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	11,773.73	137,752,687	12,008.82	140,503,306	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,292.91	121,456,441	10,301.88	121,562,278	0.250	2025/9/30	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	19,401.64	120,290,178	19,182.20	118,929,693	5.500	2029/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,895.45	115,491,871	11,145.65	118,143,956	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,130,000	10,367.75	117,155,679	10,314.82	116,557,528	0.500	2027/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,386.93	110,101,557	10,382.94	110,059,261	0.375	2025/4/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	11,787.45	104,908,363	12,240.08	108,936,773	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,275.36	108,918,852	10,256.20	108,715,753	0.500	2027/10/31	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	680,000	15,616.02	106,188,953	15,632.65	106,302,042	2.750	2027/10/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	440,000	23,132.98	101,785,136	24,069.26	105,904,759	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	10,342.70	103,427,076	10,309.56	103,095,698	0.250	2025/8/31	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	630,000	16,097.91	101,416,845	16,229.22	102,244,115	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,220.43	95,373,698	11,859.84	100,808,696	2.750	2028/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,479.21	96,425,402	11,981.13	100,641,535	2.875	2028/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	9,993.66	102,934,735	9,621.45	99,100,996	1.375	2050/8/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	440,000	21,868.40	96,220,991	21,922.93	96,460,901	5.750	2032/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	10,801.39	90,731,731	11,433.51	96,041,531	2.250	2027/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,621.17	90,279,945	11,257.64	95,689,994	2.000	2026/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,053.99	93,958,956	11,153.53	94,805,088	2.500	2024/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	10,142.59	96,354,638	9,754.87	92,671,313	1.125	2040/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	11,621.78	92,974,244	11,468.68	91,749,513	2.250	2027/8/15	0.31

フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	410,000	21,328.36	87,446,283	21,777.76	89,288,835	4.750	2035/4/25	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,748.47	84,912,952	11,155.56	88,128,933	2.375	2024/8/15	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	570,000	14,756.73	84,113,363	15,284.57	87,122,066	1.250	2036/5/25	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	12,541.53	80,265,813	13,576.69	86,890,836	3.000	2049/2/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	860,000	10,319.49	88,747,630	10,099.33	86,854,284	0.625	2030/5/15	0.30

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.46
合計	98.46

### 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12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	87,863,380,157	42.57
	カナダ	4,076,442,445	1.97
	メキシコ	1,767,012,142	0.86
	ドイツ	16,111,000,936	7.81
	イタリア	19,697,969,847	9.54
	フランス	21,988,154,272	10.65
	オランダ	4,108,914,916	1.99
	スペイン	12,548,627,680	6.08
	ベルギー	5,273,188,655	2.55
	オーストリア	3,144,378,777	1.52
	フィンランド	1,292,913,637	0.63
	アイルランド	1,753,044,196	0.85
	イギリス	13,825,813,130	6.70
	スウェーデン	671,307,193	0.33
	ノルウェー	448,223,605	0.22
デンマーク	1,036,896,423	0.50	

	ポーランド	1,267,698,734	0.61
	オーストラリア	5,679,946,784	2.75
	シンガポール	895,943,106	0.43
	マレーシア	1,015,819,813	0.49
	イスラエル	904,308,615	0.44
	小計	205,370,985,063	99.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,043,710,550	0.51
合計（純資産総額）		206,414,695,613	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		206,510,842,620	100.05

(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	10,150,000	10,062.14	1,021,307,275	10,071.84	1,022,292,141	0.625	2030/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,840,000	12,003.97	821,072,068	12,008.82	821,403,949	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,330,000	24,158.20	804,468,198	24,069.26	801,506,457	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,233.61	792,738,461	12,240.08	793,157,636	3.125	2028/11/15	0.38
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,050,000	15,678.67	791,773,105	15,632.65	789,448,999	2.750	2027/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,900,000	9,584.26	757,156,654	9,621.45	760,095,043	1.375	2050/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,089.63	738,561,083	10,099.33	739,271,352	0.625	2030/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	11,974.46	729,244,892	11,981.13	729,651,131	2.875	2028/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	16,279.04	722,789,586	16,229.22	720,577,569	2.500	2030/5/25	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,720,000	15,198.99	717,392,795	15,164.04	715,742,765	1.500	2031/5/25	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,160,000	13,488.95	696,030,233	13,462.41	694,660,498	1.750	2023/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	11,851.15	693,292,488	11,859.84	693,801,026	2.750	2028/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	10,919.65	687,938,180	10,929.35	688,549,477	1.500	2030/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	13,509.17	682,213,337	13,541.11	683,826,312	3.000	2048/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,153.74	681,493,616	11,155.56	681,604,789	2.375	2024/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	11,855.19	668,633,074	11,865.10	669,191,771	2.625	2029/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	10,839.60	666,635,561	10,851.73	667,381,504	1.500	2024/11/30	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	19,229.49	661,494,709	19,182.20	659,867,972	5.500	2029/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,149.29	651,118,786	11,153.53	651,366,726	2.500	2024/5/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,590,000	13,946.00	640,121,532	13,915.19	638,707,340	0.750	2028/5/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,451.70	635,569,841	11,468.68	636,512,243	2.250	2027/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,284.73	628,559,704	11,297.67	629,280,323	2.250	2025/11/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,060,000	10,345.14	626,915,963	10,351.41	627,295,739	0.125	2022/8/31	0.30
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	2,850,000	21,995.50	626,871,906	21,945.15	625,436,869	2.500	2046/8/15	0.30

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,345.95	620,757,376	10,351.61	621,097,000	0.125	2022/7/31	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,125.03	609,652,026	11,121.80	609,474,782	2.750	2023/11/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,460,000	11,142.42	608,376,234	11,150.50	608,817,698	2.250	2024/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,480,000	13,544.34	606,786,857	13,576.69	608,235,857	3.000	2049/2/15	0.29
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,010,000	15,172.82	608,430,142	15,128.94	606,670,849	1.250	2034/5/25	0.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,468.68	600,959,307	11,482.03	601,658,438	2.250	2027/11/15	0.29

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.49
合計	99.49

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	856,524,000.00	88,783,080,872	88,581,712,080	42.91
	カナダドル	売建	50,931,000.00	4,117,812,094	4,114,715,490	1.99
	メキシコペソ	売建	346,039,000.00	1,791,616,922	1,785,561,240	0.87
	ユーロ	売建	680,536,000.00	86,445,085,400	86,421,266,640	41.87
	英ポンド	売建	97,925,000.00	13,713,720,567	13,688,935,750	6.63
	スウェーデンクローナ	売建	53,600,000.00	673,682,320	676,968,000	0.33
	ノルウェークローネ	売建	37,870,000.00	456,159,298	455,576,100	0.22
	デンマーククローネ	売建	60,860,000.00	1,038,541,818	1,038,880,200	0.50
	ポーランドズロチ	売建	45,734,000.00	1,294,958,210	1,279,179,980	0.62
	オーストラリアドル	売建	72,668,000.00	5,721,514,980	5,727,691,760	2.77
	シンガポールドル	売建	11,572,000.00	903,188,814	902,037,400	0.44
	マレーシアリングギット	売建	36,510,000.00	934,555,030	933,560,700	0.45
	イスラエルシェケル	売建	28,133,000.00	906,819,428	904,757,280	0.44

(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12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	1,491,778,110	29.97
	アイルランド	3,459,319,921	69.50
	小計	4,951,098,031	99.46
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		26,651,608	0.54
合計（純資産総額）		4,977,749,639	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)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	554,837	5,992.43	3,324,825,273	6,234.83	3,459,319,921	69.50
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	434,922	3,368.32	1,464,958,115	3,429.98	1,491,778,110	29.97

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.46
合計	99.46

### 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先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年12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	44,721,958,118	57.92
	カナダ	2,290,253,685	2.97
	パナマ	14,716,463	0.02
	ドイツ	2,089,890,589	2.71

	イタリア	412,168,375	0.53
	フランス	2,309,726,681	2.99
	オランダ	1,225,646,700	1.59
	スペイン	553,952,104	0.72
	ベルギー	202,743,664	0.26
	オーストリア	37,309,389	0.05
	ルクセンブルク	55,716,348	0.07
	フィンランド	274,982,233	0.36
	アイルランド	1,216,298,952	1.58
	ポルトガル	42,231,936	0.05
	イギリス	2,986,751,114	3.87
	スイス	2,336,036,846	3.03
	スウェーデン	721,643,543	0.93
	ノルウェー	133,937,061	0.17
	デンマーク	574,263,099	0.74
	ケイマン	124,661,098	0.16
	リベリア	18,237,487	0.02
	オーストラリア	1,429,767,947	1.85
	バミューダ	196,114,435	0.25
	ニュージーランド	89,439,069	0.12
	パプアニューギニア	9,338,702	0.01
	香港	532,312,049	0.69
	シンガポール	200,990,502	0.26
	イスラエル	134,438,718	0.17
	キュラソー	41,076,763	0.05
	ジャージー	253,212,847	0.33
	マン島	11,257,712	0.01
	小計	65,241,074,229	84.49
投資証券	アメリカ	1,191,924,624	1.54
	カナダ	5,974,064	0.01
	フランス	36,353,815	0.05
	イギリス	41,228,331	0.05
	オーストラリア	106,412,083	0.14
	香港	29,625,919	0.04
	シンガポール	32,803,095	0.04
	小計	1,444,321,931	1.87
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		10,533,763,067	13.64
合計（純資産総額）		77,219,159,227	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	8,720,468,571	11.29

	買建	ドイツ	2,330,802,000	3.02
--	----	-----	---------------	------

(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		665,575,060	0.86

(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	233,699	9,491.86	2,218,239,043	13,959.04	3,262,214,857	4.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	98,226	19,315.24	1,897,259,473	23,199.52	2,278,796,543	2.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	5,817	252,960.36	1,471,470,467	343,827.00	2,000,041,659	2.59
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	32,918	24,669.71	812,077,760	28,646.72	942,993,058	1.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,117	156,543.45	644,489,402	181,928.16	748,998,235	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,114	156,114.33	642,254,374	182,027.51	748,861,217	0.97
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	10,210	24,585.67	251,019,702	68,929.96	703,774,943	0.91
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	36,055	15,342.74	553,182,522	15,953.49	575,203,082	0.74
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	41,718	12,213.73	509,532,483	12,938.53	539,769,803	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	23,094	21,114.00	487,606,737	22,187.29	512,393,391	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	34,093	13,156.04	448,528,949	14,326.47	488,432,342	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	39,531	12,620.61	498,905,521	12,253.89	484,408,526	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	13,033	31,103.37	405,370,230	35,950.72	468,545,799	0.61
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	19,252	22,122.28	425,898,196	23,760.49	457,437,050	0.59
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	24,844	13,804.93	342,969,770	18,350.54	455,901,064	0.59
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,445	36,394.22	307,349,195	53,585.05	452,525,789	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	12,242	33,584.38	411,140,038	35,879.30	439,234,513	0.57

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	14,748	25,560.61	376,968,010	27,550.66	406,317,207	0.53
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	15,303	15,565.54	238,199,464	23,911.60	365,919,291	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	9,649	37,797.04	364,703,676	35,959.19	346,970,248	0.45
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	56,968	6,117.16	348,482,769	6,086.83	346,754,816	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,583	41,885.74	275,733,837	51,968.38	342,107,878	0.44
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	62,734	4,520.55	283,592,643	5,335.42	334,712,552	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	6,074	43,516.90	264,321,700	54,945.04	333,736,203	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	106,922	3,100.03	331,462,268	3,106.03	332,103,474	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	56,069	5,489.13	307,770,405	5,602.45	314,124,049	0.41
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	58,306	6,470.43	377,264,989	5,111.86	298,052,401	0.39
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	30,528	10,115.22	308,797,557	9,662.53	294,977,777	0.38
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,862	37,664.36	220,788,484	50,310.28	294,918,891	0.38
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	34,728	8,677.83	301,363,773	8,426.96	292,651,814	0.38

## 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	2.51
		素材	3.85
		資本財	5.56
		商業・専門サービス	1.01
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.72
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.37
		メディア・娯楽	6.03
		小売	5.26
		食品・生活必需品小売り	1.24
		食品・飲料・タバコ	3.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	4.53
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.73		

	銀行	4.82
	各種金融	3.74
	保険	2.71
	不動産	0.39
	ソフトウェア・サービス	10.52
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48
	電気通信サービス	1.63
	公益事業	2.83
	半導体・半導体製造装置	3.69
投資証券		1.87
合計		86.36

## 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	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2103	買建	453	米ドル	83,561,075	8,648,571,262	84,255,735	8,720,468,571	11.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002103	買建	918	ユーロ	18,113,356	2,299,490,545	18,360,000	2,330,802,000	3.02

(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	4,491,000.00	464,648,740	464,728,680	0.60
	カナダドル	買建	403,000.00	32,567,880	32,570,460	0.04
	ユーロ	買建	258,000.00	32,755,344	32,753,100	0.04
	英ポンド	買建	307,000.00	42,924,678	42,921,670	0.06
	スイスフラン	買建	288,000.00	33,741,792	33,742,080	0.04
	スウェーデンクローナ	買建	871,000.00	11,004,736	11,000,730	0.01
	デンマーククローネ	買建	565,000.00	9,644,437	9,644,550	0.01
	オーストラリアドル	買建	283,000.00	22,308,550	22,308,890	0.03
	香港ドル	買建	935,000.00	12,476,827	12,472,900	0.02
	シンガポールドル	買建	44,000.00	3,431,076	3,432,000	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年12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	38,691,089	0.31
	アルゼンチン	1,574,586	0.01
	メキシコ	184,332,574	1.46
	ブラジル	548,375,119	4.33
	チリ	53,946,961	0.43
	コロンビア	20,853,936	0.16
	ペルー	4,021,887	0.03
	オランダ	35,203,113	0.28
	ルクセンブルク	23,280,706	0.18
	ギリシャ	11,318,629	0.09
	トルコ	40,227,457	0.32
	チェコ	10,135,292	0.08
	ハンガリー	22,288,610	0.18
	ポーランド	65,469,422	0.52
	ロシア	265,192,705	2.09
	ケイマン	2,626,973,693	20.75
	パミュータ	80,253,618	0.63
	香港	195,654,529	1.55
	シンガポール	3,027,780	0.02
	マレーシア	160,687,157	1.27
	タイ	197,546,096	1.56
	フィリピン	79,798,622	0.63
	インドネシア	144,486,180	1.14
	韓国	1,414,232,476	11.17
	台湾	1,309,146,664	10.34
	中国	1,153,558,694	9.11
	インド	988,926,863	7.81
	カタール	75,302,414	0.59
	エジプト	7,335,600	0.06
	南アフリカ	355,361,384	2.81
	ジャージー	7,456,495	0.06
	英ヴァージン諸島	4,646,741	0.04
	アラブ首長国連邦	57,210,216	0.45
マン島	3,903,401	0.03	
クウェート	52,827,061	0.42	
サウジアラビア	262,544,732	2.07	
小計		10,505,792,502	82.96

投資証券	メキシコ	5,440,998	0.04
	南アフリカ	4,334,429	0.03
	小計	9,775,427	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,147,486,271	16.96
合計(純資産総額)		12,663,054,200	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	2,317,803,840	18.30

(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		176,536,880	1.39

(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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	324,000	1,314.49	425,896,616	1,895.20	614,044,800	4.85
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	24,830	23,900.52	593,449,949	24,452.90	607,165,755	4.79
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	75,600	5,877.76	444,358,761	7,082.17	535,412,430	4.23
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	62,780	5,616.19	352,584,655	7,454.16	467,972,165	3.70
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	47,500	2,333.83	110,857,239	3,649.89	173,369,775	1.37
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,730	19,098.52	109,434,575	20,627.20	118,193,856	0.93
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	37,549	2,362.54	88,711,102	2,825.87	106,108,630	0.84
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	11,420	5,716.64	65,284,074	8,915.49	101,814,896	0.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,273,000	83.39	106,155,650	78.63	100,097,899	0.79
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	78,500	1,194.63	93,778,505	1,246.89	97,880,865	0.77
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	5,000	9,026.06	45,130,315	17,200.66	86,003,325	0.68
ブラジル	株式	VALE SA	素材	48,800	1,129.99	55,143,914	1,732.69	84,555,418	0.67
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	188,000	253.91	47,736,174	437.88	82,321,440	0.65
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	16,900	1,912.16	32,315,581	4,775.49	80,705,781	0.64

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	22,428	3,147.79	70,598,663	3,576.90	80,222,915	0.63
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,250	8,759.43	63,505,908	11,043.20	80,063,200	0.63
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	44,914	1,171.19	52,602,945	1,775.42	79,741,483	0.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,879	4,637.21	50,448,307	6,873.44	74,776,154	0.59
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,650	13,280.77	48,474,813	20,189.74	73,692,569	0.58
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	165,800	319.25	52,932,425	332.67	55,157,018	0.44
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	20,000	1,773.63	35,472,738	2,701.12	54,022,400	0.43
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	35,132	1,550.80	54,482,941	1,532.31	53,833,378	0.43
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	5,510	8,026.35	44,225,216	9,671.03	53,287,430	0.42
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	810,000	70.63	57,215,307	65.41	52,986,150	0.42
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,388	3,185.72	39,464,791	4,161.30	51,550,308	0.41
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,500	636.69	25,786,281	1,259.57	51,012,686	0.40
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	67,302	661.46	44,517,933	750.89	50,536,803	0.40
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	81,500	835.56	68,098,377	596.07	48,580,316	0.38
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	607	44,411.05	26,957,509	77,397.59	46,980,343	0.37
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	79,958	661.56	52,897,744	579.39	46,327,105	0.37

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.24
		素材	6.33
		資本財	2.23
		商業・専門サービス	0.21
		運輸	1.14
		自動車・自動車部品	2.83
		耐久消費財・アパレル	1.18
		消費者サービス	1.25
		メディア・娯楽	7.03
		小売	9.92
		食品・生活必需品小売り	1.06
		食品・飲料・タバコ	2.95
		家庭用品・パーソナル用品	0.93

	ヘルスケア機器・サービス	1.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.82
	銀行	10.84
	各種金融	1.82
	保険	2.45
	不動産	1.63
	ソフトウェア・サービス	1.97
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.81
	電気通信サービス	2.47
	公益事業	1.70
	半導体・半導体製造装置	7.07
投資証券		0.08
合計		83.04

### 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 2103	買建	352	米ドル	22,186,780	2,296,331,731	22,394,240	2,317,803,840	18.30

(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	1,706,000.00	176,500,542	176,536,880	1.39

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

### RAM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年12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	19,248,321,960	97.17
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		560,513,459	2.83
合計(純資産総額)		19,808,835,419	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	545,694,000	2.75

(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	2,268	743,172.54	1,685,515,337	598,000	1,356,264,000	6.85
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,015	703,300.3	1,417,150,124	596,000	1,200,940,000	6.06
日本	投資証券	G L P投資法人	6,296	145,835.58	918,180,819	162,600	1,023,729,600	5.17
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,049	305,806.26	932,403,297	322,000	981,778,000	4.96
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,516	166,349.25	1,083,931,740	147,600	961,761,600	4.86
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,875	273,576.29	786,531,862	255,200	733,700,000	3.70
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,786	198,721.14	752,358,267	187,600	710,253,600	3.59
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,015	201,169.91	807,697,219	170,500	684,557,500	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,914	332,266.26	635,957,631	309,500	592,383,000	2.99
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,309	165,563.96	713,415,125	127,600	549,828,400	2.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,848	170,072.76	484,367,221	190,500	542,544,000	2.74
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,927	83,729.32	496,263,701	75,000	444,525,000	2.24
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,010	494,414.46	499,358,611	435,500	439,855,000	2.22
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	623	764,140.8	476,059,720	700,000	436,100,000	2.20
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,255	422,959.01	530,813,561	342,000	429,210,000	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	694	662,557.39	459,814,831	580,000	402,520,000	2.03
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,317	286,889.41	377,833,360	304,500	401,026,500	2.02
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,246	167,456.44	376,107,175	166,400	373,734,400	1.89
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	703	510,991.24	359,226,848	523,000	367,669,000	1.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,491	62,231.02	403,941,571	53,000	344,023,000	1.74
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,367	166,040.73	393,018,422	142,300	336,824,100	1.70
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	429	764,421.78	327,936,945	656,000	281,424,000	1.42
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,426	45,047.62	379,571,268	33,150	279,321,900	1.41
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,044	136,542.47	279,092,810	132,000	269,808,000	1.36
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	669	408,596.72	273,351,210	399,000	266,931,000	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	879	339,030.61	298,007,908	297,300	261,326,700	1.32
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,631	101,680.26	267,520,787	95,700	251,786,700	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,622	173,267.89	281,040,528	153,900	249,625,800	1.26
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	1,315	200,615.28	263,809,096	189,500	249,192,500	1.26
日本	投資証券	日本リート投資法人	655	440,345.21	288,426,116	370,500	242,677,500	1.23

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	97.17
合 計	97.17

## 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	309	日本円	518,177,290	545,694,000	2.75

(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12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	オーストラリア	17,483,558	0.08
投資証券	アメリカ	15,662,054,403	71.36
	カナダ	412,468,047	1.88
	ドイツ	68,042,506	0.31
	イタリア	2,319,274	0.01
	フランス	576,882,177	2.63
	オランダ	42,586,613	0.19
	スペイン	106,451,313	0.49
	ベルギー	316,060,611	1.44
	アイルランド	30,269,201	0.14
	イギリス	1,248,490,216	5.69
	オーストラリア	1,734,050,582	7.90
	ニュージーランド	114,447,999	0.52
	香港	378,938,682	1.73
	シンガポール	933,380,471	4.25
	韓国	30,373,369	0.14
	イスラエル	14,945,658	0.07

	ガーンジー	58,800,678	0.27
	マン島	6,016,664	0.03
	小計	21,736,578,464	99.04
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		192,878,527	0.88
合計(純資産総額)		21,946,940,549	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		120,384,930	0.55

(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	124,285	9,808.69	1,219,073,348	10,114.02	1,257,020,976	5.73
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,010	68,028.34	1,021,105,518	73,358.72	1,101,114,537	5.02
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,268	14,192.97	670,873,751	14,283.00	675,128,844	3.08
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,540	21,875.58	558,702,453	23,577.30	602,164,242	2.74
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	55,301	10,436.48	577,148,198	8,620.51	476,723,100	2.17
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	70,401	7,013.45	493,754,168	6,539.12	460,361,291	2.10
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	283,010	1,224.85	346,647,071	1,521.61	430,631,412	1.96
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,386	19,241.55	449,983,063	16,271.23	380,519,102	1.73
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,853	16,854.55	351,467,969	18,129.05	378,045,288	1.72
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	59,241	6,876.27	407,357,446	6,310.39	373,834,110	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	57,430	7,198.46	413,407,796	6,040.26	346,892,132	1.58
香港	投資証券	LINK REIT	348,400	962.72	335,415,078	946.51	329,765,826	1.50
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	63,233	4,852.01	306,807,711	5,074.60	320,882,498	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	94,376	2,985.27	281,738,212	3,012.88	284,344,035	1.30
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,866	3,201.45	290,903,662	3,080.16	279,881,819	1.28
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,034	15,235.05	274,748,985	15,435.99	278,372,644	1.27
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	201,650	1,268.89	255,871,976	1,339.19	270,048,865	1.23
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,014	27,618.64	304,191,732	24,305.93	267,705,623	1.22
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,648	10,760.76	232,948,966	11,779.33	254,999,044	1.16
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	62,342	3,707.85	231,155,068	4,082.04	254,482,538	1.16
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,325	12,943.43	250,131,879	12,859.87	248,517,084	1.13
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	90,846	2,425.07	220,308,391	2,614.41	237,508,691	1.08
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,901	11,644.51	278,315,540	9,655.51	230,776,464	1.05
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,356	7,709.91	226,332,360	7,261.55	213,170,355	0.97
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	90,695	2,086.12	189,201,279	2,245.94	203,696,435	0.93
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	878,505	233.44	205,082,583	224.69	197,394,802	0.90

フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,462	11,146.81	261,526,620	8,317.76	195,151,379	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	49,735	4,373.85	217,533,869	3,878.14	192,879,542	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,604	6,937.18	198,431,120	6,417.00	183,551,868	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	119,245	1,437.09	171,366,398	1,485.22	177,105,655	0.81

## 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	不動産	0.08
投資証券			99.04
合計			99.12

## 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	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	760,000.00	78,629,600	78,644,800	0.36
	カナダドル	買建	39,000.00	3,151,707	3,151,980	0.01
	ユーロ	買建	55,000.00	6,982,800	6,982,250	0.03
	英ポンド	買建	80,000.00	11,185,520	11,184,800	0.05
	オーストラリアドル	買建	170,000.00	13,400,760	13,401,100	0.06
	シンガポールドル	買建	90,000.00	7,018,020	7,020,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

## FWりそな国内債券インデックスファンド

2020年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020年12月10日	0円
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■ ポートフォリオの状況

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

## ■ 組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第133回利付国債(5年)	0.10%	2022/9/20	1.6%
2	第135回利付国債(5年)	0.10%	2023/3/20	1.2%
3	第340回利付国債(10年)	0.40%	2025/9/20	1.2%
4	第139回利付国債(5年)	0.10%	2024/3/20	1.1%
5	第136回利付国債(5年)	0.10%	2023/6/20	1.1%
6	第356回利付国債(10年)	0.10%	2029/9/20	1.0%
7	第134回利付国債(5年)	0.10%	2022/12/20	1.0%
8	第346回利付国債(10年)	0.10%	2027/3/20	1.0%
9	第137回利付国債(5年)	0.10%	2023/9/20	0.9%
10	第358回利付国債(10年)	0.10%	2030/3/20	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。  
 ・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12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
2020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	98.4%
先物	1.8%
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	17.0%
2 情報・通信業	9.0%
3 化学	7.5%
4 輸送用機器	7.3%
5 医薬品	5.8%

## ■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	3.5%
2	ソニー	電気機器	2.5%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.5%
4	キーエンス	電気機器	2.1%
5	任天堂	その他製品	1.6%
6	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
7	日本電産	電気機器	1.2%
8	武田薬品工業	医薬品	1.2%
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.2%
10	第一三共	医薬品	1.2%

※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)



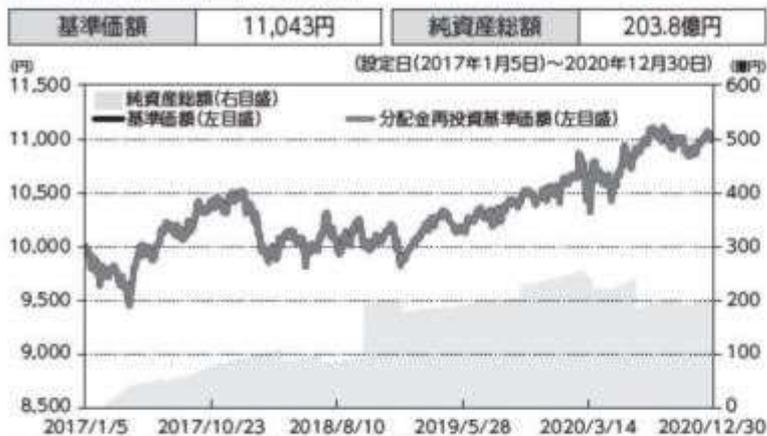
・2011年から2016年までは、対象インデックス(東証株価指数(TOPIX、配当込み))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、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

(1万円当たり、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
2020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	42.2%
ユーロ	41.2%
英ポンド	6.6%
豪ドル	2.7%
カナダドル	1.9%
その他	5.4%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	0.125%	2022/11/30	1.0%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/8/15	0.6%
3	US TREASURY N/B	アメリカ	0.500%	2027/5/31	0.5%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	1.625%	2022/11/15	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	0.250%	2025/9/30	0.4%
7	GOV OF FRANCE	フランス	5.500%	2029/4/25	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	2.000%	2025/8/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	アメリカ	0.500%	2027/4/30	0.4%
10	US TREASURY N/B	アメリカ	0.375%	2025/4/30	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12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020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	99.5%
先物	0.0%
現金等	0.5%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	42.6%
ユーロ	41.6%
英ポンド	6.7%
豪ドル	2.8%
カナダドル	2.0%
その他	4.4%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/8/15	0.5%
2	US TREASURY N/B	アメリカ	2.875%	2028/8/15	0.4%
3	GOV OF FRANCE	フランス	4.500%	2041/4/25	0.4%
4	US TREASURY N/B	アメリカ	3.125%	2028/11/15	0.4%
5	GOV OF FRANCE	フランス	2.750%	2027/10/25	0.4%
6	US TREASURY N/B	アメリカ	1.375%	2050/8/15	0.4%
7	US TREASURY N/B	アメリカ	0.625%	2030/5/15	0.4%
8	US TREASURY N/B	アメリカ	2.875%	2028/5/15	0.4%
9	GOV OF FRANCE	フランス	2.500%	2030/5/25	0.3%
10	GOV OF FRANCE	フランス	1.500%	2031/5/25	0.3%

※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(FITSE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。  
 ・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12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
2020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	99.5%
先物	0.0%
現金等	0.5%
合計	100.0%

## ■通貨別資産配分

通貨	組入比率
メキシコペソ	9.9%
ブラジルレアル	9.9%
インドネシアルピア	9.8%
中国元	9.2%
南アフリカランド	8.1%
その他	53.1%
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	-	-	69.5%
2	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	アメリカ	-	-	30.0%
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)



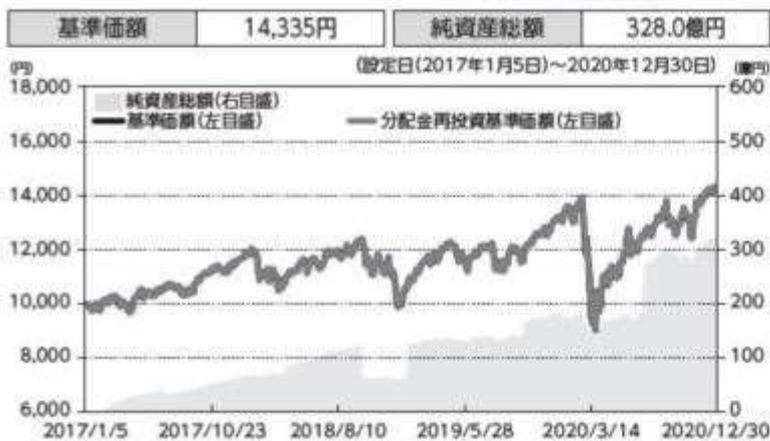
・2011年から2016年までは、対象インデックス(JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース))の年間騰落率です。  
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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12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
2020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	86.4%
先物	14.3%
現金等	-0.7%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
アメリカ	60.9%
イギリス	4.1%
フランス	3.1%
スイス	3.0%
カナダ	2.9%
その他	26.0%
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	4.2%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	3.0%
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	2.6%
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	1.2%
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	1.0%
7	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	0.9%
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬・バイオテクノロジー・ライライフ	0.7%
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.7%
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.7%

※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-KOKUSA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。

・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12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、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

(1万円当たり、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
2020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	83.0%
先物	18.3%
現金等	-1.3%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

国・地域	組入比率
中国	31.2%
韓国	11.2%
台湾	10.5%
インド	7.8%
ブラジル	4.3%
その他	35.1%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	4.8%
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	小売	4.8%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	メディア・娯楽	4.2%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	テクノロジーハードウェア及び機器	3.7%
5	MEITUAN	中国	小売	1.4%
6	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	小売	0.9%
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	エネルギー	0.8%
8	JD.COM INC-ADR	中国	小売	0.8%
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	0.8%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	保険	0.8%

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

※国・地域は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エマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

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

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。

・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12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年12月11日	0円
2018年12月10日	0円
2019年12月10日	0円
2020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	97.2%
先物	2.8%
現金等	0.1%
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	6.8%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.1%
3	GLP投資法人	5.2%
4	日本プロロジスリート投資法人	5.0%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.9%
6	大和ハウスリート投資法人	3.7%
7	日本リテールファンド投資法人	3.6%
8	オリックス不動産投資法人	3.5%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	3.0%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.8%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



- ・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。
- ・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12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
2020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	99.1%
先物	0.0%
現金等	0.9%
合計	100.0%

## ■国・地域別配分

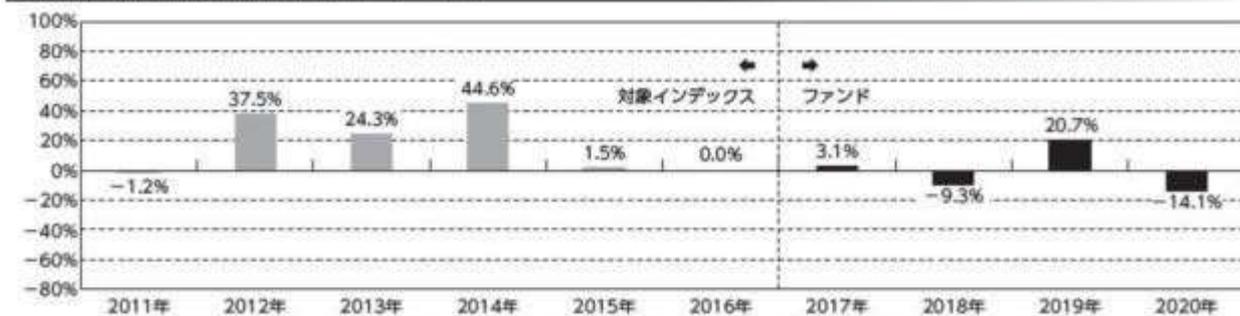
国・地域	組入比率
アメリカ	71.4%
オーストラリア	8.0%
イギリス	5.8%
シンガポール	4.1%
フランス	2.7%
その他	8.1%
合計	100.0%

## ■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	5.7%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.0%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.1%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.7%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.2%
6	WELLTOWER INC	アメリカ	2.1%
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.0%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	1.7%
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.7%
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.7%

※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。  
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース(一般コース)＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

＜F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)＞

＜F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)＞

＜F Wりそな新興国債券インデックスファンド＞

＜F Wりそな先進国株式インデックスファンド＞

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

＜F Wりそな新興国株式インデックスファンド＞

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

＜F Wりそな先進国リートインデックスファンド＞

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(6) 申込金額

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

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

F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wりそな新興国債券インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wりそな先進国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

F Wりそな新興国株式インデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

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

額です。

F Wりそな先進国リートインデックスファンド：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

( 7 ) 申込単位

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

( 8 ) 申込代金の支払い

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

( 9 ) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金(解約)手続等】

( 1 ) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

( 2 ) 取扱時間

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

( 3 ) 解約請求不可日

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし) >

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

( 4 ) 解約制限

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

#### （５）解約価額

ＦＷ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。

ＦＷ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。

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）：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷ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

ＦＷ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。

ＦＷ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。

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）：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。

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）：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。

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷ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。

ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド：原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

#### （９）受付の中止および取消

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

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

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

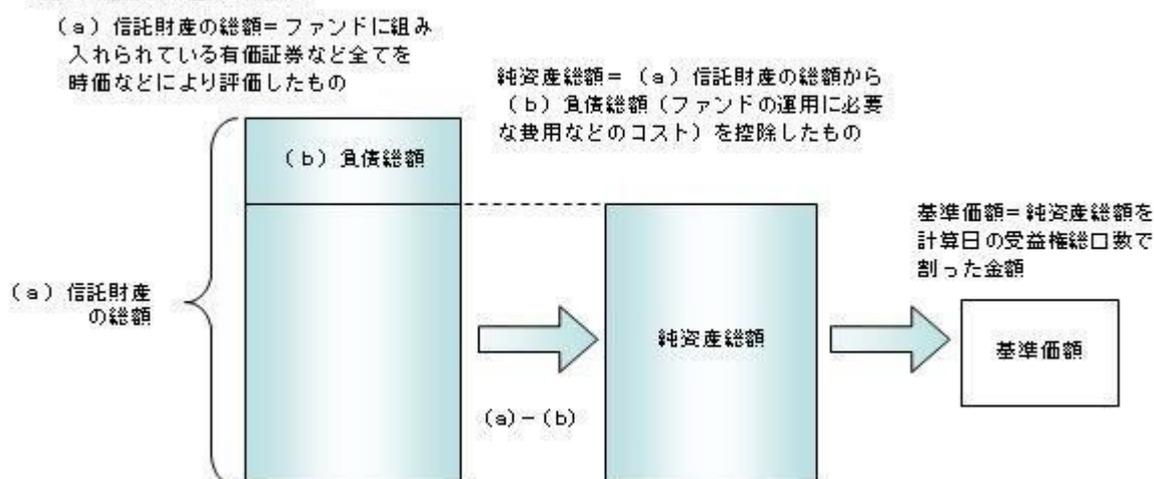
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

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

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

###### 国内上場不動産投信

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

###### 海外上場不動産投信

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

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則と

してわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## （２）【保管】

該当事項はありません。

## （３）【信託期間】

無期限とします（2017年1月5日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## （４）【計算期間】

毎年12月11日から翌年12月10日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## （５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 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。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
  - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

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

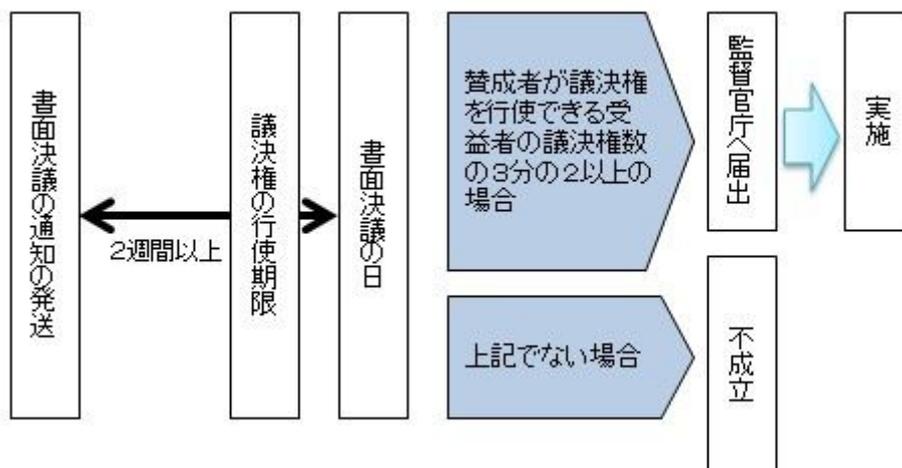
除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)

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

#### 書面決議

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

#### <書面決議の主な流れ>



#### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 関係法人との契約について

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

#### 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

1. 他の受益者の氏名または名称および住所

## 2. 他の受益者が有する受益権の内容

### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

#### (2) 解約請求権

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

#### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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4期計算期間(2019年12月11日から2020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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	123,687,640	153,454,206
親投資信託受益証券	40,672,964,303	46,468,877,458
<b>流動資産合計</b>	40,796,651,943	46,622,331,664
<b>資産合計</b>	40,796,651,943	46,622,331,664
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	36,488,718	52,724,440
未払受託者報酬	6,810,717	7,955,774
未払委託者報酬	49,945,206	58,342,220
未払利息	335	416
その他未払費用	2,270,667	2,254,047
<b>流動負債合計</b>	95,515,643	121,276,897
<b>負債合計</b>	95,515,643	121,276,897
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	39,949,947,999	46,033,775,753
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	751,188,301	467,279,014
（分配準備積立金）	549,091,662	557,649,580
<b>元本等合計</b>	40,701,136,300	46,501,054,767
<b>純資産合計</b>	40,701,136,300	46,501,054,767
<b>負債純資産合計</b>	40,796,651,943	46,622,331,664

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 2018年12月11日 至 2019年12月10日		自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		928,552,539		298,886,845
<b>営業収益合計</b>		<b>928,552,539</b>		<b>298,886,845</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		124,473		115,332
受託者報酬		14,224,191		15,557,494
委託者報酬		104,310,592		114,088,072
その他費用		4,746,694		4,429,380
<b>営業費用合計</b>		<b>123,405,950</b>		<b>134,190,278</b>
営業利益又は営業損失（ ）		805,146,589		433,077,123
経常利益又は経常損失（ ）		805,146,589		433,077,123
当期純利益又は当期純損失（ ）		805,146,589		433,077,123
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		343,083,823		166,256,016
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		270,803,932		396,927,159
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		270,803,932		396,927,159
剰余金減少額又は欠損金増加額		78,562,630		414,015,339
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		78,562,630		414,015,339
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		751,188,301		467,279,014

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 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 29,799,407,229円
期中一部解約元本額 20,624,350,895円	期中一部解約元本額 23,715,579,475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. 計算期間の末日における受益権の総数 46,033,775,753口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0188円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0102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) (10,102円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 266,867,881円	A 費用控除後の配当等収益額 225,117,945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	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 202,096,639円	C 収益調整金額 511,886,280円
D 分配準備積立金額 191,018,216円	D 分配準備積立金額 332,531,635円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 751,188,301円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 1,069,535,860円
F 当ファンドの期末残存口数 39,949,947,999口	F 当ファンドの期末残存口数 46,033,775,753口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 188円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 232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

<p style="text-align: center;">第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日</p>
<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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

### 金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第3期 2019年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第4期 2020年12月10日現在</p>
<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 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	688,445,975	145,611,162
合計	688,445,975	145,611,162

## 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	44,079,754,751	46,468,877,458	
	合計	44,079,754,751	46,468,877,458	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

当ファンドは「RAM国内債券マザーファンド」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りそな国内株式インデックスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	69,124,091	69,293,470
親投資信託受益証券	24,173,864,663	21,531,872,895
<b>流動資産合計</b>	<b>24,242,988,754</b>	<b>21,601,166,365</b>
<b>資産合計</b>	<b>24,242,988,754</b>	<b>21,601,166,365</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	22,827,987	33,869,174
未払受託者報酬	3,341,321	2,427,302
未払委託者報酬	30,071,859	21,845,676
未払利息	187	187
その他未払費用	1,113,997	687,636
<b>流動負債合計</b>	<b>57,355,351</b>	<b>58,829,975</b>
<b>負債合計</b>	<b>57,355,351</b>	<b>58,829,975</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	20,690,309,942	17,495,078,572
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	3,495,323,461	4,047,257,818
( 分配準備積立金 )	1,540,495,805	2,369,011,422
<b>元本等合計</b>	<b>24,185,633,403</b>	<b>21,542,336,390</b>
<b>純資産合計</b>	<b>24,185,633,403</b>	<b>21,542,336,390</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>24,242,988,754</b>	<b>21,601,166,365</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日	自	2019年12月11日
	至	2019年12月10日	至	2020年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,325,049,039		1,905,491,768
<b>営業収益合計</b>		<b>2,325,049,039</b>		<b>1,905,491,768</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		55,257		41,802
受託者報酬		6,217,645		5,255,387
委託者報酬		55,958,712		47,298,450
その他費用		2,074,786		1,496,603
<b>営業費用合計</b>		<b>64,306,400</b>		<b>54,092,242</b>
営業利益又は営業損失( )		2,260,742,639		1,959,584,010
経常利益又は経常損失( )		2,260,742,639		1,959,584,010
当期純利益又は当期純損失( )		2,260,742,639		1,959,584,010
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( )		34,377,761		3,895,277,130
期首剰余金又は期首欠損金( )		909,935,817		3,495,323,461
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>587,201,311</b>		<b>1,154,143,844</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		587,201,311		1,154,143,844
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>228,178,545</b>		<b>2,537,902,607</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		228,178,545		2,537,902,607
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,495,323,461		4,047,257,818

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 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 16,155,770,869円
期中一部解約元本額 4,115,126,539円	期中一部解約元本額 19,351,002,239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. 計算期間の末日における受益権の総数 17,495,078,572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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.2313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) (12,313円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 446,819,665円	A 費用控除後の配当等収益額 289,119,286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	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 1,646,573,834円
C 収益調整金額 2,461,470,418円	C 収益調整金額 2,955,497,809円
D 分配準備積立金額 820,071,407円	D 分配準備積立金額 433,318,302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	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 5,324,509,231円
F 当ファンドの期末残存口数 20,690,309,942口	F 当ファンドの期末残存口数 17,495,078,572口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,934円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,043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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	2,355,217,065	1,951,116,293
合計	2,355,217,065	1,951,116,293

## 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	16,943,557,519	21,531,872,895	
合計		16,943,557,519	21,531,872,895	

(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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	64,145,484	63,110,227
親投資信託受益証券	23,430,503,865	19,996,624,390
<b>流動資産合計</b>	<b>23,494,649,349</b>	<b>20,059,734,617</b>
<b>資産合計</b>	<b>23,494,649,349</b>	<b>20,059,734,617</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	8,716,253	11,266,707
未払受託者報酬	3,427,023	3,287,076
未払委託者報酬	36,554,750	35,062,123
未払利息	173	171
その他未払費用	1,142,469	931,252
<b>流動負債合計</b>	<b>49,840,668</b>	<b>50,547,329</b>
<b>負債合計</b>	<b>49,840,668</b>	<b>50,547,329</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	22,462,375,014	18,143,222,685
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	982,433,667	1,865,964,603
(分配準備積立金)	716,911,508	1,160,304,781
<b>元本等合計</b>	<b>23,444,808,681</b>	<b>20,009,187,288</b>
<b>純資産合計</b>	<b>23,444,808,681</b>	<b>20,009,187,288</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>23,494,649,349</b>	<b>20,059,734,617</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		612,029,687		1,303,120,525
<b>営業収益合計</b>		<b>612,029,687</b>		<b>1,303,120,525</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		50,274		48,602
受託者報酬		6,440,593		7,172,228
委託者報酬		68,699,427		76,503,731
その他費用		2,148,643		2,042,787
<b>営業費用合計</b>		<b>77,338,937</b>		<b>85,767,348</b>
営業利益又は営業損失 ( )		534,690,750		1,217,353,177
経常利益又は経常損失 ( )		534,690,750		1,217,353,177
当期純利益又は当期純損失 ( )		534,690,750		1,217,353,177
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		3,795,388		403,203,505
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		257,886,087		725,383,412
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		257,886,087		725,383,412
剰余金減少額又は欠損金増加額		78,416,323		656,002,148
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		78,416,323		656,002,148
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		982,433,667		1,865,964,603

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 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 9,148,589,469円
期中一部解約元本額 5,341,817,591円	期中一部解約元本額 13,467,741,798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. 計算期間の末日における受益権の総数 18,143,222,685口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0437円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.1028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) (11,028円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 384,362,083円	A 費用控除後の配当等収益額 354,687,985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 437,513,281円
C 収益調整金額 1,089,873,193円	C 収益調整金額 1,104,798,241円
D 分配準備積立金額 332,549,425円	D 分配準備積立金額 368,103,515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	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 2,265,103,022円
F 当ファンドの期末残存口数 22,462,375,014口	F 当ファンドの期末残存口数 18,143,222,685口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 804円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,248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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	656,431,113	952,201,688
合計	656,431,113	952,201,688

## 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	18,772,647,757	19,996,624,390	
合計		18,772,647,757	19,996,624,390	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

当ファンドは「R A M先進国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	177,840,660	325,104,537
親投資信託受益証券	60,476,767,221	107,761,394,898
<b>流動資産合計</b>	<b>60,654,607,881</b>	<b>108,086,499,435</b>
<b>資産合計</b>	<b>60,654,607,881</b>	<b>108,086,499,435</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	21,476,383	70,912,184
未払受託者報酬	9,963,176	15,623,173
未払委託者報酬	106,273,821	166,647,164
未払利息	482	881
その他未払費用	3,321,588	4,426,482
<b>流動負債合計</b>	<b>141,035,450</b>	<b>257,609,884</b>
<b>負債合計</b>	<b>141,035,450</b>	<b>257,609,884</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	57,768,211,684	98,661,659,291
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,745,360,747	9,167,230,260
（分配準備積立金）	2,195,849,034	4,333,756,736
<b>元本等合計</b>	<b>60,513,572,431</b>	<b>107,828,889,551</b>
<b>純資産合計</b>	<b>60,513,572,431</b>	<b>107,828,889,551</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>60,654,607,881</b>	<b>108,086,499,435</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,286,189,295		3,325,627,677
営業収益合計		3,286,189,295		3,325,627,677
営業費用				
支払利息		143,832		177,981
受託者報酬		17,936,847		27,010,799
委託者報酬		191,326,241		288,115,104
その他費用		5,983,931		7,684,057
営業費用合計		215,390,851		322,987,941
営業利益又は営業損失( )		3,070,798,444		3,002,639,736
経常利益又は経常損失( )		3,070,798,444		3,002,639,736
当期純利益又は当期純損失( )		3,070,798,444		3,002,639,736
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( )		649,491,194		425,223,166
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		808,655,219		4,660,235,378
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		4,660,235,378
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		815,782,435
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		815,782,435
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,745,360,747		9,167,230,260

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 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 56,096,556,318円
期中一部解約元本額 15,842,703,502円	期中一部解約元本額 15,203,108,711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. 計算期間の末日における受益権の総数 98,661,659,291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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0929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) (10,929円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 1,108,013,614円	A 費用控除後の配当等収益額 1,454,324,582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	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 1,123,091,988円
C 収益調整金額 892,211,876円	C 収益調整金額 4,833,473,524円
D 分配準備積立金額 741,700,741円	D 分配準備積立金額 1,756,340,166円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 3,088,060,910円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,167,230,260円
F 当ファンドの期末残存口数 57,768,211,684口	F 当ファンドの期末残存口数 98,661,659,291口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 534円	G 10,000口当たり収益分配対象額 929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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	2,905,619,327	3,153,598,112
合計	2,905,619,327	3,153,598,112

## 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

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)	100,495,565,512	107,761,394,898	
合計		100,495,565,512	107,761,394,898	

(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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	8,033,315	6,214,465
親投資信託受益証券	2,301,230,940	1,023,755,687
<b>流動資産合計</b>	<b>2,309,264,255</b>	<b>1,029,970,152</b>
<b>資産合計</b>	<b>2,309,264,255</b>	<b>1,029,970,152</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	1,309,920	962,657
未払受託者報酬	282,200	245,687
未払委託者報酬	4,891,425	4,258,601
未払利息	21	16
その他未払費用	93,996	69,520
<b>流動負債合計</b>	<b>6,577,562</b>	<b>5,536,481</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,577,562</b>	<b>5,536,481</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,275,289,883	1,032,035,590
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,396,810	7,601,919
（分配準備積立金）	132,343,609	83,731,849
<b>元本等合計</b>	<b>2,302,686,693</b>	<b>1,024,433,671</b>
<b>純資産合計</b>	<b>2,302,686,693</b>	<b>1,024,433,671</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>2,309,264,255</b>	<b>1,029,970,152</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2018年12月11日 至 2019年12月10日		自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	
営業収益				
有価証券売買等損益		70,801,452		159,125,253
営業収益合計		70,801,452		159,125,253
営業費用				
支払利息		4,768		5,283
受託者報酬		512,620		584,014
委託者報酬		8,885,363		10,122,972
その他費用		170,856		166,518
営業費用合計		9,573,607		10,878,787
営業利益又は営業損失( )		61,227,845		170,004,040
経常利益又は経常損失( )		61,227,845		170,004,040
当期純利益又は当期純損失( )		61,227,845		170,004,040
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		3,689,214		169,929,989
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		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		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,064,659		34,924,678
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,400,004
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		33,524,674
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		27,396,810		7,601,919

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 1,806,368,468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 748,245,689円
期中一部解約元本額 706,944,106円	期中一部解約元本額 1,991,499,982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. 計算期間の末日における受益権の総数 1,032,035,590口
	3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 7,601,919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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9926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) (9,926円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 82,074,294円	A 費用控除後の配当等収益額 42,819,884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 120,600,484円	C 収益調整金額 77,475,038円
D 分配準備積立金額 50,269,315円	D 分配準備積立金額 40,911,965円
E 当ファンドの分配対象収益額 252,944,093円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 161,206,887円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 2,275,289,883口	F 当ファンドの期末残存口数 1,032,035,590口
G 10,000口当たり収益分配対象額 1,111円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 1,562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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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>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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	71,617,761	1,796,158
合計	71,617,761	1,796,158

## 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	945,383,403	1,023,755,687	
合計		945,383,403	1,023,755,687	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

当ファンドは「R A M新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。同親投資信託受益証券の状況は、後述の「F Wりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

## 【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	48,079,551	116,467,684
親投資信託受益証券	17,421,883,306	31,807,223,408
流動資産合計	17,469,962,857	31,923,691,092
資産合計	17,469,962,857	31,923,691,092
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,338,966	40,622,070
未払受託者報酬	2,414,931	4,468,342
未払委託者報酬	29,784,081	55,109,502
未払利息	130	315
その他未払費用	805,048	1,265,928
流動負債合計	40,343,156	101,466,157
負債合計	40,343,156	101,466,157
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,770,768,469	22,483,796,307
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,658,851,232	9,338,428,628
(分配準備積立金)	2,092,660,729	5,338,978,713
元本等合計	17,429,619,701	31,822,224,935
純資産合計	17,429,619,701	31,822,224,935
負債純資産合計	17,469,962,857	31,923,691,092

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日	自	2019年12月11日
	至	2019年12月10日	至	2020年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,473,207,933		3,790,540,102
<b>営業収益合計</b>		<b>2,473,207,933</b>		<b>3,790,540,102</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		34,518		50,642
受託者報酬		4,290,146		7,265,215
委託者報酬		52,911,669		89,604,256
その他費用		1,431,346		2,065,476
<b>営業費用合計</b>		<b>58,667,679</b>		<b>98,985,589</b>
営業利益又は営業損失( )		2,414,540,254		3,691,554,513
経常利益又は経常損失( )		2,414,540,254		3,691,554,513
当期純利益又は当期純損失( )		2,414,540,254		3,691,554,513
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( )		297,223,789		487,210,302
期首剰余金又は期首欠損金( )		548,841,097		3,658,851,232
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>1,242,071,711</b>		<b>3,623,540,908</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,242,071,711		3,623,540,908
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>249,378,041</b>		<b>2,122,728,327</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		249,378,041		2,122,728,327
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,658,851,232		9,338,428,628

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 5,484,626,857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 18,203,027,051円
期中一部解約元本額 2,786,271,649円	期中一部解約元本額 9,489,999,213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. 計算期間の末日における受益権の総数 22,483,796,307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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.4153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) (14,153円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 262,260,711円	A 費用控除後の配当等収益額 303,852,917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	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 3,874,911,898円
C 収益調整金額 1,566,190,503円	C 収益調整金額 4,632,086,182円
D 分配準備積立金額 248,020,046円	D 分配準備積立金額 1,160,213,898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	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 9,971,064,895円
F 当ファンドの期末残存口数 13,770,768,469口	F 当ファンドの期末残存口数 22,483,796,307口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,656円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 4,434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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	2,340,085,864	4,359,189,743
合計	2,340,085,864	4,359,189,743

## 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	21,072,759,645	31,807,223,408	
合計		21,072,759,645	31,807,223,408	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

当ファンドは「RAM先進国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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,887,993	12,955,216
親投資信託受益証券	2,809,230,275	3,066,595,071
流動資産合計	2,819,118,268	3,079,550,287
資産合計	2,819,118,268	3,079,550,287
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,662,633	3,933,003
未払受託者報酬	344,313	375,076
未払委託者報酬	6,541,952	7,126,355
未払利息	26	35
その他未払費用	114,711	106,184
流動負債合計	8,663,635	11,540,653
負債合計	8,663,635	11,540,653
純資産の部		
元本等		
元本	2,439,675,773	2,319,474,416
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	370,778,860	748,535,218
( 分配準備積立金 )	96,834,457	438,145,780
元本等合計	2,810,454,633	3,068,009,634
純資産合計	2,810,454,633	3,068,009,634
負債純資産合計	2,819,118,268	3,079,550,287

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日	自	2019年12月11日
	至	2019年12月10日	至	2020年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		147,082,824		209,964,796
<b>営業収益合計</b>		<b>147,082,824</b>		<b>209,964,796</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		6,257		6,778
受託者報酬		634,532		761,879
委託者報酬		12,056,151		14,475,479
その他費用		211,591		217,039
<b>営業費用合計</b>		<b>12,908,531</b>		<b>15,461,175</b>
営業利益又は営業損失( )		134,174,293		194,503,621
経常利益又は経常損失( )		134,174,293		194,503,621
当期純利益又は当期純損失( )		134,174,293		194,503,621
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( )		2,324,553		215,677,290
期首剰余金又は期首欠損金( )		179,433,745		370,778,860
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>122,489,569</b>		<b>176,269,481</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		122,489,569		176,269,481
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>67,643,300</b>		<b>208,694,034</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		67,643,300		208,694,034
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )		370,778,860		748,535,218

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 1,820,179,340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 1,443,169,223円
期中一部解約元本額 687,984,458円	期中一部解約元本額 1,563,370,580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. 計算期間の末日における受益権の総数 2,319,474,416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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.3227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) (13,227円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 37,495,160円	A 費用控除後の配当等収益額 35,483,306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 356,208,603円
C 収益調整金額 273,944,403円	C 収益調整金額 310,389,438円
D 分配準備積立金額 59,339,297円	D 分配準備積立金額 46,453,871円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 370,778,860円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 748,535,218円
F 当ファンドの期末残存口数 2,439,675,773口	F 当ファンドの期末残存口数 2,319,474,416口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 1,519円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 3,227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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	158,295,423	424,661,167
合計	158,295,423	424,661,167

## 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	2,046,579,733	3,066,595,071	
合計		2,046,579,733	3,066,595,071	

(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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,091,877	7,176,660
親投資信託受益証券	3,358,381,719	1,674,252,142
流動資産合計	3,367,473,596	1,681,428,802
資産合計	3,367,473,596	1,681,428,802
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,909,773	2,435,934
未払受託者報酬	439,866	379,915
未払委託者報酬	3,958,746	3,419,169
未払利息	24	19
その他未払費用	146,561	107,549
流動負債合計	7,454,970	6,342,586
負債合計	7,454,970	6,342,586
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,592,201,841	1,600,744,853
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	767,816,785	74,341,363
（分配準備積立金）	548,420,068	265,241,220
元本等合計	3,360,018,626	1,675,086,216
純資産合計	3,360,018,626	1,675,086,216
負債純資産合計	3,367,473,596	1,681,428,802

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		483,726,971		858,329,577
<b>営業収益合計</b>		<b>483,726,971</b>		<b>858,329,577</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		6,159		5,878
受託者報酬		783,840		874,076
委託者報酬		7,054,482		7,866,545
その他費用		261,352		248,835
<b>営業費用合計</b>		<b>8,105,833</b>		<b>8,995,334</b>
営業利益又は営業損失( )		475,621,138		867,324,911
経常利益又は経常損失( )		475,621,138		867,324,911
当期純利益又は当期純損失( )		475,621,138		867,324,911
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( )		24,214,110		608,365,343
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		271,648,139		135,645,159
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		135,645,159
剰余金減少額又は欠損金増加額		41,480,362		570,161,013
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		570,161,013
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		767,816,785		74,341,363

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 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 1,323,744,119円
期中一部解約元本額 1,041,002,462円	期中一部解約元本額 2,315,201,107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. 計算期間の末日における受益権の総数 1,600,744,853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. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0464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) (10,464円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 86,810,891円	A 費用控除後の配当等収益額 67,090,645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	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 219,396,717円	C 収益調整金額 204,303,890円
D 分配準備積立金額 97,013,040円	D 分配準備積立金額 198,150,575円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 767,816,785円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 469,545,110円
F 当ファンドの期末残存口数 2,592,201,841口	F 当ファンドの期末残存口数 1,600,744,853口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,962円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 2,933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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	486,536,250	281,117,477
合計	486,536,250	281,117,477

## 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	1,410,609,270	1,674,252,142	
合計		1,410,609,270	1,674,252,142	

(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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	10,135,788	15,407,973
親投資信託受益証券	4,087,941,200	4,073,969,983
<b>流動資産合計</b>	<b>4,098,076,988</b>	<b>4,089,377,956</b>
<b>資産合計</b>	<b>4,098,076,988</b>	<b>4,089,377,956</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	1,079,358	5,055,152
未払受託者報酬	529,047	616,322
未払委託者報酬	6,524,797	7,601,284
未払利息	27	41
その他未払費用	176,283	174,527
<b>流動負債合計</b>	<b>8,309,512</b>	<b>13,447,326</b>
<b>負債合計</b>	<b>8,309,512</b>	<b>13,447,326</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,620,576,548	4,211,588,450
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	469,190,928	135,657,820
( 分配準備積立金 )	388,395,947	313,799,014
<b>元本等合計</b>	<b>4,089,767,476</b>	<b>4,075,930,630</b>
<b>純資産合計</b>	<b>4,089,767,476</b>	<b>4,075,930,630</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>4,098,076,988</b>	<b>4,089,377,956</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月11日	自	2019年12月11日
	至	2019年12月10日	至	2020年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		358,234,123		783,071,217
営業収益合計		358,234,123		783,071,217
営業費用				
支払利息		6,722		7,783
受託者報酬		924,892		1,194,282
委託者報酬		11,406,800		14,729,334
その他費用		308,378		339,729
営業費用合計		12,646,792		16,271,128
営業利益又は営業損失( )		345,587,331		799,342,345
経常利益又は経常損失( )		345,587,331		799,342,345
当期純利益又は当期純損失( )		345,587,331		799,342,345
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( )		31,304,037		643,492,636
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		113,783,452		-
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		8,704,466		448,999,039
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		190,605,670
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		258,393,369
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		469,190,928		135,657,820

## (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3期 2019年12月10日現在	第4期 2020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 1,837,841,788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 3,083,593,311円
期中一部解約元本額 525,928,645円	期中一部解約元本額 2,492,581,409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. 計算期間の末日における受益権の総数 4,211,588,450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 1.1296円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,296円)	3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 135,657,820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 0.9678円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,678円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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 99,717,907円	A 費用控除後の配当等収益額 115,081,898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	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 241,111,476円	C 収益調整金額 538,871,491円
D 分配準備積立金額 81,015,849円	D 分配準備積立金額 198,717,116円
E 当ファンドの分配対象収益額 629,507,423円 (E=A+B+C+D)	E 当ファンドの分配対象収益額 852,670,505円 (E=A+B+C+D)
F 当ファンドの期末残存口数 3,620,576,548口	F 当ファンドの期末残存口数 4,211,588,450口
G 10,000口当たり収益分配対象額 1,738円 (G=E/F×10,000)	G 10,000口当たり収益分配対象額 2,024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

<p style="text-align: center;">第3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日</p>	<p style="text-align: center;">第4期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日</p>
<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>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、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第3期 2019年12月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第4期 2020年12月10日現在</p>
<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>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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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3期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第4期 自 2019年12月11日 至 2020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	345,961,903	184,400,237
合計	345,961,903	184,400,237

## 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	3,993,305,218	4,073,969,983	
合計		3,993,305,218	4,073,969,983	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

当ファンドは「RAM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

### R A M国内債券マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

2020年12月10日現在

資産の部  
流動資産

2020年12月10日現在

金銭信託	947,931
コール・ローン	4,497,787,236
国債証券	66,848,527,400
地方債証券	4,462,718,600
特殊債券	5,642,512,929
社債券	3,515,362,000
未収入金	2,733,000
未収利息	189,454,198
前払費用	9,063,280
流動資産合計	85,169,106,574
資産合計	85,169,106,574
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,960,743,000
未払利息	12,199
流動負債合計	3,960,755,199
負債合計	3,960,755,199
純資産の部	
元本等	
元本	77,035,480,535
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,172,870,840
元本等合計	81,208,351,375
純資産合計	81,208,351,375
負債純資産合計	85,169,106,574

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

2020年12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	68,233,740,681円
期中一部解約元本額	60,435,681,253円
期末元本額	77,035,480,535円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,377,141,746円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,943,357,492円
りそなラップ型ファンド(成長型)	132,927,225円
DCりそな グローバルバランス	452,029,586円
つみたてバランスファンド	1,967,723,726円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,447,027,114円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	302,735,696円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	70,364,163円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	23,466,390円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,575,045円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	852,889円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	378,030円
リスクコントロール・オープン	51,444,088円
FWりそな円建債券アクティブファンド	330,867,430円
FWりそな国内債券インデックスファンド	44,079,754,751円
Smart-i 国内債券インデックス	933,227,299円
Smart-i 8資産バランス 安定型	546,824,506円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	313,146,432円
Smart-i 8資産バランス 成長型	110,057,017円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,868,413,178円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,534,026,050円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,475,877,995円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	967,778,332円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,489,984,932円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	410,862,642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)	11,036,543円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,067,368,018円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	119,232,220円
2. 計算日における受益権の総数	77,035,480,535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	1.0542円
(10,000口当たり純資産額)	(10,542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

2020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、運用評価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

2020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	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	836,958,940	
地方債証券	25,306,400	
特殊債券	37,387,108	
社債券	19,507,000	
合計	919,159,448	

(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408回利付国債(2年)	120,000,000	120,304,800	
	第409回利付国債(2年)	30,000,000	30,082,200	
	第410回利付国債(2年)	410,000,000	411,225,900	
	第412回利付国債(2年)	330,000,000	331,145,100	
	第413回利付国債(2年)	550,000,000	552,024,000	
	第414回利付国債(2年)	430,000,000	431,707,100	
	第415回利付国債(2年)	240,000,000	241,024,800	
	第416回利付国債(2年)	120,000,000	120,538,800	
	第417回利付国債(2年)	350,000,000	351,613,500	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	361,051,200	
	第132回利付国債(5年)	40,000,000	40,146,400	
	第133回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,285,798,400	
	第134回利付国債(5年)	830,000,000	834,291,100	
	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,005,690,000	
	第136回利付国債(5年)	910,000,000	915,642,000	
	第137回利付国債(5年)	750,000,000	755,220,000	
	第138回利付国債(5年)	800,000,000	806,072,000	
	第139回利付国債(5年)	920,000,000	927,553,200	

第140回利付国債(5年)	530,000,000	534,690,500	
第141回利付国債(5年)	450,000,000	454,270,500	
第142回利付国債(5年)	480,000,000	484,756,800	
第143回利付国債(5年)	630,000,000	636,495,300	
第144回利付国債(5年)	580,000,000	586,200,200	
第145回利付国債(5年)	50,000,000	50,528,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	58,732,400	
第2回利付国債(40年)	100,000,000	142,461,000	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	157,346,200	
第4回利付国債(40年)	150,000,000	215,626,500	
第5回利付国債(40年)	170,000,000	236,718,200	
第6回利付国債(40年)	170,000,000	233,537,500	
第7回利付国債(40年)	180,000,000	238,217,400	
第8回利付国債(40年)	190,000,000	235,212,400	
第9回利付国債(40年)	300,000,000	278,079,000	
第10回利付国債(40年)	290,000,000	314,974,800	
第11回利付国債(40年)	240,000,000	253,077,600	
第12回利付国債(40年)	250,000,000	238,505,000	
第13回利付国債(40年)	50,000,000	47,653,500	
第321回利付国債(10年)	241,000,000	244,465,580	
第322回利付国債(10年)	220,000,000	222,884,200	
第323回利付国債(10年)	340,000,000	345,395,800	
第324回利付国債(10年)	183,000,000	185,624,220	
第325回利付国債(10年)	330,000,000	335,550,600	
第326回利付国債(10年)	280,000,000	284,774,000	
第327回利付国債(10年)	387,000,000	394,383,960	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	417,929,460	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	304,068,600	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	263,728,260	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,854,900	
第332回利付国債(10年)	532,000,000	543,954,040	
第333回利付国債(10年)	225,000,000	230,433,750	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	267,788,610	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	353,311,050	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	215,394,900	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,992,000	

第338回利付国債(10年)	631,000,000	645,500,380	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	394,370,900	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	957,555,480	
第341回利付国債(10年)	520,000,000	531,039,600	
第342回利付国債(10年)	210,000,000	212,394,000	
第343回利付国債(10年)	490,000,000	495,855,500	
第344回利付国債(10年)	690,000,000	698,625,000	
第345回利付国債(10年)	460,000,000	465,855,800	
第346回利付国債(10年)	820,000,000	830,873,200	
第347回利付国債(10年)	230,000,000	233,095,800	
第348回利付国債(10年)	340,000,000	344,753,200	
第349回利付国債(10年)	480,000,000	486,960,000	
第350回利付国債(10年)	580,000,000	588,491,200	
第351回利付国債(10年)	150,000,000	152,158,500	
第352回利付国債(10年)	530,000,000	537,462,400	
第353回利付国債(10年)	570,000,000	577,814,700	
第354回利付国債(10年)	570,000,000	577,575,300	
第355回利付国債(10年)	510,000,000	516,543,300	
第356回利付国債(10年)	730,000,000	738,993,600	
第357回利付国債(10年)	630,000,000	637,119,000	
第358回利付国債(10年)	720,000,000	727,682,400	
第359回利付国債(10年)	720,000,000	726,854,400	
第360回利付国債(10年)	260,000,000	262,282,800	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	74,939,400	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,121,600	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,783,500	
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,965,200	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	111,555,000	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,718,000	
第15回利付国債(30年)	160,000,000	210,113,600	
第16回利付国債(30年)	100,000,000	131,716,000	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,362,500	
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,806,200	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	130,097,000	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	133,390,000	
第21回利付国債(30年)	90,000,000	117,739,800	

第22回利付国債(30年)	50,000,000	67,091,000	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	215,404,800	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	134,967,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	132,196,000	
第26回利付国債(30年)	145,000,000	194,349,300	
第27回利付国債(30年)	215,000,000	293,120,250	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	150,726,400	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	95,208,400	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	256,266,300	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	173,747,600	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	292,537,600	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	379,552,000	
第34回利付国債(30年)	255,000,000	344,946,150	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	416,576,480	
第36回利付国債(30年)	295,000,000	390,202,400	
第37回利付国債(30年)	320,000,000	418,240,000	
第38回利付国債(30年)	110,000,000	141,927,500	
第39回利付国債(30年)	190,000,000	249,399,700	
第40回利付国債(30年)	175,000,000	226,376,500	
第41回利付国債(30年)	155,000,000	197,480,850	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	242,326,000	
第43回利付国債(30年)	80,000,000	102,140,000	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	230,052,600	
第45回利付国債(30年)	190,000,000	234,522,700	
第46回利付国債(30年)	240,000,000	296,436,000	
第47回利付国債(30年)	230,000,000	289,374,500	
第48回利付国債(30年)	233,000,000	282,652,300	
第49回利付国債(30年)	230,000,000	279,144,100	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	267,727,500	
第51回利付国債(30年)	210,000,000	199,588,200	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	229,213,400	
第53回利付国債(30年)	220,000,000	224,290,000	
第54回利付国債(30年)	230,000,000	245,451,400	
第55回利付国債(30年)	120,000,000	127,980,000	
第56回利付国債(30年)	220,000,000	234,476,000	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	244,968,400	

第58回利付国債(30年)	350,000,000	372,071,000	
第59回利付国債(30年)	220,000,000	228,159,800	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	206,518,600	
第61回利付国債(30年)	180,000,000	186,103,800	
第62回利付国債(30年)	210,000,000	205,917,600	
第63回利付国債(30年)	210,000,000	200,012,400	
第64回利付国債(30年)	180,000,000	171,165,600	
第65回利付国債(30年)	190,000,000	180,382,200	
第66回利付国債(30年)	200,000,000	189,568,000	
第67回利付国債(30年)	200,000,000	199,748,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	102,718,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,326,600	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	113,425,400	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	103,639,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,494,000	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,937,800	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,298,500	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,904,000	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,947,200	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	126,819,600	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	403,544,800	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,340,800	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	96,920,100	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,416,600	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	119,892,300	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	108,285,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	227,810,100	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	195,550,200	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	109,601,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	108,742,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,834,200	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,618,000	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,938,200	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	99,131,400	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,054,600	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	188,125,400	

第 8 3 回利付国債(20年)	10,000,000	11,119,400	
第 8 4 回利付国債(20年)	120,000,000	132,825,600	
第 8 5 回利付国債(20年)	150,000,000	167,619,000	
第 8 6 回利付国債(20年)	100,000,000	112,807,000	
第 8 7 回利付国債(20年)	90,000,000	101,049,300	
第 8 8 回利付国債(20年)	185,000,000	209,834,400	
第 8 9 回利付国債(20年)	120,000,000	135,441,600	
第 9 0 回利付国債(20年)	170,000,000	192,880,300	
第 9 1 回利付国債(20年)	80,000,000	91,232,000	
第 9 2 回利付国債(20年)	255,000,000	289,177,650	
第 9 3 回利付国債(20年)	80,000,000	90,659,200	
第 9 4 回利付国債(20年)	140,000,000	159,537,000	
第 9 5 回利付国債(20年)	185,000,000	214,152,300	
第 9 6 回利付国債(20年)	70,000,000	80,111,500	
第 9 7 回利付国債(20年)	130,000,000	150,395,700	
第 9 8 回利付国債(20年)	70,000,000	80,504,900	
第 9 9 回利付国債(20年)	85,000,000	98,228,550	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	151,000,000	176,372,530	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	20,000,000	23,653,400	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	145,000,000	172,281,750	
第 1 0 3 回利付国債(20年)	100,000,000	118,058,000	
第 1 0 4 回利付国債(20年)	10,000,000	11,654,400	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	12,000,000	14,041,200	
第 1 0 6 回利付国債(20年)	40,000,000	47,116,800	
第 1 0 7 回利付国債(20年)	80,000,000	93,971,200	
第 1 0 8 回利付国債(20年)	220,000,000	254,872,200	
第 1 0 9 回利付国債(20年)	80,000,000	93,033,600	
第 1 1 0 回利付国債(20年)	195,000,000	230,010,300	
第 1 1 1 回利付国債(20年)	50,000,000	59,629,500	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	205,000,000	242,726,150	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	85,000,000	101,018,250	
第 1 1 4 回利付国債(20年)	160,000,000	190,752,000	
第 1 1 5 回利付国債(20年)	100,000,000	120,125,000	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	140,000,000	168,789,600	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	225,000,000	269,178,750	
第 1 1 8 回利付国債(20年)	131,000,000	155,950,260	

第119回利付国債(20年)	150,000,000	175,711,500	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	230,474,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	242,836,850	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	223,212,000	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	320,143,850	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	239,618,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	146,664,000	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	120,172,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	154,892,400	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	268,854,750	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	213,197,400	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	213,759,000	
第131回利付国債(20年)	70,000,000	82,378,800	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	200,644,200	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	291,848,900	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,735,850	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,317,600	
第136回利付国債(20年)	170,000,000	199,197,500	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,558,800	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,651,100	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	211,359,600	
第140回利付国債(20年)	380,000,000	451,546,400	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	220,299,850	
第142回利付国債(20年)	210,000,000	252,567,000	
第143回利付国債(20年)	245,000,000	289,374,400	
第144回利付国債(20年)	190,000,000	222,110,000	
第145回利付国債(20年)	275,000,000	328,809,250	
第146回利付国債(20年)	370,000,000	443,556,000	
第147回利付国債(20年)	395,000,000	469,366,650	
第148回利付国債(20年)	225,000,000	264,867,750	
第149回利付国債(20年)	380,000,000	447,993,400	
第150回利付国債(20年)	340,000,000	396,824,200	
第151回利付国債(20年)	445,000,000	507,785,050	
第152回利付国債(20年)	450,000,000	513,864,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	312,576,300	
第154回利付国債(20年)	128,000,000	146,474,240	

	第155回利付国債(20年)	380,000,000	424,030,600	
	第156回利付国債(20年)	280,000,000	287,445,200	
	第157回利付国債(20年)	280,000,000	278,740,000	
	第158回利付国債(20年)	160,000,000	166,449,600	
	第159回利付国債(20年)	330,000,000	348,060,900	
	第160回利付国債(20年)	320,000,000	342,246,400	
	第161回利付国債(20年)	330,000,000	347,499,900	
	第162回利付国債(20年)	220,000,000	231,464,200	
	第163回利付国債(20年)	330,000,000	346,876,200	
	第164回利付国債(20年)	370,000,000	382,461,600	
	第165回利付国債(20年)	330,000,000	340,701,900	
	第166回利付国債(20年)	440,000,000	469,304,000	
	第167回利付国債(20年)	320,000,000	329,814,400	
	第168回利付国債(20年)	210,000,000	212,532,600	
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	278,045,600	
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	366,740,300	
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	267,351,300	
	第172回利付国債(20年)	280,000,000	282,016,000	
	第173回利付国債(20年)	320,000,000	321,747,200	
	第174回利付国債(20年)	90,000,000	90,414,000	
	国債証券合計	61,715,000,000	66,848,527,400	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	116,190,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,332,000	
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,083,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,235,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,200,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,987,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,967,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,723,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,183,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,912,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,444,200	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,448,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,341,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,845,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,750,000	

	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,061,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,518,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,355,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,134,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,164,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,643,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,964,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	118,289,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	113,032,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,063,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,602,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	112,391,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,240,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,443,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,182,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,289,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,290,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,919,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,316,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,743,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,811,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,052,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	100,000,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,287,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,220,400	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,018,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,880,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,172,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,462,718,600	
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	101,893,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,506,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,499,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,233,000	
	第27回道路債券	100,000,000	107,817,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	175,858,500	

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	116,584,380	
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	129,603,500	
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	101,865,000	
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	102,203,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,660,490	
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	135,117,360	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,644,000	
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	101,080,000	
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	101,297,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,774,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,409,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	109,651,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,520,950	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,866,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,365,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,131,000	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,436,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,680,310	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,930,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,097,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	116,055,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,024,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	113,558,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	86,912,000	86,636,488	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	92,628,000	92,631,705	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,914,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,805,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,031,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,681,000	86,885,674	

	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,756,000	86,725,042	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,034,000	87,884,322	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,458,000	87,426,329	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,693,000	90,484,092	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,618,000	91,993,581	
	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	94,808,627	
	第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,259,000	97,442,819	
	第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,527,000	100,045,535	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	60,715,000	60,677,356	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	62,862,000	62,865,771	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	67,258,000	67,307,098	
	第327回信金中金債	100,000,000	100,054,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	100,171,000	
	第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,867,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,359,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,185,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,055,000	
	特殊債券合計	5,399,733,000	5,642,512,929	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,137,000	
	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	100,231,000	
	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	98,721,000	
	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	99,722,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,877,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,538,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,976,000	
	第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,846,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,378,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,337,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,285,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,567,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,887,000	
	第17回J A 三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	

第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	99,122,000	
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	98,837,000	
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,958,000	
第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,828,000	
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	100,358,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,249,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,248,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,609,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,867,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,040,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,045,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,205,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,891,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,539,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,207,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,706,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,191,000	
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	100,851,000	
社債券合計	3,500,000,000	3,515,362,000	
合計		80,469,120,929	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## RAM国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2020年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	839,384,217
株式	43,127,506,790
未収入金	2,290,050,000
未収配当金	23,954,856
差入委託証拠金	35,910,000
流動資産合計	46,316,805,863
資産合計	46,316,805,863
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,885,300
前受金	3,150,000
未払金	2,374,418,383
未払解約金	21,275,000
未払利息	2,276
流動負債合計	2,400,730,959
負債合計	2,400,730,959
純資産の部	
元本等	
元本	34,557,691,090
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,358,383,814
元本等合計	43,916,074,904
純資産合計	43,916,074,904
負債純資産合計	46,316,805,863

## 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)

2020年12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	33,387,304,930円
期中一部解約元本額	33,689,998,309円
期末元本額	34,557,691,090円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,874,816,733円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,891,094,747円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,555,760,719円
DCりそな グローバルバランス	50,509,952円
つみたてバランスファンド	2,458,352,139円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	822,538,649円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	424,384,626円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	251,515,650円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	21,420,796円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	16,360,024円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,295,035円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,753,234円
リスクコントロール・オープン	7,325,149円
FWりそな国内株式アクティブファンド	503,327,054円
FWりそな国内株式インデックスファンド	16,943,557,519円
Smart-i TOPIXインデックス	1,096,661,135円
Smart-i 8資産バランス 安定型	131,470,496円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	321,351,372円
Smart-i 8資産バランス 成長型	344,362,430円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	406,593,244円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	357,380,269円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	206,909,815円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	136,492,998円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	351,379,467円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	58,169,635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)	3,024,385円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	531,427,671円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	840,641,669円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,871,482,540円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	58,331,938円
2. 計算日における受益権の総数	34,557,691,090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	1.2708円

(10,000口当たり純資産額)

(12,708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

2020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、運用評価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

2020年12月10日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		3,531,017,422
合計		3,531,017,422

（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）

（2020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	815,625,300	-	813,740,000	1,885,300
合計		815,625,300	-	813,740,000	1,885,300

（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。

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	2,815.00	2,252,000	
日本水産	23,800	423.00	10,067,400	
マルハニチロ	3,400	2,183.00	7,422,200	
雪国まいたけ	1,500	1,710.00	2,565,000	
カネコ種苗	700	1,545.00	1,081,500	
サカタのタネ	2,800	3,470.00	9,716,000	
ホクト	1,800	2,101.00	3,781,800	
ホクリヨウ	400	710.00	284,000	
住石ホールディングス	4,800	116.00	556,800	
日鉄鉱業	500	5,660.00	2,830,000	
三井松島ホールディングス	900	699.00	629,100	
国際石油開発帝石	87,600	574.00	50,282,400	
石油資源開発	3,100	1,775.00	5,502,500	
K & O エナジーグループ	1,200	1,504.00	1,804,800	
ヒノキヤグループ	600	2,121.00	1,272,600	
ショーボンドホールディングス	3,700	5,090.00	18,833,000	
ミライト・ホールディングス	7,100	1,665.00	11,821,500	
タマホーム	1,300	1,413.00	1,836,900	
サンヨーホームズ	200	714.00	142,800	
日本アクア	900	622.00	559,800	
ファーストコーポレーション	700	719.00	503,300	
ベステラ	400	1,520.00	608,000	
T A T E R U	4,500	176.00	792,000	
キャンディル	400	501.00	200,400	
スペースバリューホールディングス	2,900	607.00	1,760,300	
ダイセキ環境ソリューション	500	705.00	352,500	
第一カッター興業	300	2,580.00	774,000	
安藤・間	14,200	718.00	10,195,600	
東急建設	7,000	504.00	3,528,000	
コムシスホールディングス	8,400	3,130.00	26,292,000	
ピーアールホールディングス	2,600	678.00	1,762,800	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,024.00	3,036,000	
東建コーポレーション	700	7,750.00	5,425,000	
ソネック	200	877.00	175,400	
ヤマウラ	1,000	925.00	925,000	
大成建設	18,300	3,815.00	69,814,500	
大林組	55,000	939.00	51,645,000	
清水建設	55,800	832.00	46,425,600	

飛島建設	1,600	1,101.00	1,761,600
長谷工コーポレーション	21,300	1,184.00	25,219,200
松井建設	2,200	779.00	1,713,800
銭高組	200	4,485.00	897,000
鹿島建設	43,200	1,378.00	59,529,600
不動テトラ	1,400	1,700.00	2,380,000
大末建設	600	844.00	506,400
鉄建建設	1,200	1,823.00	2,187,600
西松建設	4,200	2,077.00	8,723,400
三井住友建設	13,300	431.00	5,732,300
大豊建設	1,300	3,580.00	4,654,000
前田建設工業	13,800	919.00	12,682,200
佐田建設	1,200	447.00	536,400
ナカノフドー建設	1,500	394.00	591,000
奥村組	2,600	2,445.00	6,357,000
東鉄工業	2,400	2,804.00	6,729,600
イチケン	400	1,776.00	710,400
富士ピー・エス	800	598.00	478,400
浅沼組	600	3,960.00	2,376,000
戸田建設	22,800	643.00	14,660,400
熊谷組	2,500	2,604.00	6,510,000
北野建設	300	2,573.00	771,900
植木組	200	2,785.00	557,000
矢作建設工業	2,400	858.00	2,059,200
ピーエス三菱	1,800	588.00	1,058,400
日本ハウスホールディングス	3,800	237.00	900,600
大東建託	6,000	9,700.00	58,200,000
新日本建設	2,300	855.00	1,966,500
N I P P O	4,500	2,750.00	12,375,000
東亜道路工業	300	3,775.00	1,132,500
前田道路	4,900	1,720.00	8,428,000
日本道路	500	7,580.00	3,790,000
東亜建設工業	1,700	2,020.00	3,434,000
日本国土開発	5,300	578.00	3,063,400
若築建設	1,000	1,170.00	1,170,000
東洋建設	6,200	430.00	2,666,000
五洋建設	21,800	897.00	19,554,600
世紀東急工業	2,600	812.00	2,111,200
福田組	600	5,480.00	3,288,000
住友林業	13,900	1,899.00	26,396,100
日本基礎技術	1,800	499.00	898,200
巴コーポレーション	2,400	416.00	998,400

大和ハウス工業	54,400	3,186.00	173,318,400
ライト工業	3,100	1,785.00	5,533,500
積水ハウス	59,600	2,015.00	120,094,000
日特建設	1,400	809.00	1,132,600
北陸電気工事	1,000	1,295.00	1,295,000
ユアテック	3,100	756.00	2,343,600
日本リーテック	1,200	2,362.00	2,834,400
四電工	300	2,778.00	833,400
中電工	2,200	2,169.00	4,771,800
関電工	7,800	817.00	6,372,600
きんでん	13,100	1,640.00	21,484,000
東京エネシス	1,800	858.00	1,544,400
トーエネック	600	3,880.00	2,328,000
住友電設	1,600	2,607.00	4,171,200
日本電設工業	3,000	2,102.00	6,306,000
協和エクシオ	8,300	2,809.00	23,314,700
新日本空調	1,500	2,165.00	3,247,500
九電工	3,900	3,125.00	12,187,500
三機工業	3,900	1,186.00	4,625,400
日揮ホールディングス	16,900	924.00	15,615,600
中外炉工業	600	1,850.00	1,110,000
ヤマト	1,800	771.00	1,387,800
太平電業	1,300	2,541.00	3,303,300
高砂熱学工業	4,200	1,482.00	6,224,400
三晃金属工業	200	2,651.00	530,200
朝日工業社	400	3,120.00	1,248,000
明星工業	3,600	782.00	2,815,200
大気社	2,700	2,751.00	7,427,700
ダイダン	1,300	2,923.00	3,799,900
日比谷総合設備	1,800	1,897.00	3,414,600
フィル・カンパニー	300	1,953.00	585,900
OSJBホールディングス	8,700	264.00	2,296,800
東洋エンジニアリング	2,300	427.00	982,100
レイズネクスト	2,900	1,167.00	3,384,300
日本製粉	5,100	1,647.00	8,399,700
日清製粉グループ本社	19,900	1,692.00	33,670,800
日東富士製粉	100	6,550.00	655,000
昭和産業	1,600	3,075.00	4,920,000
鳥越製粉	1,600	1,005.00	1,608,000
中部飼料	2,100	1,427.00	2,996,700
フィード・ワン	2,400	891.00	2,138,400
東洋精糖	300	1,220.00	366,000

日本甜菜製糖	900	1,615.00	1,453,500
三井製糖	1,500	1,789.00	2,683,500
塩水港精糖	1,900	222.00	421,800
日新製糖	800	1,844.00	1,475,200
森永製菓	4,100	3,905.00	16,010,500
中村屋	500	3,985.00	1,992,500
江崎グリコ	4,800	4,535.00	21,768,000
名糖産業	800	1,432.00	1,145,600
井村屋グループ	1,000	2,629.00	2,629,000
不二家	1,100	2,472.00	2,719,200
山崎製パン	13,200	1,742.00	22,994,400
第一屋製パン	300	1,005.00	301,500
モロゾフ	300	5,860.00	1,758,000
亀田製菓	1,000	4,960.00	4,960,000
寿スピリッツ	1,700	5,360.00	9,112,000
カルビー	8,000	3,095.00	24,760,000
森永乳業	3,300	5,060.00	16,698,000
六甲バター	1,200	1,938.00	2,325,600
ヤクルト本社	12,100	5,370.00	64,977,000
明治ホールディングス	11,600	7,470.00	86,652,000
雪印メグミルク	4,200	2,256.00	9,475,200
プリマハム	2,800	3,115.00	8,722,000
日本ハム	6,700	4,735.00	31,724,500
林兼産業	600	582.00	349,200
丸大食品	1,900	1,698.00	3,226,200
S Foods	1,400	3,360.00	4,704,000
柿安本店	600	2,539.00	1,523,400
伊藤ハム米久ホールディングス	11,300	682.00	7,706,600
サッポロホールディングス	6,000	2,064.00	12,384,000
アサヒグループホールディングス	38,400	4,564.00	175,257,600
キリンホールディングス	74,600	2,414.00	180,084,400
宝ホールディングス	13,000	1,272.00	16,536,000
オエノンホールディングス	5,000	413.00	2,065,000
養命酒製造	500	1,899.00	949,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	13,500	1,640.00	22,140,000
サントリー食品インターナショナル	11,800	3,880.00	45,784,000
ダイドーグループホールディングス	900	5,670.00	5,103,000
伊藤園	5,300	7,100.00	37,630,000
キーコーヒー	1,700	2,156.00	3,665,200
ユニカフェ	500	1,200.00	600,000
ジャパンフーズ	200	1,208.00	241,600
日清オイリオグループ	2,300	3,030.00	6,969,000

不二製油グループ本社	4,300	2,824.00	12,143,200
かどや製油	200	3,910.00	782,000
J・オイルミルズ	900	3,535.00	3,181,500
キッコーマン	12,700	6,550.00	83,185,000
味の素	38,900	2,257.00	87,797,300
キューピー	9,800	2,162.00	21,187,600
ハウス食品グループ本社	6,600	3,825.00	25,245,000
カゴメ	7,200	3,725.00	26,820,000
焼津水産化学工業	900	993.00	893,700
アリアケジャパン	1,600	7,200.00	11,520,000
ピエトロ	200	1,698.00	339,600
エバラ食品工業	400	2,410.00	964,000
やまみ	200	2,034.00	406,800
ニチレイ	8,400	2,782.00	23,368,800
東洋水産	9,100	5,180.00	47,138,000
イトアンドホールディングス	600	1,853.00	1,111,800
大冷	200	1,969.00	393,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	819.00	819,000
日清食品ホールディングス	7,500	8,710.00	65,325,000
永谷園ホールディングス	900	2,234.00	2,010,600
一正蒲鉾	700	1,166.00	816,200
フジッコ	1,900	1,995.00	3,790,500
ロック・フィールド	1,900	1,614.00	3,066,600
日本たばこ産業	94,300	2,165.00	204,159,500
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,918.00	1,918,000
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,417.00	1,700,400
なとり	1,000	1,924.00	1,924,000
イフジ産業	300	817.00	245,100
ピクルスコーポレーション	400	3,165.00	1,266,000
北の達人コーポレーション	6,100	478.00	2,915,800
ユーグレナ	7,600	786.00	5,973,600
ミヨシ油脂	600	1,289.00	773,400
理研ビタミン	1,700	1,376.00	2,339,200
片倉工業	2,300	1,396.00	3,210,800
ゲンゼ	1,300	3,520.00	4,576,000
東洋紡	6,800	1,340.00	9,112,000
ユニチカ	5,000	393.00	1,965,000
富士紡ホールディングス	800	3,800.00	3,040,000
倉敷紡績	1,700	1,878.00	3,192,600
シキボウ	900	1,027.00	924,300
日本毛織	5,600	1,019.00	5,706,400
ダイトウボウ	2,800	105.00	294,000

トーア紡コーポレーション	700	474.00	331,800
ダイドーリミテッド	2,300	194.00	446,200
帝国繊維	1,900	2,530.00	4,807,000
帝人	14,000	1,947.00	27,258,000
東レ	124,300	625.70	77,774,510
サカイオーベックス	500	2,113.00	1,056,500
住江織物	400	2,239.00	895,600
日本フェルト	1,000	448.00	448,000
イチカワ	200	1,288.00	257,600
日東製網	200	1,554.00	310,800
アツギ	1,400	512.00	716,800
ダイニック	600	825.00	495,000
セーレン	4,200	1,587.00	6,665,400
ソトー	700	901.00	630,700
東海染工	200	1,129.00	225,800
小松マテーレ	2,800	984.00	2,755,200
ワコールホールディングス	4,300	2,049.00	8,810,700
ホギメディカル	2,000	3,350.00	6,700,000
クラウディアホールディングス	400	288.00	115,200
T S Iホールディングス	5,200	216.00	1,123,200
マツオカコーポレーション	500	2,295.00	1,147,500
ワールド	2,400	1,301.00	3,122,400
三陽商会	900	575.00	517,500
ナイガイ	600	347.00	208,200
オンワードホールディングス	10,300	205.00	2,111,500
ルックホールディングス	600	1,010.00	606,000
キムラタン	10,100	24.00	242,400
ゴールドウイン	3,100	7,080.00	21,948,000
デサント	3,300	1,749.00	5,771,700
キング	800	522.00	417,600
ヤマトインターナショナル	1,500	337.00	505,500
特種東海製紙	1,100	5,200.00	5,720,000
王子ホールディングス	71,800	550.00	39,490,000
日本製紙	7,600	1,217.00	9,249,200
三菱製紙	1,900	326.00	619,400
北越コーポレーション	10,200	374.00	3,814,800
中越パルプ工業	700	1,281.00	896,700
巴川製紙所	500	796.00	398,000
大王製紙	8,300	1,784.00	14,807,200
阿波製紙	400	474.00	189,600
レンゴー	16,200	824.00	13,348,800
トーモク	1,100	1,717.00	1,888,700

ザ・パックス	1,300	2,960.00	3,848,000
クラレ	27,000	1,129.00	30,483,000
旭化成	113,800	1,063.00	120,969,400
共和レザー	900	612.00	550,800
昭和電工	13,000	2,160.00	28,080,000
住友化学	126,100	412.00	51,953,200
住友精化	800	3,975.00	3,180,000
日産化学	9,500	6,290.00	59,755,000
ラサ工業	600	2,246.00	1,347,600
クレハ	1,500	6,450.00	9,675,000
多木化学	700	6,640.00	4,648,000
テイカ	1,300	1,559.00	2,026,700
石原産業	3,100	629.00	1,949,900
片倉コープアグリ	400	1,221.00	488,400
日本曹達	2,500	2,887.00	7,217,500
東ソー	26,500	1,765.00	46,772,500
トクヤマ	4,900	2,359.00	11,559,100
セントラル硝子	3,500	2,271.00	7,948,500
東亜合成	10,800	1,273.00	13,748,400
大阪ソーダ	1,700	2,701.00	4,591,700
関東電化工業	4,100	752.00	3,083,200
デンカ	6,300	3,850.00	24,255,000
信越化学工業	29,500	17,245.00	508,727,500
日本カーバイド工業	600	1,292.00	775,200
堺化学工業	1,100	2,064.00	2,270,400
第一稀元素化学工業	1,900	817.00	1,552,300
エア・ウォーター	16,000	1,778.00	28,448,000
日本酸素ホールディングス	16,500	1,786.00	29,469,000
日本化学工業	500	2,596.00	1,298,000
東邦アセチレン	300	1,248.00	374,400
日本パーカラライジング	8,700	1,094.00	9,517,800
高压ガス工業	2,700	835.00	2,254,500
チタン工業	200	2,325.00	465,000
四国化成工業	2,500	1,194.00	2,985,000
戸田工業	400	2,430.00	972,000
ステラ ケミファ	900	3,440.00	3,096,000
保土谷化学工業	600	4,595.00	2,757,000
日本触媒	2,700	5,420.00	14,634,000
大日精化工業	1,500	2,408.00	3,612,000
カネカ	4,400	3,450.00	15,180,000
三菱瓦斯化学	16,000	2,330.00	37,280,000
三井化学	15,900	2,894.00	46,014,600

J S R	16,000	2,786.00	44,576,000
東京応化工業	2,900	6,990.00	20,271,000
大阪有機化学工業	1,600	3,000.00	4,800,000
三菱ケミカルホールディングス	114,800	640.40	73,517,920
K Hネオケム	2,800	2,751.00	7,702,800
ダイセル	21,400	720.00	15,408,000
住友ベークライト	2,700	3,535.00	9,544,500
積水化学工業	36,300	1,929.00	70,022,700
日本ゼオン	15,500	1,386.00	21,483,000
アイカ工業	5,200	3,665.00	19,058,000
宇部興産	8,700	1,909.00	16,608,300
積水樹脂	3,100	2,192.00	6,795,200
タキロンシーアイ	3,700	701.00	2,593,700
旭有機材	1,000	1,547.00	1,547,000
ニチバン	900	1,646.00	1,481,400
リケンテクノス	4,200	453.00	1,902,600
大倉工業	800	1,833.00	1,466,400
積水化成成品工業	2,300	536.00	1,232,800
群栄化学工業	400	2,412.00	964,800
タイガースポリマー	900	425.00	382,500
ミライアル	600	1,160.00	696,000
ダイキアクシス	600	1,139.00	683,400
ダイキョーニシカワ	3,600	818.00	2,944,800
竹本容器	600	1,009.00	605,400
森六ホールディングス	900	2,149.00	1,934,100
日本化薬	10,600	957.00	10,144,200
カーリットホールディングス	1,800	698.00	1,256,400
日本精化	1,400	1,483.00	2,076,200
扶桑化学工業	1,700	3,785.00	6,434,500
トリケミカル研究所	400	14,020.00	5,608,000
A D E K A	7,900	1,783.00	14,085,700
日油	6,500	4,895.00	31,817,500
新日本理化	2,800	235.00	658,000
ハリマ化成グループ	1,400	1,077.00	1,507,800
花王	42,000	7,745.00	325,290,000
第一工業製薬	600	4,335.00	2,601,000
石原ケミカル	500	2,102.00	1,051,000
日華化学	600	938.00	562,800
ニイタカ	400	3,115.00	1,246,000
三洋化成工業	1,000	4,675.00	4,675,000
有機合成薬品工業	1,300	313.00	406,900
大日本塗料	1,900	993.00	1,886,700

日本ペイントホールディングス	14,200	10,680.00	151,656,000
関西ペイント	19,300	3,005.00	57,996,500
神東塗料	1,300	196.00	254,800
中国塗料	4,900	993.00	4,865,700
日本特殊塗料	1,300	1,246.00	1,619,800
藤倉化成	2,300	541.00	1,244,300
太陽ホールディングス	1,300	6,130.00	7,969,000
D I C	7,300	2,688.00	19,622,400
サカタインクス	3,700	1,202.00	4,447,400
東洋インキS Cホールディングス	3,600	2,007.00	7,225,200
T & K T O K A	1,300	821.00	1,067,300
富士フィルムホールディングス	33,600	5,611.00	188,529,600
資生堂	34,800	7,305.00	254,214,000
ライオン	22,800	2,490.00	56,772,000
高砂香料工業	1,100	2,506.00	2,756,600
マンダム	3,900	1,691.00	6,594,900
ミルボン	2,300	6,020.00	13,846,000
ファンケル	7,100	4,235.00	30,068,500
コーセー	3,300	16,580.00	54,714,000
コタ	1,000	1,387.00	1,387,000
シーボン	200	1,955.00	391,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,500	2,050.00	15,375,000
ノエビアホールディングス	1,500	4,365.00	6,547,500
アジュバンコスメジャパン	400	1,011.00	404,400
エステー	1,100	1,967.00	2,163,700
アグロ カネショウ	700	1,726.00	1,208,200
コニシ	2,900	1,608.00	4,663,200
長谷川香料	3,000	2,043.00	6,129,000
星光P M C	1,000	732.00	732,000
小林製薬	4,900	12,500.00	61,250,000
荒川化学工業	1,600	1,157.00	1,851,200
メック	1,200	2,214.00	2,656,800
日本高純度化学	500	2,775.00	1,387,500
タカラバイオ	4,600	2,917.00	13,418,200
J C U	2,100	3,740.00	7,854,000
新田ゼラチン	1,100	684.00	752,400
O A T アグリオ	300	1,459.00	437,700
デクセリアルズ	4,500	1,311.00	5,899,500
アース製薬	1,300	5,960.00	7,748,000
北興化学工業	1,600	1,114.00	1,782,400
大成ラミック	600	2,956.00	1,773,600
クミアイ化学工業	7,200	1,080.00	7,776,000

日本農薬	3,100	531.00	1,646,100
アキレス	1,200	1,444.00	1,732,800
有沢製作所	2,800	956.00	2,676,800
日東電工	12,100	8,610.00	104,181,000
レック	1,900	1,469.00	2,791,100
三光合成	2,000	406.00	812,000
きもと	3,000	202.00	606,000
藤森工業	1,600	4,795.00	7,672,000
前澤化成工業	1,100	989.00	1,087,900
未来工業	900	1,779.00	1,601,100
ウェーブロックホールディングス	600	794.00	476,400
J S P	1,000	1,575.00	1,575,000
エフピコ	3,700	4,110.00	15,207,000
天馬	1,200	1,998.00	2,397,600
信越ポリマー	3,100	981.00	3,041,100
東リ	4,400	255.00	1,122,000
ニフコ	6,400	3,845.00	24,608,000
バルカー	1,400	2,000.00	2,800,000
ユニ・チャーム	37,200	4,831.00	179,713,200
ショーエイコーポレーション	300	1,006.00	301,800
協和キリン	17,600	2,835.00	49,896,000
武田薬品工業	145,900	3,877.00	565,654,300
アステラス製薬	152,000	1,493.00	226,936,000
大日本住友製薬	13,000	1,326.00	17,238,000
塩野義製薬	22,000	5,620.00	123,640,000
わかもと製薬	2,100	257.00	539,700
あすか製薬	2,000	1,803.00	3,606,000
日本新薬	4,600	7,240.00	33,304,000
バイオフェルミン製薬	300	2,463.00	738,900
中外製薬	54,800	5,018.00	274,986,400
科研製薬	3,000	3,965.00	11,895,000
エーザイ	21,000	7,702.00	161,742,000
ロート製薬	9,000	3,125.00	28,125,000
小野薬品工業	40,300	3,213.00	129,483,900
久光製薬	4,600	6,170.00	28,382,000
持田製薬	2,400	3,920.00	9,408,000
参天製薬	32,700	1,708.00	55,851,600
扶桑薬品工業	600	2,931.00	1,758,600
日本ケミファ	200	2,330.00	466,000
ツムラ	5,400	3,270.00	17,658,000
日医工	5,000	1,012.00	5,060,000
キッセイ薬品工業	3,100	2,163.00	6,705,300

生化学工業	3,400	1,038.00	3,529,200
栄研化学	3,100	1,970.00	6,107,000
日水製薬	700	964.00	674,800
鳥居薬品	1,100	3,325.00	3,657,500
JCRファーマ	4,900	2,501.00	12,254,900
東和薬品	2,200	1,869.00	4,111,800
富士製薬工業	1,200	1,270.00	1,524,000
沢井製薬	3,600	4,860.00	17,496,000
ゼリア新薬工業	3,200	1,917.00	6,134,400
第一三共	150,500	3,395.00	510,947,500
キョーリン製薬ホールディングス	3,900	1,927.00	7,515,300
大幸薬品	2,200	1,620.00	3,564,000
ダイト	1,100	3,695.00	4,064,500
大塚ホールディングス	36,400	4,401.00	160,196,400
大正製薬ホールディングス	3,700	6,610.00	24,457,000
ペプチドリーム	8,900	5,430.00	48,327,000
日本コークス工業	14,800	70.00	1,036,000
ニチレキ	2,100	1,629.00	3,420,900
ユシロ化学工業	1,000	1,200.00	1,200,000
ピーピー・カストロール	600	1,287.00	772,200
富士石油	4,700	177.00	831,900
MORESCO	600	1,020.00	612,000
出光興産	19,500	2,238.00	43,641,000
ENEOSホールディングス	263,700	354.20	93,402,540
コスモエネルギーホールディングス	5,100	1,753.00	8,940,300
横浜ゴム	10,200	1,594.00	16,258,800
TOYO TIRE	9,200	1,709.00	15,722,800
ブリヂストン	46,600	3,682.00	171,581,200
住友ゴム工業	15,700	902.00	14,161,400
藤倉コンポジット	1,500	392.00	588,000
オカモト	1,100	4,055.00	4,460,500
フコク	800	695.00	556,000
ニッタ	2,000	2,343.00	4,686,000
住友理工	3,400	561.00	1,907,400
三ツ星ベルト	2,300	1,706.00	3,923,800
バンドー化学	3,100	594.00	1,841,400
日東紡績	2,600	4,215.00	10,959,000
AGC	16,100	3,430.00	55,223,000
日本板硝子	8,400	440.00	3,696,000
石塚硝子	300	1,887.00	566,100
日本山村硝子	700	916.00	641,200
日本電気硝子	6,500	2,382.00	15,483,000

オハラ	700	1,652.00	1,156,400
住友大阪セメント	3,300	3,180.00	10,494,000
太平洋セメント	11,100	2,773.00	30,780,300
日本ヒューム	1,800	798.00	1,436,400
日本コンクリート工業	3,800	322.00	1,223,600
三谷セキサン	800	3,990.00	3,192,000
アジアパイルホールディングス	2,500	471.00	1,177,500
東海カーボン	17,100	1,175.00	20,092,500
日本カーボン	1,000	3,925.00	3,925,000
東洋炭素	1,000	1,859.00	1,859,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	2,958.00	2,958,000
TOTO	12,500	5,800.00	72,500,000
日本碍子	21,000	1,686.00	35,406,000
日本特殊陶業	13,300	1,900.00	25,270,000
ダントーホールディングス	1,300	493.00	640,900
MARUWA	700	11,230.00	7,861,000
品川リフラクトリーズ	500	2,351.00	1,175,500
黒崎播磨	300	3,650.00	1,095,000
ヨータイ	1,400	830.00	1,162,000
イソライト工業	900	490.00	441,000
東京窯業	2,200	338.00	743,600
ニッカトー	800	805.00	644,000
フジインコーポレーテッド	1,600	3,840.00	6,144,000
クニミネ工業	700	1,046.00	732,200
エーアンドエーマテリアル	300	1,022.00	306,600
ニチアス	4,800	2,448.00	11,750,400
ニチハ	2,400	3,155.00	7,572,000
日本製鉄	77,600	1,335.00	103,596,000
神戸製鋼所	31,700	537.00	17,022,900
中山製鋼所	2,400	390.00	936,000
合同製鐵	900	1,950.00	1,755,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	46,800	1,071.00	50,122,800
東京製鐵	8,400	632.00	5,308,800
共英製鋼	2,000	1,463.00	2,926,000
大和工業	3,700	2,723.00	10,075,100
東京鐵鋼	700	2,137.00	1,495,900
大阪製鐵	900	1,242.00	1,117,800
淀川製鋼所	2,300	1,996.00	4,590,800
丸一鋼管	5,600	2,265.00	12,684,000
モリ工業	500	2,662.00	1,331,000
大同特殊鋼	2,800	4,480.00	12,544,000
日本高周波鋼業	600	341.00	204,600

日本冶金工業	1,400	1,795.00	2,513,000
山陽特殊製鋼	1,200	1,308.00	1,569,600
愛知製鋼	1,000	2,927.00	2,927,000
日立金属	18,700	1,545.00	28,891,500
日本金属	400	1,036.00	414,400
大太平洋金属	1,200	2,082.00	2,498,400
新日本電工	11,200	266.00	2,979,200
栗本鐵工所	900	1,710.00	1,539,000
虹技	300	1,207.00	362,100
日本鑄鉄管	200	1,280.00	256,000
三菱製鋼	1,300	585.00	760,500
日亜鋼業	2,500	290.00	725,000
日本精線	300	3,815.00	1,144,500
エンビプロ・ホールディングス	700	632.00	442,400
シンニッタン	2,700	188.00	507,600
新家工業	400	1,156.00	462,400
大紀アルミニウム工業所	2,800	739.00	2,069,200
日本軽金属ホールディングス	4,400	1,952.00	8,588,800
三井金属鉱業	4,700	3,535.00	16,614,500
東邦亜鉛	900	2,407.00	2,166,300
三菱マテリアル	11,500	2,069.00	23,793,500
住友金属鉱山	22,200	4,258.00	94,527,600
D O W Aホールディングス	4,400	3,665.00	16,126,000
古河機械金属	3,100	1,298.00	4,023,800
エス・サイエンス	7,700	43.00	331,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	963.00	1,733,400
東邦チタニウム	3,100	787.00	2,439,700
U A C J	2,600	1,899.00	4,937,400
C Kサンエツ	400	3,935.00	1,574,000
古河電気工業	5,400	2,895.00	15,633,000
住友電気工業	64,800	1,240.50	80,384,400
フジクラ	20,900	465.00	9,718,500
昭和電線ホールディングス	2,000	1,773.00	3,546,000
東京特殊電線	300	2,418.00	725,400
タツタ電線	3,400	694.00	2,359,600
カナレ電気	300	1,800.00	540,000
平河ヒューテック	900	1,152.00	1,036,800
リョービ	2,100	1,288.00	2,704,800
アーレスティ	2,300	338.00	777,400
アサヒホールディングス	3,000	3,255.00	9,765,000
稲葉製作所	1,000	1,372.00	1,372,000
宮地エンジニアリンググループ	500	2,259.00	1,129,500

トーカロ	4,800	1,337.00	6,417,600
アルファC o	600	973.00	583,800
SUMCO	22,200	2,381.00	52,858,200
川田テクノロジーズ	400	4,290.00	1,716,000
RS Technologies	600	4,975.00	2,985,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,700.00	370,000
信和	1,000	674.00	674,000
東洋製罐グループホールディングス	11,000	1,103.00	12,133,000
ホッカンホールディングス	1,000	1,403.00	1,403,000
コロナ	1,000	941.00	941,000
横河ブリッジホールディングス	3,200	2,108.00	6,745,600
駒井ハルテック	300	1,657.00	497,100
高田機工	200	2,553.00	510,600
三和ホールディングス	16,300	1,200.00	19,560,000
文化シャッター	5,100	944.00	4,814,400
三協立山	2,200	767.00	1,687,400
アルインコ	1,300	918.00	1,193,400
東洋シャッター	400	738.00	295,200
LIXIL	25,600	2,328.00	59,596,800
日本フィルコン	1,200	514.00	616,800
ノーリツ	3,600	1,668.00	6,004,800
長府製作所	1,800	2,088.00	3,758,400
リンナイ	3,400	11,890.00	40,426,000
ダイニチ工業	900	829.00	746,100
日東精工	2,200	443.00	974,600
三洋工業	200	1,896.00	379,200
岡部	3,500	797.00	2,789,500
ジーテクト	2,200	1,480.00	3,256,000
東プレ	3,200	1,440.00	4,608,000
高周波熱錬	3,300	480.00	1,584,000
東京製綱	1,200	891.00	1,069,200
サンコール	1,300	445.00	578,500
モリテック スチール	1,400	528.00	739,200
パイオラックス	2,600	1,707.00	4,438,200
エイチワン	1,700	781.00	1,327,700
日本発條	18,600	664.00	12,350,400
中央発條	200	2,997.00	599,400
アドバネクス	200	1,287.00	257,400
立川ブラインド工業	800	1,355.00	1,084,000
三益半導体工業	1,400	2,779.00	3,890,600
日本ドライケミカル	400	1,541.00	616,400
日本製鋼所	5,300	2,930.00	15,529,000

三浦工業	7,500	5,660.00	42,450,000
タクマ	5,900	1,790.00	10,561,000
ツガミ	3,600	1,592.00	5,731,200
オークマ	2,000	5,890.00	11,780,000
芝浦機械	2,000	2,290.00	4,580,000
アマダ	21,500	1,107.00	23,800,500
アイダエンジニアリング	4,500	954.00	4,293,000
滝澤鉄工所	500	986.00	493,000
F U J I	7,500	2,715.00	20,362,500
牧野フライス製作所	2,000	4,060.00	8,120,000
オーエスジー	8,600	1,895.00	16,297,000
ダイジェット工業	200	1,334.00	266,800
旭ダイヤモンド工業	4,500	427.00	1,921,500
D M G 森精機	11,000	1,608.00	17,688,000
ソディック	3,800	841.00	3,195,800
ディスコ	2,400	32,750.00	78,600,000
日東工器	900	1,770.00	1,593,000
日進工具	700	2,699.00	1,889,300
パンチ工業	1,600	476.00	761,600
富士ダイス	800	661.00	528,800
豊和工業	1,000	840.00	840,000
O K K	700	393.00	275,100
石川製作所	400	1,795.00	718,000
東洋機械金属	1,200	406.00	487,200
津田駒工業	300	900.00	270,000
エンシュウ	400	938.00	375,200
島精機製作所	2,700	1,806.00	4,876,200
オプトラン	2,200	2,255.00	4,961,000
N C ホールディングス	500	529.00	264,500
イワキポンプ	1,100	840.00	924,000
フリー	1,700	1,074.00	1,825,800
ヤマシンフィルタ	3,900	1,118.00	4,360,200
日阪製作所	2,100	837.00	1,757,700
やまびこ	3,400	1,383.00	4,702,200
平田機工	800	8,530.00	6,824,000
ペガサスミシン製造	1,800	331.00	595,800
マルマエ	600	1,225.00	735,000
タツモ	700	1,552.00	1,086,400
ナプテスコ	10,200	4,300.00	43,860,000
三井海洋開発	1,800	1,779.00	3,202,200
レオン自動機	1,700	1,117.00	1,898,900
S M C	5,500	65,550.00	360,525,000

ホソカワミクロン	600	6,430.00	3,858,000
ユニオンツール	600	3,105.00	1,863,000
オイレス工業	2,200	1,683.00	3,702,600
日精エー・エス・ピー機械	500	6,110.00	3,055,000
サトーホールディングス	2,500	2,190.00	5,475,000
技研製作所	1,500	4,195.00	6,292,500
日本エアータック	600	1,562.00	937,200
カワタ	500	1,069.00	534,500
日精樹脂工業	1,500	876.00	1,314,000
オカダアイヨン	500	1,061.00	530,500
ワイエイシイホールディングス	700	1,137.00	795,900
小松製作所	79,400	2,763.50	219,421,900
住友重機械工業	10,000	2,290.00	22,900,000
日立建機	7,000	2,941.00	20,587,000
日工	2,400	689.00	1,653,600
巴工業	700	1,904.00	1,332,800
井関農機	1,800	1,411.00	2,539,800
TOWA	1,800	1,969.00	3,544,200
丸山製作所	400	1,504.00	601,600
北川鉄工所	800	1,367.00	1,093,600
ローツェ	800	5,790.00	4,632,000
タカキタ	600	684.00	410,400
クボタ	92,100	2,175.50	200,363,550
荏原実業	400	3,870.00	1,548,000
三菱化工機	600	3,175.00	1,905,000
月島機械	3,200	1,399.00	4,476,800
帝国電機製作所	1,400	1,248.00	1,747,200
東京機械製作所	700	246.00	172,200
新東工業	4,200	743.00	3,120,600
澁谷工業	1,500	3,625.00	5,437,500
アイチ コーポレーション	3,000	941.00	2,823,000
小森コーポレーション	4,400	724.00	3,185,600
鶴見製作所	1,300	1,799.00	2,338,700
住友精密工業	300	2,007.00	602,100
日本ギア工業	700	297.00	207,900
酒井重工業	300	2,382.00	714,600
荏原製作所	7,300	3,410.00	24,893,000
石井鐵工所	200	2,817.00	563,400
西島製作所	1,800	889.00	1,600,200
北越工業	1,800	1,048.00	1,886,400
ダイキン工業	22,300	22,770.00	507,771,000
オルガノ	600	6,060.00	3,636,000

トーヨーカネツ	800	2,115.00	1,692,000
栗田工業	9,500	3,790.00	36,005,000
椿本チエイン	2,500	2,797.00	6,992,500
大同工業	800	668.00	534,400
木村化工機	1,500	546.00	819,000
アネスト岩田	2,700	997.00	2,691,900
ダイフク	9,000	12,370.00	111,330,000
サムコ	400	3,375.00	1,350,000
加藤製作所	1,000	1,007.00	1,007,000
油研工業	300	1,510.00	453,000
タダノ	8,500	896.00	7,616,000
フジテック	6,400	2,221.00	14,214,400
C K D	4,800	2,337.00	11,217,600
キトー	1,300	1,618.00	2,103,400
平和	4,900	1,450.00	7,105,000
理想科学工業	1,500	1,279.00	1,918,500
S A N K Y O	3,900	2,644.00	10,311,600
日本金銭機械	1,900	529.00	1,005,100
マースグループホールディングス	1,100	1,598.00	1,757,800
フクシマガリレイ	1,100	4,590.00	5,049,000
オーイズミ	700	386.00	270,200
ダイコク電機	800	865.00	692,000
竹内製作所	2,900	2,517.00	7,299,300
アマノ	4,600	2,667.00	12,268,200
J U K I	2,400	515.00	1,236,000
サンデンホールディングス	2,300	380.00	874,000
蛇の目ミシン工業	1,600	798.00	1,276,800
マックス	2,700	1,408.00	3,801,600
グローリー	4,500	2,104.00	9,468,000
新晃工業	1,600	1,695.00	2,712,000
大和冷機工業	2,800	1,158.00	3,242,400
セガサミーホールディングス	17,400	1,486.00	25,856,400
日本ピストンリング	600	1,019.00	611,400
リケン	800	2,172.00	1,737,600
T P R	2,400	1,435.00	3,444,000
ツバキ・ナカシマ	3,400	953.00	3,240,200
ホシザキ	5,500	9,840.00	54,120,000
大豊工業	1,400	663.00	928,200
日本精工	33,000	941.00	31,053,000
N T N	40,600	251.00	10,190,600
ジェイテクト	16,800	780.00	13,104,000
不二越	1,600	4,255.00	6,808,000

日本トムソン	5,200	375.00	1,950,000
THK	10,900	3,410.00	37,169,000
ユーシン精機	1,400	887.00	1,241,800
前澤給装工業	600	2,365.00	1,419,000
イーグル工業	2,200	969.00	2,131,800
前澤工業	1,200	455.00	546,000
日本ピラー工業	1,800	1,611.00	2,899,800
キット	6,400	655.00	4,192,000
マキタ	22,900	5,320.00	121,828,000
日立造船	13,900	433.00	6,018,700
三菱重工業	29,400	2,711.00	79,703,400
IHI	12,600	1,770.00	22,302,000
スター精密	2,700	1,698.00	4,584,600
日清紡ホールディングス	10,700	800.00	8,560,000
イビデン	10,700	5,030.00	53,821,000
コニカミノルタ	38,300	374.00	14,324,200
ブラザー工業	21,400	2,064.00	44,169,600
ミネベアミツミ	32,500	2,165.00	70,362,500
日立製作所	84,200	4,207.00	354,229,400
三菱電機	175,300	1,502.50	263,388,250
富士電機	10,600	3,665.00	38,849,000
東洋電機製造	600	1,151.00	690,600
安川電機	18,900	4,865.00	91,948,500
シンフォニアテクノロジー	2,300	1,424.00	3,275,200
明電舎	3,200	2,094.00	6,700,800
オリジン	500	1,332.00	666,000
山洋電気	800	5,240.00	4,192,000
デンヨー	1,500	2,105.00	3,157,500
東芝テック	2,200	3,880.00	8,536,000
芝浦メカトロニクス	300	4,200.00	1,260,000
マブチモーター	4,900	4,570.00	22,393,000
日本電産	42,200	12,400.00	523,280,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	443.00	487,300
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,371.00	1,371,000
東光高岳	1,000	1,822.00	1,822,000
ダブル・スコープ	2,900	910.00	2,639,000
宮越ホールディングス	700	684.00	478,800
ダイヘン	1,900	4,910.00	9,329,000
ヤーマン	2,900	2,374.00	6,884,600
JVCケンウッド	14,300	148.00	2,116,400
ミマキエンジニアリング	1,600	511.00	817,600
I-PEX	800	1,992.00	1,593,600

日新電機	4,100	1,137.00	4,661,700
大崎電気工業	3,500	555.00	1,942,500
オムロン	15,700	8,960.00	140,672,000
日東工業	2,600	2,015.00	5,239,000
I D E C	2,500	1,855.00	4,637,500
正興電機製作所	400	2,294.00	917,600
不二電機工業	300	1,313.00	393,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,900	2,689.00	15,865,100
サクサホールディングス	400	1,421.00	568,400
メルコホールディングス	600	3,285.00	1,971,000
テクノメディカ	400	1,508.00	603,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	1,412.00	564,800
日本電気	21,300	5,420.00	115,446,000
富士通	16,900	13,740.00	232,206,000
沖電気工業	7,100	915.00	6,496,500
岩崎通信機	800	849.00	679,200
電気興業	800	2,773.00	2,218,400
サンケン電気	1,900	3,900.00	7,410,000
ナカヨ	300	1,456.00	436,800
アイホン	1,000	1,705.00	1,705,000
ルネサスエレクトロニクス	75,100	1,014.00	76,151,400
セイコーエプソン	21,800	1,626.00	35,446,800
ワコム	11,800	912.00	10,761,600
アルバック	3,200	4,515.00	14,448,000
アクセル	700	759.00	531,300
E I Z O	1,400	3,795.00	5,313,000
ジャパンディスプレイ	50,700	51.00	2,585,700
日本信号	4,500	945.00	4,252,500
京三製作所	4,100	445.00	1,824,500
能美防災	2,300	2,393.00	5,503,900
ホーチキ	1,300	1,294.00	1,682,200
星和電機	900	656.00	590,400
エレコム	2,000	4,750.00	9,500,000
パナソニック	200,300	1,170.00	234,351,000
シャープ	20,300	1,406.00	28,541,800
アンリツ	11,300	2,286.00	25,831,800
富士通ゼネラル	4,800	2,828.00	13,574,400
ソニー	109,800	9,818.00	1,078,016,400
T D K	8,500	14,080.00	119,680,000
帝国通信工業	800	1,159.00	927,200
タムラ製作所	5,900	576.00	3,398,400
アルプスアルパイン	15,500	1,265.00	19,607,500

池上通信機	600	921.00	552,600
日本電波工業	1,600	657.00	1,051,200
鈴木	900	1,064.00	957,600
日本トリム	200	4,160.00	832,000
ローランド ディー・ジー・	1,000	1,880.00	1,880,000
フォスター電機	1,800	1,206.00	2,170,800
S M K	400	3,035.00	1,214,000
ヨコオ	1,100	2,561.00	2,817,100
ティアック	1,100	103.00	113,300
ホシデン	4,800	969.00	4,651,200
ヒロセ電機	2,700	15,100.00	40,770,000
日本航空電子工業	4,000	1,497.00	5,988,000
T O A	1,900	865.00	1,643,500
マクセルホールディングス	3,800	1,323.00	5,027,400
古野電気	2,300	1,161.00	2,670,300
ユニデンホールディングス	500	2,330.00	1,165,000
スミダコーポレーション	1,500	1,100.00	1,650,000
アイコム	1,000	2,712.00	2,712,000
リオン	700	3,195.00	2,236,500
本多通信工業	1,500	488.00	732,000
船井電機	1,800	432.00	777,600
横河電機	16,100	1,933.00	31,121,300
新電元工業	600	2,567.00	1,540,200
アズビル	11,100	5,180.00	57,498,000
東亜ディーケーケー	900	881.00	792,900
日本光電工業	7,200	3,490.00	25,128,000
チノー	600	1,441.00	864,600
共和電業	1,800	402.00	723,600
日本電子材料	700	1,743.00	1,220,100
堀場製作所	3,500	5,630.00	19,705,000
アドバンテスト	13,000	7,540.00	98,020,000
小野測器	700	516.00	361,200
エスベック	1,600	2,015.00	3,224,000
キーエンス	15,900	52,640.00	836,976,000
日置電機	800	4,260.00	3,408,000
シスメックス	12,500	11,645.00	145,562,500
日本マイクロニクス	3,100	1,103.00	3,419,300
メガチップス	1,600	3,005.00	4,808,000
O B A R A G R O U P	1,000	3,910.00	3,910,000
澤藤電機	200	2,301.00	460,200
原田工業	800	862.00	689,600
コーセル	2,300	1,208.00	2,778,400

イリソ電子工業	1,500	4,695.00	7,042,500
オブテックスグループ	2,900	1,952.00	5,660,800
千代田インテグレ	700	1,587.00	1,110,900
アイ・オー・データ機器	600	1,061.00	636,600
レーザーテック	7,700	11,420.00	87,934,000
スタンレー電気	12,300	3,410.00	41,943,000
岩崎電気	700	1,403.00	982,100
ウシオ電機	9,700	1,308.00	12,687,600
岡谷電機産業	1,400	409.00	572,600
ハリオス テクノ ホールディング	1,600	300.00	480,000
エノモト	500	1,427.00	713,500
日本セラミック	1,800	2,984.00	5,371,200
遠藤照明	900	540.00	486,000
古河電池	1,200	1,403.00	1,683,600
双信電機	800	454.00	363,200
山一電機	1,300	1,622.00	2,108,600
図研	1,100	2,868.00	3,154,800
日本電子	3,500	4,475.00	15,662,500
カシオ計算機	15,500	1,947.00	30,178,500
ファナック	16,500	26,035.00	429,577,500
日本シイエムケイ	4,100	418.00	1,713,800
エンプラス	900	3,215.00	2,893,500
大真空	600	2,531.00	1,518,600
ローム	7,300	9,800.00	71,540,000
浜松ホトニクス	12,600	5,940.00	74,844,000
三井ハイテック	1,900	2,943.00	5,591,700
新光電気工業	5,900	2,328.00	13,735,200
京セラ	24,700	6,187.00	152,818,900
太陽誘電	7,800	4,555.00	35,529,000
村田製作所	51,500	8,799.00	453,148,500
双葉電子工業	2,800	860.00	2,408,000
北陸電気工業	700	924.00	646,800
ニチコン	5,900	1,213.00	7,156,700
日本ケミコン	1,400	1,825.00	2,555,000
K O A	2,600	1,513.00	3,933,800
市光工業	2,600	628.00	1,632,800
小糸製作所	10,500	6,870.00	72,135,000
ミツバ	3,200	486.00	1,555,200
S C R E E Nホールディングス	3,000	7,160.00	21,480,000
キャノン電子	1,600	1,527.00	2,443,200
キャノン	87,100	2,063.00	179,687,300
リコー	44,600	749.00	33,405,400

象印マホービン	4,700	1,853.00	8,709,100
MUTOHホールディングス	200	1,468.00	293,600
東京エレクトロン	11,100	36,420.00	404,262,000
トヨタ紡織	5,100	1,659.00	8,460,900
芦森工業	400	976.00	390,400
ユニプレス	3,400	962.00	3,270,800
豊田自動織機	14,200	7,820.00	111,044,000
モリタホールディングス	3,100	1,660.00	5,146,000
三櫻工業	2,200	822.00	1,808,400
デンソー	38,600	5,720.00	220,792,000
東海理化電機製作所	4,600	1,662.00	7,645,200
三井E & Sホールディングス	6,300	352.00	2,217,600
川崎重工業	13,600	1,760.00	23,936,000
名村造船所	5,600	199.00	1,114,400
サノヤスホールディングス	2,100	167.00	350,700
日本車輛製造	600	2,484.00	1,490,400
三菱ロジスネクスト	2,300	1,272.00	2,925,600
近畿車輛	300	1,304.00	391,200
日産自動車	206,800	561.30	116,076,840
いすゞ自動車	50,800	1,020.00	51,816,000
トヨタ自動車	195,600	7,480.00	1,463,088,000
日野自動車	21,900	1,002.00	21,943,800
三菱自動車工業	64,900	198.00	12,850,200
エフテック	1,200	606.00	727,200
レシップホールディングス	700	549.00	384,300
GMB	300	662.00	198,600
ファルテック	300	588.00	176,400
武蔵精密工業	3,900	1,577.00	6,150,300
日産車体	3,400	894.00	3,039,600
新明和工業	4,700	872.00	4,098,400
極東開発工業	3,300	1,492.00	4,923,600
トピー工業	1,400	1,258.00	1,761,200
ティラド	600	1,319.00	791,400
曙ブレーキ工業	9,600	134.00	1,286,400
タチエス	2,900	1,209.00	3,506,100
NOK	9,400	1,156.00	10,866,400
フタバ産業	4,900	540.00	2,646,000
KYB	2,000	2,532.00	5,064,000
大同メタル工業	3,400	468.00	1,591,200
プレス工業	8,700	339.00	2,949,300
ミクニ	2,200	284.00	624,800
太平洋工業	3,700	1,060.00	3,922,000

河西工業	2,400	390.00	936,000
アイシン精機	14,400	3,075.00	44,280,000
マツダ	51,600	663.00	34,210,800
今仙電機製作所	1,600	826.00	1,321,600
本田技研工業	138,000	3,100.00	427,800,000
スズキ	34,700	5,268.00	182,799,600
S U B A R U	54,400	2,121.00	115,382,400
安永	800	1,377.00	1,101,600
ヤマハ発動機	24,800	2,204.00	54,659,200
T B K	2,100	443.00	930,300
エクセディ	2,400	1,302.00	3,124,800
豊田合成	5,700	2,853.00	16,262,100
愛三工業	2,700	477.00	1,287,900
盟和産業	300	893.00	267,900
日本プラスト	1,400	482.00	674,800
ヨロズ	1,600	1,165.00	1,864,000
エフ・シー・シー	2,900	1,993.00	5,779,700
シマノ	6,600	24,350.00	160,710,000
テイ・エス テック	4,100	3,275.00	13,427,500
ジャムコ	900	666.00	599,400
テルモ	49,600	4,108.00	203,756,800
クリエートメディック	600	984.00	590,400
日機装	5,700	1,035.00	5,899,500
日本エム・ディ・エム	1,000	2,351.00	2,351,000
島津製作所	20,900	3,755.00	78,479,500
J M S	1,500	900.00	1,350,000
クボテック	500	393.00	196,500
長野計器	1,300	879.00	1,142,700
ブイ・テクノロジー	800	5,490.00	4,392,000
東京計器	1,100	940.00	1,034,000
愛知時計電機	200	4,395.00	879,000
インターアクション	900	2,020.00	1,818,000
オーバル	1,600	353.00	564,800
東京精密	3,200	4,875.00	15,600,000
マニー	7,000	2,570.00	17,990,000
ニコン	26,800	672.00	18,009,600
トプコン	8,800	1,322.00	11,633,600
オリンパス	97,000	2,220.50	215,388,500
理研計器	1,500	2,897.00	4,345,500
タムロン	1,400	1,712.00	2,396,800
H O Y A	34,800	12,975.00	451,530,000
シード	700	624.00	436,800

ノーリツ銅機	1,200	2,463.00	2,955,600
エー・アンド・デイ	1,600	1,029.00	1,646,400
朝日インテック	19,900	3,635.00	72,336,500
シチズン時計	20,500	293.00	6,006,500
リズム	500	611.00	305,500
大研医器	1,200	526.00	631,200
メニコン	2,500	6,280.00	15,700,000
シンシア	200	398.00	79,600
松風	800	1,787.00	1,429,600
セイコーホールディングス	2,500	1,389.00	3,472,500
ニプロ	12,100	1,190.00	14,399,000
中本パックス	400	1,540.00	616,000
スノーピーク	1,000	1,748.00	1,748,000
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,405.00	7,929,000
トランザクション	1,000	913.00	913,000
粧美堂	500	391.00	195,500
ニホンフラッシュ	1,600	1,290.00	2,064,000
前田工織	1,900	2,537.00	4,820,300
永大産業	2,300	283.00	650,900
アートネイチャー	1,900	664.00	1,261,600
バンダイナムコホールディングス	18,100	9,372.00	169,633,200
アイフィスジャパン	400	803.00	321,200
共立印刷	2,800	122.00	341,600
S H O E I	1,500	3,645.00	5,467,500
フランスベッドホールディングス	2,500	863.00	2,157,500
パイロットコーポレーション	3,100	2,986.00	9,256,600
萩原工業	1,000	1,497.00	1,497,000
トッパン・フォームズ	3,800	1,052.00	3,997,600
フジシールインターナショナル	3,900	2,031.00	7,920,900
タカラトミー	7,900	947.00	7,481,300
廣済堂	1,200	680.00	816,000
エステールホールディングス	500	624.00	312,000
タカノ	700	597.00	417,900
プロネクサス	1,500	1,030.00	1,545,000
ホクシン	900	109.00	98,100
ウッドワン	600	1,122.00	673,200
大建工業	1,200	1,917.00	2,300,400
凸版印刷	24,700	1,525.00	37,667,500
大日本印刷	22,900	1,884.00	43,143,600
共同印刷	500	3,070.00	1,535,000
N I S S H A	3,600	1,468.00	5,284,800
光村印刷	200	1,795.00	359,000

TAKARA & COMPANY	800	1,923.00	1,538,400
アシックス	15,500	2,180.00	33,790,000
ツツミ	500	2,132.00	1,066,000
小松ウオール工業	500	1,758.00	879,000
ヤマハ	10,400	6,490.00	67,496,000
河合楽器製作所	500	2,926.00	1,463,000
クリナップ	1,600	481.00	769,600
ピジョン	11,300	4,640.00	52,432,000
オリバー	400	2,300.00	920,000
兼松サステック	100	1,614.00	161,400
キングジム	1,500	920.00	1,380,000
リンテック	4,200	2,266.00	9,517,200
イトーキ	3,500	356.00	1,246,000
任天堂	10,800	59,010.00	637,308,000
三菱鉛筆	2,900	1,440.00	4,176,000
タカラスタANDARD	3,600	1,430.00	5,148,000
コクヨ	8,400	1,461.00	12,272,400
ナカバヤシ	1,700	620.00	1,054,000
グローブライド	800	4,200.00	3,360,000
オカムラ	6,100	938.00	5,721,800
美津濃	1,600	2,034.00	3,254,400
東京電力ホールディングス	140,000	272.00	38,080,000
中部電力	53,600	1,231.00	65,981,600
関西電力	66,400	934.30	62,037,520
中国電力	25,300	1,277.00	32,308,100
北陸電力	16,000	679.00	10,864,000
東北電力	43,800	850.00	37,230,000
四国電力	15,800	686.00	10,838,800
九州電力	36,100	878.00	31,695,800
北海道電力	16,400	378.00	6,199,200
沖縄電力	3,400	1,392.00	4,732,800
電源開発	13,900	1,373.00	19,084,700
エフオン	900	1,053.00	947,700
イーレックス	2,500	1,899.00	4,747,500
レノバ	2,900	2,691.00	7,803,900
東京瓦斯	33,700	2,255.50	76,010,350
大阪瓦斯	34,000	2,010.00	68,340,000
東邦瓦斯	8,600	6,590.00	56,674,000
北海道瓦斯	900	1,539.00	1,385,100
広島ガス	3,600	368.00	1,324,800
西部瓦斯	2,000	3,605.00	7,210,000
静岡ガス	5,000	1,022.00	5,110,000

メタウォーター	1,700	2,272.00	3,862,400
SBSホールディングス	1,300	2,541.00	3,303,300
東武鉄道	18,300	3,080.00	56,364,000
相鉄ホールディングス	5,600	2,620.00	14,672,000
東急	44,200	1,277.00	56,443,400
京浜急行電鉄	22,500	1,811.00	40,747,500
小田急電鉄	26,100	3,205.00	83,650,500
京王電鉄	9,100	7,630.00	69,433,000
京成電鉄	12,200	3,760.00	45,872,000
富士急行	2,400	4,745.00	11,388,000
新京成電鉄	500	2,235.00	1,117,500
東日本旅客鉄道	30,900	6,908.00	213,457,200
西日本旅客鉄道	15,600	5,453.00	85,066,800
東海旅客鉄道	14,600	14,255.00	208,123,000
西武ホールディングス	22,900	1,062.00	24,319,800
鴻池運輸	2,800	1,015.00	2,842,000
西日本鉄道	4,900	2,910.00	14,259,000
ハマキョウレックス	1,300	2,922.00	3,798,600
サカイ引越センター	900	5,330.00	4,797,000
近鉄グループホールディングス	16,600	4,665.00	77,439,000
阪急阪神ホールディングス	22,100	3,440.00	76,024,000
南海電気鉄道	7,900	2,650.00	20,935,000
京阪ホールディングス	7,400	4,950.00	36,630,000
神戸電鉄	400	3,630.00	1,452,000
名古屋鉄道	13,700	2,764.00	37,866,800
山陽電気鉄道	1,200	1,999.00	2,398,800
日本通運	5,700	6,980.00	39,786,000
ヤマトホールディングス	27,500	2,556.00	70,290,000
山九	4,600	3,910.00	17,986,000
丸運	900	252.00	226,800
丸全昭和運輸	1,300	3,345.00	4,348,500
センコーグループホールディングス	9,200	996.00	9,163,200
トナミホールディングス	400	6,170.00	2,468,000
ニッコンホールディングス	5,900	2,109.00	12,443,100
日本石油輸送	200	2,602.00	520,400
福山通運	2,100	4,360.00	9,156,000
セイノーホールディングス	12,400	1,392.00	17,260,800
エスライン	500	905.00	452,500
神奈川中央交通	400	3,960.00	1,584,000
日立物流	3,000	3,095.00	9,285,000
丸和運輸機関	1,800	4,110.00	7,398,000
C&Fロジホールディングス	1,700	1,933.00	3,286,100

九州旅客鉄道	14,600	2,276.00	33,229,600
S Gホールディングス	34,900	2,809.00	98,034,100
日本郵船	13,900	2,394.00	33,276,600
商船三井	10,500	2,992.00	31,416,000
川崎汽船	5,100	1,986.00	10,128,600
N Sユナイテッド海運	900	1,388.00	1,249,200
明治海運	1,800	417.00	750,600
飯野海運	7,900	420.00	3,318,000
共栄タンカー	300	838.00	251,400
乾汽船	1,000	939.00	939,000
日本航空	37,300	1,964.00	73,257,200
A N Aホールディングス	30,400	2,434.50	74,008,800
パスコ	300	1,443.00	432,900
トランコム	500	8,590.00	4,295,000
日新	1,400	1,260.00	1,764,000
三菱倉庫	5,300	2,934.00	15,550,200
三井倉庫ホールディングス	1,900	2,120.00	4,028,000
住友倉庫	6,000	1,344.00	8,064,000
澁澤倉庫	900	2,317.00	2,085,300
東陽倉庫	3,000	318.00	954,000
日本トランスシティ	3,700	575.00	2,127,500
ケイヒン	300	1,365.00	409,500
中央倉庫	1,000	1,169.00	1,169,000
川西倉庫	300	1,112.00	333,600
安田倉庫	1,400	1,016.00	1,422,400
ファイズホールディングス	400	1,024.00	409,600
東洋埠頭	500	1,463.00	731,500
宇徳	1,400	475.00	665,000
上組	9,300	1,876.00	17,446,800
サンリツ	400	697.00	278,800
キムラユニティー	400	1,046.00	418,400
キューソー流通システム	400	1,682.00	672,800
近鉄エクスプレス	3,500	2,134.00	7,469,000
東海運	900	317.00	285,300
エーアイティー	1,200	981.00	1,177,200
内外トランスライン	600	1,320.00	792,000
日本コンセプト	500	1,776.00	888,000
N E C ネットエスアイ	4,900	1,705.00	8,354,500
クロスキャット	500	1,199.00	599,500
システナ	6,100	2,137.00	13,035,700
デジタルアーツ	800	8,600.00	6,880,000
日鉄ソリューションズ	2,600	2,929.00	7,615,400

キューブシステム	900	1,238.00	1,114,200
エイジア	300	2,024.00	607,200
コア	700	1,394.00	975,800
ラクーンホールディングス	900	1,743.00	1,568,700
ソリトンシステムズ	900	1,885.00	1,696,500
ソフトクリエイトホールディングス	700	2,724.00	1,906,800
T I S	17,200	2,071.00	35,621,200
J N Sホールディングス	700	571.00	399,700
電算システム	600	3,245.00	1,947,000
グリー	10,500	582.00	6,111,000
コーエーテックモホールディングス	3,500	6,070.00	21,245,000
三菱総合研究所	700	4,215.00	2,950,500
ボルテージ	400	551.00	220,400
電算	200	2,474.00	494,800
A G S	1,000	813.00	813,000
ファインデックス	1,400	1,254.00	1,755,600
ブレインパッド	400	4,565.00	1,826,000
K L a b	3,100	997.00	3,090,700
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,100	1,068.00	2,242,800
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,614.00	522,800
ネクソン	43,400	2,949.00	127,986,600
アイスタイル	4,800	421.00	2,020,800
エムアップホールディングス	500	2,492.00	1,246,000
エイチーム	1,200	1,099.00	1,318,800
エニグモ	1,600	1,267.00	2,027,200
テクノスジャパン	1,300	693.00	900,900
e n i s h	900	464.00	417,600
コロプラ	5,600	948.00	5,308,800
オルトプラス	1,000	424.00	424,000
ブロードリーフ	8,500	715.00	6,077,500
クロス・マーケティンググループ	800	361.00	288,800
デジタルハーツホールディングス	900	1,242.00	1,117,800
システム情報	1,300	1,108.00	1,440,400
メディアドゥ	600	6,810.00	4,086,000
じげん	4,300	336.00	1,444,800
ブイキューブ	900	3,125.00	2,812,500
エンカレッジ・テクノロジー	400	759.00	303,600
サイバーリンクス	300	6,590.00	1,977,000
ディー・エル・イー	1,400	337.00	471,800
フィックスターズ	1,800	960.00	1,728,000
C A R T A H O L D I N G S	700	1,235.00	864,500
オブティム	900	2,787.00	2,508,300

セレス	600	2,453.00	1,471,800
S H I F T	800	13,220.00	10,576,000
ティーガイア	1,500	1,811.00	2,716,500
セック	300	2,976.00	892,800
日本アジアグループ	1,600	685.00	1,096,000
テクマトリックス	2,400	2,050.00	4,920,000
プロシップ	500	1,444.00	722,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,626.00	10,766,600
GMOペイメントゲートウェイ	3,600	13,570.00	48,852,000
ザッパラス	700	483.00	338,100
システムリサーチ	500	1,582.00	791,000
インターネットイニシアティブ	2,500	4,150.00	10,375,000
さくらインターネット	1,800	677.00	1,218,600
ヴィンクス	500	1,216.00	608,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	9,400.00	3,760,000
SRAホールディングス	900	2,454.00	2,208,600
システムインテグレータ	500	637.00	318,500
朝日ネット	1,200	858.00	1,029,600
e B A S E	2,100	1,059.00	2,223,900
アバント	1,600	1,163.00	1,860,800
アドソル日進	600	3,000.00	1,800,000
フリービット	900	942.00	847,800
コムチュア	1,900	3,100.00	5,890,000
サイバーコム	300	1,744.00	523,200
アステリア	1,000	1,042.00	1,042,000
アイル	1,000	1,511.00	1,511,000
マークライنز	700	2,764.00	1,934,800
メディカル・データ・ビジョン	2,000	2,580.00	5,160,000
g u m i	2,200	881.00	1,938,200
ショーケース	400	1,006.00	402,400
モバイルファクトリー	400	1,002.00	400,800
テラスカイ	600	4,260.00	2,556,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,469.00	1,028,300
PCIホールディングス	600	1,228.00	736,800
パイプHD	200	1,602.00	320,400
アイビーシー	300	1,195.00	358,500
ネオジャパン	300	2,518.00	755,400
P R T I M E S	300	3,055.00	916,500
ランドコンピュータ	300	1,111.00	333,300
ダブルスタンダード	200	4,160.00	832,000
オープンドア	900	1,364.00	1,227,600
マイネット	600	852.00	511,200

アカツキ	600	4,380.00	2,628,000
ベネフィットジャパン	100	1,673.00	167,300
U b i c o mホールディングス	400	3,280.00	1,312,000
L I N E	3,600	5,360.00	19,296,000
カナミックネットワーク	1,600	765.00	1,224,000
ノムラシステムコーポレーション	700	358.00	250,600
チェンジ	1,200	7,420.00	8,904,000
シンクロ・フード	700	306.00	214,200
オークネット	900	1,450.00	1,305,000
セグエグループ	400	1,323.00	529,200
エイトレッド	300	2,505.00	751,500
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	413.00	702,100
マクロミル	3,500	686.00	2,401,000
ビーグリー	300	1,825.00	547,500
オロ	500	4,430.00	2,215,000
ユーザーローカル	200	3,815.00	763,000
テモナ	400	1,118.00	447,200
ニーズウェル	300	683.00	204,900
サインポスト	400	874.00	349,600
ソルクシーズ	700	981.00	686,700
フェイス	600	754.00	452,400
プロトコーポレーション	1,500	1,028.00	1,542,000
ハイマックス	400	1,126.00	450,400
野村総合研究所	24,400	3,370.00	82,228,000
サイバネットシステム	1,200	1,018.00	1,221,600
C Eホールディングス	900	555.00	499,500
日本システム技術	300	1,512.00	453,600
インテージホールディングス	2,100	1,015.00	2,131,500
東邦システムサイエンス	500	921.00	460,500
ソースネクスト	8,200	298.00	2,443,600
インフォコム	1,900	3,290.00	6,251,000
H E R O Z	200	2,942.00	588,400
ラクスル	1,400	4,760.00	6,664,000
F I G	1,900	274.00	520,600
システムサポート	400	1,556.00	622,400
イーソル	900	1,288.00	1,159,200
アルテリア・ネットワークス	1,900	1,530.00	2,907,000
E d u L a b	200	6,820.00	1,364,000
東海ソフト	100	1,100.00	110,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,441.00	432,300
東名	100	1,198.00	119,800
ヴィッツ	100	2,498.00	249,800

トピラシステムズ	200	1,627.00	325,400
Link-U	100	1,528.00	152,800
フォーカスシステムズ	1,100	900.00	990,000
クレスコ	1,000	1,283.00	1,283,000
フジ・メディア・ホールディングス	16,600	1,122.00	18,625,200
オービック	6,000	21,740.00	130,440,000
ジャストシステム	2,800	6,850.00	19,180,000
TDCソフト	1,500	980.00	1,470,000
Zホールディングス	236,300	625.50	147,805,650
トレンドマイクロ	9,200	5,710.00	52,532,000
IDホールディングス	700	1,223.00	856,100
日本オラクル	3,500	11,280.00	39,480,000
アルファシステムズ	500	3,535.00	1,767,500
フューチャー	2,100	1,782.00	3,742,200
CAC Holdings	1,100	1,468.00	1,614,800
SBテクノロジー	600	3,690.00	2,214,000
トーセ	500	846.00	423,000
オービックビジネスコンサルタント	1,800	6,730.00	12,114,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,800	3,780.00	29,484,000
アイティフォー	2,100	920.00	1,932,000
東計電算	300	4,515.00	1,354,500
エクスネット	300	973.00	291,900
大塚商会	9,300	5,030.00	46,779,000
サイボウズ	2,000	2,601.00	5,202,000
ソフトブレーン	500	866.00	433,000
電通国際情報サービス	1,100	6,680.00	7,348,000
ACCESS	1,600	762.00	1,219,200
デジタルガレージ	3,100	4,150.00	12,865,000
EMシステムズ	2,400	846.00	2,030,400
ウェザーニューズ	600	5,640.00	3,384,000
CIJ	1,200	932.00	1,118,400
ビジネスエンジニアリング	200	3,415.00	683,000
日本エンタープライズ	1,700	214.00	363,800
WOWOW	800	2,839.00	2,271,200
スカラ	1,100	825.00	907,500
インテリジェント ウェイブ	1,000	687.00	687,000
IMAGICA GROUP	1,500	368.00	552,000
ネットワンシステムズ	6,600	3,660.00	24,156,000
システムソフト	3,700	89.00	329,300
アルゴグラフィックス	1,500	2,999.00	4,498,500
マーベラス	2,600	846.00	2,199,600
エイベックス	3,000	994.00	2,982,000

日本ユニシス	5,400	3,790.00	20,466,000
兼松エレクトロニクス	900	3,990.00	3,591,000
都築電気	500	1,591.00	795,500
TBSホールディングス	10,500	1,934.00	20,307,000
日本テレビホールディングス	14,400	1,141.00	16,430,400
朝日放送グループホールディングス	1,700	685.00	1,164,500
テレビ朝日ホールディングス	4,700	1,700.00	7,990,000
スカパーJSATホールディングス	11,300	503.00	5,683,900
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,302.00	3,222,800
日本BS放送	600	1,078.00	646,800
ビジョン	2,100	1,043.00	2,190,300
スマートバリュー	400	964.00	385,600
USEN-NEXT HOLDINGS	700	1,335.00	934,500
ワイヤレスゲート	700	622.00	435,400
コネクシオ	1,000	1,263.00	1,263,000
日本通信	13,400	193.00	2,586,200
クロップス	300	772.00	231,600
日本電信電話	230,000	2,579.50	593,285,000
KDDI	125,400	2,950.50	369,992,700
ソフトバンク	156,300	1,311.50	204,987,450
光通信	1,800	25,660.00	46,188,000
エムティーアイ	1,700	797.00	1,354,900
GMOインターネット	6,200	2,785.00	17,267,000
ファイバーゲート	600	2,213.00	1,327,800
アйдママーケティングコミュニケーション	500	371.00	185,500
KADOKAWA	4,600	3,545.00	16,307,000
学研ホールディングス	2,300	1,752.00	4,029,600
ゼンリン	3,400	1,266.00	4,304,400
昭文社ホールディングス	800	470.00	376,000
インプレスホールディングス	1,400	168.00	235,200
アイネット	900	1,520.00	1,368,000
松竹	1,100	13,870.00	15,257,000
東宝	10,200	4,230.00	43,146,000
東映	600	16,130.00	9,678,000
エヌ・ティ・ティ・データ	45,800	1,362.00	62,379,600
ピー・シー・エー	300	4,450.00	1,335,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,519.00	911,400
DTS	3,800	2,203.00	8,371,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	6,330.00	46,209,000
シーイーシー	1,800	1,509.00	2,716,200
カブコン	8,100	6,330.00	51,273,000
アイ・エス・ビー	400	2,790.00	1,116,000

ジャステック	1,100	1,288.00	1,416,800
S C S K	4,000	5,930.00	23,720,000
日本システムウエア	600	2,140.00	1,284,000
アイネス	1,700	1,418.00	2,410,600
T K C	1,500	6,790.00	10,185,000
富士ソフト	1,800	4,835.00	8,703,000
N S D	5,500	1,953.00	10,741,500
コナミホールディングス	6,200	5,980.00	37,076,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,355.00	2,348,500
J B C Cホールディングス	1,200	1,490.00	1,788,000
ミロク情報サービス	1,500	1,994.00	2,991,000
ソフトバンクグループ	136,500	8,306.00	1,133,769,000
ハウスイ	100	1,015.00	101,500
高千穂交易	700	1,138.00	796,600
カワニシホールディングス	200	1,407.00	281,400
伊藤忠食品	400	5,360.00	2,144,000
エレマテック	1,600	1,003.00	1,604,800
J A L U X	500	1,348.00	674,000
あらた	1,400	5,090.00	7,126,000
トーメンデバイス	300	3,320.00	996,000
東京エレクトロン デバイス	600	3,125.00	1,875,000
フィールズ	1,300	393.00	510,900
双日	95,400	234.00	22,323,600
アルフレッサ ホールディングス	19,200	2,043.00	39,225,600
横浜冷凍	4,500	866.00	3,897,000
神栄	200	644.00	128,800
ラサ商事	900	902.00	811,800
アルコニックス	1,800	1,468.00	2,642,400
神戸物産	11,900	3,440.00	40,936,000
ハイパー	300	589.00	176,700
あい ホールディングス	2,500	2,191.00	5,477,500
ディーブイエックス	600	1,011.00	606,600
ダイワボウホールディングス	1,500	7,040.00	10,560,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,100	2,035.00	8,343,500
ラクト・ジャパン	800	2,959.00	2,367,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	841.00	2,691,200
八洲電機	1,300	975.00	1,267,500
メディアスホールディングス	1,000	810.00	810,000
レスターホールディングス	1,800	2,210.00	3,978,000
ジューテックホールディングス	400	993.00	397,200
大光	700	662.00	463,400
O C H Iホールディングス	500	1,311.00	655,500

TO K A Iホールディングス	9,100	1,007.00	9,163,700
黒谷	500	741.00	370,500
C o m i n i x	300	751.00	225,300
三洋貿易	1,700	981.00	1,667,700
ビューティガレージ	300	2,828.00	848,400
ウイン・パートナーズ	1,200	1,151.00	1,381,200
ミタチ産業	500	636.00	318,000
シップヘルスケアホールディングス	2,800	5,370.00	15,036,000
明治電機工業	500	1,414.00	707,000
デリカフーズホールディングス	600	643.00	385,800
スターティアホールディングス	400	702.00	280,800
コメダホールディングス	3,800	1,858.00	7,060,400
ピーバンドットコム	200	902.00	180,400
アセンテック	400	1,779.00	711,600
富士興産	500	894.00	447,000
協栄産業	200	1,301.00	260,200
小野建	1,500	1,215.00	1,822,500
南陽	400	1,587.00	634,800
佐島電機	1,200	795.00	954,000
エコートレーディング	400	657.00	262,800
伯東	1,100	1,069.00	1,175,900
コンドーテック	1,300	1,032.00	1,341,600
中山福	1,000	537.00	537,000
ナガイレーベン	2,300	2,701.00	6,212,300
三菱食品	1,900	2,772.00	5,266,800
松田産業	1,300	1,828.00	2,376,400
第一興商	2,600	3,675.00	9,555,000
メディバルホールディングス	18,600	2,037.00	37,888,200
S P K	700	1,292.00	904,400
萩原電気ホールディングス	600	2,500.00	1,500,000
アズワン	1,100	14,200.00	15,620,000
スズデン	600	1,223.00	733,800
尾家産業	500	1,447.00	723,500
シモジマ	1,100	1,376.00	1,513,600
ドウシシャ	1,600	1,938.00	3,100,800
小津産業	400	1,868.00	747,200
高速	1,000	1,582.00	1,582,000
たけびし	600	1,566.00	939,600
リックス	400	1,630.00	652,000
丸文	1,500	536.00	804,000
ハピネット	1,400	1,502.00	2,102,800
橋本総業ホールディングス	300	2,642.00	792,600

日本ライフライン	5,100	1,614.00	8,231,400
タカショー	1,100	802.00	882,200
マルカ	600	1,931.00	1,158,600
I D O M	4,700	575.00	2,702,500
進和	1,000	2,194.00	2,194,000
エスケイジャパン	400	433.00	173,200
ダイترون	700	1,535.00	1,074,500
シークス	2,200	1,592.00	3,502,400
田中商事	500	691.00	345,500
オーハシテクニカ	900	1,363.00	1,226,700
白銅	600	1,419.00	851,400
ダイコー通産	100	1,336.00	133,600
伊藤忠商事	120,800	2,931.50	354,125,200
丸紅	179,700	662.40	119,033,280
高島	300	1,599.00	479,700
長瀬産業	9,700	1,488.00	14,433,600
蝶理	1,100	1,583.00	1,741,300
豊田通商	19,300	3,750.00	72,375,000
三共生興	2,600	452.00	1,175,200
兼松	6,400	1,234.00	7,897,600
ツカモトコーポレーション	300	1,444.00	433,200
三井物産	149,500	1,900.50	284,124,750
日本紙パルプ商事	1,000	3,595.00	3,595,000
カメイ	2,300	1,197.00	2,753,100
東都水産	200	4,550.00	910,000
O U Gホールディングス	300	2,845.00	853,500
スターゼン	600	4,145.00	2,487,000
山善	6,700	1,054.00	7,061,800
椿本興業	300	3,840.00	1,152,000
住友商事	108,900	1,333.00	145,163,700
内田洋行	700	4,335.00	3,034,500
三菱商事	113,200	2,527.50	286,113,000
第一実業	800	4,055.00	3,244,000
キャノンマーケティングジャパン	4,300	2,269.00	9,756,700
西華産業	1,000	1,308.00	1,308,000
佐藤商事	1,400	1,007.00	1,409,800
菱洋エレクトロ	1,800	2,762.00	4,971,600
東京産業	1,600	586.00	937,600
ユアサ商事	1,600	3,500.00	5,600,000
神鋼商事	400	1,916.00	766,400
トルク	1,000	258.00	258,000
阪和興業	3,200	2,727.00	8,726,400

正栄食品工業	1,100	3,750.00	4,125,000
カナデン	1,400	1,353.00	1,894,200
菱電商事	1,200	1,525.00	1,830,000
フルサト工業	1,000	1,299.00	1,299,000
岩谷産業	4,500	5,880.00	26,460,000
ナイス	700	1,621.00	1,134,700
昭光通商	600	599.00	359,400
ニチモウ	300	1,960.00	588,000
極東貿易	500	1,310.00	655,000
イワキ	2,300	519.00	1,193,700
三愛石油	4,300	1,223.00	5,258,900
稲畑産業	3,800	1,441.00	5,475,800
G S Iクレオス	400	1,708.00	683,200
明和産業	1,600	435.00	696,000
クワザワホールディングス	600	570.00	342,000
ヤマエ久野	1,300	1,211.00	1,574,300
ワキタ	3,700	1,147.00	4,243,900
東邦ホールディングス	5,500	1,867.00	10,268,500
サンゲツ	4,700	1,487.00	6,988,900
ミツウロコグループホールディングス	2,500	1,315.00	3,287,500
シナネンホールディングス	700	2,928.00	2,049,600
伊藤忠エネクス	3,800	1,015.00	3,857,000
サンリオ	4,800	1,540.00	7,392,000
サンワテクノス	1,200	955.00	1,146,000
リョーサン	1,900	1,896.00	3,602,400
新光商事	2,600	739.00	1,921,400
トーヨー	800	1,990.00	1,592,000
三信電気	900	2,170.00	1,953,000
東陽テクニカ	1,800	1,123.00	2,021,400
モスフードサービス	2,300	2,805.00	6,451,500
加賀電子	1,700	2,201.00	3,741,700
ソーダニッカ	1,800	539.00	970,200
立花エレテック	1,300	1,656.00	2,152,800
フォーバル	800	878.00	702,400
P A L T A C	2,800	5,660.00	15,848,000
三谷産業	2,300	411.00	945,300
太平洋興発	700	617.00	431,900
西本Wismettacホールディングス	400	2,244.00	897,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,387.00	277,400
コア商事ホールディングス	300	1,492.00	447,600
国際紙パルプ商事	4,100	250.00	1,025,000
ヤマタネ	900	1,361.00	1,224,900

丸紅建材リース	200	1,701.00	340,200
日鉄物産	1,200	3,775.00	4,530,000
泉州電業	500	3,040.00	1,520,000
トラスコ中山	4,000	2,805.00	11,220,000
オートバックスセブン	6,400	1,383.00	8,851,200
モリト	1,300	604.00	785,200
加藤産業	2,500	3,430.00	8,575,000
北恵	400	867.00	346,800
イノテック	900	972.00	874,800
イエローハット	3,300	1,564.00	5,161,200
J Kホールディングス	1,600	867.00	1,387,200
日伝	1,600	2,281.00	3,649,600
北沢産業	1,300	268.00	348,400
杉本商事	900	2,482.00	2,233,800
因幡電機産業	4,900	2,451.00	12,009,900
東テク	600	2,760.00	1,656,000
ミスミグループ本社	21,600	3,425.00	73,980,000
アルテック	1,200	293.00	351,600
タキヒヨー	500	1,974.00	987,000
蔵王産業	300	1,321.00	396,300
スズケン	7,300	3,930.00	28,689,000
ジェコス	1,200	951.00	1,141,200
グローセル	1,700	429.00	729,300
ローソン	4,400	4,805.00	21,142,000
サンエー	1,400	4,175.00	5,845,000
カワチ薬品	1,300	2,914.00	3,788,200
エービーシー・マート	2,700	5,510.00	14,877,000
ハードオフコーポレーション	700	708.00	495,600
アスクル	1,800	4,220.00	7,596,000
ゲオホールディングス	3,100	1,232.00	3,819,200
アダストリア	2,400	1,874.00	4,497,600
ジーフット	1,000	412.00	412,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	418.00	83,600
くら寿司	1,000	6,630.00	6,630,000
キャンドゥ	800	1,884.00	1,507,200
パルグループホールディングス	1,800	1,210.00	2,178,000
エディオン	7,900	1,005.00	7,939,500
サーラコーポレーション	3,500	561.00	1,963,500
ワッツ	800	818.00	654,400
ハローズ	600	3,515.00	2,109,000
フジオフードグループ本社	1,500	1,380.00	2,070,000
あみやき亭	400	2,881.00	1,152,400

ひらまつ	3,200	174.00	556,800
大黒天物産	400	5,830.00	2,332,000
ハニーズホールディングス	1,500	929.00	1,393,500
ファーマライズホールディングス	400	771.00	308,400
アルペン	1,300	2,363.00	3,071,900
ハブ	500	565.00	282,500
クオールホールディングス	2,500	1,104.00	2,760,000
ジinzホールディングス	900	6,740.00	6,066,000
ビックカメラ	10,200	1,090.00	11,118,000
D C Mホールディングス	10,600	1,153.00	12,221,800
ペッパーフードサービス	1,700	298.00	506,600
Monotaro	12,300	5,300.00	65,190,000
東京一番フーズ	400	614.00	245,600
D Dホールディングス	700	606.00	424,200
きちりホールディングス	500	670.00	335,000
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,112.00	2,956,800
J . フロント リテイリング	20,600	892.00	18,375,200
ドトール・日レスホールディングス	2,500	1,520.00	3,800,000
マツモトキヨシホールディングス	7,100	4,665.00	33,121,500
ブロンコビリー	900	2,417.00	2,175,300
Z O Z O	11,900	2,659.00	31,642,100
トレジャー・ファクトリー	500	679.00	339,500
物語コーポレーション	500	12,610.00	6,305,000
ココカラファイン	1,800	7,800.00	14,040,000
三越伊勢丹ホールディングス	30,200	609.00	18,391,800
H a m e e	600	1,602.00	961,200
ウエルシアホールディングス	10,300	4,015.00	41,354,500
クリエイトSDホールディングス	2,900	3,805.00	11,034,500
丸善C H Iホールディングス	2,000	366.00	732,000
ミサワ	300	830.00	249,000
ティーライフ	300	1,141.00	342,300
エー・ピーホールディングス	300	403.00	120,900
チムニー	500	1,255.00	627,500
シュッピン	1,200	851.00	1,021,200
オイシックス・ラ・大地	1,700	2,870.00	4,879,000
ネクステージ	2,900	1,355.00	3,929,500
ジョイフル本田	5,100	1,427.00	7,277,700
鳥貴族	500	1,518.00	759,000
麒麟堂ホールディングス	200	3,485.00	697,000
ホットランド	1,300	1,290.00	1,677,000
すかいらーくホールディングス	19,400	1,637.00	31,757,800
S F Pホールディングス	1,000	1,308.00	1,308,000

綿半ホールディングス	1,300	1,340.00	1,742,000	
ヨシックス	300	1,866.00	559,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,000	1,109.00	5,545,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	896.00	806,400	
B E E N O S	800	2,534.00	2,027,200	
あさひ	1,300	1,661.00	2,159,300	
日本調剤	1,000	1,512.00	1,512,000	
コスモス薬品	1,500	17,020.00	25,530,000	
トーエル	800	782.00	625,600	
オンリー	300	455.00	136,500	
セブン&アイ・ホールディングス	67,500	3,603.00	243,202,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	9,300	606.00	5,635,800	
ツルハホールディングス	3,800	16,340.00	62,092,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,393.00	1,950,200	
フェリシモ	400	1,322.00	528,800	
トリドールホールディングス	4,300	1,394.00	5,994,200	
T O K Y O B A S E	1,600	509.00	814,400	
ウイルプラスホールディングス	200	689.00	137,800	
J Mホールディングス	1,300	2,407.00	3,129,100	
サツドラホールディングス	300	2,030.00	609,000	
アレンザホールディングス	900	1,285.00	1,156,500	
串カツ田中ホールディングス	500	1,565.00	782,500	
パロックジャパンリミテッド	1,200	665.00	798,000	
クスリのアオキホールディングス	1,500	8,840.00	13,260,000	
力の源ホールディングス	800	597.00	477,600	
スシローグローバルホールディングス	9,500	3,410.00	32,395,000	
メディカルシステムネットワーク	1,700	615.00	1,045,500	
はるやまホールディングス	800	683.00	546,400	
ノジマ	3,100	2,650.00	8,215,000	
カッパ・クリエイト	2,400	1,460.00	3,504,000	
ライトオン	1,300	608.00	790,400	
ジーンズメイト	500	314.00	157,000	
良品計画	22,900	1,991.00	45,593,900	
三城ホールディングス	1,800	297.00	534,600	
アドヴァン	2,600	1,307.00	3,398,200	
アルビス	700	2,478.00	1,734,600	
コナカ	2,000	273.00	546,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,630.00	326,000	
G - 7ホールディングス	1,000	2,303.00	2,303,000	
イオン北海道	2,300	949.00	2,182,700	
コジマ	3,000	709.00	2,127,000	

ヒマラヤ	600	947.00	568,200
コーナン商事	2,500	3,120.00	7,800,000
エコス	600	2,078.00	1,246,800
ワタミ	2,000	891.00	1,782,000
マルシェ	500	495.00	247,500
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	38,000	2,484.00	94,392,000
西松屋チェーン	3,800	1,461.00	5,551,800
ゼンショーホールディングス	8,300	2,652.00	22,011,600
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,747.00	1,921,700
ハークスレイ	400	892.00	356,800
サイゼリヤ	2,600	1,912.00	4,971,200
V Tホールディングス	7,100	388.00	2,754,800
魚力	500	1,797.00	898,500
ポプラ	400	390.00	156,000
フジ・コーポレーション	500	2,171.00	1,085,500
ユナイテッドアローズ	1,800	1,580.00	2,844,000
ハイデイ日高	2,500	1,747.00	4,367,500
京都きもの友禅	1,100	224.00	246,400
コロワイド	5,700	1,625.00	9,262,500
ピーシーデポコーポレーション	2,300	591.00	1,359,300
壱番屋	1,200	5,090.00	6,108,000
トップカルチャー	600	373.00	223,800
P L A N T	400	740.00	296,000
スギホールディングス	3,400	6,980.00	23,732,000
薬王堂ホールディングス	800	2,457.00	1,965,600
ヴィア・ホールディングス	2,100	237.00	497,700
スクロール	2,700	740.00	1,998,000
ヨンドシーホールディングス	1,800	1,914.00	3,445,200
木曽路	2,300	2,429.00	5,586,700
S R Sホールディングス	2,000	853.00	1,706,000
千趣会	3,100	343.00	1,063,300
タカキュー	1,200	135.00	162,000
リテールパートナーズ	2,300	1,399.00	3,217,700
ケーヨー	3,500	738.00	2,583,000
上新電機	2,000	2,778.00	5,556,000
日本瓦斯	2,700	5,470.00	14,769,000
ロイヤルホールディングス	3,000	1,944.00	5,832,000
東天紅	100	936.00	93,600
いなげや	2,100	1,990.00	4,179,000
島忠	2,900	5,480.00	15,892,000
チヨダ	1,800	918.00	1,652,400
ライフコーポレーション	1,300	3,550.00	4,615,000

リンガーハット	2,100	2,306.00	4,842,600
MrMaxHD	2,400	800.00	1,920,000
テンアライド	1,600	333.00	532,800
AOKIホールディングス	3,500	500.00	1,750,000
オークワ	2,700	1,307.00	3,528,900
コメリ	2,700	2,741.00	7,400,700
青山商事	3,600	500.00	1,800,000
しまむら	2,000	10,160.00	20,320,000
はせがわ	900	290.00	261,000
高島屋	12,600	850.00	10,710,000
松屋	3,500	809.00	2,831,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,200	680.00	5,576,000
近鉄百貨店	700	3,355.00	2,348,500
丸井グループ	15,800	1,912.00	30,209,600
アクシアル リテイリング	1,400	4,925.00	6,895,000
井筒屋	900	176.00	158,400
イオン	66,400	3,096.00	205,574,400
イズミ	3,500	3,760.00	13,160,000
平和堂	3,500	2,137.00	7,479,500
フジ	2,100	1,932.00	4,057,200
ヤオコー	2,000	7,050.00	14,100,000
ゼビオホールディングス	2,100	821.00	1,724,100
ケーズホールディングス	16,700	1,268.00	21,175,600
Olympicグループ	900	933.00	839,700
日産東京販売ホールディングス	2,500	252.00	630,000
シルバーライフ	200	2,266.00	453,200
一家ダイニングプロジェクト	200	536.00	107,200
Genky DrugStores	800	4,090.00	3,272,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	713.00	285,200
ブックオフグループホールディングス	1,000	840.00	840,000
ギフト	200	1,711.00	342,200
アインホールディングス	2,100	6,190.00	12,999,000
元気寿司	400	2,403.00	961,200
ヤマダホールディングス	52,600	504.00	26,510,400
アークランドサカモト	2,700	1,768.00	4,773,600
ニトリホールディングス	7,500	21,065.00	157,987,500
グルメ杵屋	1,200	1,000.00	1,200,000
愛眼	1,300	234.00	304,200
ケーユーホールディングス	900	825.00	742,500
吉野家ホールディングス	5,700	1,938.00	11,046,600
松屋フーズホールディングス	800	3,380.00	2,704,000
サガミホールディングス	2,300	1,253.00	2,881,900

関西スーパーマーケット	1,400	1,240.00	1,736,000
王将フードサービス	1,300	6,000.00	7,800,000
プレナス	1,900	1,729.00	3,285,100
ミニストップ	1,300	1,378.00	1,791,400
アークス	3,500	2,225.00	7,787,500
パローホールディングス	3,800	2,640.00	10,032,000
藤久	400	813.00	325,200
ベルク	900	6,320.00	5,688,000
大庄	900	1,039.00	935,100
ファーストリテイリング	2,300	85,140.00	195,822,000
サンドラッグ	6,500	4,410.00	28,665,000
サクスパー ホールディングス	1,500	539.00	808,500
ヤマザワ	400	1,738.00	695,200
やまや	400	2,140.00	856,000
ベルーナ	3,700	903.00	3,341,100
島根銀行	500	640.00	320,000
じもとホールディングス	1,200	878.00	1,053,600
めぶきフィナンシャルグループ	89,800	203.00	18,229,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,130.00	2,599,000
九州フィナンシャルグループ	37,800	474.00	17,917,200
ゆうちょ銀行	49,000	844.00	41,356,000
富山第一銀行	4,100	290.00	1,189,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,800	371.00	36,654,800
西日本フィナンシャルホールディングス	11,500	739.00	8,498,500
関西みらいフィナンシャルグループ	10,100	515.00	5,201,500
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,261.00	2,017,600
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	2,347.00	7,041,000
ひろぎんホールディングス	25,500	596.00	15,198,000
新生銀行	12,700	1,210.00	15,367,000
あおぞら銀行	10,300	1,851.00	19,065,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,182,800	441.80	522,561,040
りそなホールディングス	188,000	369.40	69,447,200
三井住友トラスト・ホールディングス	32,700	3,171.00	103,691,700
三井住友フィナンシャルグループ	119,600	3,067.00	366,813,200
千葉銀行	57,700	581.00	33,523,700
群馬銀行	33,200	329.00	10,922,800
武蔵野銀行	2,600	1,559.00	4,053,400
千葉興業銀行	4,700	256.00	1,203,200
筑波銀行	7,200	196.00	1,411,200
七十七銀行	5,800	1,447.00	8,392,600
青森銀行	1,300	2,492.00	3,239,600
秋田銀行	1,100	1,384.00	1,522,400

山形銀行	1,900	1,049.00	1,993,100
岩手銀行	1,100	2,115.00	2,326,500
東邦銀行	15,500	218.00	3,379,000
東北銀行	800	1,034.00	827,200
みちのく銀行	1,100	1,122.00	1,234,200
ふくおかフィナンシャルグループ	14,600	1,858.00	27,126,800
静岡銀行	42,100	753.00	31,701,300
十六銀行	2,200	1,904.00	4,188,800
スルガ銀行	17,700	332.00	5,876,400
八十二銀行	41,700	358.00	14,928,600
山梨中央銀行	2,000	763.00	1,526,000
大垣共立銀行	3,400	2,240.00	7,616,000
福井銀行	1,500	1,829.00	2,743,500
北國銀行	1,700	2,808.00	4,773,600
清水銀行	700	1,786.00	1,250,200
富山銀行	300	3,475.00	1,042,500
滋賀銀行	3,500	2,279.00	7,976,500
南都銀行	2,900	1,850.00	5,365,000
百五銀行	15,600	308.00	4,804,800
京都銀行	6,200	5,270.00	32,674,000
紀陽銀行	6,100	1,526.00	9,308,600
ほくほくフィナンシャルグループ	11,500	1,036.00	11,914,000
山陰合同銀行	10,300	546.00	5,623,800
中国銀行	14,900	848.00	12,635,200
鳥取銀行	600	1,111.00	666,600
伊予銀行	24,700	661.00	16,326,700
百十四銀行	1,800	1,542.00	2,775,600
四国銀行	2,600	699.00	1,817,400
阿波銀行	2,800	2,513.00	7,036,400
大分銀行	1,000	2,338.00	2,338,000
宮崎銀行	1,200	2,279.00	2,734,800
佐賀銀行	1,000	1,356.00	1,356,000
沖縄銀行	1,600	2,944.00	4,710,400
琉球銀行	4,000	833.00	3,332,000
セブン銀行	57,800	218.00	12,600,400
みずほフィナンシャルグループ	235,000	1,311.50	308,202,500
高知銀行	600	801.00	480,600
山口フィナンシャルグループ	21,600	628.00	13,564,800
長野銀行	600	1,388.00	832,800
名古屋銀行	1,300	2,686.00	3,491,800
北洋銀行	26,100	233.00	6,081,300
愛知銀行	600	3,105.00	1,863,000

中京銀行	700	2,015.00	1,410,500
大光銀行	600	1,214.00	728,400
愛媛銀行	2,400	1,035.00	2,484,000
トマト銀行	700	1,084.00	758,800
京葉銀行	7,400	439.00	3,248,600
栃木銀行	8,400	182.00	1,528,800
北日本銀行	500	1,934.00	967,000
東和銀行	3,000	617.00	1,851,000
福島銀行	1,600	205.00	328,000
大東銀行	900	612.00	550,800
トモニホールディングス	13,400	340.00	4,556,000
フィデアホールディングス	16,800	110.00	1,848,000
池田泉州ホールディングス	19,900	149.00	2,965,100
F P G	5,300	512.00	2,713,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	900	1,467.00	1,320,300
マーキュリアインベストメント	700	660.00	462,000
S B Iホールディングス	19,800	2,853.00	56,489,400
日本アジア投資	1,500	214.00	321,000
ジャフコ グループ	2,700	4,670.00	12,609,000
大和証券グループ本社	138,700	470.00	65,189,000
野村ホールディングス	304,300	548.80	166,999,840
岡三証券グループ	14,700	386.00	5,674,200
丸三証券	5,100	474.00	2,417,400
東洋証券	6,200	139.00	861,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,900	314.00	6,248,600
光世証券	400	657.00	262,800
水戸証券	5,000	238.00	1,190,000
いちよし証券	3,200	467.00	1,494,400
松井証券	9,900	812.00	8,038,800
マネックスグループ	12,700	327.00	4,152,900
極東証券	2,300	696.00	1,600,800
岩井コスモホールディングス	1,600	1,279.00	2,046,400
藍澤証券	3,100	725.00	2,247,500
マネーパートナーズグループ	1,800	203.00	365,400
スパークス・グループ	8,000	267.00	2,136,000
小林洋行	500	267.00	133,500
かんぽ生命保険	6,100	1,872.00	11,419,200
S O M P Oホールディングス	32,500	4,154.00	135,005,000
アニコム ホールディングス	5,700	1,053.00	6,002,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	45,200	3,126.00	141,295,200
第一生命ホールディングス	97,800	1,637.50	160,147,500
東京海上ホールディングス	61,100	5,270.00	321,997,000

T & Dホールディングス	51,700	1,206.00	62,350,200
アドバンスクリエイト	400	1,901.00	760,400
全国保証	4,900	4,735.00	23,201,500
ジェイリース	500	611.00	305,500
イントラスト	600	887.00	532,200
日本モーゲージサービス	700	1,147.00	802,900
C a s a	600	1,021.00	612,600
アルヒ	2,700	1,761.00	4,754,700
プレミアムグループ	900	2,189.00	1,970,100
クレディセゾン	12,100	1,252.00	15,149,200
芙蓉総合リース	1,800	6,560.00	11,808,000
みずほリース	2,700	3,000.00	8,100,000
東京センチュリー	3,500	7,180.00	25,130,000
日本証券金融	7,600	518.00	3,936,800
アイフル	26,400	262.00	6,916,800
リコーリース	1,400	3,045.00	4,263,000
イオンフィナンシャルサービス	10,600	1,219.00	12,921,400
アコム	34,800	471.00	16,390,800
ジャックス	1,900	1,852.00	3,518,800
オリエントコーポレーション	46,800	112.00	5,241,600
日立キャピタル	4,100	2,351.00	9,639,100
オリックス	107,300	1,569.50	168,407,350
三菱UFJリース	43,900	471.00	20,676,900
九州リースサービス	800	600.00	480,000
日本取引所グループ	49,600	2,566.50	127,298,400
イー・ギャランティ	2,000	2,069.00	4,138,000
アサックス	900	703.00	632,700
NECキャピタルソリューション	700	1,825.00	1,277,500
いちご	22,000	326.00	7,172,000
日本駐車場開発	17,100	144.00	2,462,400
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,394.00	1,254,600
ADワークスグループ	3,300	160.00	528,000
ヒューリック	36,700	1,105.00	40,553,500
三栄建築設計	700	1,567.00	1,096,900
野村不動産ホールディングス	10,500	2,289.00	24,034,500
三重交通グループホールディングス	3,500	480.00	1,680,000
サムティ	2,500	1,710.00	4,275,000
ディア・ライフ	2,400	421.00	1,010,400
コーセーアールイー	500	643.00	321,500
日本商業開発	1,100	1,731.00	1,904,100
プレサンスコーポレーション	2,800	1,751.00	4,902,800
THEグローバル社	800	317.00	253,600

ハウスコム	300	1,289.00	386,700
日本管理センター	900	1,246.00	1,121,400
サンセイランディック	500	746.00	373,000
エストラスト	200	696.00	139,200
フージャースホールディングス	3,400	730.00	2,482,000
オープンハウス	5,400	3,915.00	21,141,000
東急不動産ホールディングス	47,000	531.00	24,957,000
飯田グループホールディングス	14,400	2,057.00	29,620,800
イーランド	300	770.00	231,000
ムゲンエステート	1,100	500.00	550,000
ビーロット	800	707.00	565,600
ファーストブラザーズ	300	910.00	273,000
ハウストゥ	800	1,201.00	960,800
シーアールイー	400	1,306.00	522,400
プロパティエージェント	300	1,471.00	441,300
ケイアイスター不動産	500	2,620.00	1,310,000
アグレ都市デザイン	300	603.00	180,900
グッドコムアセット	800	1,561.00	1,248,800
ジェイ・エス・ビー	300	3,455.00	1,036,500
テンポイノベーション	400	822.00	328,800
グローバル・リンク・マネジメント	300	895.00	268,500
パーク24	9,300	1,793.00	16,674,900
パラカ	400	1,615.00	646,000
三井不動産	84,100	2,256.50	189,771,650
三菱地所	121,200	1,757.50	213,009,000
平和不動産	3,200	3,445.00	11,024,000
東京建物	17,100	1,475.00	25,222,500
ダイビル	4,500	1,317.00	5,926,500
京阪神ビルディング	2,800	1,956.00	5,476,800
住友不動産	38,900	3,478.00	135,294,200
テーオーシー	3,400	682.00	2,318,800
東京楽天地	300	4,240.00	1,272,000
レオパレス21	22,700	139.00	3,155,300
スターツコーポレーション	2,400	3,040.00	7,296,000
フジ住宅	2,000	629.00	1,258,000
空港施設	1,700	485.00	824,500
明和地所	900	528.00	475,200
ゴールドクレスト	1,400	1,560.00	2,184,000
エスリード	700	1,351.00	945,700
日神グループホールディングス	2,600	403.00	1,047,800
日本エスコン	3,100	900.00	2,790,000
タカラレーベン	7,900	313.00	2,472,700

AVANTIA	1,000	840.00	840,000
イオンモール	8,700	1,656.00	14,407,200
毎日コムネット	400	692.00	276,800
ファースト住建	700	1,024.00	716,800
ランド	94,100	9.00	846,900
カチタス	4,300	3,155.00	13,566,500
トーセイ	2,400	1,226.00	2,942,400
穴吹興産	400	1,655.00	662,000
サンフロンティア不動産	2,400	895.00	2,148,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	1,035.00	1,552,500
インテリックス	500	525.00	262,500
ランドビジネス	600	336.00	201,600
サンネクスタグループ	500	1,005.00	502,500
グランディハウス	1,300	384.00	499,200
日本空港ビルデング	5,500	6,700.00	36,850,000
明豊ファシリティワークス	800	689.00	551,200
日本工営	1,100	2,880.00	3,168,000
LIFULL	5,800	392.00	2,273,600
ミクシィ	3,200	2,565.00	8,208,000
ジェイエシーリクルートメント	1,100	1,889.00	2,077,900
日本M&Aセンター	12,800	6,630.00	84,864,000
メンバーズ	500	1,986.00	993,000
中広	200	326.00	65,200
UTグループ	2,600	3,290.00	8,554,000
アイティメディア	700	2,289.00	1,602,300
タケエイ	1,800	1,260.00	2,268,000
E・Jホールディングス	600	1,028.00	616,800
ビーネックスグループ	2,100	1,135.00	2,383,500
コシダカホールディングス	4,000	463.00	1,852,000
アルトナー	400	880.00	352,000
パソナグループ	1,800	1,935.00	3,483,000
CDS	400	1,354.00	541,600
リンクアンドモチベーション	3,100	595.00	1,844,500
GCA	2,200	740.00	1,628,000
エス・エム・エス	5,200	3,610.00	18,772,000
サニーサイドアップグループ	600	653.00	391,800
パーソルホールディングス	16,700	2,050.00	34,235,000
リニカル	800	711.00	568,800
クックパッド	5,300	318.00	1,685,400
エスクリ	500	312.00	156,000
アイ・ケイ・ケイ	800	628.00	502,400
学情	600	1,437.00	862,200

スタジオアリス	800	1,961.00	1,568,800
シミックホールディングス	800	1,357.00	1,085,600
エプコ	400	1,002.00	400,800
N J S	400	2,008.00	803,200
総合警備保障	6,700	5,410.00	36,247,000
カカクコム	12,400	2,812.00	34,868,800
アイロムグループ	600	1,690.00	1,014,000
セントケア・ホールディング	1,100	845.00	929,500
サイネックス	300	671.00	201,300
ルネサンス	900	911.00	819,900
ディップ	2,300	2,763.00	6,354,900
デジタルホールディングス	1,200	1,991.00	2,389,200
新日本科学	1,800	666.00	1,198,800
ツクイホールディングス	3,900	555.00	2,164,500
キャリアデザインセンター	400	977.00	390,800
ベネフィット・ワン	6,100	3,080.00	18,788,000
エムスリー	36,900	8,702.00	321,103,800
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	267.00	347,100
プラス	200	392.00	78,400
アウトソーシング	9,600	1,503.00	14,428,800
ウェルネット	1,700	484.00	822,800
ワールドホールディングス	600	2,094.00	1,256,400
ディー・エヌ・エー	7,100	1,925.00	13,667,500
博報堂D Yホールディングス	23,300	1,465.00	34,134,500
ぐるなび	2,900	513.00	1,487,700
タカミヤ	1,800	534.00	961,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	891.00	1,158,300
ファンコミュニケーションズ	4,600	432.00	1,987,200
ライク	600	2,042.00	1,225,200
ビジネス・ブレークスルー	700	427.00	298,900
エスプール	4,300	741.00	3,186,300
W D Bホールディングス	800	2,737.00	2,189,600
手間いらず	100	5,270.00	527,000
ティア	1,000	411.00	411,000
C D G	200	1,501.00	300,200
バリューコマース	1,100	3,425.00	3,767,500
インフォマート	16,900	892.00	15,074,800
J Pホールディングス	5,300	283.00	1,499,900
エコナックホールディングス	3,000	91.00	273,000
E P Sホールディングス	2,300	1,006.00	2,313,800
レッグス	400	1,830.00	732,000
プレステージ・インターナショナル	6,300	958.00	6,035,400

アミューズ	900	2,529.00	2,276,100
ドリームインキュベータ	500	1,455.00	727,500
クイック	1,000	1,160.00	1,160,000
T A C	1,000	238.00	238,000
ケネディクス	14,400	749.00	10,785,600
電通グループ	18,800	3,315.00	62,322,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	580.00	348,000
ぴあ	500	2,916.00	1,458,000
イオンファンタジー	600	2,364.00	1,418,400
シーティーエス	1,900	994.00	1,888,600
ネクシィーズグループ	500	856.00	428,000
H . U . グループホールディングス	4,700	2,838.00	13,338,600
アルプス技研	1,500	2,242.00	3,363,000
サニックス	2,900	262.00	759,800
ダイオーズ	300	958.00	287,400
日本空調サービス	1,800	774.00	1,393,200
オリエンタルランド	17,800	18,390.00	327,342,000
ダスキン	4,200	2,840.00	11,928,000
明光ネットワークジャパン	2,100	583.00	1,224,300
ファルコホールディングス	900	1,635.00	1,471,500
秀英予備校	400	420.00	168,000
田谷	300	545.00	163,500
ラウンドワン	4,700	949.00	4,460,300
リゾートトラスト	7,700	1,628.00	12,535,600
ビー・エム・エル	2,200	3,415.00	7,513,000
ワタベウェディング	200	274.00	54,800
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,331.00	3,859,900
リソー教育	7,700	312.00	2,402,400
早稲田アカデミー	700	982.00	687,400
ユー・エス・エス	18,800	2,082.00	39,141,600
東京個別指導学院	600	623.00	373,800
サイバーエージェント	10,300	6,930.00	71,379,000
楽天	78,100	1,007.00	78,646,700
クリーク・アンド・リバー社	900	1,039.00	935,100
モーニングスター	1,800	453.00	815,400
テー・オー・ダブリュ	2,700	282.00	761,400
山田コンサルティンググループ	1,100	975.00	1,072,500
セントラルスポーツ	600	2,223.00	1,333,800
フルキャストホールディングス	1,500	1,795.00	2,692,500
エン・ジャパン	3,000	3,450.00	10,350,000
リソルホールディングス	200	3,795.00	759,000
テクノプロ・ホールディングス	3,300	8,320.00	27,456,000

アトラ	400	323.00	129,200
インターワークス	300	332.00	99,600
アイ・アールジャパンホールディングス	700	15,280.00	10,696,000
K e e P e r 技研	1,200	2,070.00	2,484,000
ファーストロジック	300	774.00	232,200
三機サービス	300	972.00	291,600
G u n o s y	1,000	722.00	722,000
デザインワン・ジャパン	400	215.00	86,000
イー・ガーディアン	700	3,030.00	2,121,000
リブセンス	900	239.00	215,100
ジャパンマテリアル	5,200	1,418.00	7,373,600
ベクトル	2,100	932.00	1,957,200
ウチヤマホールディングス	800	302.00	241,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,202.00	1,682,800
キャリアリンク	500	1,876.00	938,000
I B J	1,400	833.00	1,166,200
アサンテ	700	1,448.00	1,013,600
N・フィールド	1,200	784.00	940,800
バリューHR	700	1,695.00	1,186,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,400	6,320.00	8,848,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,921.00	1,152,600
E R Iホールディングス	500	676.00	338,000
アビスト	300	3,020.00	906,000
シグマクシス	1,100	1,765.00	1,941,500
ウィルグループ	1,100	1,007.00	1,107,700
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	2,500	313.00	782,500
メドピア	800	6,390.00	5,112,000
リクルートホールディングス	120,000	4,187.00	502,440,000
エラン	1,200	3,065.00	3,678,000
土木管理総合試験所	800	355.00	284,000
ネットマーケティング	600	577.00	346,200
日本郵政	137,300	770.00	105,721,000
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,726.00	4,832,800
鎌倉新書	1,300	950.00	1,235,000
S M N	400	750.00	300,000
一蔵	200	362.00	72,400
L I T A L I C O	600	3,460.00	2,076,000
グローバルキッズCOMPANY	300	946.00	283,800
エアトリ	900	1,347.00	1,212,300
ハイアス・アンド・カンパニー	900	172.00	154,800
アトラエ	500	2,717.00	1,358,500
ストライク	600	5,950.00	3,570,000

ソラスト	4,600	1,473.00	6,775,800
セラク	500	2,197.00	1,098,500
インソース	700	3,430.00	2,401,000
ベイカレント・コンサルティング	1,000	15,650.00	15,650,000
Orchestra Holdings	300	2,320.00	696,000
アイモパイル	600	1,177.00	706,200
キャリアインデックス	700	738.00	516,600
MS - Japan	500	840.00	420,000
船場	300	904.00	271,200
グレイステクノロジー	800	6,840.00	5,472,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,900	4,660.00	8,854,000
フルテック	200	1,468.00	293,600
グリーンズ	400	489.00	195,600
ツナググループ・ホールディングス	300	342.00	102,600
GameWith	500	574.00	287,000
ソウルドアウト	400	1,535.00	614,000
MS&Consulting	300	612.00	183,600
エル・ティー・エス	100	4,415.00	441,500
ミダック	200	3,195.00	639,000
日総工産	1,100	765.00	841,500
キュービーネットホールディングス	700	1,534.00	1,073,800
RPAホールディングス	1,300	635.00	825,500
スプリックス	500	793.00	396,500
マネジメントソリューションズ	800	1,384.00	1,107,200
プロレド・パートナーズ	200	4,250.00	850,000
and factory	200	802.00	160,400
フロンティア・マネジメント	100	4,915.00	491,500
ピアラ	100	2,234.00	223,400
コプロ・ホールディングス	100	3,100.00	310,000
ギークス	200	1,125.00	225,000
カーブスホールディングス	4,600	788.00	3,624,800
フォーラムエンジニアリング	900	857.00	771,300
ダイレクトマーケティングミックス	700	2,863.00	2,004,100
アドバンテッジリスクマネジメント	800	663.00	530,400
リログループ	9,200	2,622.00	24,122,400
東祥	1,000	1,640.00	1,640,000
エイチ・アイ・エス	2,400	1,750.00	4,200,000
ラックランド	500	2,375.00	1,187,500
共立メンテナンス	2,800	3,920.00	10,976,000
イチネンホールディングス	1,900	1,279.00	2,430,100
建設技術研究所	1,100	2,112.00	2,323,200
スペース	1,100	796.00	875,600

長大	700	1,400.00	980,000	
燦ホールディングス	700	1,259.00	881,300	
スバル興業	100	8,460.00	846,000	
東京テアトル	700	1,293.00	905,100	
タナベ経営	300	1,325.00	397,500	
ナガワ	500	8,950.00	4,475,000	
よみうりランド	300	6,040.00	1,812,000	
東京都競馬	1,100	5,060.00	5,566,000	
常盤興産	700	1,431.00	1,001,700	
カナモト	3,000	2,282.00	6,846,000	
東京ドーム	6,800	1,302.00	8,853,600	
西尾レントオール	1,500	2,148.00	3,222,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	9,200	25.00	230,000	
トランス・コスモス	1,600	2,737.00	4,379,200	
乃村工藝社	7,200	850.00	6,120,000	
藤田観光	700	1,495.00	1,046,500	
KNT-CTホールディングス	1,000	993.00	993,000	
日本管財	1,800	2,031.00	3,655,800	
トーカイ	1,600	2,077.00	3,323,200	
白洋舎	200	2,463.00	492,600	
セコム	17,800	9,699.00	172,642,200	
セントラル警備保障	800	3,620.00	2,896,000	
丹青社	3,200	851.00	2,723,200	
メイテック	2,100	5,110.00	10,731,000	
応用地質	2,000	1,241.00	2,482,000	
船井総研ホールディングス	3,500	2,576.00	9,016,000	
進学会ホールディングス	700	434.00	303,800	
オオバ	1,200	749.00	898,800	
いであ	400	1,811.00	724,400	
学究社	500	1,271.00	635,500	
ベネッセホールディングス	5,600	2,099.00	11,754,400	
イオンディライト	2,100	2,593.00	5,445,300	
ナック	900	928.00	835,200	
ダイセキ	2,800	3,110.00	8,708,000	
ステップ	600	1,599.00	959,400	
合計	18,560,300		43,127,506,790	

## (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）

2020年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	194,841,980
コール・ローン	145,636,016
国債証券	28,733,100,708
派生商品評価勘定	306,549
未収入金	160,620,000
未収利息	146,684,306
前払費用	8,718,928
流動資産合計	29,389,908,487
資産合計	29,389,908,487
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,575
未払金	380,517,967
未払解約金	4,002,000
未払利息	395
流動負債合計	384,569,937
負債合計	384,569,937
純資産の部	
元本等	
元本	27,229,225,343
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,776,113,207
元本等合計	29,005,338,550
純資産合計	29,005,338,550
負債純資産合計	29,389,908,487

#### 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

法	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	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12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	14,539,859,270円
期中一部解約元本額	16,134,407,800円
期末元本額	27,229,225,343円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,828,694,046円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	490,879,165円
りそなラップ型ファンド(成長型)	267,626,808円
DCりそな グローバルバランス	67,264,483円
つみたてバランスファンド	483,861,549円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	780,872,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	163,251,253円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	37,990,822円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,672,490円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,105,882円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	469,336円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	141,784円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	91,186,853円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	320,051,276円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	126,340,952円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	18,772,647,757円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	568,144,779円
Smart-i 8資産バランス 安定型	303,404,704円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	159,617,174円
Smart-i 8資産バランス 成長型	62,198,492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)	762,168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)	687,040,658円
2. 計算日における受益権の総数	27,229,225,343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	1.0652円
(10,000口当たり純資産額)	(10,652円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020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、運用評価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

2020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	<p>国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		609,212,739
合計		609,212,739

(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)

(2020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	244,904,344	-	245,161,318	256,974
	米ドル	105,486,343	-	105,686,262	199,919
	カナダドル	4,715,692	-	4,717,720	2,028
	メキシコペソ	3,950,700	-	3,930,000	20,700
	ユーロ	103,333,834	-	103,307,997	25,837
	英ポンド	13,589,759	-	13,639,188	49,429
	オーストラリアドル	6,106,050	-	6,138,951	32,901
シンガポールドル	5,804,588	-	5,818,800	14,212	

	イスラエルシェケル	1,917,378	-	1,922,400	5,022
	合計	244,904,344	-	245,161,318	256,974

(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	590,000.00	599,461.12	
		US TREASURY N/B	600,000.00	610,324.68	
		US TREASURY N/B	700,000.00	709,529.66	
		US TREASURY N/B	500,000.00	512,727.35	
		US TREASURY N/B	560,000.00	571,172.50	
		US TREASURY N/B	500,000.00	507,983.10	
		US TREASURY N/B	600,000.00	615,679.68	
		US TREASURY N/B	380,000.00	386,019.12	
		US TREASURY N/B	490,000.00	499,800.00	
		US TREASURY N/B	500,000.00	507,187.50	

US TREASURY N/B	340,000.00	347,570.30
US TREASURY N/B	470,000.00	479,372.45
US TREASURY N/B	320,000.00	326,856.22
US TREASURY N/B	700,000.00	719,865.23
US TREASURY N/B	410,000.00	418,696.46
US TREASURY N/B	460,000.00	470,457.77
US TREASURY N/B	500,000.00	514,257.80
US TREASURY N/B	470,000.00	480,584.16
US TREASURY N/B	700,000.00	716,966.74
US TREASURY N/B	430,000.00	439,952.13
US TREASURY N/B	510,000.00	523,078.69
US TREASURY N/B	550,000.00	563,073.22
US TREASURY N/B	470,000.00	481,419.49
US TREASURY N/B	390,000.00	402,027.52
US TREASURY N/B	410,000.00	420,257.99
US TREASURY N/B	650,000.00	649,796.87
US TREASURY N/B	450,000.00	461,531.25
US TREASURY N/B	360,000.00	370,940.61
US TREASURY N/B	400,000.00	411,351.56
US TREASURY N/B	270,000.00	276,728.88
US TREASURY N/B	390,000.00	401,585.73
US TREASURY N/B	480,000.00	492,196.84
US TREASURY N/B	560,000.00	573,300.00
US TREASURY N/B	520,000.00	535,031.22
US TREASURY N/B	350,000.00	360,855.46
US TREASURY N/B	600,000.00	599,695.26
US TREASURY N/B	430,000.00	439,716.96
US TREASURY N/B	430,000.00	444,016.96
US TREASURY N/B	410,000.00	424,317.93
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,367,899.68
US TREASURY N/B	670,000.00	694,483.74
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,818,567.72
US TREASURY N/B	460,000.00	473,611.30
US TREASURY N/B	720,000.00	749,137.46
US TREASURY N/B	560,000.00	575,804.65

US TREASURY N/B	400,000.00	413,726.56	
US TREASURY N/B	560,000.00	586,523.39	
US TREASURY N/B	650,000.00	676,126.94	
US TREASURY N/B	300,000.00	308,906.25	
US TREASURY N/B	390,000.00	401,958.96	
US TREASURY N/B	410,000.00	432,037.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	701,421.84	
US TREASURY N/B	490,000.00	507,054.25	
US TREASURY N/B	420,000.00	445,872.63	
US TREASURY N/B	640,000.00	664,549.95	
US TREASURY N/B	530,000.00	529,399.56	
US TREASURY N/B	320,000.00	331,487.48	
US TREASURY N/B	400,000.00	425,406.24	
US TREASURY N/B	520,000.00	520,954.66	
US TREASURY N/B	470,000.00	484,393.75	
US TREASURY N/B	550,000.00	584,331.99	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,265.60	
US TREASURY N/B	320,000.00	341,681.24	
US TREASURY N/B	460,000.00	488,624.19	
US TREASURY N/B	530,000.00	547,214.60	
US TREASURY N/B	130,000.00	139,054.29	
US TREASURY N/B	540,000.00	557,929.67	
US TREASURY N/B	480,000.00	516,037.48	
US TREASURY N/B	400,000.00	399,156.24	
US TREASURY N/B	540,000.00	562,338.23	
US TREASURY N/B	150,000.00	161,575.18	
US TREASURY N/B	710,000.00	763,166.78	
US TREASURY N/B	440,000.00	465,162.50	
US TREASURY N/B	340,000.00	366,947.65	
US TREASURY N/B	140,000.00	148,717.18	
US TREASURY N/B	450,000.00	483,082.02	
US TREASURY N/B	420,000.00	446,848.79	
US TREASURY N/B	690,000.00	745,523.40	
US TREASURY N/B	490,000.00	519,897.64	
US TREASURY N/B	340,000.00	363,414.81	

US TREASURY N/B	350,000.00	371,765.62	
US TREASURY N/B	320,000.00	339,049.98	
US TREASURY N/B	700,000.00	747,468.75	
US TREASURY N/B	850,000.00	915,642.52	
US TREASURY N/B	60,000.00	63,644.52	
US TREASURY N/B	390,000.00	414,131.25	
US TREASURY N/B	420,000.00	442,246.85	
US TREASURY N/B	220,000.00	234,867.18	
US TREASURY N/B	420,000.00	442,607.80	
US TREASURY N/B	790,000.00	851,348.39	
US TREASURY N/B	400,000.00	423,750.00	
US TREASURY N/B	600,000.00	621,632.76	
US TREASURY N/B	220,000.00	235,314.04	
US TREASURY N/B	710,000.00	742,684.92	
US TREASURY N/B	310,000.00	333,516.38	
US TREASURY N/B	530,000.00	554,802.30	
US TREASURY N/B	750,000.00	807,421.87	
US TREASURY N/B	400,000.00	428,875.00	
US TREASURY N/B	450,000.00	471,287.07	
US TREASURY N/B	400,000.00	431,375.00	
US TREASURY N/B	400,000.00	423,187.48	
US TREASURY N/B	430,000.00	468,700.00	
US TREASURY N/B	550,000.00	573,826.16	
US TREASURY N/B	730,000.00	780,843.33	
US TREASURY N/B	340,000.00	374,584.35	
US TREASURY N/B	250,000.00	274,492.17	
US TREASURY N/B	600,000.00	604,101.54	
US TREASURY N/B	250,000.00	277,568.35	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,061,283.55	
US TREASURY N/B	570,000.00	614,575.76	
US TREASURY N/B	240,000.00	266,878.10	
US TREASURY N/B	700,000.00	696,718.75	
US TREASURY N/B	290,000.00	321,299.58	
US TREASURY N/B	470,000.00	524,086.70	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,140,121.05	

US TREASURY N/B	310,000.00	344,390.62
US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,710.90
US TREASURY N/B	230,000.00	258,579.29
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,171,979.65
US TREASURY N/B	570,000.00	641,762.08
US TREASURY N/B	770,000.00	764,465.62
US TREASURY N/B	450,000.00	490,640.62
US TREASURY N/B	480,000.00	538,387.48
US TREASURY N/B	300,000.00	333,234.36
US TREASURY N/B	330,000.00	367,021.87
US TREASURY N/B	670,000.00	711,063.63
US TREASURY N/B	350,000.00	387,296.87
US TREASURY N/B	430,000.00	470,648.41
US TREASURY N/B	450,000.00	496,054.66
US TREASURY N/B	730,000.00	775,539.44
US TREASURY N/B	470,000.00	512,171.45
US TREASURY N/B	450,000.00	484,541.01
US TREASURY N/B	590,000.00	635,632.78
US TREASURY N/B	610,000.00	644,360.14
US TREASURY N/B	320,000.00	335,800.00
US TREASURY N/B	400,000.00	425,515.60
US TREASURY N/B	650,000.00	691,589.79
US TREASURY N/B	850,000.00	923,279.26
US TREASURY N/B	300,000.00	319,218.75
US TREASURY N/B	290,000.00	310,889.04
US TREASURY N/B	840,000.00	926,592.15
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,123,511.31
US TREASURY N/B	580,000.00	645,748.39
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,500,149.51
US TREASURY N/B	730,000.00	724,667.56
US TREASURY N/B	800,000.00	885,156.24
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,048,240.57
US TREASURY N/B	690,000.00	764,579.27
US TREASURY N/B	850,000.00	973,283.15
US TREASURY N/B	840,000.00	971,840.60

US TREASURY N/B	120,000.00	162,993.74
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,356,971.38
US TREASURY N/B	890,000.00	1,051,972.96
US TREASURY N/B	310,000.00	420,510.13
US TREASURY N/B	730,000.00	836,163.60
US TREASURY N/B	680,000.00	766,633.56
US TREASURY N/B	560,000.00	597,384.36
US TREASURY N/B	710,000.00	765,413.22
US TREASURY N/B	560,000.00	590,821.84
US TREASURY N/B	120,000.00	178,889.05
US TREASURY N/B	860,000.00	838,365.58
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,565,221.87
US TREASURY N/B	400,000.00	397,593.71
US TREASURY N/B	200,000.00	287,375.00
US TREASURY N/B	80,000.00	117,268.74
US TREASURY N/B	90,000.00	140,797.26
US TREASURY N/B	30,000.00	44,497.26
US TREASURY N/B	100,000.00	150,738.28
US TREASURY N/B	70,000.00	94,808.98
US TREASURY N/B	140,000.00	207,112.50
US TREASURY N/B	190,000.00	289,831.62
US TREASURY N/B	40,000.00	60,301.56
US TREASURY N/B	190,000.00	295,427.73
US TREASURY N/B	210,000.00	318,084.37
US TREASURY N/B	650,000.00	613,234.37
US TREASURY N/B	150,000.00	214,265.62
US TREASURY N/B	850,000.00	799,664.02
US TREASURY N/B	210,000.00	314,598.03
US TREASURY N/B	550,000.00	540,160.11
US TREASURY N/B	230,000.00	366,400.76
US TREASURY N/B	50,000.00	76,398.43
US TREASURY N/B	230,000.00	325,503.88
US TREASURY N/B	130,000.00	169,238.66
US TREASURY N/B	180,000.00	234,871.86
US TREASURY N/B	80,000.00	102,384.36

US TREASURY N/B	300,000.00	369,937.50	
US TREASURY N/B	290,000.00	357,243.75	
US TREASURY N/B	320,000.00	417,724.99	
US TREASURY N/B	360,000.00	452,573.42	
US TREASURY N/B	360,000.00	505,828.11	
US TREASURY N/B	320,000.00	458,187.48	
US TREASURY N/B	410,000.00	577,283.19	
US TREASURY N/B	390,000.00	530,278.12	
US TREASURY N/B	430,000.00	563,736.70	
US TREASURY N/B	380,000.00	488,626.53	
US TREASURY N/B	510,000.00	603,871.87	
US TREASURY N/B	390,000.00	502,551.54	
US TREASURY N/B	410,000.00	518,169.50	
US TREASURY N/B	290,000.00	374,643.75	
US TREASURY N/B	530,000.00	628,588.26	
US TREASURY N/B	460,000.00	545,531.25	
US TREASURY N/B	370,000.00	419,212.87	
US TREASURY N/B	350,000.00	443,994.11	
US TREASURY N/B	440,000.00	571,278.09	
US TREASURY N/B	210,000.00	272,917.95	
US TREASURY N/B	380,000.00	473,010.92	
US TREASURY N/B	420,000.00	523,260.90	
US TREASURY N/B	520,000.00	677,381.22	
US TREASURY N/B	530,000.00	706,183.55	
US TREASURY N/B	630,000.00	822,297.60	
US TREASURY N/B	560,000.00	780,718.73	
US TREASURY N/B	640,000.00	837,524.99	
US TREASURY N/B	590,000.00	755,568.75	
US TREASURY N/B	680,000.00	771,481.21	
US TREASURY N/B	530,000.00	617,160.14	
US TREASURY N/B	630,000.00	677,889.82	
US TREASURY N/B	780,000.00	699,867.16	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	953,796.06	
US TREASURY N/B	340,000.00	335,006.24	
米ドル 小計	109,720,000.00	118,779,146.21	

カナダドル	GOV OF CANADA	100,000.00	101,506.00
	GOV OF CANADA	210,000.00	210,789.60
	GOV OF CANADA	200,000.00	203,590.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	124,482.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	150,054.00
	GOV OF CANADA	380,000.00	385,000.80
	GOV OF CANADA	290,000.00	289,921.70
	GOV OF CANADA	300,000.00	309,861.00
	GOV OF CANADA	270,000.00	278,129.70
	GOV OF CANADA	340,000.00	355,755.60
	GOV OF CANADA	210,000.00	223,001.10
	GOV OF CANADA	160,000.00	171,964.80
	GOV OF CANADA	170,000.00	177,223.30
	GOV OF CANADA	200,000.00	207,190.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	162,181.50
	GOV OF CANADA	460,000.00	461,237.40
	GOV OF CANADA	60,000.00	59,277.00
	GOV OF CANADA	180,000.00	189,714.60
	GOV OF CANADA	120,000.00	123,457.20
	GOV OF CANADA	60,000.00	88,363.80
	GOV OF CANADA	150,000.00	165,363.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	170,002.80
	GOV OF CANADA	110,000.00	124,270.30
	GOV OF CANADA	540,000.00	564,246.00
	GOV OF CANADA	170,000.00	165,068.30
	GOV OF CANADA	130,000.00	204,250.80
	GOV OF CANADA	120,000.00	192,214.80
	GOV OF CANADA	140,000.00	213,014.20
	GOV OF CANADA	180,000.00	267,856.20
	GOV OF CANADA	150,000.00	202,138.50
GOV OF CANADA	320,000.00	377,126.40	
GOV OF CANADA	60,000.00	89,003.40	
	カナダドル 小計	6,320,000.00	7,007,255.80 (570,040,259)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	2,630,000.00	2,703,769.13

	UNITED MEXICAN STATE	3,680,000.00	3,791,391.76
	UNITED MEXICAN STATE	3,670,000.00	3,854,894.60
	UNITED MEXICAN STATE	2,970,000.00	3,261,832.20
	UNITED MEXICAN STATE	2,850,000.00	3,186,214.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,220,000.00	3,849,027.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,410,000.00	3,549,775.90
	UNITED MEXICAN STATE	3,690,000.00	4,176,637.20
	UNITED MEXICAN STATE	4,150,000.00	5,040,465.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,850,000.00	2,163,612.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,110,000.00	1,296,713.10
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	1,217,356.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,420,000.00	2,943,325.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,700,000.00	3,039,930.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,100,000.00	2,416,554.00
	メキシコペソ 小計	41,330,000.00	46,491,498.69 (244,080,368)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	95,372.82
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	182,385.00
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	64,865.62
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	122,082.00
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	132,514.72
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	160,830.00
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	112,952.95
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	131,296.93
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	153,334.58
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	155,949.60
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	195,300.36
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,967.00
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	190,625.79
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	142,797.46
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	152,037.20
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	166,957.92
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	164,215.23
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	309,895.56
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	40,514.32

GOV OF AUSTRIA	90,000.00	159,235.44
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	139,196.10
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	60,221.40
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	123,077.35
GOV OF AUSTRIA	74,000.00	168,093.68
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	68,444.64
GOV OF BELGIUM	180,000.00	191,190.60
GOV OF BELGIUM	210,000.00	229,175.41
GOV OF BELGIUM	160,000.00	172,388.00
GOV OF BELGIUM	160,000.00	164,420.53
GOV OF BELGIUM	190,000.00	212,813.49
GOV OF BELGIUM	160,000.00	167,772.19
GOV OF BELGIUM	260,000.00	278,090.80
GOV OF BELGIUM	130,000.00	166,290.41
GOV OF BELGIUM	250,000.00	273,386.69
GOV OF BELGIUM	170,000.00	186,019.10
GOV OF BELGIUM	90,000.00	93,683.25
GOV OF BELGIUM	260,000.00	377,847.86
GOV OF BELGIUM	190,000.00	209,821.75
GOV OF BELGIUM	210,000.00	235,262.79
GOV OF BELGIUM	170,000.00	178,422.87
GOV OF BELGIUM	190,000.00	217,440.94
GOV OF BELGIUM	50,000.00	74,873.15
GOV OF BELGIUM	140,000.00	166,691.00
GOV OF BELGIUM	120,000.00	172,502.40
GOV OF BELGIUM	260,000.00	455,181.22
GOV OF BELGIUM	60,000.00	74,778.18
GOV OF BELGIUM	100,000.00	133,416.80
GOV OF BELGIUM	80,000.00	84,688.40
GOV OF BELGIUM	220,000.00	402,494.40
GOV OF BELGIUM	140,000.00	258,160.56
GOV OF BELGIUM	140,000.00	187,368.78
GOV OF BELGIUM	100,000.00	138,995.00
GOV OF BELGIUM	80,000.00	130,992.08
GOV OF BELGIUM	90,000.00	153,191.97

GOV OF FINLAND	60,000.00	60,615.24	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,563.44	
GOV OF FINLAND	90,000.00	94,834.26	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,262.46	
GOV OF FINLAND	90,000.00	98,407.71	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,413.75	
GOV OF FINLAND	80,000.00	97,621.40	
GOV OF FINLAND	50,000.00	53,872.25	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,861.74	
GOV OF FINLAND	80,000.00	86,160.00	
GOV OF FINLAND	60,000.00	75,510.00	
GOV OF FINLAND	60,000.00	65,064.84	
GOV OF FINLAND	80,000.00	87,205.77	
GOV OF FINLAND	50,000.00	52,159.20	
GOV OF FINLAND	60,000.00	67,418.52	
GOV OF FINLAND	50,000.00	59,460.20	
GOV OF FINLAND	40,000.00	41,970.86	
GOV OF FINLAND	50,000.00	53,450.75	
GOV OF FINLAND	60,000.00	96,149.34	
GOV OF FINLAND	50,000.00	69,008.65	
GOV OF FRANCE	430,000.00	433,854.09	
GOV OF FRANCE	580,000.00	610,045.16	
GOV OF FRANCE	500,000.00	505,567.50	
GOV OF FRANCE	480,000.00	507,442.08	
GOV OF FRANCE	300,000.00	305,035.20	
GOV OF FRANCE	540,000.00	549,541.80	
GOV OF FRANCE	620,000.00	658,775.42	
GOV OF FRANCE	560,000.00	642,003.37	
GOV OF FRANCE	530,000.00	543,244.70	
GOV OF FRANCE	440,000.00	486,309.50	
GOV OF FRANCE	460,000.00	506,016.10	
GOV OF FRANCE	570,000.00	587,430.80	
GOV OF FRANCE	620,000.00	653,845.80	
GOV OF FRANCE	340,000.00	453,333.22	
GOV OF FRANCE	490,000.00	531,581.40	

GOV OF FRANCE	320,000.00	330,954.24	
GOV OF FRANCE	520,000.00	638,773.72	
GOV OF FRANCE	510,000.00	542,792.38	
GOV OF FRANCE	550,000.00	579,241.85	
GOV OF FRANCE	430,000.00	475,365.00	
GOV OF FRANCE	680,000.00	839,818.76	
GOV OF FRANCE	580,000.00	637,094.37	
GOV OF FRANCE	430,000.00	474,204.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	939,132.60	
GOV OF FRANCE	360,000.00	390,418.20	
GOV OF FRANCE	660,000.00	686,246.22	
GOV OF FRANCE	630,000.00	807,861.21	
GOV OF FRANCE	400,000.00	414,770.00	
GOV OF FRANCE	570,000.00	682,428.51	
GOV OF FRANCE	440,000.00	762,989.92	
GOV OF FRANCE	470,000.00	561,735.01	
GOV OF FRANCE	410,000.00	705,314.80	
GOV OF FRANCE	570,000.00	688,395.84	
GOV OF FRANCE	360,000.00	622,315.80	
GOV OF FRANCE	310,000.00	411,346.75	
GOV OF FRANCE	100,000.00	108,331.70	
GOV OF FRANCE	440,000.00	837,306.80	
GOV OF FRANCE	380,000.00	659,539.40	
GOV OF FRANCE	370,000.00	541,931.97	
GOV OF FRANCE	390,000.00	522,658.50	
GOV OF FRANCE	310,000.00	347,519.30	
GOV OF FRANCE	220,000.00	480,087.08	
GOV OF FRANCE	190,000.00	440,327.47	
GOV OF FRANCE	160,000.00	247,364.80	
GOV OF GERMANY	220,000.00	221,723.70	
GOV OF GERMANY	180,000.00	185,377.14	
GOV OF GERMANY	230,000.00	232,212.60	
GOV OF GERMANY	330,000.00	333,401.64	
GOV OF GERMANY	90,000.00	91,045.80	
GOV OF GERMANY	360,000.00	374,496.48	

GOV OF GERMANY	260,000.00	270,497.50	
GOV OF GERMANY	240,000.00	243,323.30	
GOV OF GERMANY	290,000.00	294,292.23	
GOV OF GERMANY	270,000.00	283,816.17	
GOV OF GERMANY	260,000.00	265,031.78	
GOV OF GERMANY	250,000.00	264,224.90	
GOV OF GERMANY	340,000.00	366,024.48	
GOV OF GERMANY	270,000.00	276,426.09	
GOV OF GERMANY	320,000.00	346,554.56	
GOV OF GERMANY	360,000.00	369,851.61	
GOV OF GERMANY	360,000.00	389,052.00	
GOV OF GERMANY	290,000.00	309,793.66	
GOV OF GERMANY	360,000.00	371,353.32	
GOV OF GERMANY	310,000.00	327,421.38	
GOV OF GERMANY	300,000.00	310,653.60	
GOV OF GERMANY	320,000.00	347,699.84	
GOV OF GERMANY	480,000.00	498,914.40	
GOV OF GERMANY	410,000.00	438,385.12	
GOV OF GERMANY	370,000.00	387,046.64	
GOV OF GERMANY	460,000.00	490,024.66	
GOV OF GERMANY	140,000.00	208,985.14	
GOV OF GERMANY	360,000.00	391,163.83	
GOV OF GERMANY	340,000.00	357,650.59	
GOV OF GERMANY	170,000.00	249,219.23	
GOV OF GERMANY	360,000.00	392,909.06	
GOV OF GERMANY	190,000.00	271,585.62	
GOV OF GERMANY	350,000.00	376,789.00	
GOV OF GERMANY	340,000.00	366,980.55	
GOV OF GERMANY	350,000.00	370,768.65	
GOV OF GERMANY	210,000.00	346,769.43	
GOV OF GERMANY	310,000.00	328,728.65	
GOV OF GERMANY	420,000.00	445,521.37	
GOV OF GERMANY	300,000.00	491,963.10	
GOV OF GERMANY	280,000.00	488,149.38	
GOV OF GERMANY	320,000.00	339,703.68	

GOV OF GERMANY	370,000.00	643,942.45	
GOV OF GERMANY	260,000.00	492,893.18	
GOV OF GERMANY	250,000.00	511,200.00	
GOV OF GERMANY	250,000.00	451,680.00	
GOV OF GERMANY	360,000.00	606,724.56	
GOV OF GERMANY	390,000.00	675,718.55	
GOV OF GERMANY	350,000.00	496,380.35	
GOV OF GERMANY	230,000.00	243,001.44	
GOV OF IRELAND	90,000.00	91,743.48	
GOV OF IRELAND	60,000.00	60,823.74	
GOV OF IRELAND	90,000.00	99,550.44	
GOV OF IRELAND	110,000.00	124,902.14	
GOV OF IRELAND	140,000.00	176,601.74	
GOV OF IRELAND	160,000.00	174,122.00	
GOV OF IRELAND	110,000.00	115,156.25	
GOV OF IRELAND	100,000.00	110,365.50	
GOV OF IRELAND	120,000.00	135,546.85	
GOV OF IRELAND	120,000.00	151,828.50	
GOV OF IRELAND	80,000.00	84,110.08	
GOV OF IRELAND	70,000.00	82,107.48	
GOV OF IRELAND	60,000.00	71,320.74	
GOV OF IRELAND	90,000.00	96,429.60	
GOV OF IRELAND	80,000.00	102,645.68	
GOV OF IRELAND	100,000.00	143,431.20	
GOV OF IRELAND	80,000.00	106,900.88	
GOV OF ITALY	140,000.00	143,780.34	
GOV OF ITALY	260,000.00	277,444.18	
GOV OF ITALY	210,000.00	214,558.55	
GOV OF ITALY	250,000.00	256,050.67	
GOV OF ITALY	210,000.00	214,986.87	
GOV OF ITALY	270,000.00	276,129.00	
GOV OF ITALY	230,000.00	253,677.58	
GOV OF ITALY	210,000.00	217,137.90	
GOV OF ITALY	340,000.00	378,131.00	
GOV OF ITALY	180,000.00	181,812.96	

GOV OF ITALY	240,000.00	247,210.56	
GOV OF ITALY	200,000.00	206,168.70	
GOV OF ITALY	250,000.00	279,537.50	
GOV OF ITALY	180,000.00	184,545.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	386,607.43	
GOV OF ITALY	100,000.00	101,763.30	
GOV OF ITALY	340,000.00	366,945.00	
GOV OF ITALY	400,000.00	411,523.47	
GOV OF ITALY	150,000.00	151,281.45	
GOV OF ITALY	130,000.00	150,119.85	
GOV OF ITALY	230,000.00	246,588.75	
GOV OF ITALY	350,000.00	374,659.25	
GOV OF ITALY	270,000.00	309,956.22	
GOV OF ITALY	200,000.00	213,030.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	276,700.25	
GOV OF ITALY	300,000.00	306,474.00	
GOV OF ITALY	290,000.00	353,415.48	
GOV OF ITALY	200,000.00	213,859.00	
GOV OF ITALY	240,000.00	257,425.44	
GOV OF ITALY	240,000.00	261,298.56	
GOV OF ITALY	220,000.00	247,771.70	
GOV OF ITALY	330,000.00	363,831.60	
GOV OF ITALY	80,000.00	82,098.29	
GOV OF ITALY	270,000.00	333,460.53	
GOV OF ITALY	240,000.00	260,736.72	
GOV OF ITALY	300,000.00	334,470.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	299,404.28	
GOV OF ITALY	390,000.00	407,147.13	
GOV OF ITALY	210,000.00	237,494.46	
GOV OF ITALY	240,000.00	269,420.16	
GOV OF ITALY	160,000.00	167,836.18	
GOV OF ITALY	350,000.00	499,692.90	
GOV OF ITALY	370,000.00	415,830.42	
GOV OF ITALY	300,000.00	401,135.19	
GOV OF ITALY	280,000.00	334,324.11	

GOV OF ITALY	250,000.00	305,325.45	
GOV OF ITALY	360,000.00	511,977.92	
GOV OF ITALY	320,000.00	408,220.16	
GOV OF ITALY	280,000.00	302,909.88	
GOV OF ITALY	260,000.00	271,291.80	
GOV OF ITALY	330,000.00	365,591.75	
GOV OF ITALY	260,000.00	268,410.63	
GOV OF ITALY	270,000.00	417,171.60	
GOV OF ITALY	330,000.00	365,623.09	
GOV OF ITALY	260,000.00	411,242.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	336,283.24	
GOV OF ITALY	310,000.00	475,704.45	
GOV OF ITALY	180,000.00	239,034.27	
GOV OF ITALY	230,000.00	246,344.95	
GOV OF ITALY	230,000.00	273,150.30	
GOV OF ITALY	340,000.00	490,157.26	
GOV OF ITALY	190,000.00	247,215.65	
GOV OF ITALY	270,000.00	446,944.82	
GOV OF ITALY	200,000.00	266,391.20	
GOV OF ITALY	280,000.00	468,090.00	
GOV OF ITALY	150,000.00	165,429.00	
GOV OF ITALY	230,000.00	391,553.15	
GOV OF ITALY	210,000.00	296,509.26	
GOV OF ITALY	240,000.00	310,356.89	
GOV OF ITALY	200,000.00	293,467.60	
GOV OF ITALY	170,000.00	267,873.25	
GOV OF ITALY	200,000.00	249,051.20	
GOV OF ITALY	110,000.00	116,511.23	
GOV OF ITALY	120,000.00	160,171.34	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	211,706.04	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	188,715.06	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	164,347.50	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	234,587.10	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	194,594.96	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	209,192.58	

GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	251,292.00	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	224,595.63	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	218,872.92	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	197,279.82	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	217,199.55	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	243,801.80	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	182,592.92	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	199,897.67	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	218,929.12	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	344,981.73	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	126,946.21	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	394,583.91	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	377,950.44	
GOV OF NETHERLANDS	80,000.00	83,237.92	
GOV OF SPAIN	280,000.00	300,708.24	
GOV OF SPAIN	260,000.00	263,708.69	
GOV OF SPAIN	270,000.00	275,339.25	
GOV OF SPAIN	280,000.00	316,224.46	
GOV OF SPAIN	340,000.00	344,849.08	
GOV OF SPAIN	260,000.00	266,379.10	
GOV OF SPAIN	260,000.00	297,784.76	
GOV OF SPAIN	250,000.00	292,612.50	
GOV OF SPAIN	250,000.00	287,381.25	
GOV OF SPAIN	220,000.00	226,508.48	
GOV OF SPAIN	290,000.00	327,526.29	
GOV OF SPAIN	270,000.00	275,663.52	
GOV OF SPAIN	370,000.00	404,556.89	
GOV OF SPAIN	250,000.00	310,438.82	
GOV OF SPAIN	300,000.00	338,961.90	
GOV OF SPAIN	50,000.00	51,108.37	
GOV OF SPAIN	290,000.00	327,562.87	
GOV OF SPAIN	280,000.00	380,745.96	
GOV OF SPAIN	350,000.00	385,356.65	
GOV OF SPAIN	250,000.00	279,630.16	
GOV OF SPAIN	240,000.00	257,349.60	

	GOV OF SPAIN	350,000.00	391,641.25	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	291,365.88	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	359,508.48	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	284,685.00	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	511,492.73	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	385,274.40	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	297,195.92	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	273,195.00	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	345,296.04	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	302,882.32	
	GOV OF SPAIN	310,000.00	512,240.59	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	304,232.76	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	304,196.25	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	448,152.60	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	436,694.88	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	222,985.20	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	504,661.36	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	357,676.92	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	347,162.75	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	266,367.24	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	187,834.96	
	GOV OF SPAIN	190,000.00	348,765.90	
	ユーロ 小計	78,224,000.00	94,968,171.14 (11,963,140,518)	
英bond	UK TREASURY	160,000.00	168,112.64	
	UK TREASURY	360,000.00	363,446.36	
	UK TREASURY	320,000.00	330,288.64	
	UK TREASURY	380,000.00	381,382.66	
	UK TREASURY	280,000.00	286,178.02	
	UK TREASURY	230,000.00	244,729.56	
	UK TREASURY	310,000.00	321,265.71	
	UK TREASURY	150,000.00	165,823.42	
	UK TREASURY	250,000.00	303,856.90	
	UK TREASURY	310,000.00	319,362.24	
	UK TREASURY	190,000.00	208,418.96	

UK TREASURY	260,000.00	261,465.52
UK TREASURY	170,000.00	184,490.66
UK TREASURY	290,000.00	312,791.68
UK TREASURY	180,000.00	232,609.46
UK TREASURY	230,000.00	230,163.65
UK TREASURY	200,000.00	223,684.80
UK TREASURY	140,000.00	205,007.60
UK TREASURY	180,000.00	190,629.79
UK TREASURY	340,000.00	343,421.82
UK TREASURY	190,000.00	274,164.30
UK TREASURY	140,000.00	138,522.20
UK TREASURY	210,000.00	301,788.01
UK TREASURY	200,000.00	306,787.32
UK TREASURY	130,000.00	130,562.69
UK TREASURY	230,000.00	353,837.88
UK TREASURY	360,000.00	422,595.06
UK TREASURY	190,000.00	323,015.88
UK TREASURY	160,000.00	260,798.52
UK TREASURY	190,000.00	315,377.12
UK TREASURY	260,000.00	284,732.76
UK TREASURY	240,000.00	422,607.36
UK TREASURY	280,000.00	426,193.04
UK TREASURY	280,000.00	446,609.85
UK TREASURY	220,000.00	398,511.96
UK TREASURY	260,000.00	303,558.72
UK TREASURY	140,000.00	173,681.31
UK TREASURY	160,000.00	303,517.28
UK TREASURY	280,000.00	266,755.20
UK TREASURY	150,000.00	275,105.85
UK TREASURY	180,000.00	225,052.50
UK TREASURY	230,000.00	476,965.07
UK TREASURY	260,000.00	343,754.72
UK TREASURY	160,000.00	338,208.64
UK TREASURY	150,000.00	138,584.91
UK TREASURY	200,000.00	336,082.83

	UK TREASURY	180,000.00	383,491.58
	UK TREASURY	90,000.00	129,031.02
	英債券 小計	10,650,000.00	13,777,023.67 (1,921,481,491)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,396,450.70
	GOV OF SWEDEN	1,220,000.00	1,288,405.40
	GOV OF SWEDEN	1,000,000.00	1,128,157.18
	GOV OF SWEDEN	880,000.00	947,363.64
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	706,856.56
	GOV OF SWEDEN	730,000.00	786,848.75
	GOV OF SWEDEN	400,000.00	405,867.35
	GOV OF SWEDEN	600,000.00	943,674.60
	スウェーデンクローナ 小計	6,810,000.00	7,603,624.18 (93,372,504)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,030,000.00	1,073,280.07
	GOV OF NORWAY	710,000.00	770,692.22
	GOV OF NORWAY	610,000.00	642,597.18
	GOV OF NORWAY	410,000.00	429,434.00
	GOV OF NORWAY	490,000.00	522,166.05
	GOV OF NORWAY	500,000.00	544,850.00
	GOV OF NORWAY	480,000.00	516,852.00
	GOV OF NORWAY	580,000.00	606,152.20
	ノルウェークローネ 小計	4,810,000.00	5,106,023.72 (60,302,140)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	840,000.00	854,857.74
	GOV OF DENMARK	780,000.00	830,057.28
	GOV OF DENMARK	820,000.00	918,348.99
	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,043,706.42
	GOV OF DENMARK	1,420,000.00	1,550,398.60
	GOV OF DENMARK	1,640,000.00	3,152,180.36
	GOV OF DENMARK	310,000.00	341,316.20
	デンマーククローネ 小計	6,780,000.00	8,690,865.59 (147,049,445)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	500,000.00	515,449.09
	GOV OF POLAND	500,000.00	551,335.00
	GOV OF POLAND	560,000.00	589,618.84

	GOV OF POLAND	330,000.00	367,220.70
	GOV OF POLAND	420,000.00	452,945.97
	GOV OF POLAND	410,000.00	441,061.39
	GOV OF POLAND	390,000.00	394,813.57
	GOV OF POLAND	360,000.00	405,177.12
	GOV OF POLAND	760,000.00	833,972.69
	GOV OF POLAND	390,000.00	429,103.03
	GOV OF POLAND	430,000.00	481,804.41
	GOV OF POLAND	80,000.00	110,464.00
	GOV OF POLAND	600,000.00	675,983.64
	GOV OF POLAND	110,000.00	108,814.38
	ポーランドズロチ 小計	5,840,000.00	6,357,763.83 (180,814,803)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	224,422.70
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	349,045.28
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	395,952.43
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	439,254.50
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	435,287.91
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	400,603.04
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	451,774.60
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	368,471.55
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	506,289.54
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	360,780.62
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	492,709.50
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	435,050.60
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	411,665.88
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	518,675.62
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	478,242.16
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	521,189.94
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	535,248.31
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	468,904.98
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	323,426.72
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	375,889.12
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	202,282.82
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	290,325.86

	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	82,481.79
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	211,538.56
	GOV OF AUSTRALIA	120,000.00	150,012.05
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	186,149.54
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	206,777.86
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	187,391.20
	オーストラリアドル 小計	9,020,000.00	10,009,844.68 (776,964,144)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,558.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	125,793.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	103,000.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	116,677.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,535.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	120,483.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	54,160.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	49,921.75
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	64,830.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	105,147.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	78,995.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	104,697.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	106,306.65
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	114,435.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	92,877.20
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	48,186.60
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	89,880.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	105,680.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	59,249.75
	シンガポールドル 小計	1,430,000.00	1,623,411.95 (126,642,366)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,747.19
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,916.09
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	269,152.22
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	269,049.27
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	145,830.87
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	125,648.35
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,837.84

	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	214,336.24	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,156.40	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,175.71	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	205,350.23	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	209,815.40	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	140,474.24	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	130,024.57	
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	370,728.22	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	249,137.72	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	86,091.48	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	205,780.94	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	284,018.07	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	168,352.70	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	235,272.89	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	139,238.64	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	45,603.43	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	233,238.80	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	77,209.69	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	207,835.34	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	139,838.56	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,302.64	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	161,978.04	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	90,125.48	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	172,090.48	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,567.20	
	マレーシアリングット 小計	5,060,000.00	5,447,924.94 (139,739,274)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	220,000.00	244,024.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	385,054.00	
	GOV OF ISRAEL	190,000.00	194,246.50	
	GOV OF ISRAEL	150,000.00	149,797.50	
	GOV OF ISRAEL	450,000.00	467,032.50	
	GOV OF ISRAEL	160,000.00	161,656.00	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	299,614.00	
	GOV OF ISRAEL	210,000.00	282,229.50	

	GOV OF ISRAEL	240,000.00	265,668.00	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	314,678.00	
	GOV OF ISRAEL	160,000.00	163,144.00	
	GOV OF ISRAEL	120,000.00	120,234.00	
	GOV OF ISRAEL	250,000.00	432,637.50	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	363,480.00	
	イスラエルシュケル 小計	3,350,000.00	3,843,495.50	(123,184,030)
合計			28,733,100,708	(28,733,100,708)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 219銘柄	100.0%	43.2%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 321銘柄	100.0%	41.7%
英ポンド	国債証券 48銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
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 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.7%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

（単位：円）	
2020年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	165,916,525
コール・ローン	1,156,736,701
国債証券	204,319,207,796
派生商品評価勘定	9,248,246
未収入金	4,838,540,166
未収利息	960,797,761
前払費用	103,341,454
流動資産合計	211,553,788,649
<b>資産合計</b>	<b>211,553,788,649</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,694,121,064
未払金	5,050,842,038
未払解約金	74,592,000
未払利息	3,137
流動負債合計	6,819,558,239
<b>負債合計</b>	<b>6,819,558,239</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	190,933,135,042
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,801,095,368
元本等合計	204,734,230,410
純資産合計	204,734,230,410
<b>負債純資産合計</b>	<b>211,553,788,649</b>

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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	為替予約取引

法	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	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12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	205,972,557,743円
期中一部解約元本額	162,692,178,246円
期末元本額	190,933,135,042円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	19,785,232,065円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	9,436,100,413円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,288,878,112円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,417,374,046円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	296,553,916円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	68,921,926円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	23,136,377円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,451,170円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	841,270円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	371,842円
リスクコントロール・オープン	202,028,519円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,212,988,548円
FWりそな円建債券アクティブファンド	857,994,040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)	100,495,565,512円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	764,949,332円
Smart-i 8資産バランス 安定型	538,896,639円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	308,606,785円
Smart-i 8資産バランス 成長型	107,806,969円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	11,290,547,881円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	9,971,217,951円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	5,787,879,896円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	3,808,099,658円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	9,798,822,493円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,616,769,500円

りそなF T 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)	7,280,297,840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)	10,879,869円
りそなD A Aファンド(適格機関投資家専用)	4,479,168,297円
りそなF T R Cバランスファンド(適格機関投資家専用)	75,754,176円
2. 計算日における受益権の総数	190,933,135,042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	1.0723円
(10,000口当たり純資産額)	(10,723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

2020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、運用評価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

2020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	<p>国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,076,674,126
合計		3,076,674,126

(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)

(2020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	4,989,278,898	-	4,995,992,511	6,713,613
	米ドル	2,167,147,865	-	2,172,058,797	4,910,932
	カナダドル	111,098,496	-	111,167,378	68,882

ユーロ	2,178,000,656	-	2,177,454,435	546,221
英ポンド	363,489,019	-	364,980,766	1,491,747
オーストラリアドル	146,223,265	-	146,954,535	731,270
シンガポールドル	23,319,597	-	23,376,600	57,003
売建	203,833,541,489	-	205,525,127,920	1,691,586,431
米ドル	88,517,244,298	-	88,858,008,800	340,764,502
カナダドル	4,033,596,377	-	4,101,618,160	68,021,783
メキシコペソ	1,725,993,634	-	1,749,314,710	23,321,076
ユーロ	84,395,929,104	-	85,431,551,180	1,035,622,076
英ポンド	13,562,882,809	-	13,662,052,320	99,169,511
スウェーデンクローナ	655,828,160	-	658,208,000	2,379,840
ノルウェークローネ	445,434,514	-	446,866,000	1,431,486
デンマーククローネ	1,016,885,396	-	1,029,751,200	12,865,804
ポーランドズロチ	1,267,842,521	-	1,300,217,620	32,375,099
オーストラリアドル	5,526,400,098	-	5,579,186,540	52,786,442
シンガポールドル	898,219,738	-	902,037,400	3,817,662
マレーシアリンギット	905,109,920	-	905,216,000	106,080
イスラエルシケル	882,174,920	-	901,099,990	18,925,070
合計	208,822,820,387	-	210,521,120,431	1,684,872,818

## (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	3,330,000.00	3,383,399.21	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,268,373.39	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,243,564.16	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,461,091.28	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,804,416.85	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,539,915.50	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,104,531.20	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,387,223.53	
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,662,200.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,043,125.00	
		US TREASURY N/B	3,560,000.00	3,639,265.53	
		US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,223,472.25	
		US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,770,058.01	
		US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,656,511.46	
		US TREASURY N/B	4,520,000.00	4,648,272.62	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,348,785.07	
		US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,810,239.71	
		US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,263,696.05	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,085,546.80	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,239,317.70	
		US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,509,383.59	
		US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,530,000.00	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,813,647.37	
		US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,066,677.05	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,866,554.60			

US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,498,945.20	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,175,320.08	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,412,250.52	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,947,537.05	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,998,750.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,256,375.00	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,493,545.25	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,033,717.75	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,997,655.80	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,818,534.95	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,557,128.75	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,409,514.38	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,753,451.27	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	6,057,159.07	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,501,225.00	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,574,226.48	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,793,967.14	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,797,054.18	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,536,042.04	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,266,247.76	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,943,052.05	
US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,224,759.68	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,332,749.32	
US TREASURY N/B	2,850,000.00	2,848,552.48	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,655,043.79	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,619,681.02	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,395,758.65	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,440,986.70	
US TREASURY N/B	3,830,000.00	4,011,401.05	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,816,104.23	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,566,455.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,368,281.25	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,581,972.60	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,527,001.80	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,205,620.96	

US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,476,312.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,507,109.20	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,707,427.59	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,395,030.21	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,579,164.51	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,895,581.69	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,133,950.70	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,914,328.08	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,456,333.85	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,256,775.00	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,358,576.39	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,093,753.65	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,159,144.40	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,551,931.82	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,717,792.75	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,193,273.27	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,395,354.52	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,278,351.09	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,491,562.50	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,091,484.27	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,041,456.93	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,957,194.98	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,938,902.22	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,890,357.74	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,006,640.50	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,558,393.75	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,432,039.80	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,039,549.95	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,898,492.12	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,627,986.63	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,142,851.40	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,543,937.33	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,909,828.08	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,591,393.45	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,682,703.12	

US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,458,112.38	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,139,368.75	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,291,002.76	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,330,730.19	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,527,262.50	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,674,540.49	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,580,015.58	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,215,312.40	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,584,479.38	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,796,750.00	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,569,415.40	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,695,415.43	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,887,056.87	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,603,579.50	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,349,749.76	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,878,031.25	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,393,843.75	
US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,440,923.29	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,960,812.50	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,020,281.06	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,855,800.00	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,706,962.04	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,546,005.70	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,533,953.01	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,777,860.81	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,820,094.43	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,655,630.68	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,258,902.24	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,746,620.48	
US TREASURY N/B	3,920,000.00	3,901,625.00	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,348,810.75	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,625,115.06	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,508,925.72	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,692,527.71	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,700,605.27	

US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,099,671.87	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,968,554.50	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,731,946.45	
US TREASURY N/B	5,670,000.00	5,631,461.57	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,476,976.48	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,964,062.50	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	6,073,040.62	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,929,221.83	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,790,710.72	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,888,328.04	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,136,368.75	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,242,767.66	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,881,156.25	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,922,398.30	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,755,859.25	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,758,114.76	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,942,261.55	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,907,246.06	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,801,093.62	
US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,418,963.15	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,022,200.00	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,712,661.95	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,681,240.43	
US TREASURY N/B	3,910,000.00	4,247,084.61	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,713,359.37	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,216,093.60	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,725,104.24	
US TREASURY N/B	2,730,000.00	3,011,424.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,034,062.50	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,807,710.92	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,155,997.60	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,143,719.96	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,563,468.40	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,474,433.55	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	6,140,771.41	

US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,755,562.08	
US TREASURY N/B	4,370,000.00	4,289,428.12	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,966,718.60	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,806,370.11	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,698,478.15	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	7,045,844.37	
US TREASURY N/B	220,000.00	298,821.86	
US TREASURY N/B	6,840,000.00	7,933,063.46	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,659,308.80	
US TREASURY N/B	530,000.00	718,936.67	
US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,460,222.94	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,648,285.52	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,333,789.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,910,726.36	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,646,745.70	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,162,778.83	
US TREASURY N/B	7,320,000.00	7,135,855.88	
US TREASURY N/B	10,150,000.00	9,867,703.12	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,975,937.20	
US TREASURY N/B	610,000.00	876,493.75	
US TREASURY N/B	540,000.00	791,564.02	
US TREASURY N/B	130,000.00	203,373.82	
US TREASURY N/B	690,000.00	1,023,437.04	
US TREASURY N/B	520,000.00	783,839.05	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,300,237.44	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,908,393.75	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	2,044,075.66	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,412,062.40	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,212,808.58	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,438,953.12	
US TREASURY N/B	4,970,000.00	4,688,884.37	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	2,014,096.87	
US TREASURY N/B	5,440,000.00	5,117,849.72	
US TREASURY N/B	770,000.00	1,153,526.14	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,749,906.04	

US TREASURY N/B	900,000.00	1,433,742.12	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,726,604.63	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,528,453.04	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,353,909.33	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,748,490.55	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,983,697.13	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	2,022,325.00	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,291,287.50	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,924,074.94	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	4,022,874.88	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,414,339.78	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,235,949.13	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,421,144.49	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,684,753.12	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	4,523,003.82	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,600,406.04	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	4,002,131.25	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,608,062.36	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,273,314.77	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,643,087.50	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,632,954.63	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,858,109.37	
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,682,275.35	
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,592,167.65	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,778,488.90	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,677,195.15	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	4,269,546.00	
US TREASURY N/B	2,690,000.00	3,351,361.51	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	5,275,757.61	
US TREASURY N/B	3,940,000.00	5,249,741.89	
US TREASURY N/B	5,050,000.00	6,591,433.21	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	5,018,906.16	
US TREASURY N/B	4,480,000.00	5,862,674.94	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	5,724,393.75	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,684,001.31	

	US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,832,480.36
	US TREASURY N/B	3,860,000.00	4,153,420.21
	US TREASURY N/B	6,400,000.00	5,742,499.84
	US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,315,523.23
	US TREASURY N/B	900,000.00	886,781.25
	米ドル 小計	782,120,000.00	844,401,403.52 (88,054,178,359)
カナダドル	GOV OF CANADA	610,000.00	619,186.60
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,455,452.00
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,119,745.00
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,120,338.00
	GOV OF CANADA	1,500,000.00	1,500,540.00
	GOV OF CANADA	2,110,000.00	2,137,767.60
	GOV OF CANADA	3,100,000.00	3,100,155.00
	GOV OF CANADA	1,460,000.00	1,459,605.80
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,869,494.70
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,205,228.70
	GOV OF CANADA	1,960,000.00	2,050,826.40
	GOV OF CANADA	840,000.00	892,004.40
	GOV OF CANADA	470,000.00	468,862.60
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,268,240.40
	GOV OF CANADA	840,000.00	875,691.60
	GOV OF CANADA	1,090,000.00	1,129,185.50
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,189,331.00
	GOV OF CANADA	3,500,000.00	3,509,415.00
	GOV OF CANADA	950,000.00	938,552.50
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,212,065.50
	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,368,317.30
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,102,420.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	495,841.50
	GOV OF CANADA	1,410,000.00	1,592,919.30
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,761,640.00
	GOV OF CANADA	1,410,000.00	1,369,095.90
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,492,602.00
	GOV OF CANADA	860,000.00	1,377,539.40

	GOV OF CANADA	950,000.00	1,445,453.50
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,755,946.20
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,455,397.20
	GOV OF CANADA	2,400,000.00	2,828,448.00
	GOV OF CANADA	420,000.00	623,023.80
	カナダドル 小計	45,410,000.00	49,790,332.40 (4,050,443,540)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	19,950,000.00	20,509,579.54
	UNITED MEXICAN STATE	26,930,000.00	27,745,157.63
	UNITED MEXICAN STATE	21,050,000.00	22,110,499.00
	UNITED MEXICAN STATE	22,780,000.00	25,018,362.80
	UNITED MEXICAN STATE	21,980,000.00	24,572,980.60
	UNITED MEXICAN STATE	24,140,000.00	28,855,749.00
	UNITED MEXICAN STATE	18,620,000.00	19,383,233.80
	UNITED MEXICAN STATE	27,110,000.00	30,685,266.80
	UNITED MEXICAN STATE	27,620,000.00	33,546,423.40
	UNITED MEXICAN STATE	13,346,000.00	15,608,413.92
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	8,831,667.60
	UNITED MEXICAN STATE	6,300,000.00	8,715,168.00
	UNITED MEXICAN STATE	17,820,000.00	21,673,575.00
	UNITED MEXICAN STATE	18,100,000.00	20,378,790.00
	UNITED MEXICAN STATE	16,400,000.00	18,872,136.00
	メキシコペソ 小計	289,706,000.00	326,507,003.09 (1,714,161,766)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	741,788.60
	GOV OF AUSTRIA	790,000.00	800,467.50
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	940,551.60
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	600,236.50
	GOV OF AUSTRIA	1,060,000.00	1,080,504.64
	GOV OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,125,810.00
	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	954,965.85
	GOV OF AUSTRIA	900,000.00	984,726.99
	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,117,151.94
	GOV OF AUSTRIA	840,000.00	1,091,647.20
	GOV OF AUSTRIA	1,240,000.00	1,345,402.48
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,010,241.50

GOV OF AUSTRIA	880,000.00	1,290,390.01	
GOV OF AUSTRIA	910,000.00	999,582.22	
GOV OF AUSTRIA	1,040,000.00	1,129,419.20	
GOV OF AUSTRIA	910,000.00	949,573.17	
GOV OF AUSTRIA	760,000.00	1,040,029.89	
GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	2,307,000.28	
GOV OF AUSTRIA	290,000.00	293,728.82	
GOV OF AUSTRIA	630,000.00	1,114,648.15	
GOV OF AUSTRIA	690,000.00	960,453.09	
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	421,549.80	
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	861,541.45	
GOV OF AUSTRIA	560,000.00	1,272,060.31	
GOV OF AUSTRIA	240,000.00	410,667.84	
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,210,873.80	
GOV OF BELGIUM	1,560,000.00	1,702,445.93	
GOV OF BELGIUM	1,220,000.00	1,314,458.50	
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,007,075.82	
GOV OF BELGIUM	1,330,000.00	1,489,694.43	
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,289,748.72	
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,893,156.60	
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,189,616.01	
GOV OF BELGIUM	1,610,000.00	1,760,610.33	
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,378,729.80	
GOV OF BELGIUM	770,000.00	801,512.25	
GOV OF BELGIUM	1,640,000.00	2,383,348.04	
GOV OF BELGIUM	1,580,000.00	1,744,833.50	
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,725,260.46	
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,290,942.05	
GOV OF BELGIUM	1,470,000.00	1,682,306.22	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,048,224.10	
GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,154,930.50	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,006,264.00	
GOV OF BELGIUM	1,750,000.00	3,063,719.75	
GOV OF BELGIUM	490,000.00	610,688.47	
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,040,651.04	

GOV OF BELGIUM	480,000.00	508,130.40	
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,780,870.40	
GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,825,563.96	
GOV OF BELGIUM	1,020,000.00	1,365,115.46	
GOV OF BELGIUM	670,000.00	931,266.50	
GOV OF BELGIUM	550,000.00	900,570.55	
GOV OF BELGIUM	650,000.00	1,106,386.45	
GOV OF FINLAND	430,000.00	434,409.22	
GOV OF FINLAND	530,000.00	552,643.72	
GOV OF FINLAND	340,000.00	358,262.76	
GOV OF FINLAND	670,000.00	684,097.47	
GOV OF FINLAND	510,000.00	557,643.69	
GOV OF FINLAND	280,000.00	287,917.00	
GOV OF FINLAND	520,000.00	634,539.10	
GOV OF FINLAND	620,000.00	668,015.90	
GOV OF FINLAND	610,000.00	649,729.60	
GOV OF FINLAND	550,000.00	592,350.00	
GOV OF FINLAND	470,000.00	591,495.00	
GOV OF FINLAND	510,000.00	553,051.14	
GOV OF FINLAND	480,000.00	523,234.65	
GOV OF FINLAND	360,000.00	375,546.24	
GOV OF FINLAND	350,000.00	393,274.70	
GOV OF FINLAND	390,000.00	463,789.56	
GOV OF FINLAND	420,000.00	440,694.02	
GOV OF FINLAND	320,000.00	342,084.80	
GOV OF FINLAND	380,000.00	608,945.82	
GOV OF FINLAND	350,000.00	483,060.55	
GOV OF FRANCE	2,430,000.00	2,451,780.09	
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	4,396,532.36	
GOV OF FRANCE	3,260,000.00	3,296,300.10	
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,721,241.92	
GOV OF FRANCE	2,330,000.00	2,369,106.72	
GOV OF FRANCE	3,740,000.00	3,806,085.80	
GOV OF FRANCE	5,160,000.00	5,482,711.56	
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,390,844.51	

GOV OF FRANCE	4,110,000.00	4,212,708.90	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,348,904.15	
GOV OF FRANCE	3,220,000.00	3,542,112.70	
GOV OF FRANCE	4,550,000.00	4,689,140.81	
GOV OF FRANCE	4,220,000.00	4,450,369.80	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,026,665.91	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,330,520.20	
GOV OF FRANCE	2,370,000.00	2,451,129.84	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,631,109.47	
GOV OF FRANCE	4,200,000.00	4,470,054.95	
GOV OF FRANCE	3,960,000.00	4,170,541.32	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,349,665.00	
GOV OF FRANCE	5,050,000.00	6,236,889.37	
GOV OF FRANCE	4,130,000.00	4,536,551.40	
GOV OF FRANCE	3,630,000.00	4,003,164.00	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,210,671.20	
GOV OF FRANCE	3,660,000.00	3,969,251.70	
GOV OF FRANCE	3,650,000.00	3,795,149.55	
GOV OF FRANCE	4,440,000.00	5,693,498.13	
GOV OF FRANCE	2,840,000.00	2,944,867.00	
GOV OF FRANCE	4,720,000.00	5,650,986.96	
GOV OF FRANCE	2,700,000.00	4,681,983.60	
GOV OF FRANCE	4,010,000.00	4,792,675.40	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	4,369,511.20	
GOV OF FRANCE	3,280,000.00	3,961,295.36	
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	4,079,625.80	
GOV OF FRANCE	2,800,000.00	3,715,390.00	
GOV OF FRANCE	930,000.00	1,007,484.81	
GOV OF FRANCE	3,330,000.00	6,336,890.10	
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	4,182,868.30	
GOV OF FRANCE	2,380,000.00	3,485,940.78	
GOV OF FRANCE	2,780,000.00	3,725,617.00	
GOV OF FRANCE	2,020,000.00	2,264,480.60	
GOV OF FRANCE	1,720,000.00	3,753,408.08	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	3,360,393.85	

GOV OF FRANCE	1,180,000.00	1,824,315.40	
GOV OF GERMANY	1,350,000.00	1,360,577.25	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	1,884,667.59	
GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,453,852.80	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,091,337.56	
GOV OF GERMANY	1,220,000.00	1,234,176.40	
GOV OF GERMANY	2,290,000.00	2,382,213.72	
GOV OF GERMANY	2,220,000.00	2,309,632.50	
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,622,155.36	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,877,381.47	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,018,248.32	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,895,996.58	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,441,438.07	
GOV OF GERMANY	1,840,000.00	1,980,838.38	
GOV OF GERMANY	2,250,000.00	2,303,550.89	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,187,625.66	
GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,578,687.65	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,183,014.00	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	2,360,841.34	
GOV OF GERMANY	3,370,000.00	3,476,279.69	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,798,924.70	
GOV OF GERMANY	1,760,000.00	1,822,501.12	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,694,673.76	
GOV OF GERMANY	2,420,000.00	2,515,360.10	
GOV OF GERMANY	350,000.00	363,837.84	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,780,003.20	
GOV OF GERMANY	2,990,000.00	3,127,755.28	
GOV OF GERMANY	3,360,000.00	3,579,310.56	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,507,678.51	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	3,020,654.03	
GOV OF GERMANY	2,030,000.00	2,135,384.40	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,905,794.14	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,968,646.35	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,629,513.72	
GOV OF GERMANY	2,380,000.00	2,562,165.20	

GOV OF GERMANY	2,350,000.00	2,536,483.30	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,595,380.55	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,221,949.42	
GOV OF GERMANY	2,710,000.00	2,873,724.65	
GOV OF GERMANY	3,150,000.00	3,341,410.36	
GOV OF GERMANY	700,000.00	744,314.20	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	3,033,772.45	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,905,195.16	
GOV OF GERMANY	2,200,000.00	2,335,462.80	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	4,403,174.05	
GOV OF GERMANY	1,780,000.00	3,374,422.54	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	3,926,016.00	
GOV OF GERMANY	1,740,000.00	3,143,692.80	
GOV OF GERMANY	2,660,000.00	4,483,020.36	
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,937,943.34	
GOV OF GERMANY	2,440,000.00	3,460,480.21	
GOV OF GERMANY	1,470,000.00	1,553,096.16	
GOV OF IRELAND	560,000.00	570,848.32	
GOV OF IRELAND	510,000.00	517,001.79	
GOV OF IRELAND	630,000.00	696,853.08	
GOV OF IRELAND	790,000.00	897,024.46	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,324,513.05	
GOV OF IRELAND	1,040,000.00	1,131,792.99	
GOV OF IRELAND	710,000.00	743,281.25	
GOV OF IRELAND	770,000.00	849,814.35	
GOV OF IRELAND	910,000.00	1,027,897.04	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,050,147.12	
GOV OF IRELAND	740,000.00	778,018.24	
GOV OF IRELAND	640,000.00	750,696.96	
GOV OF IRELAND	420,000.00	499,245.18	
GOV OF IRELAND	390,000.00	417,861.60	
GOV OF IRELAND	490,000.00	628,704.78	
GOV OF IRELAND	840,000.00	1,204,822.08	
GOV OF IRELAND	540,000.00	721,580.94	
GOV OF ITALY	2,150,000.00	2,208,055.37	

GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,803,387.17	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	1,961,678.20	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,669,450.40	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,412,770.86	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,943,130.00	
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,113,975.46	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,654,384.00	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,623,739.00	
GOV OF ITALY	1,330,000.00	1,343,395.76	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,411,160.28	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,742,125.51	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,169,211.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,578,885.00	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,274,161.40	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,668,918.12	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,834,725.00	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,656,382.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,553,156.22	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,286,440.83	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,500,975.00	
GOV OF ITALY	2,630,000.00	2,815,296.65	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,963,056.06	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,640,331.00	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,903,697.72	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,808,196.60	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,437,348.19	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,646,714.30	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,855,608.38	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,883,527.12	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,621,778.40	
GOV OF ITALY	2,880,000.00	3,175,257.60	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,477,769.32	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,395,975.66	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,890,341.22	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,694,648.00	

GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,491,471.33	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,785,183.57	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,933,883.46	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,503,362.32	
GOV OF ITALY	1,300,000.00	1,363,669.06	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,684,064.72	
GOV OF ITALY	2,850,000.00	3,203,018.10	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,500,409.35	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	3,044,737.48	
GOV OF ITALY	2,010,000.00	2,454,816.61	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,687,884.10	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,176,463.12	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,520,642.93	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,180,768.70	
GOV OF ITALY	3,230,000.00	3,578,367.77	
GOV OF ITALY	2,460,000.00	3,800,896.80	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,415,328.38	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	2,752,158.00	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,185,841.11	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	3,345,276.49	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,084,910.07	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,295,988.65	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,674,530.10	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,719,428.62	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,600,396.05	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,575,558.59	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,051,212.24	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	3,209,760.00	
GOV OF ITALY	1,060,000.00	1,169,031.60	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,740,872.05	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	2,287,357.21	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	2,198,361.46	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,259,700.52	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,843,598.25	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,519,212.32	

GOV OF ITALY	870,000.00	921,497.91	
GOV OF ITALY	860,000.00	1,147,894.62	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,502,104.76	
GOV OF NETHERLANDS	1,430,000.00	1,499,236.31	
GOV OF NETHERLANDS	990,000.00	1,084,693.50	
GOV OF NETHERLANDS	1,830,000.00	1,951,338.15	
GOV OF NETHERLANDS	1,410,000.00	1,444,099.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,480,000.00	1,629,500.12	
GOV OF NETHERLANDS	1,420,000.00	1,486,811.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	1,614,949.53	
GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	1,219,434.84	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,490,558.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,621,756.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,520,000.00	1,684,448.80	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,202,965.12	
GOV OF NETHERLANDS	1,250,000.00	1,315,116.25	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,765,116.03	
GOV OF NETHERLANDS	1,430,000.00	2,466,619.42	
GOV OF NETHERLANDS	810,000.00	934,785.99	
GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	2,837,246.21	
GOV OF NETHERLANDS	1,530,000.00	2,753,638.92	
GOV OF NETHERLANDS	570,000.00	593,070.18	
GOV OF SPAIN	1,550,000.00	1,664,634.90	
GOV OF SPAIN	2,570,000.00	2,606,658.99	
GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,784,606.25	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,281,333.66	
GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,332,802.60	
GOV OF SPAIN	1,980,000.00	2,028,579.30	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,038,680.28	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,802,493.00	
GOV OF SPAIN	1,890,000.00	2,172,602.25	
GOV OF SPAIN	1,590,000.00	1,637,038.56	
GOV OF SPAIN	2,400,000.00	2,710,562.40	
GOV OF SPAIN	2,190,000.00	2,235,937.44	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,132,124.15	

GOV OF SPAIN	2,050,000.00	2,545,598.36	
GOV OF SPAIN	2,230,000.00	2,519,616.79	
GOV OF SPAIN	400,000.00	408,866.96	
GOV OF SPAIN	2,380,000.00	2,688,274.73	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,706,015.93	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,433,251.99	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,181,115.35	
GOV OF SPAIN	1,710,000.00	1,833,615.90	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,148,432.00	
GOV OF SPAIN	1,970,000.00	2,207,656.86	
GOV OF SPAIN	2,080,000.00	2,336,805.12	
GOV OF SPAIN	1,610,000.00	2,291,714.25	
GOV OF SPAIN	2,170,000.00	3,264,527.16	
GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,186,998.80	
GOV OF SPAIN	2,460,000.00	2,611,078.44	
GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,133,022.50	
GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,417,072.28	
GOV OF SPAIN	2,430,000.00	2,725,940.95	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	3,172,586.88	
GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,446,538.44	
GOV OF SPAIN	1,940,000.00	2,360,562.90	
GOV OF SPAIN	1,860,000.00	2,977,013.70	
GOV OF SPAIN	1,770,000.00	3,220,624.74	
GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,393,657.50	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	3,460,535.04	
GOV OF SPAIN	1,260,000.00	2,503,738.44	
GOV OF SPAIN	1,630,000.00	2,460,327.37	
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,923,763.40	
GOV OF SPAIN	1,270,000.00	1,325,280.03	
GOV OF SPAIN	1,390,000.00	2,551,497.90	
	ユーロ 小計	557,660,000.00	675,639,194.23 (85,110,269,297)
英ポンド	UK TREASURY	1,470,000.00	1,544,534.88
	UK TREASURY	2,070,000.00	2,089,816.73
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,332,663.52

UK TREASURY	2,750,000.00	2,760,006.15
UK TREASURY	2,260,000.00	2,309,865.54
UK TREASURY	1,260,000.00	1,340,692.41
UK TREASURY	610,000.00	612,867.00
UK TREASURY	2,210,000.00	2,290,313.61
UK TREASURY	1,190,000.00	1,315,532.50
UK TREASURY	880,000.00	1,069,576.28
UK TREASURY	2,910,000.00	2,997,884.32
UK TREASURY	1,250,000.00	1,371,177.37
UK TREASURY	1,910,000.00	1,920,766.08
UK TREASURY	1,470,000.00	1,595,301.62
UK TREASURY	1,710,000.00	1,844,392.32
UK TREASURY	1,310,000.00	1,692,879.98
UK TREASURY	1,310,000.00	1,310,932.18
UK TREASURY	1,520,000.00	1,700,004.48
UK TREASURY	950,000.00	1,391,123.00
UK TREASURY	1,810,000.00	1,916,888.46
UK TREASURY	2,260,000.00	2,282,745.08
UK TREASURY	1,430,000.00	2,063,447.10
UK TREASURY	1,750,000.00	2,514,900.15
UK TREASURY	1,250,000.00	1,917,420.75
UK TREASURY	1,660,000.00	1,667,185.13
UK TREASURY	1,690,000.00	2,599,939.26
UK TREASURY	2,270,000.00	2,664,696.70
UK TREASURY	1,320,000.00	2,244,110.35
UK TREASURY	1,280,000.00	2,086,388.22
UK TREASURY	1,380,000.00	2,290,633.84
UK TREASURY	1,790,000.00	1,960,275.54
UK TREASURY	1,780,000.00	3,134,337.92
UK TREASURY	1,940,000.00	2,952,908.92
UK TREASURY	2,000,000.00	3,190,070.39
UK TREASURY	1,470,000.00	2,662,784.46
UK TREASURY	2,080,000.00	2,428,469.88
UK TREASURY	930,000.00	1,153,740.14
UK TREASURY	1,260,000.00	2,390,198.58

	UK TREASURY	1,580,000.00	1,505,261.57	
	UK TREASURY	1,190,000.00	2,182,506.41	
	UK TREASURY	1,310,000.00	1,637,882.12	
	UK TREASURY	1,570,000.00	3,255,805.08	
	UK TREASURY	1,820,000.00	2,406,283.14	
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,409,736.56	
	UK TREASURY	960,000.00	886,943.42	
	UK TREASURY	1,340,000.00	2,251,755.01	
	UK TREASURY	1,400,000.00	2,982,712.31	
	UK TREASURY	710,000.00	1,017,911.38	
	英ポンド 小計	75,670,000.00	98,148,267.84 (13,688,738,915)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	9,615,000.00	10,171,873.86	
	GOV OF SWEDEN	8,400,000.00	8,870,988.00	
	GOV OF SWEDEN	6,380,000.00	7,197,642.92	
	GOV OF SWEDEN	6,020,000.00	6,480,828.59	
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,526,333.16	
	GOV OF SWEDEN	5,130,000.00	5,529,498.75	
	GOV OF SWEDEN	3,200,000.00	3,246,938.87	
	GOV OF SWEDEN	4,000,000.00	6,291,164.00	
	スウェーデンクローナ 小計	47,905,000.00	53,315,268.15 (654,711,492)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	7,480,000.00	7,794,305.86	
	GOV OF NORWAY	5,470,000.00	5,937,586.54	
	GOV OF NORWAY	4,040,000.00	4,255,889.52	
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,540,212.00	
	GOV OF NORWAY	3,560,000.00	3,793,696.20	
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,628,701.00	
	GOV OF NORWAY	3,790,000.00	4,080,977.25	
	GOV OF NORWAY	4,170,000.00	4,358,025.30	
	ノルウェークローネ 小計	35,220,000.00	37,389,393.67 (441,568,739)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,400,000.00	5,495,514.12	
	GOV OF DENMARK	5,820,000.00	6,193,504.32	
	GOV OF DENMARK	5,900,000.00	6,607,633.02	
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,531,902.00	

	GOV OF DENMARK	9,770,000.00	10,667,179.10	
	GOV OF DENMARK	11,420,000.00	21,949,938.90	
	GOV OF DENMARK	2,250,000.00	2,477,295.00	
	デンマーククローネ 小計	47,560,000.00	60,922,966.46 (1,030,816,592)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	3,410,000.00	3,515,362.84	
	GOV OF POLAND	2,730,000.00	2,729,043.12	
	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,635,381.30	
	GOV OF POLAND	3,920,000.00	4,127,331.93	
	GOV OF POLAND	2,120,000.00	2,359,114.80	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,138,268.54	
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,238,036.09	
	GOV OF POLAND	1,900,000.00	1,923,450.75	
	GOV OF POLAND	2,610,000.00	2,937,534.12	
	GOV OF POLAND	4,300,000.00	4,718,529.74	
	GOV OF POLAND	2,790,000.00	3,069,737.11	
	GOV OF POLAND	3,120,000.00	3,495,883.22	
	GOV OF POLAND	740,000.00	1,021,792.00	
	GOV OF POLAND	4,790,000.00	5,396,602.72	
	GOV OF POLAND	940,000.00	929,868.39	
	ポーランドズロチ 小計	41,680,000.00	45,235,936.67 (1,286,510,038)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,350,000.00	1,377,139.32	
	GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,225,163.66	
	GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	3,011,322.48	
	GOV OF AUSTRALIA	3,240,000.00	3,649,191.26	
	GOV OF AUSTRALIA	2,980,000.00	3,242,895.00	
	GOV OF AUSTRALIA	2,720,000.00	2,724,100.67	
	GOV OF AUSTRALIA	2,930,000.00	3,309,248.94	
	GOV OF AUSTRALIA	2,490,000.00	2,479,714.05	
	GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	3,314,991.07	
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,715,876.35	
	GOV OF AUSTRALIA	2,880,000.00	3,638,470.17	
	GOV OF AUSTRALIA	2,610,000.00	2,988,110.70	
	GOV OF AUSTRALIA	2,740,000.00	3,048,552.77	

	GOV OF AUSTRALIA	2,950,000.00	3,400,206.87
	GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	3,515,079.87
	GOV OF AUSTRALIA	3,210,000.00	3,717,821.67
	GOV OF AUSTRALIA	3,310,000.00	3,769,514.72
	GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	2,883,266.85
	GOV OF AUSTRALIA	2,460,000.00	2,566,547.52
	GOV OF AUSTRALIA	2,440,000.00	2,413,603.83
	GOV OF AUSTRALIA	1,720,000.00	1,739,632.25
	GOV OF AUSTRALIA	1,300,000.00	1,797,255.33
	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	954,432.23
	GOV OF AUSTRALIA	1,220,000.00	1,612,981.52
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	887,571.35
	GOV OF AUSTRALIA	1,070,000.00	1,244,875.12
	GOV OF AUSTRALIA	1,270,000.00	1,544,752.30
	GOV OF AUSTRALIA	1,420,000.00	1,330,477.52
	オーストラリアドル 小計	64,050,000.00	71,102,795.39 (5,518,998,978)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	509,300.00
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	691,861.50
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	628,300.00
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	806,132.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	304,703.00
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	722,898.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	584,928.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	299,530.50
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	529,445.00
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	887,908.00
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	473,970.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	732,879.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	732,334.70
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	724,755.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	626,921.10
	GOV OF SINGAPORE	390,000.00	469,819.35
	GOV OF SINGAPORE	400,000.00	513,600.00
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	805,810.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	414,748.25

	シンガポールドル 小計	10,100,000.00	11,459,843.40 (893,982,383)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	794,340.53
	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,232,118.84
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	832,657.40
	GOV OF MALAYSIA	1,250,000.00	1,294,001.12
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,666,035.88
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	635,405.95
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	869,067.76
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	796,459.55
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	889,495.39
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,350,170.64
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	782,382.68
	GOV OF MALAYSIA	1,700,000.00	1,837,344.19
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	894,476.19
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,285,879.60
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,094,373.48
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,896,010.06
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,462,330.12
	GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,409,747.98
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,166,115.20
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,283,761.69
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,938,200.47
	GOV OF MALAYSIA	1,060,000.00	1,135,330.49
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,254,094.38
	GOV OF MALAYSIA	1,540,000.00	1,632,671.65
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	661,797.42
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,073,815.94
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	1,037,136.04
	GOV OF MALAYSIA	1,270,000.00	1,309,031.16
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	856,169.64
	GOV OF MALAYSIA	790,000.00	889,989.11
GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,066,961.00	
GOV OF MALAYSIA	820,000.00	829,179.40	
	マレーシアリングgit 小計	35,360,000.00	38,156,550.95

				(978,715,531)
イスラエルシケル	GOV OF ISRAEL		1,570,000.00	1,741,444.00
	GOV OF ISRAEL		1,860,000.00	1,884,738.00
	GOV OF ISRAEL		1,120,000.00	1,145,032.00
	GOV OF ISRAEL		1,610,000.00	1,808,432.50
	GOV OF ISRAEL		910,000.00	908,771.50
	GOV OF ISRAEL		1,820,000.00	1,888,887.00
	GOV OF ISRAEL		1,450,000.00	1,654,522.50
	GOV OF ISRAEL		920,000.00	929,522.00
	GOV OF ISRAEL		1,840,000.00	1,968,892.00
	GOV OF ISRAEL		1,610,000.00	2,163,759.50
	GOV OF ISRAEL		1,800,000.00	1,992,510.00
	GOV OF ISRAEL		1,540,000.00	1,730,729.00
	GOV OF ISRAEL		1,310,000.00	1,335,741.50
	GOV OF ISRAEL		930,000.00	931,813.50
	GOV OF ISRAEL		1,860,000.00	3,218,823.00
	GOV OF ISRAEL		1,900,000.00	2,656,200.00
	イスラエルシケル 小計			24,050,000.00
合計				204,319,207,796 (204,319,207,796)

(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 240銘柄	100.0%	43.2%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 322銘柄	100.0%	41.7%
英ポンド	国債証券 48銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
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	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.7%
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	32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.4%

（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）

2020年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	18,699,003
コール・ローン	11,894,997
投資信託受益証券	4,768,336,421
未収入金	19,491,738
流動資産合計	4,818,422,159
資産合計	4,818,422,159
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,916
未払解約金	11,414,000
未払利息	32
流動負債合計	11,428,948
負債合計	11,428,948
純資産の部	
元本等	
元本	4,438,908,043
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	368,085,168
元本等合計	4,806,993,211
純資産合計	4,806,993,211

2020年12月10日現在

負債純資産合計

4,818,422,159

## 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12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	4,297,173,503円
期中一部解約元本額	4,952,748,186円
期末元本額	4,438,908,043円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	722,067,133円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	482,020,238円
りそなラップ型ファンド(成長型)	263,613,613円
DCりそな グローバルバランス	12,769,595円
つみたてバランスファンド	483,403,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	198,802,747円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	102,656,624円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	62,347,583円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	5,126,998円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,955,761円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,558,065円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,628,129円
リスクコントロール・オープン	2,173,388円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	58,560,517円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	2,180,500円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	945,383,403円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,555,592円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	78,211,310円
Smart-i 8資産バランス 成長型	77,867,930円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	238,159,065円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	211,274,236円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	124,184,057円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	80,693,023円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	206,852,663円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,113,368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)	749,444円
2. 計算日における受益権の総数	4,438,908,043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	1.0829円
(10,000口当たり純資産額)	(10,829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

2020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、運用評価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

2020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)

2020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	2020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		105,139,123
合計		105,139,123

(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)

(2020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	13,508,903	-	13,523,819	14,916
	米ドル	13,508,903	-	13,523,819	14,916
	合計	13,508,903	-	13,523,819	14,916

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	538,147	32,003,602.09	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	417,992	13,722,677.36	
		米ドル 小計	956,139	45,726,279.45	(4,768,336,421)
	合計			4,768,336,421	(4,768,336,421)

(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)

2020年12月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	5,556,346,244
コール・ローン	2,882,088,070
株式	64,395,246,690
投資証券	1,445,537,804
派生商品評価勘定	471,456,106
未収入金	33,184
未収配当金	81,647,330
差入委託証拠金	3,051,071,645
流動資産合計	77,883,427,073
資産合計	77,883,427,073
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	274,778
未払解約金	2,894,854,000
未払利息	7,817
流動負債合計	2,895,136,595
負債合計	2,895,136,595
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	49,679,839,868
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	25,308,450,610
元本等合計	74,988,290,478
純資産合計	74,988,290,478
負債純資産合計	77,883,427,073

## 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	<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 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12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	55,498,393,240円
期中一部解約元本額	42,597,711,807円
期末元本額	49,679,839,868円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,226,237,297円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,288,971,511円

りそなラップ型ファンド(成長型)	4,200,266,471円
DCりそな グローバルバランス	22,090,023円
つみたてバランスファンド	1,397,493,220円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	817,251,797円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	405,294,155円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	242,233,603円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	20,345,333円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	15,486,966円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,030,402円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,869,775円
リスクコントロール・オープン	40,376,622円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	344,823,505円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	152,830,667円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	21,072,759,645円
Smart-i 先進国株式インデックス	3,920,902,294円
Smart-i 8資産バランス 安定型	135,717,442円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	299,017,505円
Smart-i 8資産バランス 成長型	313,851,031円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,041,180,502円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,818,052,396円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,068,828,476円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	694,439,321円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,773,283,024円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	292,511,438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)	5,092,522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)	396,143,642円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,601,563,556円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	52,895,727円
2. 計算日における受益権の総数	49,679,839,868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	1.5094円
(10,000口当たり純資産額)	(15,094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

2020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、運用評価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

2020年12月10日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2.時価の算定方法

株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	5,640,650,488	
投資証券	82,344,231	
合計	5,558,306,257	

(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)

(2020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	株価指数先物取引 買建	8,667,266,660	-	9,138,447,988	471,181,328
	合計	8,667,266,660	-	9,138,447,988	471,181,328

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	22.73	163,315.05	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	16.77	90,943.71	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	60.45	151,971.30	
	CHEVRON CORP	26,491	90.44	2,395,846.04	

CONCHO RESOURCES INC	2,677	62.13	166,322.01
CONOCOPHILLIPS	14,168	42.70	604,973.60
EOG RESOURCES INC	7,783	52.96	412,187.68
EXXON MOBIL CORP	58,218	42.80	2,491,730.40
HALLIBURTON CO	11,937	19.51	232,890.87
HESS CORP	4,079	54.09	220,633.11
KINDER MORGAN INC	27,151	14.61	396,676.11
MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	42.64	372,630.96
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	13,724	19.39	266,108.36
ONEOK INC	6,554	40.22	263,601.88
PHILLIPS 66	5,838	68.77	401,479.26
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,424	114.43	277,378.32
SCHLUMBERGER LTD	18,563	23.37	433,817.31
VALERO ENERGY CORP	5,488	58.80	322,694.40
WILLIAMS COS INC	16,239	22.40	363,753.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,096	270.57	837,684.72
ALBEMARLE CORP	1,582	142.55	225,514.10
AMCOR PLC	23,330	11.61	270,861.30
AVERY DENNISON CORP	928	153.90	142,819.20
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	28.99	48,877.14
BALL CORP	4,409	93.36	411,624.24
CELANESE CORP	1,759	130.55	229,637.45
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	39.06	115,500.42
CORTEVA INC	10,203	39.01	398,019.03
CROWN HOLDINGS INC	1,510	97.10	146,621.00
DOW INC	9,910	54.66	541,680.60
DUPONT DE NEMOURS INC	9,759	67.57	659,415.63
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	104.15	195,697.85
ECOLAB INC	3,609	225.90	815,273.10
FMC CORP	1,927	118.93	229,178.11
FREEMPORT-MCMORAN INC	19,809	24.46	484,528.14
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	49.54	274,154.36
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,182	115.22	136,190.04
LINDE PLC	7,260	251.14	1,823,276.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	88.54	325,473.04

MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	277.18	256,668.68
MOSAIC CO/THE	3,288	22.41	73,684.08
NEWMONT CORP	10,613	59.98	636,567.74
NUCOR CORP	4,490	56.43	253,370.70
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	136.32	178,851.84
PPG INDUSTRIES INC	3,178	145.39	462,049.42
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	88.43	127,869.78
SEALED AIR CORP	1,397	45.88	64,094.36
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,149	720.64	828,015.36
STEEL DYNAMICS INC	2,352	38.78	91,210.56
VULCAN MATERIALS CO	1,832	141.75	259,686.00
WESTROCK CO	3,862	44.89	173,365.18
3M CO	7,994	175.29	1,401,268.26
ALLEGION PLC	1,026	111.36	114,255.36
AMETEK INC	3,087	118.76	366,612.12
BOEING CO/THE	7,426	232.06	1,723,277.56
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	37.84	417,753.60
CATERPILLAR INC	7,524	180.07	1,354,846.68
CUMMINS INC	1,966	224.19	440,757.54
DEERE & CO	4,154	254.83	1,058,563.82
DOVER CORP	2,147	123.24	264,596.28
EATON CORP PLC	5,290	117.89	623,638.10
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	81.60	644,476.80
FASTENAL CO	7,657	49.63	380,016.91
FORTIVE CORP	4,092	69.64	284,966.88
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	84.52	159,066.64
GENERAC HOLDINGS INC	936	209.43	196,026.48
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	154.14	498,180.48
GENERAL ELECTRIC CO	121,691	11.39	1,386,060.49
HD SUPPLY HOLDINGS INC	2,416	55.87	134,981.92
HEICO CORP	647	130.88	84,679.36
HEICO CORP-CLASS A	819	120.65	98,812.35
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,692	212.24	2,057,030.08
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	25.45	148,984.30
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	173.44	104,757.76

IDEX CORP	1,126	194.46	218,961.96
ILLINOIS TOOL WORKS	4,425	206.57	914,072.25
INGERSOLL-RAND INC	5,287	44.99	237,862.13
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	109.70	194,717.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	55.07	154,196.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	26.15	60,145.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	45.79	453,962.06
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	188.30	538,161.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	286.06	134,448.20
LOCKHEED MARTIN CORP	3,495	361.35	1,262,918.25
MASCO CORP	3,079	54.05	166,419.95
NORDSON CORP	746	198.53	148,103.38
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	303.73	632,365.86
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	65.49	360,980.88
OWENS CORNING	1,611	75.25	121,227.75
PACCAR INC	4,610	87.38	402,821.80
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	276.32	474,165.12
PENTAIR PLC	2,474	52.60	130,132.40
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,167	73.54	1,556,621.18
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	251.28	389,484.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	419.54	578,126.12
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	49.61	83,444.02
SMITH (A.O.) CORP	1,507	57.67	86,908.69
SNAP-ON INC	772	182.08	140,565.76
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	178.29	368,882.01
SUNRUN INC	1,550	57.12	88,536.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	550	394.70	217,085.00
TEXTRON INC	3,103	48.07	149,161.21
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	141.05	450,654.75
TRANSDIGM GROUP INC	689	595.50	410,299.50
UNITED RENTALS INC	983	246.75	242,555.25
WABTEC CORP	2,696	76.50	206,244.00
WW GRAINGER INC	677	411.22	278,395.94
XYLEM INC	2,684	98.53	264,454.52
CINTAS CORP	1,181	354.04	418,121.24

COPART INC	2,853	114.08	325,470.24
COSTAR GROUP INC	524	853.29	447,123.96
EQUIFAX INC	1,644	179.98	295,887.12
IHS MARKIT LTD	5,054	90.27	456,224.58
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	94.32	284,374.80
ROBERT HALF INTL INC	1,565	64.61	101,114.65
ROLLINS INC	2,014	54.56	109,883.84
TRANSUNION	2,592	94.61	245,229.12
VERISK ANALYTICS INC	2,060	193.45	398,507.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	102.11	359,631.42
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	116.58	648,651.12
AMERCO	106	431.97	45,788.82
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	95.08	141,288.88
CSX CORP	10,702	91.73	981,694.46
DELTA AIR LINES INC	1,316	42.11	55,416.76
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,507	90.63	227,209.41
FEDEX CORP	3,480	295.32	1,027,713.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	139.51	162,668.66
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	196.85	258,464.05
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	41.66	43,493.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	240.86	815,070.24
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	202.77	262,992.69
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	45.76	100,900.80
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	53.79	688,350.63
UNION PACIFIC CORP	9,382	205.88	1,931,566.16
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,792	169.18	1,656,610.56
XPO LOGISTICS INC	977	120.20	117,435.40
APTIV PLC	3,602	123.73	445,675.46
AUTOLIV INC	743	94.22	70,005.46
BORGWARNER INC	3,548	39.86	141,423.28
FORD MOTOR CO	52,187	9.45	493,167.15
GENERAL MOTORS CO	17,042	44.43	757,176.06
LEAR CORP	775	158.64	122,946.00
TESLA INC	10,210	604.48	6,171,740.80
DR HORTON INC	4,656	69.91	325,500.96

GARMIN LTD	1,968	119.45	235,077.60
HASBRO INC	1,788	88.76	158,702.88
LENNAR CORP-A	3,733	72.39	270,231.87
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	363.56	595,511.28
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	134.41	75,807.24
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	20.75	114,830.50
NIKE INC -CL B	17,217	138.79	2,389,547.43
NVR INC	54	4,034.32	217,853.28
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,689	110.79	297,914.31
PULTEGROUP INC	3,683	42.08	154,980.64
VF CORP	4,481	88.13	394,910.53
WHIRLPOOL CORP	714	185.04	132,118.56
ARAMARK	2,216	38.44	85,183.04
CARNIVAL CORP	6,635	22.69	150,548.15
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,313.98	466,462.90
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	114.39	205,444.44
DOMINO'S PIZZA INC	590	384.97	227,132.30
DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	48.94	124,894.88
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	106.70	400,978.60
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	57.99	297,198.75
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	130.47	484,696.05
MCDONALD'S CORP	10,270	208.69	2,143,246.30
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	18.96	68,256.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	29.94	210,388.38
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	82.37	202,712.57
STARBUCKS CORP	16,209	100.40	1,627,383.60
VAIL RESORTS INC	557	286.25	159,441.25
WYNN RESORTS LTD	1,017	111.16	113,049.72
YUM! BRANDS INC	4,053	106.57	431,928.21
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,874	82.58	897,974.92
ALPHABET INC-CL A	4,117	1,777.86	7,319,449.62
ALPHABET INC-CL C	4,114	1,784.13	7,339,910.82
ALTICE USA INC- A	4,447	34.80	154,755.60
CABLE ONE INC	68	2,079.48	141,404.64
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,998	644.08	1,286,871.84

COMCAST CORP-CLASS A	62,734	51.26	3,215,744.84
DISCOVERY INC - A	1,722	28.50	49,077.00
DISCOVERY INC-C	3,336	25.18	84,000.48
DISH NETWORK CORP-A	3,674	36.13	132,741.62
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	133.17	517,898.13
FACEBOOK INC-A	32,918	277.92	9,148,570.56
FOX CORP - CLASS A	3,877	29.24	113,363.48
FOX CORP- CLASS B	1,836	28.73	52,748.28
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	140.17	157,831.42
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	23.70	139,213.80
LIBERTY BROADBAND-A	223	157.24	35,064.52
LIBERTY BROADBAND-C	1,523	160.08	243,801.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	43.15	92,901.95
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	42.21	74,162.97
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	42.32	40,034.72
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	70.26	172,488.30
MATCH GROUP INC	3,380	143.52	485,097.60
NETFLIX INC	6,074	493.60	2,998,126.40
NEWS CORP - CLASS A	5,861	18.27	107,080.47
OMNICOM GROUP	3,237	64.36	208,333.32
PINTEREST INC- CLASS A	6,698	68.47	458,612.06
ROKU INC	1,447	306.23	443,114.81
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.41	66,580.67
SNAP INC - A	12,546	49.15	616,635.90
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,602	183.68	294,255.36
TWITTER INC	10,694	47.23	505,077.62
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	36.44	291,884.40
WALT DISNEY CO/THE	24,844	154.43	3,836,658.92
ZILLOW GROUP INC - A	904	119.90	108,389.60
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	117.23	232,936.01
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	157.95	147,999.15
AMAZON.COM INC	5,817	3,104.20	18,057,131.40
AUTOZONE INC	311	1,136.67	353,504.37
BEST BUY CO INC	3,104	104.76	325,175.04
BOOKING HOLDINGS INC	566	2,107.11	1,192,624.26

BURLINGTON STORES INC	893	237.40	211,998.20
CARMAX INC	2,353	94.87	223,229.11
CARVANA CO	902	255.50	230,461.00
CHEWY INC - CLASS A	1,090	75.57	82,371.30
DOLLAR GENERAL CORP	3,308	208.98	691,305.84
DOLLAR TREE INC	3,180	110.86	352,534.80
EBAY INC	9,836	49.50	486,882.00
ETSY INC	1,722	159.23	274,194.06
EXPEDIA GROUP INC	1,958	128.84	252,268.72
GENUINE PARTS CO	1,957	97.95	191,688.15
HOME DEPOT INC	14,748	265.58	3,916,773.84
LKQ CORP	2,845	37.21	105,862.45
LOWE'S COS INC	10,409	160.13	1,666,793.17
MERCADOLIBRE INC	587	1,536.54	901,948.98
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	444.02	436,471.66
POOL CORP	578	334.90	193,572.20
ROSS STORES INC	4,714	113.80	536,453.20
TARGET CORP	6,913	174.07	1,203,345.91
TIFFANY & CO	1,214	131.28	159,373.92
TJX COMPANIES INC	16,596	66.72	1,107,285.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	135.58	227,367.66
ULTA BEAUTY INC	726	275.66	200,129.16
WAYFAIR INC- CLASS A	864	240.60	207,878.40
COSTCO WHOLESALE CORP	6,083	374.29	2,276,806.07
KROGER CO	10,508	31.21	327,954.68
SYSCO CORP	6,442	76.41	492,233.22
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	41.77	415,862.12
WALMART INC	19,472	148.27	2,887,113.44
ALTRIA GROUP INC	25,841	42.98	1,110,646.18
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	49.84	367,769.36
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	76.75	316,056.50
BUNGE LTD	1,423	63.50	90,360.50
CAMPBELL SOUP CO	1,995	47.28	94,323.60
COCA-COLA CO/THE	56,069	53.33	2,990,159.77
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,797	47.62	133,193.14

CONAGRA BRANDS INC	6,526	35.71	233,043.46
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	209.38	464,404.84
GENERAL MILLS INC	7,972	59.33	472,978.76
HERSHEY CO/THE	1,965	152.14	298,955.10
HORMEL FOODS CORP	4,355	47.07	204,989.85
JM SMUCKER CO/THE	1,257	118.06	148,401.42
KELLOGG CO	3,449	62.00	213,838.00
KEURIG DR PEPPER INC	8,271	30.26	250,280.46
KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	34.22	306,029.46
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	77.40	165,249.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,284	93.12	305,806.08
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	48.08	134,383.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19,830	57.72	1,144,587.60
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	87.90	458,046.90
PEPSICO INC	19,035	145.69	2,773,209.15
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,507	84.61	1,819,707.27
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	69.16	272,767.04
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	86.44	278,596.12
CLOROX COMPANY	1,647	200.51	330,239.97
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,289	84.75	956,742.75
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,127	246.65	771,274.55
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	135.76	601,281.04
PROCTER & GAMBLE CO/THE	34,093	136.41	4,650,626.13
ABBOTT LABORATORIES	24,356	106.32	2,589,529.92
ABIOMED INC	494	266.15	131,478.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	509.01	512,573.07
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	101.11	228,003.05
ANTHEM INC	3,497	318.44	1,113,584.68
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	79.30	532,578.80
BECTON DICKINSON AND CO	4,044	239.96	970,398.24
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	34.13	640,347.06
CARDINAL HEALTH INC	4,308	56.15	241,894.20
CENTENE CORP	7,685	63.45	487,613.25
CERNER CORP	4,098	74.41	304,932.18
CIGNA CORP	5,108	217.00	1,108,436.00

COOPER COS INC/THE	727	342.58	249,055.66
CVS HEALTH CORP	18,157	73.53	1,335,084.21
DANAHER CORP	8,807	222.84	1,962,551.88
DAVITA INC	1,175	111.30	130,777.50
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	54.50	175,381.00
DEXCOM INC	1,222	333.39	407,402.58
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	85.03	693,249.59
HCA HEALTHCARE INC	3,581	159.93	572,709.33
HENRY SCHEIN INC	2,103	71.15	149,628.45
HOLOGIC INC	3,815	71.83	274,031.45
HUMANA INC	1,738	408.14	709,347.32
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	449.88	507,914.52
INSULET CORP	967	243.88	235,831.96
INTUITIVE SURGICAL INC	1,625	753.51	1,224,453.75
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	202.37	268,140.25
MASIMO CORP	701	267.87	187,776.87
MCKESSON CORP	2,170	178.68	387,735.60
MEDTRONIC PLC	18,512	112.95	2,090,930.40
MOLINA HEALTHCARE INC	807	209.76	169,276.32
NOVOCURE LTD	1,266	161.02	203,851.32
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	124.17	245,608.26
RESMED INC	1,937	211.77	410,198.49
STERIS PLC	1,157	188.25	217,805.25
STRYKER CORP	4,699	235.93	1,108,635.07
TELADOC HEALTH INC	1,474	192.28	283,420.72
TELEFLEX INC	632	381.37	241,025.84
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,033	344.41	4,488,695.53
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	133.91	141,676.78
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,342	174.64	234,366.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	258.87	462,600.69
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	261.16	259,854.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	147.21	406,152.39
10X GENOMICS INC-CLASS A	892	144.32	128,733.44
ABBVIE INC	24,246	108.67	2,634,812.82
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	116.40	479,684.40

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	117.74	349,099.10
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	124.04	208,883.36
AMGEN INC	8,068	229.85	1,854,429.80
AVANTOR INC	6,265	26.46	165,771.90
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	541.87	133,300.02
BIOGEN INC	2,151	244.75	526,457.25
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	76.16	200,605.44
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	31,024	60.92	1,889,982.08
CATALENT INC	2,108	92.31	194,589.48
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	28.89	156,814.92
ELI LILLY & CO	11,862	158.00	1,874,196.00
EXACT SCIENCES CORP	2,304	130.33	300,280.32
GILEAD SCIENCES INC	17,383	60.82	1,057,234.06
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	70.10	224,320.00
ILLUMINA INC	1,933	337.76	652,890.08
INCYTE CORP	2,513	80.96	203,452.48
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	46.65	84,063.30
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	168.50	428,327.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	146.05	109,975.65
JOHNSON & JOHNSON	36,055	153.10	5,520,020.50
MERCK & CO. INC.	34,728	83.47	2,898,746.16
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	1,150.68	369,368.28
MODERNA INC	3,691	156.59	577,973.69
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	91.97	88,659.08
PERKINELMER INC	1,624	143.91	233,709.84
PERRIGO CO PLC	1,855	48.48	89,930.40
PFIZER INC	76,299	41.85	3,193,113.15
PPD INC	1,772	34.65	61,399.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,458	488.64	712,437.12
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	44.70	73,844.40
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	159.30	129,510.90
SEAGEN INC	1,643	181.36	297,974.48
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	10.65	136,522.35
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,436	461.38	2,508,061.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,629	224.38	814,275.02

VIATRIS INC	17,737	17.52	310,752.24
WATERS CORP	843	239.13	201,586.59
ZOETIS INC	6,586	158.70	1,045,198.20
BANK OF AMERICA CORP	106,922	28.80	3,079,353.60
CITIGROUP INC	28,659	58.95	1,689,448.05
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	35.81	203,221.75
FIFTH THIRD BANCORP	10,229	27.73	283,650.17
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	129.77	294,967.21
HUNTINGTON BANCSHARES INC	14,642	12.91	189,028.22
JPMORGAN CHASE & CO	41,718	121.05	5,049,963.90
KEYCORP	12,976	16.05	208,264.80
M & T BANK CORP	1,846	128.14	236,546.44
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	143.28	793,914.48
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	15.87	202,612.29
SVB FINANCIAL GROUP	685	348.13	238,469.05
TRUIST FINANCIAL CORP	18,676	47.88	894,206.88
US BANCORP	18,811	45.85	862,484.35
WELLS FARGO & CO	53,908	29.05	1,566,027.40
ALLY FINANCIAL INC	5,678	33.53	190,383.34
AMERICAN EXPRESS CO	9,575	121.69	1,165,181.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	193.24	323,870.24
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	46.95	73,007.25
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	40.79	436,534.58
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	19,252	227.51	4,380,022.52
BLACKROCK INC	2,122	701.68	1,488,964.96
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,940	62.39	557,766.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	94.92	579,201.84
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	30.00	37,500.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	88.88	110,122.32
CME GROUP INC	5,056	182.38	922,113.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	83.19	351,727.32
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	26.49	148,291.02
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	345.76	180,832.48
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	23.98	65,657.24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,581	242.82	1,112,358.42

INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	110.17	794,986.72
INVESCO LTD	5,927	17.70	104,907.90
KKR & CO INC	6,932	39.15	271,387.80
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	564.67	293,628.40
MOODY'S CORP	2,233	275.32	614,789.56
MORGAN STANLEY	18,743	64.37	1,206,486.91
MSCI INC	1,140	414.62	472,666.80
NASDAQ INC	1,746	126.10	220,170.60
NORTHERN TRUST CORP	2,987	93.22	278,448.14
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	92.56	157,629.68
S&P GLOBAL INC	3,373	327.28	1,103,915.44
SCHWAB (CHARLES) CORP	21,435	50.55	1,083,539.25
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	56.58	98,222.88
STATE STREET CORP	4,767	72.76	346,846.92
SYNCHRONY FINANCIAL	7,979	32.35	258,120.65
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	151.57	462,288.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	64.36	47,240.24
VOYA FINANCIAL INC	1,741	58.47	101,796.27
AFLAC INC	9,192	45.12	414,743.04
ALLEGHANY CORP	197	598.79	117,961.63
ALLSTATE CORP	4,209	105.19	442,744.71
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	88.79	68,901.04
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	39.94	463,543.64
AON PLC	3,057	207.05	632,951.85
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	33.55	204,688.55
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	117.48	303,568.32
ASSURANT INC	896	131.18	117,537.28
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	43.28	54,965.60
BROWN & BROWN INC	2,686	45.23	121,487.78
CHUBB LTD	6,327	153.03	968,220.81
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	81.33	141,026.22
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	227.56	86,927.92
EVEREST RE GROUP LTD	550	236.00	129,800.00
FNF GROUP	3,124	36.58	114,275.92
GLOBE LIFE INC	1,521	94.36	143,521.56

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,383	47.57	256,069.31
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	52.59	108,335.40
LOEWS CORP	2,906	43.16	125,422.96
MARKEL CORP	207	1,008.44	208,747.08
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	115.90	778,500.30
METLIFE INC	10,331	47.64	492,168.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	50.05	188,388.20
PROGRESSIVE CORP	8,272	93.60	774,259.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	80.23	425,860.84
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	120.82	123,357.22
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	164.07	92,207.34
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	134.91	457,075.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	207.57	359,511.24
MR BERKLEY CORP	2,140	65.07	139,249.80
CBRE GROUP INC - A	4,736	66.10	313,049.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.33	87,033.00
ACCENTURE PLC-CL A	8,750	246.77	2,159,237.50
ADOBE INC	6,583	483.74	3,184,460.42
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	104.43	226,717.53
ANSYS INC	1,132	334.55	378,710.60
AUTODESK INC	3,052	279.42	852,789.84
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,962	173.84	1,036,434.08
AVALARA INC	1,064	159.90	170,133.60
BLACK KNIGHT INC	2,282	87.41	199,469.62
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	87.40	134,683.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	148.31	248,122.63
CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	115.49	425,580.65
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	96.87	186,862.23
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	120.86	201,111.04
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	131.82	224,753.10
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,240	77.31	173,174.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	79.01	561,919.12
COUPA SOFTWARE INC	887	307.30	272,575.10
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,914	166.17	318,049.38
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	109.23	77,771.76

DATADOG INC - CLASS A	1,771	95.65	169,396.15
DOCUSIGN INC	2,288	220.97	505,579.36
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	21.26	57,295.70
DYNATRACE INC	2,449	38.66	94,678.34
EPAM SYSTEMS INC	745	320.58	238,832.10
FAIR ISAAC CORP	389	498.32	193,846.48
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,567	147.77	1,265,945.59
FISERV INC	7,910	114.58	906,327.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	267.06	298,306.02
FORTINET INC	1,600	125.34	200,544.00
GARTNER INC	1,196	154.58	184,877.68
GLOBAL PAYMENTS INC	4,167	195.66	815,315.22
GODADDY INC - CLASS A	2,217	83.82	185,828.94
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	120.92	109,795.36
HUBSPOT INC	629	379.57	238,749.53
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,287	126.79	1,557,868.73
INTUIT INC	3,606	364.18	1,313,233.08
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	157.00	132,351.00
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	104.11	204,367.93
MASTERCARD INC-CLASS A	12,242	336.85	4,123,717.70
MICROSOFT CORP	98,226	211.80	20,804,266.80
MONGODB INC	644	280.01	180,326.44
NORTONLIFELOCK INC	6,268	19.49	122,163.32
OKTA INC	1,540	232.38	357,865.20
ORACLE CORP	27,510	59.73	1,643,172.30
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	302.15	386,752.00
PAYCHEX INC	4,283	93.22	399,261.26
PAYCOM SOFTWARE INC	719	421.66	303,173.54
PAYPAL HOLDINGS INC	15,303	210.80	3,225,872.40
PTC INC	1,603	111.57	178,846.71
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	338.98	330,505.50
SALESFORCE.COM INC	12,489	220.57	2,754,698.73
SERVICENOW INC	2,649	527.99	1,398,645.51
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	42.09	216,216.33
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	371.26	141,078.80

SPLUNK INC	2,092	155.59	325,494.28
SQUARE INC - A	5,144	207.04	1,065,013.76
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	72.34	224,109.32
SYNOPSYS INC	1,988	232.77	462,746.76
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	885.26	483,351.96
TWILIO INC - A	1,834	312.54	573,198.36
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	444.70	260,149.50
VERISIGN INC	1,385	204.41	283,107.85
VISA INC-CLASS A SHARES	23,094	209.58	4,840,040.52
VMWARE INC-CLASS A	1,126	141.16	158,946.16
WESTERN UNION CO	5,513	22.28	122,829.64
WIX.COM LTD	747	248.27	185,457.69
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	219.48	502,170.24
ZENDESK INC	1,677	132.32	221,900.64
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,398	385.36	924,093.28
ZSCALER INC	963	176.70	170,162.10
AMPHENOL CORP-CL A	3,944	133.62	526,997.28
APPLE INC	233,699	121.78	28,459,864.22
ARISTA NETWORKS INC	777	277.59	215,687.43
ARROW ELECTRONICS INC	902	94.95	85,644.90
CDW CORP/DE	2,130	131.95	281,053.50
CISCO SYSTEMS INC	58,210	44.69	2,601,404.90
COGNEX CORP	1,928	76.15	146,817.20
CORNING INC	10,238	37.66	385,563.08
DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	71.53	235,762.88
F5 NETWORKS INC	916	170.58	156,251.28
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	12.13	233,551.02
HP INC	19,172	23.19	444,598.68
IPG PHOTONICS CORP	558	207.87	115,991.46
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	21.90	99,272.70
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	124.67	317,409.82
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	172.90	394,730.70
NETAPP INC	2,471	60.78	150,187.38
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	63.53	200,691.27
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	118.82	522,689.18

TRIMBLE INC	3,417	63.24	216,091.08
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	51.10	209,510.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	793	376.87	298,857.91
AT&T INC	98,260	31.46	3,091,259.60
CENTURYLINK INC	12,971	10.45	135,546.95
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	24.19	31,592.14
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	23.22	81,339.66
T-MOBILE US INC	7,827	131.12	1,026,276.24
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,968	61.46	3,501,253.28
AES CORP	9,870	20.85	205,789.50
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	52.29	193,700.68
AMEREN CORPORATION	3,331	77.80	259,151.80
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	83.60	547,245.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	148.47	359,000.46
ATMOS ENERGY CORP	1,353	97.75	132,255.75
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	22.23	151,608.60
CMS ENERGY CORP	3,883	59.80	232,203.40
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	74.24	332,075.52
DOMINION ENERGY INC	11,742	74.30	872,430.60
DTE ENERGY COMPANY	2,584	124.98	322,948.32
DUKE ENERGY CORP	10,265	91.39	938,118.35
EDISON INTERNATIONAL	5,098	62.91	320,715.18
ENTERGY CORP	2,701	104.46	282,146.46
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	47.70	117,580.50
EVERGY INC	2,522	55.50	139,971.00
EVERSOURCE ENERGY	4,479	86.02	385,283.58
EXELON CORP	12,893	41.09	529,773.37
FIRSTENERGY CORP	8,044	30.64	246,468.16
NEXTERA ENERGY INC	27,024	73.67	1,990,858.08
NISOURCE INC	4,230	23.20	98,136.00
NRG ENERGY INC	3,312	33.81	111,978.72
OGE ENERGY CORP	2,970	32.81	97,445.70
P G & E CORP	21,589	12.39	267,487.71
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	81.33	124,109.58
PPL CORP	10,335	28.88	298,474.80

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	56.89	383,779.94	
	SEMPRA ENERGY	3,870	128.96	499,075.20	
	SOUTHERN CO/THE	14,774	60.77	897,815.98	
	UGI CORP	3,091	35.26	108,988.66	
	VISTRA CORP	4,854	19.01	92,274.54	
	WEC ENERGY GROUP INC	4,196	92.74	389,137.04	
	XCEL ENERGY INC	6,948	65.56	455,510.88	
	ADVANCED MICRO DEVICES	16,160	89.83	1,451,652.80	
	ANALOG DEVICES INC	4,806	141.78	681,394.68	
	APPLIED MATERIALS INC	12,609	87.82	1,107,322.38	
	BROADCOM INC	5,520	416.22	2,297,534.40	
	ENPHASE ENERGY INC	1,709	127.26	217,487.34	
	INTEL CORP	58,306	50.07	2,919,381.42	
	KLA CORP	2,030	256.49	520,674.70	
	LAM RESEARCH CORP	2,014	493.83	994,573.62	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,745	42.56	372,187.20	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,781	84.99	321,347.19	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	139.80	450,156.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	15,347	71.41	1,095,929.27	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	308.61	187,943.49	
	NVIDIA CORP	8,445	517.23	4,368,007.35	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	157.32	573,903.36	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	30.67	166,384.75	
	QORVO INC	1,631	160.38	261,579.78	
	QUALCOMM INC	15,483	156.02	2,415,657.66	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	148.29	325,348.26	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	716	271.76	194,580.16	
	TERADYNE INC	2,370	114.02	270,227.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	12,577	162.76	2,047,032.52	
	XILINX INC	3,193	141.40	451,490.20	
	米ドル 小計	4,239,920		441,158,041.54 (46,003,960,571)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	14.84	36,565.76	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	31.15	507,246.60	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	7.51	77,630.87	

ENBRIDGE INC	28,581	43.02	1,229,554.62
IMPERIAL OIL LTD	2,877	24.77	71,263.29
INTER PIPELINE LTD	3,471	13.25	45,990.75
KEYERA CORP	2,259	23.50	53,086.50
PARKLAND CORP	1,790	41.50	74,285.00
PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	34.25	295,783.00
SUNCOR ENERGY INC	20,962	23.05	483,174.10
TC ENERGY CORP	12,551	57.90	726,702.90
AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	90.64	310,079.44
B2GOLD CORP	10,119	7.13	72,148.47
BARRICK GOLD CORP	23,822	29.92	712,754.24
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	59.07	98,824.11
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	19.91	183,430.83
FRANCO-NEVADA CORP	2,617	173.79	454,808.43
KINROSS GOLD CORP	19,092	9.37	178,892.04
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	52.67	165,436.47
LUNDIN MINING CORP	7,300	9.82	71,686.00
NUTRIEN LTD	7,998	64.21	513,551.58
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	38.47	78,863.50
SSR MINING INC	2,800	24.46	68,488.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	23.07	170,810.28
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	52.34	327,700.74
YAMANA GOLD INC	9,288	7.11	66,037.68
CAE INC	3,196	31.51	100,705.96
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	93.02	131,716.32
WSP GLOBAL INC	1,340	116.30	155,842.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	36.56	114,615.60
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	90.73	164,130.57
THOMSON REUTERS CORP	2,714	103.53	280,980.42
AIR CANADA	840	26.19	21,999.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,995	141.72	1,416,491.40
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,833	435.67	798,583.11
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,285	80.79	346,185.15
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	35.64	64,152.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	78.59	324,262.34

QUEBECOR INC -CL B	1,274	32.85	41,850.90
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	23.37	133,933.47
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	165.29	154,215.57
DOLLARAMA INC	3,451	55.00	189,805.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	44.65	523,119.40
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	36.08	94,818.24
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	65.82	139,143.48
METRO INC	4,107	59.56	244,612.92
WESTON (GEORGE) LTD	817	100.65	82,231.05
SAPUTO INC	3,667	37.60	137,879.20
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	26.34	86,316.18
CANOPY GROWTH CORP	3,659	34.91	127,735.69
BANK OF MONTREAL	8,502	98.33	836,001.66
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	68.36	1,095,195.56
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	111.76	664,077.92
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	72.75	335,814.00
ROYAL BANK OF CANADA	19,705	106.25	2,093,656.25
TORONTO-DOMINION BANK	25,036	72.37	1,811,855.32
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	53.20	955,418.80
CI FINANCIAL CORP	775	16.58	12,849.50
IGM FINANCIAL INC	81	35.28	2,857.68
ONEX CORPORATION	908	72.73	66,038.84
TMX GROUP LTD	540	125.89	67,980.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	454.39	148,131.14
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	29.41	127,286.48
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	57.85	72,543.90
INTACT FINANCIAL CORP	2,057	154.00	316,778.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	23.15	614,586.20
POWER CORP OF CANADA	8,338	29.79	248,389.02
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	57.41	463,700.57
FIRSTSERVICE CORP	671	167.60	112,459.60
BLACKBERRY LTD	1,407	10.64	14,970.48
CGI INC	3,488	94.33	329,023.04
CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,642.75	451,756.25
OPEN TEXT CORP	4,289	58.85	252,407.65

	SHOPIFY INC - CLASS A	1,503	1,326.95	1,994,405.85
	BCE INC	2,440	58.39	142,471.60
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	61.02	315,656.46
	TELUS CORP	4,085	25.99	106,169.15
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	20.53	183,702.44
	ALTAGAS LTD	2,930	18.65	54,644.50
	ATCO LTD -CLASS I	863	38.31	33,061.53
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,371	89.59	122,827.89
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	31.92	31,505.04
	EMERA INC	4,109	54.28	223,036.52
	FORTIS INC	6,487	52.63	341,410.81
	HYDRO ONE LTD	4,991	29.07	145,088.37
	NORTHLAND POWER INC	3,252	43.64	141,917.28
	カナダドル 小計	514,556		27,879,796.67 (2,268,021,459)
ユーロ	ENI SPA	35,538	8.84	314,262.53
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.16	67,890.42
	NESTE OYJ	5,733	57.90	331,940.70
	OMV AG	1,475	32.84	48,439.00
	REPSOL SA	21,728	8.85	192,466.62
	TENARIS SA	5,062	6.81	34,512.71
	TOTAL SE	35,015	36.89	1,291,878.42
	VOPAK	762	43.73	33,322.26
	AIR LIQUIDE SA	6,642	134.85	895,673.70
	AKZO NOBEL	2,659	89.36	237,608.24
	ARCELORMITTAL	11,383	17.35	197,563.34
	ARKEMA	822	95.70	78,665.40
	BASF SE	12,913	63.51	820,104.63
	COVESTRO AG	2,528	49.64	125,489.92
	CRH PLC	10,365	33.35	345,672.75
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	26.61	47,711.73
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	46.58	50,539.30
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	59.84	129,493.76
	KONINKLIJKE DSM NV	2,331	135.20	315,151.20
	LANXESS AG	745	62.42	46,502.90

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	37.50	149,100.00
SOLVAY SA	925	98.74	91,334.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	14.74	128,473.84
SYMRISE AG	1,815	105.25	191,028.75
UMICORE	2,388	37.45	89,430.60
UPM-KYMMENE OYJ	8,076	29.29	236,546.04
VOESTALPINE AG	2,425	28.15	68,263.75
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	27.32	78,545.00
AIRBUS SE	7,861	93.59	735,710.99
ALSTOM	3,998	44.97	179,790.06
BOUYGUES SA	3,499	34.66	121,275.34
BRENTAG AG	2,419	63.40	153,364.60
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	9.06	147,576.34
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	39.29	284,341.73
DASSAULT AVIATION SA	11	900.50	9,905.50
EIFFAGE	1,313	81.28	106,720.64
FERROVIAL SA	7,014	23.04	161,602.56
GEA GROUP AG	1,676	28.47	47,715.72
HOCHTIEF AG	17	79.35	1,348.95
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	72.45	148,522.50
KION GROUP AG	740	69.52	51,444.80
KNORR-BREMSE AG	1,136	106.28	120,734.08
KONE OYJ-B	4,561	67.40	307,411.40
LEGRAND SA	3,715	70.46	261,758.90
MTU AERO ENGINES AG	831	208.20	173,014.20
PRYSMIAN SPA	2,867	26.75	76,692.25
RATIONAL AG	80	722.00	57,760.00
SAFRAN SA	4,327	120.00	519,240.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	114.50	838,598.00
SIEMENS AG-REG	10,651	113.82	1,212,296.82
SIEMENS ENERGY AG	5,006	25.13	125,800.78
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	28.52	65,424.88
THALES SA	1,768	78.06	138,010.08
VINCI SA	7,391	85.50	631,930.50
WARTSILA OYJ ABP	2,705	8.42	22,792.33

BUREAU VERITAS SA	4,564	22.73	103,739.72
RANDSTAD NV	1,871	52.38	98,002.98
TELEPERFORMANCE	832	269.50	224,224.00
WOLTERS KLUWER	3,691	69.42	256,229.22
ADP	314	106.00	33,284.00
AENA SME SA	1,045	137.00	143,165.00
ATLANTIA SPA	8,066	15.38	124,055.08
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	9.95	13,999.65
DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	39.35	520,639.85
GETLINK	4,655	13.82	64,332.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	73.03	330,241.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	55.35	34,261.65
CONTINENTAL AG	1,647	113.50	186,934.50
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	57.66	657,208.68
FAURECIA	800	40.97	32,776.00
FERRARI NV	1,758	179.55	315,648.90
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	16,479	13.77	227,014.70
MICHELIN (CGDE)	2,383	106.15	252,955.45
PEUGEOT SA	8,853	21.07	186,532.71
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	54.96	97,554.00
RENAULT SA	3,099	36.51	113,159.98
VALEO SA	3,692	31.68	116,962.56
VOLKSWAGEN AG	462	160.20	74,012.40
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	147.22	368,344.44
ADIDAS AG	2,705	281.40	761,187.00
ESSILORLUXOTTICA	3,854	129.10	497,551.40
HERMES INTERNATIONAL	437	830.20	362,797.40
KERING	1,018	574.30	584,637.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,853	498.00	1,918,794.00
MONCLER SPA	2,414	46.61	112,516.54
PUMA SE	1,586	86.90	137,823.40
SEB SA	151	145.10	21,910.10
ACCOR SA	2,330	31.10	72,463.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,314	164.55	380,768.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	35.83	28,878.98

SODEXO	1,088	73.42	79,880.96
BOLLORE	3,240	3.35	10,873.44
PUBLICIS GROUPE	3,613	40.16	145,098.08
SCOUT24 AG	1,621	66.25	107,391.25
SES	2,232	7.87	17,574.76
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	78.42	85,869.90
VIVENDI	11,862	25.90	307,225.80
DELIVERY HERO SE	1,926	103.70	199,726.20
HELLOFRESH SE	2,219	50.20	111,393.80
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	27.14	400,993.50
JUST EAT TAKEAWAY	1,952	89.54	174,782.08
PROSUS NV	6,873	93.00	639,189.00
ZALANDO SE	2,148	78.94	169,563.12
CARREFOUR SA	7,042	13.90	97,919.01
COLRUYT SA	290	49.59	14,381.10
JERONIMO MARTINS	5,217	14.37	74,994.37
KESKO OYJ-B SHS	4,478	20.24	90,634.72
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	23.60	346,070.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	58.23	592,606.71
DANONE	8,264	51.90	428,901.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	9.32	84,046.53
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	79.50	144,690.00
HEINEKEN NV	3,455	90.64	313,161.20
JDE PEET'S BV	1,184	32.88	38,929.92
KERRY GROUP PLC-A	2,069	119.40	247,038.60
PERNOD RICARD SA	2,853	157.45	449,204.85
REMY COINTREAU	264	144.90	38,253.60
BEIERSDORF AG	1,128	91.32	103,008.96
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	78.60	122,773.20
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	89.46	214,346.16
L'OREAL	3,494	302.00	1,055,188.00
UNILEVER PLC	18,967	48.13	912,976.54
AMPLIFON SPA	2,059	32.33	66,567.47
BIOMERIEUX	402	116.90	46,993.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	110.30	27,023.50

DIASORIN SPA	256	168.50	43,136.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	68.28	201,835.68
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	38.05	219,814.85
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	42.64	515,474.96
ORPEA	501	105.85	53,030.85
SARTORIUS AG-VORZUG	502	358.80	180,117.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	40.70	140,944.10
ARGENX SE	674	229.80	154,885.20
BAYER AG-REG	12,953	47.40	613,972.20
EUROFINS SCIENTIFIC	1,530	63.70	97,461.00
GALAPAGOS NV	507	98.10	49,736.70
GRIFOLS SA	3,329	23.93	79,662.97
IPSEN	158	68.50	10,823.00
MERCK KGAA	1,798	135.70	243,988.60
ORION OYJ-CLASS B	739	39.00	28,821.00
QIAGEN N.V.	2,679	41.10	110,106.90
RECORDATI SPA	830	44.12	36,619.60
SANOFI	15,691	81.52	1,279,130.32
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	291.60	129,470.40
UCB SA	2,009	88.10	176,992.90
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.50	32,351.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	4.15	378,449.86
BANCO SANTANDER SA	240,521	2.72	655,539.98
BNP PARIBAS	14,918	44.54	664,522.31
CAIXABANK S.A	52,513	2.29	120,254.77
COMMERZBANK AG	13,866	5.33	73,961.24
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	10.46	172,830.58
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	25.40	99,593.40
FINECOBANK SPA	7,003	13.24	92,754.73
ING GROEP NV-CVA	51,310	8.32	427,258.37
INTESA SANPAOLO	223,051	1.97	440,748.77
KBC GROEP NV	3,531	60.42	213,343.02
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.53	51,688.06
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	16.76	20,380.16
SOCIETE GENERALE SA	12,059	17.67	213,106.64

UNICREDIT SPA	29,529	8.02	237,088.34
AMUNDI SA	618	66.55	41,127.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	9.28	254,875.20
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	137.70	353,062.80
EURAZEO	403	54.50	21,963.50
EXOR NV	1,318	60.16	79,290.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	81.86	162,000.94
NATIXIS	3,105	2.69	8,374.18
SOFINA	168	265.00	44,520.00
WENDEL	294	98.00	28,812.00
AEGON NV	16,557	3.16	52,369.79
AGEAS	2,765	41.72	115,355.80
ALLIANZ SE-REG	5,820	197.26	1,148,053.20
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	14.32	229,285.95
AXA SA	26,166	19.90	520,808.06
CNP ASSURANCES	1,015	13.33	13,529.95
HANNOVER RUECK SE	718	135.60	97,360.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	240.20	451,335.80
NN GROUP NV	4,060	34.34	139,420.40
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.40	45,173.84
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	35.21	228,512.90
SCOR SE	1,565	27.54	43,100.10
AROUNDTOWN SA	10,475	6.31	66,097.25
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	42.11	206,802.21
LEG IMMOBILIEN AG	1,031	119.34	123,039.54
VONOVIA SE	7,029	55.96	393,342.84
ADYEN NV	239	1,739.00	415,621.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,112	60.92	372,343.04
ATOS SE	1,599	74.72	119,477.28
BECHTLE AG	414	176.40	73,029.60
CAPGEMINI SA	2,213	118.15	261,465.95
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	154.15	278,240.75
EDEMRED	3,764	46.37	174,536.68
NEMETSCHKE SE	536	57.90	31,034.40
NEXI SPA	7,091	16.28	115,441.48

SAP SE	14,429	101.96	1,471,180.84
TEAMVIEWER AG	2,285	38.17	87,218.45
WORLDLINE SA	3,094	73.22	226,542.68
NOKIA OYJ	76,089	3.47	264,142.96
ALTICE EUROPE NV	7,300	4.47	32,674.80
CELLNEX TELECOM SA	4,483	51.18	229,439.94
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	47,340	15.06	712,940.40
ELISA OYJ	2,152	44.61	96,000.72
ILIAD SA	98	177.05	17,350.90
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	10.10	24,967.20
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.51	148,367.08
ORANGE	28,127	10.22	287,598.57
PROXIMUS	918	18.02	16,542.36
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.39	28,651.14
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.42	30,613.03
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.35	29,710.68
TELEFONICA SA	69,076	3.85	266,357.05
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	33.37	25,561.42
E.ON SE	30,402	9.19	279,394.38
EDF	10,409	12.79	133,131.11
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	4.68	173,939.25
ELIA GROUP SA/NV	345	93.50	32,257.50
ENAGAS SA	2,667	20.23	53,953.41
ENDESA SA	4,803	22.61	108,595.83
ENEL SPA	113,841	8.12	924,388.92
ENGIE	25,193	12.57	316,801.97
FORTUM OYJ	6,395	18.44	117,923.80
IBERDROLA SA	83,775	11.24	941,631.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	18.98	88,219.04
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.63	81,603.41
RWE AG	8,723	33.88	295,535.24
SNAM SPA	32,585	4.53	147,610.05
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	15.90	92,185.38
TERNA SPA	16,305	6.10	99,558.33
UNIPER SE	2,857	27.90	79,710.30

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	20.04	171,702.72
	VERBUND AG	797	59.70	47,580.90
	ASML HOLDING NV	5,862	383.30	2,246,904.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	18,294	29.48	539,307.12
	STMICROELECTRONICS NV	8,739	29.96	261,820.44
	ユーロ 小計	2,505,775		56,950,592.23 (7,174,066,103)
英債券	BP PLC	284,061	2.72	774,350.28
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	57,449	13.83	794,979.26
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	52,102	13.34	695,457.49
	ANGLO AMERICAN PLC	16,694	24.96	416,682.24
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	14.34	61,948.80
	BHP GROUP PLC	28,186	19.16	540,269.24
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	62.70	137,501.10
	EVRAZ PLC	3,072	4.38	13,461.50
	FRESNILLO PLC	2,896	11.35	32,869.60
	GLENCORE PLC	138,176	2.37	328,444.35
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	24.08	43,416.24
	MONDI PLC	5,627	17.45	98,191.15
	RIO TINTO PLC	15,750	53.69	845,617.50
	ASHTREAD GROUP PLC	6,287	32.65	205,270.55
	BAE SYSTEMS PLC	43,957	5.15	226,554.37
	BUNZL PLC	4,790	24.22	116,013.80
	DCC PLC	1,401	56.26	78,820.26
	FERGUSON PLC	3,075	85.04	261,498.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.62	124,534.43
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	1.29	139,035.36
	SMITHS GROUP PLC	3,824	15.68	59,979.44
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	111.70	94,721.60
	EXPERIAN PLC	12,198	27.37	333,859.26
	INTERTEK GROUP PLC	1,825	58.20	106,215.00
	RELX PLC	25,710	18.04	463,936.95
	RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	4.98	104,028.18
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	6.30	76,459.26
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	43.51	65,177.98

BURBERRY GROUP PLC	5,808	17.85	103,672.80
PERSIMMON PLC	5,194	26.85	139,458.90
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.60	69,418.48
COMPASS GROUP PLC	24,300	14.49	352,107.00
GVC HOLDINGS PLC	6,950	10.39	72,245.25
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	47.71	119,847.52
WHITBREAD PLC	2,921	31.51	92,040.71
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.60	63,549.85
INFORMA PLC	17,619	5.61	98,983.54
PEARSON PLC	7,332	6.74	49,447.00
WPP PLC	19,572	7.84	153,522.76
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.08	40,086.72
KINGFISHER PLC	29,802	2.73	81,627.67
NEXT PLC	1,878	68.64	128,905.92
OCADO GROUP PLC	6,371	23.26	148,189.46
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.22	62,059.81
TESCO PLC	132,370	2.26	299,818.05
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.77	40,758.67
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	22.62	112,511.88
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	32,021	29.09	931,490.89
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	22.84	41,934.24
DIAGEO PLC	32,550	29.58	962,991.75
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	15.46	220,175.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,941	64.84	644,574.44
UNILEVER PLC	17,261	43.52	751,198.72
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	15.24	184,830.72
ASTRAZENECA PLC	18,127	80.12	1,452,335.24
GLAXOSMITHKLINE PLC	69,675	13.98	974,613.90
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	24.79	33,516.08
BARCLAYS PLC	231,567	1.45	337,856.25
HSBC HOLDINGS PLC	281,727	4.03	1,135,359.81
LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.37	351,559.91
NATWEST GROUP PLC	73,118	1.67	122,692.00
STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.75	189,156.90

	3I GROUP PLC	14,053	11.38	159,923.14	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	14.75	45,253.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	86.58	368,311.32	
	M&G PLC	41,949	1.95	81,800.55	
	SCHRODERS PLC	1,161	32.16	37,337.76	
	ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	10.92	84,668.75	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	2.82	93,014.08	
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	27.98	76,805.10	
	AVIVA PLC	60,743	3.33	202,395.67	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	2.97	58,359.86	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	2.55	213,355.27	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	7.11	62,282.50	
	PRUDENTIAL PLC	34,888	12.90	450,055.20	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	16,473	6.75	111,291.58	
	AVEVA GROUP PLC	700	32.84	22,988.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	5.70	86,565.90	
	HALMA PLC	4,416	23.44	103,511.04	
	BT GROUP PLC	129,623	1.38	179,268.60	
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.32	477,756.01	
	NATIONAL GRID PLC	46,737	8.99	420,352.57	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	23.50	64,249.00	
	SSE PLC	14,351	14.31	205,434.56	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	9.49	74,416.83	
	英ポンド 小計	4,005,916		21,481,227.52 (2,995,986,802)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	18.30	52,136.70	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	817.50	63,765.00	
	GIVAUDAN-REG	124	3,613.00	448,012.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	7,141	47.56	339,625.96	
	SIKA AG-REG	1,908	227.40	433,879.20	
	ABB LTD-REG	24,382	24.03	585,899.46	
	GEBERIT AG-REG	504	527.20	265,708.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	240.40	51,686.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	244.80	113,342.40	
	ADECCO SA-REG	2,354	55.28	130,129.12	

	SGS SA-REG	90	2,626.00	236,340.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	197.10	166,352.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	75.78	529,853.76	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	232.90	95,489.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	44.96	11,284.96	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,026.00	85,092.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	8,155.00	122,325.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	85,000.00	85,000.00	
	NESTLE SA-REG	39,531	100.02	3,953,890.62	
	ALCON INC	6,601	57.02	376,389.02	
	SONOVA HOLDING AG-REG	840	222.50	186,900.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	1,037.50	120,350.00	
	LONZA GROUP AG-REG	985	545.00	536,825.00	
	NOVARTIS AG-REG	30,528	81.29	2,481,621.12	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,649	306.25	2,955,006.25	
	VIFOR PHARMA AG	638	133.40	85,109.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	95.00	25,935.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	11.62	382,681.46	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	50.88	181,590.72	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	987.40	255,736.60	
	UBS GROUP AG-REG	48,789	12.89	629,134.15	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	153.80	101,200.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	403.70	148,561.60	
	SWISS RE AG	4,010	82.08	329,140.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,123	363.70	772,135.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	84.25	94,107.25	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	121.15	89,287.55	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	79.86	185,195.34	
	SWISSCOM AG-REG	414	478.70	198,181.80	
	スイスフラン 小計	235,120		17,904,900.74 (2,099,528,660)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	221.20	243,098.80	
	BOLIDEN AB	4,039	292.00	1,179,388.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	9,468	139.60	1,321,732.80	
	ALFA LAVAL AB	4,566	220.50	1,006,803.00	

ASSA ABLOY AB-B	13,841	206.20	2,854,014.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	445.50	4,064,742.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	387.80	2,153,065.60	
EPIROC AB-A	9,564	148.00	1,415,472.00	
EPIROC AB-B	4,649	140.30	652,254.70	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	187.50	274,500.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,889	259.40	1,268,206.60	
SANDVIK AB	15,627	195.95	3,062,110.65	
SKANSKA AB-B SHS	4,937	209.90	1,036,276.30	
SKF AB-B SHARES	4,538	215.30	977,031.40	
VOLVO AB-B SHS	20,302	194.10	3,940,618.20	
SECURITAS AB-B SHS	3,833	144.05	552,143.65	
ELECTROLUX AB-SER B	3,653	206.70	755,075.10	
HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	100.50	285,118.50	
EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	761.80	1,429,898.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	186.35	1,787,282.85	
ICA GRUPPEN AB	1,462	419.60	613,455.20	
SWEDISH MATCH AB	1,999	655.80	1,310,944.20	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	263.40	2,160,143.40	
NORDEA BANK ABP	43,708	74.16	3,241,385.28	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	91.04	2,174,308.32	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	86.44	1,988,552.20	
SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	158.46	2,116,391.76	
EQT AB	2,344	191.20	448,172.80	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	272.60	467,236.40	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	262.70	618,133.10	
INVESTOR AB-B SHS	6,250	592.60	3,703,750.00	
KINNEVIK AB - B	3,881	388.50	1,507,768.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	920	437.40	402,408.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	427.70	677,049.10	
ERICSSON LM-B SHS	39,493	105.50	4,166,511.50	
HEXAGON AB-B SHS	3,933	707.80	2,783,777.40	
TELE2 AB-B SHS	7,424	111.75	829,632.00	
TELIA CO AB	31,100	35.22	1,095,342.00	
	352,059		60,563,794.11	

スウェーデンクローナ 小計				(743,723,391)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	14,162	150.80	2,135,629.60
	NORSK HYDRO ASA	20,202	38.78	783,433.56
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	357.30	990,435.60
	ADEVINTA ASA	3,943	131.00	516,533.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	314.20	173,438.40
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	354.90	413,458.50
	MOWI ASA	5,643	179.85	1,014,893.55
	ORKLA ASA	11,182	85.22	952,930.04
	DNB ASA	13,159	162.40	2,137,021.60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	185.30	495,492.20
	TELENOR ASA	9,278	154.50	1,433,451.00
ノルウェークローネ 小計		84,732		11,046,717.05 (130,461,728)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	611.40	744,685.20
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	344.70	1,149,229.80
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,236.00	288,444.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	1,243.50	3,364,911.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	12,030.00	469,170.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	12,800.00	1,267,200.00
	DSV PANALPINA A S	2,852	1,003.00	2,860,556.00
	PANDORA A/S	1,659	635.40	1,054,128.60
	CARLSBERG AS-B	1,603	950.00	1,522,850.00
	AMBU A/S-B	1,526	206.10	314,508.60
	COLOPLAST-B	1,680	917.20	1,540,896.00
	DEMANT A/S	550	221.00	121,550.00
	GN STORE NORD A/S	1,892	485.10	917,809.20
	GENMAB A/S	907	2,354.00	2,135,078.00
	H LUNDBECK A/S	120	194.00	23,280.00
	NOVO NORDISK A/S-B	23,899	431.95	10,323,173.05
	DANSKE BANK A/S	9,894	103.10	1,020,071.40
	TRYG A/S	694	175.10	121,519.40
ORSTED A/S	2,606	1,056.50	2,753,239.00	
デンマーククローネ 小計		57,407		31,992,299.25 (541,309,703)

オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	30.41	91,594.92
	OIL SEARCH LTD	32,812	3.75	123,045.00
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	5.14	135,737.12
	SANTOS LTD	26,550	6.50	172,575.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	29.72	10,610.04
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	22.81	310,421.29
	BHP GROUP LTD	41,230	42.73	1,761,757.90
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	17.72	110,856.32
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	5.12	82,636.80
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	21.80	510,839.40
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	37.02	246,405.12
	NEWCREST MINING LTD	11,374	27.60	313,922.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	13.00	95,901.00
	ORICA LTD	6,263	16.24	101,711.12
	RIO TINTO LTD	5,096	115.44	588,282.24
	SOUTH32 LTD	74,829	2.62	196,051.98
	CIMIC GROUP LTD	682	26.79	18,270.78
	BRAMBLES LTD	17,428	11.14	194,147.92
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.25	97,903.00
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.36	46,632.00
	SYDNEY AIRPORT	22,505	6.67	150,108.35
	TRANSURBAN GROUP	37,559	14.00	525,826.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	31.31	285,202.79
	CROWN RESORTS LTD	773	9.74	7,529.02
	TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.89	82,596.37
	REA GROUP LTD	563	148.22	83,447.86
	SEEK LTD	3,309	27.21	90,037.89
	WESFARMERS LTD	15,132	50.25	760,383.00
	COLES GROUP LTD	18,622	18.27	340,223.94
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	39.79	674,878.19
	COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	12.76	65,956.44
	TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.28	65,424.00
COCHLEAR LTD	1,060	209.76	222,345.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	65.44	179,960.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	32.88	239,037.60	

	CSL LTD	6,304	304.14	1,917,298.56
	AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	23.30	876,149.90
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	24,511	83.18	2,038,824.98
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	46,101	23.44	1,080,607.44
	WESTPAC BANKING CORP	47,676	20.07	956,857.32
	AMP LTD	36,656	1.74	63,781.44
	ASX LTD	3,256	77.51	252,372.56
	MACQUARIE GROUP LTD	4,578	139.77	639,867.06
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	58.10	90,461.70
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	5.20	183,513.20
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.86	96,147.48
	QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	9.95	241,486.50
	SUNCORP GROUP LTD	19,255	10.18	196,015.90
	LENLEASE GROUP	8,292	14.32	118,741.44
	AFTERPAY LTD	2,984	98.45	293,774.80
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	14.52	81,370.08
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	31.57	50,512.00
	XERO LTD	1,891	141.00	266,631.00
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.07	222,148.27
	TPG TELECOM LTD	287	7.74	2,221.38
	AGL ENERGY LTD	7,599	13.34	101,370.66
	APA GROUP	13,816	10.47	144,653.52
	AUSNET SERVICES	1,437	1.85	2,658.45
	オーストラリアドル 小計	956,860		18,899,724.04 (1,466,996,579)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	8.15	181,663.50
	A2 MILK CO LTD	7,857	13.85	108,819.45
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	32.09	212,949.24
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	14.79	81,433.74
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.52	103,584.84
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.81	49,068.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	7.06	162,090.54
	ニュージーランドドル 小計	95,365		899,609.31 (65,833,409)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	55.80	2,176,200.00

TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	21,500	99.35	2,136,025.00		
MTR CORP	19,500	42.80	834,600.00		
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	18.44	553,200.00		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	60.40	1,932,800.00		
SANDS CHINA LTD	31,000	34.60	1,072,600.00		
SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.08	18,160.00		
WYNN MACAU LTD	5,200	13.52	70,304.00		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	26.40	580,800.00		
WH GROUP LTD	152,000	6.55	995,600.00		
BANK OF EAST ASIA	3,600	16.86	60,696.00		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	24.55	1,080,200.00		
HANG SENG BANK LTD	11,900	137.20	1,632,680.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,200	384.60	6,615,120.00		
AIA GROUP LTD	168,200	89.00	14,969,800.00		
CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	42.65	1,706,000.00		
ESR CAYMAN LTD	29,200	23.25	678,900.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	19.74	532,980.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	31.20	434,179.20		
NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	37.95	986,700.00		
SINO LAND CO	18,000	10.36	186,480.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	104.30	2,054,710.00		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	44.40	186,480.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	23.55	117,750.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	39.50	908,500.00		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.34	341,220.00		
PCCW LTD	4,000	4.79	19,160.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	39.55	174,020.00		
CLP HOLDINGS LTD	24,000	71.30	1,711,200.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.77	240,870.00		
HONG KONG & CHINA GAS	156,874	11.80	1,851,113.20		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	41.15	740,700.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	98.15	157,040.00		
香港ドル 小計	1,077,990		47,756,787.40 (642,328,790)		
シンガポールド	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.25	99,750.00	

ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.88	46,560.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.38	115,194.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.84	68,276.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.21	106,092.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	25.45	623,525.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	10.08	461,664.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	22.82	378,812.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	9.07	104,305.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	3.18	158,364.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.82	23,460.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.56	15,876.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.81	77,121.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.40	295,440.00	
	シンガポールドル 小計		443,800		2,574,439.00
イスラエルシ ケル	ICL GROUP LTD	4,122	15.59	64,261.98	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	390.30	148,704.30	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	22.00	401,082.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	19.30	345,933.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	11.75	88,348.25	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	70.90	100,252.60	
	AZRIELI GROUP	234	198.40	46,425.60	
	NICE SYSTEMS LTD	960	776.70	745,632.00	
イスラエルシケル 小計		50,785		1,940,639.93	(62,197,509)
合 計		14,620,285		64,395,246,690	(64,395,246,690)

(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	8,437	131,617.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	300,047.52	

AMERICAN TOWER CORP	6,152	1,349,994.88	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	133,190.10	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	324,411.05	
BOSTON PROPERTIES INC	2,200	221,056.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	108,927.48	
CROWN CASTLE INTL CORP	6,024	954,141.36	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	467,359.50	
DUKE REALTY CORP	5,513	210,431.21	
EQUINIX INC	1,170	793,728.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	146,773.35	
EQUITY RESIDENTIAL	5,175	317,072.25	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	242,674.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	216,000.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	231,906.94	
HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	159,283.74	
INVITATION HOMES INC	7,683	224,266.77	
IRON MOUNTAIN INC	4,068	123,504.48	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	122,199.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	209,175.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	88,237.10	
PROLOGIS INC	10,311	994,289.73	
PUBLIC STORAGE	2,131	468,052.84	
REALTY INCOME CORP	4,769	289,430.61	
REGENCY CENTERS CORP	1,514	72,217.80	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	416,578.80	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	386,796.72	
SUN COMMUNITIES INC	1,389	202,502.31	
UDR INC	3,355	132,925.10	
VENTAS INC	5,547	274,742.91	
VEREIT INC	11,100	84,249.00	
VICI PROPERTIES INC	7,940	201,993.60	
VORNADO REALTY TRUST	1,259	49,957.12	
WELLTOWER INC	5,753	374,060.06	
WEYERHAEUSER CO	10,330	327,564.30	
WP CAREY INC	2,436	169,155.84	

		米ドル 小計	177,880	11,520,515.27 (1,201,359,332)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		950	47,224.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1,530	26,484.30
		カナダドル 小計	2,480	73,708.80 (5,996,210)
ユーロ	COVIVIO		522	39,724.20
	GECINA SA		569	72,661.30
	KLEPIERRE		1,289	24,484.55
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		2,281	139,277.86
		ユーロ 小計	4,661	276,147.91 (34,786,352)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC		13,842	69,763.68
	LAND SECURITIES GROUP PLC		6,648	47,858.95
	SEGRO PLC		18,596	168,182.22
		英ポンド 小計	39,086	285,804.85 (39,861,202)
オーストラリアドル	DEXUS		13,745	132,089.45
	GOODMAN GROUP		23,275	422,906.75
	GPT GROUP		32,860	154,113.40
	MIRVAC GROUP		63,099	167,843.34
	SCENTRE GROUP		83,252	239,765.76
	STOCKLAND		29,890	129,124.80
	VICINITY CENTRES		42,168	73,372.32
		オーストラリアドル 小計	288,289	1,319,215.82 (102,397,531)
香港ドル	LINK REIT		31,300	2,172,220.00
		香港ドル 小計	31,300	2,172,220.00 (29,216,359)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		41,300	120,596.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER		74,160	154,252.80
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		23,000	47,840.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		38,500	73,920.00
	SUNTEC REIT		8,500	12,580.00
		シンガポールドル 小計	185,460	409,188.80 (31,920,818)

合計		1,445,537,804	
		(1,445,537,804)	

(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 594銘柄	97.5%		69.9%
	投資証券 37銘柄		2.5%	1.8%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式 235銘柄	99.5%		10.9%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.1%
英ポンド	株式 86銘柄	98.7%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.2%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	93.5%		2.2%
	投資証券 7銘柄		6.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 33銘柄	95.6%		1.0%
	投資証券 1銘柄		4.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.3%		0.3%
	投資証券 5銘柄		13.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## RAM新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2020年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	947,569,952
コール・ローン	195,253,293
株式	10,456,385,441
投資証券	9,215,979
派生商品評価勘定	147,513,700
未収入金	14,930
未収配当金	3,065,515
差入委託証拠金	759,035,454
流動資産合計	12,518,054,264
資産合計	12,518,054,264
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,524
未払金	5,094,968
未払解約金	212,873,000
未払利息	529
流動負債合計	217,984,021
負債合計	217,984,021
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	8,208,572,255
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,091,497,988
元本等合計	12,300,070,243
純資産合計	12,300,070,243
負債純資産合計	12,518,054,264

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>投資証券</p>
--------------------	--

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
<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12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	7,956,855,242円
期中一部解約元本額	7,133,506,043円
期末元本額	8,208,572,255円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	521,398,182円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,002,802,151円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,019,525,270円
DCりそな グローバルバランス	9,221,994円
つみたてバランスファンド	356,285,200円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	283,921,938円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	146,869,637円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	87,017,149円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	7,283,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,516,992円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,212,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,937,786円

リスクコントロール・オープン	6,288,613円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	83,075,746円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	13,968,701円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,046,579,733円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,053,427,073円
Smart-i 8資産バランス 安定型	42,505,837円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	102,404,224円
Smart-i 8資産バランス 成長型	114,153,546円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	344,307,409円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	307,426,064円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	180,353,390円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	117,416,268円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	299,307,001円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	49,330,093円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,035,637円
2. 計算日における受益権の総数	8,208,572,255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	1.4984円
(10,000口当たり純資産額)	(14,984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

2020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、運用評価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

2020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)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		1,230,049,318
投資証券		2,556,667
合計		1,227,492,651

(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)

(2020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	1,683,658,475	-	1,831,171,399	147,512,924
合計		1,683,658,475	-	1,831,171,399	147,512,924

(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	92,757	-	92,033	724
	米ドル	92,757	-	92,033	724
	売建	19,912,957	-	19,926,981	14,024
	米ドル	10,415,000	-	10,427,000	12,000
	ブラジルリアル	92,757	-	91,981	776
	香港ドル	9,405,200	-	9,408,000	2,800
合計		20,005,714	-	20,019,014	14,748

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	79,958	5.09	407,146.13	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,577	68.04	379,459.08	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,253	159.50	199,853.50	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	16,741	5.93	99,307.61	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	14,710	4.63	68,195.56	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,326	40.02	133,106.52	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	5.14	9,766.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	12.30	39,273.90	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	8,612	31.34	269,900.08	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	26.56	48,870.40	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	13.64	31,999.44	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	98.80	86,450.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	15.90	50,880.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,085	59.48	64,535.80	
	51JOB INC-ADR	300	73.50	22,050.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,600	28.04	157,024.00	
	NIO INC - ADR	14,100	44.01	620,541.00	
	XPENG INC - ADR	1,300	44.65	58,045.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	64.82	64,820.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,200	46.56	102,432.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	2,050	160.40	328,820.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	5,100	67.84	345,984.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,350	56.76	303,666.00	
	AUTOHOME INC-ADR	820	97.54	79,982.80	
BAIDU INC - SPON ADR	3,650	151.59	553,303.50		

BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,500	73.06	109,590.00	
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	12.55	20,080.00	
HUYA INC-ADR	900	20.08	18,072.00	
IQIYI INC-ADR	2,900	21.56	62,524.00	
JOYY INC	720	85.22	61,358.40	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	28.50	48,193.50	
MOMO INC-SPON ADR	1,950	13.75	26,812.50	
NETEASE INC-ADR	5,510	89.01	490,445.10	
SINA CORP	630	45.06	28,387.80	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	18.88	86,848.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	630	40.82	25,716.60	
YANDEX NV-A	4,000	69.03	276,120.00	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	24,830	263.80	6,550,154.00	
BAOZUN INC-SPN ADR	900	36.52	32,868.00	
JD.COM INC-ADR	11,420	81.82	934,384.40	
PINDUODUO INC-ADR	5,000	147.57	737,850.00	
TRIP.COM GROUP LTD	6,450	33.96	219,042.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	6,100	24.90	151,890.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	5,297	17.15	90,843.55	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	38.26	71,890.54	
BEIGENE LTD-ADR	600	222.45	133,470.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	900	28.46	25,614.00	
ZAI LAB LTD-ADR	900	106.15	95,535.00	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	3.89	73,911.52	
CREDICORP LTD	844	162.86	137,453.84	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	35,132	15.32	538,397.90	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.98	21,781.52	
LUFAX HOLDING LTD	2,100	14.15	29,715.00	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	36.98	18,490.00	
KE HOLDINGS INC	1,200	67.20	80,640.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.76	7,680.96	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,200	89.15	106,980.00	
GLOBANT SA	521	177.00	92,217.00	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	40.99	36,891.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,000	8.63	60,410.00	

	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	8.25	7,177.50	
	米ドル 小計	378,418		16,034,847.95	(1,672,113,944)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	10.59	2,007,864.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	42,200	76.82	3,241,804.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	325.37	601,934.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	44.02	625,084.00	
	ALFA S.A.B. -A	34,600	16.44	568,824.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	50.75	375,550.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	213.99	1,091,349.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	309.51	937,815.30	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	174.24	479,160.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	33,900	31.80	1,078,020.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	72.36	159,192.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	70,200	53.71	3,770,442.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	103.25	495,600.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	48.05	254,665.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	90.89	703,943.05	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,100	148.76	3,882,636.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	224.94	642,203.70	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	42.54	867,816.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	33.17	547,305.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	34,800	107.78	3,750,744.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	30,800	19.87	611,996.00		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	452,000	13.97	6,314,440.00		
TELESITES SAB DE CV	19,700	21.62	425,914.00		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	78.26	485,212.00		
	メキシコペソ 小計	1,034,230		33,919,513.55	(178,077,446)
ブラジルリアル	COSAN SA	2,000	70.00	140,000.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	49,500	27.26	1,349,370.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	63,200	26.94	1,702,608.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	22.50	234,000.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,300	62.27	205,491.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	25.82	255,618.00	

GERDAU SA-PREF	15,200	22.63	343,976.00	
KLABIN SA - UNIT	10,200	23.75	242,250.00	
SUZANO SA	10,207	52.48	535,663.36	
VALE SA	48,800	82.70	4,035,760.00	
WEG SA	11,550	71.00	820,050.00	
CCR SA	13,400	13.15	176,210.00	
LOCALIZA RENT A CAR	8,010	63.87	511,598.70	
RUMO SA	17,100	19.24	329,004.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	39.77	107,379.00	
B2W CIA DIGITAL	2,800	81.40	227,920.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	24.34	272,608.00	
LOJAS RENNER S.A.	9,800	44.54	436,492.00	
MAGAZINE LUIZA SA	39,000	23.98	935,220.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	20.95	201,120.00	
VIA VAREJO SA	15,900	17.21	273,639.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	19.27	57,810.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	71.72	121,924.00	
RAIA DROGASIL SA	14,000	24.25	339,500.00	
AMBEV SA	63,100	15.26	962,906.00	
BRF SA	5,900	22.68	133,812.00	
JBS SA	13,600	22.60	307,360.00	
NATURA &CO HOLDING SA	12,000	48.29	579,480.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	15.10	259,720.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,000	75.25	451,500.00	
HYPERA SA	4,000	32.23	128,920.00	
BANCO BRADESCO S.A.	18,120	22.73	411,867.60	
BANCO BRADESCO SA-PREF	58,890	25.73	1,515,239.70	
BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	35.96	384,772.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	42.95	188,980.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,200	30.54	1,960,668.00	
ITAUSA SA	59,400	11.27	669,438.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	27,800	56.65	1,574,870.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,400	79.44	270,096.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	28.58	280,084.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	4,358	42.52	185,302.16	

	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	24.84	54,648.00	
	TOTVS SA	7,200	25.73	185,256.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	5,600	45.30	253,680.00	
	TIM SA	9,000	14.32	128,880.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	36.45	123,930.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	35.97	176,253.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,119	13.02	183,829.38	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	69.40	76,340.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	45.32	226,600.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	30.40	69,920.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	46.87	93,740.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	43.30	98,507.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	21.25	252,875.00	
	ブラジルリアル 小計	836,329		26,044,685.40	(525,321,304)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	6,485.00	36,932,075.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,766.00	26,177,418.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,512	34,590.00	52,300,080.00	
	FALABELLA SA	10,992	2,624.80	28,851,801.60	
	CENCOSUD SA	18,824	1,330.00	25,035,920.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,631.00	9,769,785.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,797.00	5,121,450.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	73.32	44,112,904.68	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	27,650.00	16,424,100.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	35.49	34,131,584.76	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,275.00	6,636,375.00	
	COLBUN SA	83,944	124.00	10,409,056.00	
	ENEL AMERICAS SA	443,665	116.20	51,553,873.00	
	ENEL CHILE SA	369,172	55.34	20,429,978.48	
	チリペソ 小計	2,522,384		367,886,401.52	(51,651,250)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,235.00	158,738,640.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	32,300.00	82,106,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	32,500.00	194,350,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	24,430.00	63,224,840.00	

	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	24,940.00	165,676,420.00	
	コロンビアペソ 小計	88,777		664,096,500.00	(19,922,895)
ユーロ	OPAP SA	2,135	10.21	21,798.35	
	JUMBO SA	1,515	14.82	22,452.30	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	13.85	45,594.20	
	ユーロ 小計	6,942		89,844.85	(11,317,755)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	16.59	50,614.75	
	英ポンド 小計	3,050		50,614.75	(7,059,239)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	95.50	167,602.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	13.54	307,913.14	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	17.82	140,956.20	
	KOC HOLDING AS	8,691	18.85	163,825.35	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	7.03	119,510.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	12.30	67,650.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	122.50	65,047.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	68.60	409,473.40	
	AKBANK T.A.S.	43,035	6.20	266,817.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	9.28	294,370.88	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	6.55	164,005.45	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.93	86,763.16	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	10.53	126,981.27	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.44	294,765.04	
	トルコリラ 小計	230,654		2,675,680.89	(35,666,826)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	648.00	485,352.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	67.10	472,719.50	
	CEZ AS	2,147	466.50	1,001,575.50	
	チェココルナ 小計	9,941		1,959,647.00	(9,386,709)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,066.00	11,216,314.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	7,520.00	15,235,520.00	
	OTP BANK PLC	2,819	12,840.00	36,195,960.00	
		10,274		62,647,794.00	

	ハンガリーフォリント 小計			(22,133,465)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	61.70	247,417.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	19,031	5.27	100,293.37	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	185.00	335,775.00	
	LPP SA	19	7,365.00	139,935.00	
	CD PROJEKT SA	857	395.80	339,200.60	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	27.94	89,184.48	
	ALLEGRO.EU SA	3,100	75.57	234,267.00	
	DINO POLSKA SA	707	260.80	184,385.60	
	BANK PEKAO SA	2,676	63.84	170,835.84	
	PKO BANK POLSKI SA	11,255	29.15	328,083.25	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	188.50	101,413.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	28.58	223,752.82	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.35	29,838.65	
	PGE SA	9,929	6.40	63,585.31	
	ポーランドズロチ 小計	69,657		2,587,966.92	(73,601,779)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	5.80	162,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	330,000	3.36	1,108,800.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	14.52	624,360.00	
	CNOOC LTD	239,000	6.71	1,603,690.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	2.35	629,800.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	6.33	88,620.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	2.77	182,820.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	48.20	843,500.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	6.93	180,180.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	3.74	179,520.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	9.53	457,440.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	9.30	334,800.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	12.12	181,800.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	6.16	135,520.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	10.38	207,600.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	17.80	169,100.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	9.68	125,840.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	7.42	549,080.00		

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	4.48	197,120.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	67.95	237,825.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	60,000	3.82	229,200.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.76	105,280.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	36.55	767,550.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	13.06	169,780.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	4.78	112,330.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	3.56	156,640.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	4.88	146,400.00	
CITIC LTD	77,000	5.70	438,900.00	
CRRC CORP LTD - H	51,000	2.94	149,940.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	11.02	380,190.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	23.35	186,800.00	
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	8,000	5.87	46,960.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	19.00	152,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	26,000	15.50	403,000.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	12.12	155,136.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	6,700	25.30	169,510.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	9.22	180,712.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,250	30.10	218,225.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	41,000	4.43	181,630.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	19,000	49.55	941,450.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.98	179,600.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.56	196,800.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	6.75	135,000.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	9.36	168,480.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.87	126,620.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	7.02	273,780.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	5.07	91,260.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.42	168,400.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	12.70	196,850.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.95	107,100.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	6.26	212,840.00	
BYD CO LTD-H	8,500	179.00	1,521,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	7.93	253,760.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	7,600	34.65	263,340.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	80,000	21.75	1,740,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	43,000	15.30	657,900.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	7.85	314,000.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	37.45	374,500.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	16,000	14.12	225,920.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	15,000	109.00	1,635,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	3.33	179,820.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	18,000	38.50	693,000.00	
LI NING CO LTD	28,500	43.15	1,229,775.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,300	137.10	1,549,230.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	16.52	99,120.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	14.12	155,320.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	6.76	81,120.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	55.30	553,000.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	27.60	69,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	0.97	135,800.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	58.35	245,070.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	75,600	585.00	44,226,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	30.50	244,000.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	0.87	120,930.00	
MEITUAN	47,500	286.40	13,604,000.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	14.80	213,120.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	10.80	151,200.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,000	53.95	431,600.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	8.09	254,835.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	92.67	101,937.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	17.40	278,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	37,000	42.75	1,581,750.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	20,000	65.35	1,307,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.81	146,705.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	7,000	47.70	333,900.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	13.18	342,680.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	79.00	474,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	7.20	108,000.00	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.47	393,840.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	88.45	530,700.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	9,000	53.65	482,850.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	20.75	83,000.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	12.38	49,520.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	54,000	25.00	1,350,000.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	13.96	279,200.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	11,000	35.05	385,550.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	92.00	662,400.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	14.22	455,040.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	12.56	141,928.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	19.14	336,864.00	
3SBIO INC	13,000	7.06	91,780.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	167.50	100,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	7.85	125,600.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	3.96	43,560.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.77	90,480.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	124,000	7.47	926,280.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	12.10	217,800.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	152.50	289,750.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	16,000	33.95	543,200.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	13,500	56.20	758,700.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.34	75,950.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	106.00	222,600.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	34.85	209,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	142,250	6.84	972,990.00	
SSY GROUP LTD	10,000	4.67	46,700.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	3,624	124.40	450,825.60	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	40,500	79.40	3,215,700.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.89	1,109,760.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,059,000	2.68	2,838,120.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	4.23	469,530.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	4.63	182,885.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	3.33	382,950.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,273,000	5.90	7,510,700.00	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.96	139,120.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	52,500	48.00	2,520,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.35	326,685.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.17	57,060.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	810,000	4.80	3,888,000.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	4.33	541,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.51	158,550.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	10.58	148,120.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.72	264,320.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.91	93,730.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	17.94	315,744.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	16.94	482,790.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.30	240,700.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	10.66	166,296.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	6.61	288,196.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	11.98	208,452.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	100,000	17.36	1,736,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	37,800	29.50	1,115,100.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	14.18	345,992.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	31.95	341,865.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.44	307,440.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	6.19	532,340.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	78,500	94.45	7,414,325.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	34.60	179,920.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	10.18	183,240.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	7.33	102,620.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	15.62	374,880.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	3.65	270,100.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	53,500	17.64	943,740.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	4.58	68,700.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	30.80	1,355,200.00
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	26.50	585,650.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	6.01	252,420.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	106,000	10.04	1,064,240.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	11.96	179,400.00

GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	10.08	266,112.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,000	19.48	233,760.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	3.80	140,600.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	9.74	136,360.00	
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	11.92	226,480.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,000	42.20	1,055,000.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	53.20	63,840.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	6.39	153,360.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.60	135,200.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	24.70	395,200.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	36,000	27.85	1,002,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	20,000	19.46	389,200.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.58	164,320.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.62	55,440.00	
CHINA YOUZAN LTD	204,000	2.27	463,080.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	34,000	25.95	882,300.00	
KINGSOFT CORP LTD	10,000	40.70	407,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	18.60	241,800.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	42.05	399,475.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	38.80	349,200.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	29.20	277,400.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	11.56	190,740.00	
LENOVO GROUP LTD	92,000	5.72	526,240.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,700	153.60	1,489,920.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	164,000	27.50	4,510,000.00	
ZTE CORP-H	8,800	19.18	168,784.00	
CHINA MOBILE LTD	81,500	45.20	3,683,800.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	168,000	2.21	371,280.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	614,000	1.16	712,240.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	78,000	4.42	344,760.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	24.70	148,200.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.10	179,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.57	172,700.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	36,200	29.15	1,055,230.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	49,000	6.24	305,760.00	

	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.53	90,270.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	38.75	465,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	7.67	199,420.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,900	104.90	1,143,410.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	12.34	468,920.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	2.86	148,720.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	5.83	303,160.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	38.35	191,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	55,500	22.25	1,234,875.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	13.06	679,120.00	
	香港ドル 小計	11,892,324		170,684,773.60 (2,295,710,204)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.57	178,500.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	20.70	60,030.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	7.67	235,469.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	8.03	134,101.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.81	80,010.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.30	63,080.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.35	77,785.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.75	74,175.00	
	MISC BHD	17,600	7.01	123,376.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.40	29,920.00	
	GENTING BHD	32,900	4.39	144,431.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.59	84,434.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	32.48	68,208.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.86	29,580.00	
	IOI CORP BHD	32,500	4.45	144,625.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	23.70	151,680.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	136.80	136,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	8,220	18.78	154,371.60	
	QL RESOURCES BHD	17,150	6.12	104,958.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	5.03	152,912.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	14.66	347,442.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.59	177,762.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	5.82	96,612.00	

	SUPERMAX CORP BHD	19,217	7.75	148,931.75	
	TOP GLOVE CORP BHD	66,500	6.84	454,860.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.26	76,284.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	4.05	324,810.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	18.88	135,936.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	17.60	31,680.00	
	MALAYAN BANKING BHD	53,700	8.38	450,006.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	39,100	19.86	776,526.00	
	RHB BANK BHD	18,100	5.80	104,980.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.71	112,784.00	
	DIGI.COM BHD	39,700	4.15	164,755.00	
	MAXIS BHD	30,200	5.00	151,000.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.13	94,392.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,400	17.34	180,336.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	10.64	312,816.00	
	マレーシアリングット 小計	905,387		6,370,358.35	(163,399,691)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	20,000	103.00	2,060,000.00	
	PTT PCL-NVDR	154,400	43.00	6,639,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	55.50	732,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	35.25	581,625.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	59.75	1,959,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,800	395.00	4,266,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	59,300	68.00	4,032,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	9.20	823,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	10.40	1,097,200.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	5.00	311,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	28.00	1,360,800.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	35.00	721,875.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	14.50	1,277,450.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	38.00	627,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	79,400	61.75	4,902,950.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	28.50	1,615,950.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	39.75	258,375.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	14.70	714,420.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	132,600	22.10	2,930,460.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	126.50	759,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	6,700	71.75	480,725.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	133.00	1,037,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	121.50	2,587,950.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	11.90	297,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	91.50	905,850.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	21.90	400,770.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	53.50	438,700.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	55.75	423,700.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	61.50	553,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	56.25	1,653,750.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	8.50	819,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,100	343.00	1,749,300.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,600	189.00	3,137,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	56.50	1,615,900.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	38.00	368,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.40	289,340.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	52.25	496,375.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	212.00	848,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	48.25	863,675.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	71.50	521,950.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	36.00	1,159,200.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	56.75	635,600.00	
	タイパーツ 小計	1,534,625		58,956,090.00	(204,577,632)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	45.75	1,068,720.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	820.00	3,107,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	669.00	1,043,640.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,131	68.00	2,728,908.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	1,039.00	3,309,215.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	119.40	1,396,980.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	210.60	1,463,670.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	42.90	407,550.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,280	148.00	1,965,440.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	83.90	2,215,799.00	
	BDO UNIBANK INC	28,100	107.00	3,006,700.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	51.00	1,408,212.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.39	636,550.00	
	AYALA LAND INC	105,400	38.70	4,078,980.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.96	388,080.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	37.90	4,881,520.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,046.00	920,700.00	
	PLDT INC	980	1,325.00	1,298,500.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	27.10	433,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	300.00	942,000.00	
	フィリピンベソ 小計	693,348		36,702,564.00 (79,644,563)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,545.00	233,140,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	26,775.00	591,727,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	1,215.00	458,662,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	10,575.00	284,467,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	14,425.00	334,660,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,030.00	325,815,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	11,575.00	372,715,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	5,700.00	1,429,560,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,635.00	81,750,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,400.00	693,120,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	47,600.00	314,160,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	9,800.00	320,460,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	7,000.00	337,400,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	7,625.00	767,837,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,475.00	334,087,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	132,200	32,450.00	4,289,890,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	6,675.00	1,540,590,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	6,650.00	701,575,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	740,200	4,400.00	3,256,880,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,040.00	361,192,000.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	665,000	3,300.00	2,194,500,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,690.00	222,235,000.00		

	インドネシアルピア 小計	3,969,600		19,446,425,000.00 (143,903,545)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	37,700.00	18,473,000.00	
	S-OIL CORP	483	71,700.00	34,631,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	750	185,000.00	138,750,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,444	46,800.00	67,579,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,255	39,950.00	50,137,250.00	
	KOREA ZINC CO LTD	121	395,000.00	47,795,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	141,500.00	30,847,000.00	
	LG CHEM LTD	607	836,000.00	507,452,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	381,000.00	33,528,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	239	279,500.00	66,800,500.00	
	POSCO	989	273,000.00	269,997,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	286	105,500.00	30,173,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	383,000.00	42,130,000.00	
	CJ CORP	193	81,300.00	15,690,900.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	82,300.00	25,759,900.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	27,650.00	14,212,100.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	29,800.00	17,284,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	2,846	14,550.00	41,409,300.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	35,150.00	29,490,850.00	
	HANWHA CORPORATION	800	26,100.00	20,880,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	36,800.00	31,942,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	276,000.00	30,360,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	23,950.00	23,950,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	102,000.00	56,814,000.00	
	LG CORP	1,224	77,000.00	94,248,000.00	
	LOTTE CORP	242	34,750.00	8,409,500.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,073	124,500.00	133,588,500.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	13,350.00	32,106,750.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,960.00	48,072,720.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	454	245,500.00	111,457,000.00	
S-1 CORPORATION	228	80,500.00	18,354,000.00		
CJ LOGISTICS	135	160,500.00	21,667,500.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	185,500.00	40,624,500.00		

KOREAN AIR LINES CO LTD	955	27,750.00	26,501,250.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	4,155.00	13,615,935.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	40,200.00	38,833,200.00	
HANON SYSTEMS	2,393	16,350.00	39,125,550.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	885	241,500.00	213,727,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,979	191,500.00	378,978,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	89,900.00	41,713,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	86,600.00	29,097,600.00	
KIA MOTORS CORP	3,506	63,700.00	223,332,200.00	
COWAY CO LTD	531	70,500.00	37,435,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	42,000.00	27,468,000.00	
HLB INC	571	98,500.00	56,243,500.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	96,200.00	130,062,400.00	
KANGWON LAND INC	1,387	23,700.00	32,871,900.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	20,800.00	21,840,000.00	
KAKAO CORP	760	375,000.00	285,000,000.00	
NAVER CORP	1,629	288,000.00	469,152,000.00	
NCSOFT CORP	220	879,000.00	193,380,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	128,000.00	34,688,000.00	
PEARL ABYSS CORP	70	236,500.00	16,555,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	136,100.00	15,379,300.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	84,600.00	34,432,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	102,000.00	8,160,000.00	
SHINSEGAE INC	109	245,000.00	26,705,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	125,500.00	7,153,500.00	
E-MART INC	257	156,500.00	40,220,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	33,800.00	6,591,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	363,000.00	31,944,000.00	
KT&G CORP	1,569	84,600.00	132,737,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	122,000.00	30,622,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	555,000.00	7,215,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	422	217,000.00	91,574,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	57,200.00	24,538,800.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	125	1,555,000.00	194,375,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	695,000.00	21,545,000.00	

CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	836	150,000.00	125,400,000.00	
ALTEOGEN INC	240	170,700.00	40,968,000.00	
CELLTRION INC	1,266	353,500.00	447,531,000.00	
CELLTRION PHARM INC	234	209,700.00	49,069,800.00	
HANMI PHARM CO LTD	86	359,500.00	30,917,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	227	822,000.00	186,594,000.00	
SEEGENE INC	240	194,500.00	46,680,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	191,000.00	76,400,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	227	172,500.00	39,157,500.00	
YUHAN CORP	514	67,000.00	34,438,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	4,027	35,100.00	141,347,700.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	9,420.00	24,407,220.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,250	46,150.00	242,287,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	34,050.00	188,773,200.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	10,000.00	74,130,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	78,000.00	43,446,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,775.00	8,746,675.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,302	10,150.00	43,665,300.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	11,750.00	18,095,000.00	
SAMSUNG CARD CO	517	34,600.00	17,888,200.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	41,350.00	34,072,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	726	43,700.00	31,726,200.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	968	22,650.00	21,925,200.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	187,500.00	71,437,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	72,600.00	70,131,600.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	190	101,000.00	19,190,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	430	175,500.00	75,465,000.00	
KMW CO LTD	357	76,800.00	27,417,600.00	
LG DISPLAY CO LTD	3,338	16,100.00	53,741,800.00	
LG INNOTEK CO LTD	153	163,500.00	25,015,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	162,500.00	117,650,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	62,780	73,900.00	4,639,442,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	10,879	66,900.00	727,805,100.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	731	566,000.00	413,746,000.00	
LG UPLUS CORP	2,330	11,700.00	27,261,000.00	

	SK TELECOM	534	240,000.00	128,160,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	22,400.00	76,406,400.00	
	KOREA GAS CORPORATION	525	28,550.00	14,988,750.00	
	SK HYNIX INC	7,250	120,500.00	873,625,000.00	
	韓国ウォン 小計	191,814		14,466,578,450.00 (1,393,131,504)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	94.30	1,414,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	43.90	1,360,900.00	
	CHINA STEEL CORP	150,000	23.35	3,502,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	79.30	3,568,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	52,000	90.00	4,680,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	70,000	67.10	4,697,000.00	
	TAIWAN CEMENT	61,477	43.35	2,665,027.95	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	912.00	1,824,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	27.75	1,082,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	325.00	1,031,550.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	28.50	899,175.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	30.85	678,700.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	45.30	996,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	397.00	801,940.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	189.50	1,152,160.00	
	GIANT MANUFACTURING	4,000	275.00	1,100,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	324.00	648,000.00	
	POU CHEN	34,000	31.35	1,065,900.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	644.00	2,576,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	267.00	2,136,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	3,120	61.20	190,944.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	65.40	4,251,000.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	234.50	703,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	17.10	1,224,633.60	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	238,000	19.20	4,569,600.00		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	25.10	3,536,740.60		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	20.60	2,690,916.20		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	17.70	1,901,263.20		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	149,000	28.75	4,283,750.00		

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	11.05	1,602,194.75
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	12.95	1,538,058.55
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.53	759,274.16
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	19.75	2,337,886.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	49,000	39.15	1,918,350.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	156.50	2,503,530.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	19.45	2,449,144.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	41.00	4,059,000.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	176,000	8.90	1,566,400.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	22.05	615,172.95
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	45.10	3,788,400.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	8.56	1,325,387.60
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	44.50	293,700.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	40.40	382,992.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	259.00	1,813,000.00
ACER INC	38,000	24.90	946,200.00
ADVANTECH CO LTD	5,299	315.00	1,669,185.00
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	264.00	2,376,000.00
AU OPTRONICS CORP	122,000	15.60	1,903,200.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	207.50	1,867,500.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	88.00	441,320.00
COMPAL ELECTRONICS	46,000	20.50	943,000.00
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	251.00	6,526,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	54.70	765,800.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	165,800	89.00	14,756,200.00
INNOLUX CORP	90,000	13.55	1,219,500.00
INVENTEC CORP	28,000	24.20	677,600.00
LARGAN PRECISION CO LTD	1,350	3,470.00	4,684,500.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	49.25	1,329,750.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	132.00	1,320,000.00
PEGATRON CORP	26,000	69.40	1,804,400.00
QUANTA COMPUTER INC	37,000	81.90	3,030,300.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	45.35	770,950.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	83.20	1,414,400.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	230.00	1,150,000.00

	WISTRON CORP	29,951	32.15	962,924.65	
	WIWYNN CORP	1,000	691.00	691,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	17,960	42.15	757,014.00	
	YAGEO CORPORATION	5,198	499.00	2,593,802.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	122.50	735,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	108.50	5,533,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	61.00	1,464,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	97.80	2,053,800.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	79.50	3,259,500.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,690.00	845,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	658.00	1,974,000.00	
	MEDIATEK INC	20,000	734.00	14,680,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	91.90	1,562,300.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	321.50	2,250,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	346.00	346,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	100.50	1,005,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	409.00	2,454,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	2,310.00	2,310,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	324,000	520.00	168,480,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	146,000	49.90	7,285,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	123.50	1,482,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	358.00	1,432,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	26.50	1,113,000.00	
	新台湾ドル 小計	4,219,600		363,051,087.21 (1,343,289,022)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,598	395.15	3,397,499.70	
	COAL INDIA LTD	16,101	134.70	2,168,804.70	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	218.30	1,770,849.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	93.95	2,299,332.30	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	91.20	2,415,888.00	
	PETRONET LNG LTD	7,875	257.70	2,029,387.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	37,549	2,026.95	76,109,945.55	
	ACC LTD	1,105	1,656.60	1,830,543.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	252.85	1,957,059.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,129	2,522.30	12,936,876.70	

BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	677.95	1,789,110.05
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	920.25	2,974,248.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,528	241.00	5,188,248.00
JSW STEEL LTD	9,306	361.85	3,367,376.10
PI INDUSTRIES LTD	1,184	2,329.40	2,758,009.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	1,620.55	3,450,150.95
SHREE CEMENT LTD	150	24,420.70	3,663,105.00
TATA STEEL LTD	9,239	609.35	5,629,784.65
ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	5,144.80	7,336,484.80
UPL LTD	5,324	492.60	2,622,602.40
VEDANTA LTD	19,986	143.55	2,868,990.30
HAVELLS INDIA LTD	2,780	823.85	2,290,303.00
LARSEN & TOUBRO LTD	9,499	1,181.00	11,218,319.00
SIEMENS LTD	766	1,564.95	1,198,751.70
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	463.90	3,095,140.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	403.45	1,657,372.60
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,731.65	2,249,413.35
BAJAJ AUTO LTD	881	3,306.55	2,913,070.55
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	1,668.10	2,026,741.50
BHARAT FORGE LTD	3,030	548.50	1,661,955.00
EICHER MOTORS LTD	1,839	2,547.25	4,684,392.75
HERO MOTOCORP LTD	1,613	3,190.70	5,146,599.10
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,773	755.00	8,133,615.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,802	7,709.25	13,892,068.50
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	157.70	2,021,714.00
MRF LTD	27	78,371.30	2,116,025.10
TATA MOTORS LTD	22,991	182.70	4,200,455.70
PAGE INDUSTRIES LTD	54	24,278.20	1,311,022.80
TITAN CO LTD	4,773	1,426.15	6,807,013.95
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	2,518.05	2,822,734.05
INFO EDGE INDIA LTD	964	4,383.35	4,225,549.40
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	215.55	2,008,279.35
TRENT LTD	2,541	683.20	1,736,011.20
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,625.30	5,255,850.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,464	3,627.10	5,310,074.40

ITC LTD	39,545	205.40	8,122,543.00
NESTLE INDIA LTD	452	17,569.15	7,941,255.80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,154	565.50	4,611,087.00
UNITED SPIRITS LTD	3,058	583.80	1,785,260.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,567.90	2,641,911.50
DABUR INDIA LTD	7,196	502.15	3,613,471.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	704.95	3,792,631.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,853	2,292.20	24,877,246.60
MARICO LTD	7,098	398.40	2,827,843.20
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,300	2,442.70	3,175,510.00
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	888.20	3,286,340.00
BIOCON LTD	5,970	450.95	2,692,171.50
CIPLA LTD	6,268	762.40	4,778,723.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,884	3,725.40	7,018,653.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	5,056.90	7,438,699.90
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,255.05	2,257,305.05
LUPIN LTD	2,363	950.60	2,246,267.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	569.55	6,205,247.25
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,655.40	1,274,592.00
AXIS BANK LTD	29,968	634.20	19,005,705.60
BANDHAN BANK LTD	9,895	399.95	3,957,505.25
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	22,428	2,306.70	51,734,667.60
ICICI BANK LTD	67,302	511.50	34,424,973.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	7,353	1,883.55	13,849,743.15
STATE BANK OF INDIA	22,200	270.35	6,001,770.00
YES BANK LTD	141,484	19.00	2,688,196.00
BAJAJ FINANCE LTD	3,685	4,844.15	17,850,692.75
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,811.95	1,996,484.50
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,190.45	2,159,476.30
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,466.20	1,756,507.60
REC LTD	14,000	135.85	1,901,900.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,062.30	2,907,515.10
BAJAJ FINSERV LTD	521	9,010.65	4,694,548.65
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,748	652.60	5,708,944.80
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,453.40	3,758,492.40

	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	486.85	1,814,489.95	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	858.00	4,283,136.00	
	DLF LTD	9,206	212.20	1,953,513.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	14,482	870.55	12,607,305.10	
	INFOSYS LTD	44,914	1,175.20	52,782,932.80	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	3,265.85	2,442,855.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	12,388	2,810.80	34,820,190.40	
	TECH MAHINDRA LTD	8,467	929.50	7,870,076.50	
	WIPRO LTD	14,289	359.50	5,136,895.50	
	BHARTI AIRTEL LTD	15,312	503.05	7,702,701.60	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	246.40	591,360.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,600	1,070.10	5,992,560.00	
	GAIL INDIA LTD	24,471	122.50	2,997,697.50	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	483.15	2,278,535.40	
	NTPC LTD	63,698	98.30	6,261,513.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	29,117	192.70	5,610,845.90	
	インドルピー 小計	1,037,576		676,677,261.25 (960,881,710)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	18.88	120,832.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.26	121,119.71	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.07	100,845.00	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	10.90	260,651.70	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	4.38	95,330.56	
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.44	199,623.48	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	9.03	84,739.60	
	QATAR ISLAMIC BANK	15,926	16.92	269,467.92	
	QATAR NATIONAL BANK	60,107	18.23	1,095,750.61	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.44	85,071.20	
	OORED00 QPSC	12,412	7.12	88,472.73	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	18.40	149,003.20	
	カタールリアル 小計	313,315		2,670,907.71 (76,120,869)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	139.10	389,480.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	257.61	421,707.57	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,240.65	839,920.05	

ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,636	316.99	1,786,555.64	
GOLD FIELDS LTD	11,992	131.50	1,576,948.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	63.22	435,901.90	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,824	186.86	2,022,572.64	
KUMBA IRON ORE LTD	703	575.21	404,372.63	
NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	192.14	956,857.20	
SASOL LTD	7,017	138.81	974,029.77	
SIBANYE STILLWATER LTD	27,980	54.59	1,527,428.20	
BIDVEST GROUP LTD	4,193	164.50	689,748.50	
MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	134.11	819,143.88	
MR PRICE GROUP LTD	2,802	171.54	480,655.08	
NASPERS LTD-N SHS	5,730	3,141.63	18,001,539.90	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	36.20	469,152.00	
BID CORP LTD	4,319	271.00	1,170,449.00	
CLICKS GROUP LTD	3,433	236.96	813,483.68	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	130.92	853,467.48	
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	184.56	468,966.96	
TIGER BRANDS LTD	2,099	204.88	430,043.12	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	128.96	667,239.04	
ABSA GROUP LTD	9,806	117.10	1,148,282.60	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	941	1,303.95	1,227,016.95	
NEDBANK GROUP LTD	5,252	128.90	676,982.80	
STANDARD BANK GROUP LTD	17,330	126.79	2,197,270.70	
FIRSTRAND LTD	64,793	50.30	3,259,087.90	
REINET INVESTMENTS SCA	2,213	278.27	615,811.51	
REMGRO LTD	7,030	98.43	691,962.90	
DISCOVERY LTD	5,539	133.12	737,351.68	
OLD MUTUAL LTD	59,174	12.21	722,514.54	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	30.47	305,126.58	
SANLAM LTD	21,916	58.67	1,285,811.72	
NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	85.66	511,304.54	
MTN GROUP LTD	20,781	70.22	1,459,241.82	
VODACOM GROUP LTD	7,934	120.50	956,047.00	
南アフリカランド 小計	375,711		51,993,475.48	(362,394,524)

アラブディールハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	6.08	204,932.48	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	4.69	95,549.37	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.59	93,819.60	
	EMIRATES NBD PJSC	34,921	10.95	382,384.95	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,331	13.14	490,529.34	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	3.22	164,274.74	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.88	57,667.12	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	3.60	177,022.80	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	17.20	365,500.00	
アラブディールハム 小計		298,885		2,031,680.40	(57,780,990)
クウェートディナール	AGILITY	17,000	0.67	11,526.00	
	BOUBYAN BANK K.S.C	13,763	0.57	7,899.96	
	GULF BANK	19,790	0.22	4,353.80	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	55,281	0.68	37,591.08	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	85,336	0.84	72,023.58	
	MABANEE CO KPSC	7,369	0.67	4,966.70	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	28,329	0.60	17,252.36	
クウェートディナール 小計		226,868		155,613.48	(53,327,183)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	5.74	11,480.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.07	48,026.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	18.60	102,300.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.94	3,234.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.45	2,225.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.18	90,706.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	10.00	25,000.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.45	1,935.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.91	25,567.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	5.52	2,870.40	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	35.40	31,860.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	10.89	10,791.99	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.79	7,959.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	52.93	148,204.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	5.92	111,888.00		

BBMG CORPORATION-A	900	3.05	2,745.00
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,800	35.29	63,522.00
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	17.34	41,616.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	16.68	48,372.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.53	30,804.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	12.63	6,315.00
GEM CO LTD-A	3,500	5.23	18,305.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	5.34	7,476.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	33.97	16,985.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	700	85.80	60,060.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	24.40	88,328.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	12.50	24,375.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.21	3,315.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	23.50	25,850.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.14	17,990.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.17	20,943.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.01	17,535.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	11.66	22,154.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	119.31	35,793.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	20.32	6,096.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	80.00	88,000.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	17.05	54,560.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	32.75	55,675.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.27	16,344.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	25.60	87,040.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	24.03	37,679.04
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	35.31	49,434.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.65	26,500.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	41.46	33,168.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	14.94	32,868.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	108.35	32,505.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.62	17,376.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	98.39	59,034.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	19.29	42,438.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.47	2,082.00

SKSHU PAINT CO LTD-A	400	144.50	57,800.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	15.25	16,775.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	31.30	6,260.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	18.83	28,245.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.51	3,765.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.29	6,877.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	82.60	189,980.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	78.48	31,392.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	14.78	17,736.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.01	21,443.80
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	108.59	65,154.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	57.50	14,950.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	7.30	16,790.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	14.16	5,664.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	9.26	3,704.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	8.71	154,167.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	20.11	20,110.00
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	44.90	62,860.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.97	32,910.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	58.50	64,350.00
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	2,500	29.88	74,700.00
AVICOPTER PLC-A	500	52.27	26,135.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	37.40	52,360.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.52	14,996.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	17.16	1,716.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	7.54	2,262.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.62	3,310.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	6.01	3,005.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	8.29	61,346.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.48	117,272.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	25,300	4.22	106,766.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	31.65	3,165.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.15	153,470.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	266.00	505,400.00
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.50	101,750.00

DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	10.25	6,150.00
EAST GROUP CO LTD-A	3,000	8.36	25,080.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	66.46	101,019.20
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.82	2,843.94
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	29.49	29,490.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	136.49	54,596.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	47.11	28,266.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	49.46	14,838.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	9.80	13,720.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	31.88	38,256.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	96.03	99,487.08
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	10.60	27,560.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.65	4,770.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	22.35	79,096.65
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.98	15,920.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	30.81	191,022.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.04	17,024.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.69	4,552.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,800	84.03	151,254.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	12.97	16,861.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	50.87	76,305.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	29.39	38,207.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	10.81	4,324.00
TBEA CO LTD-A	400	8.18	3,272.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	20.63	18,567.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	5,900	16.10	94,990.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.45	5,995.00
XIAMEN C & D INC-A	300	9.06	2,718.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.77	4,708.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	700	60.17	42,119.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	31.49	62,980.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	103.45	43,449.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	23.15	69,218.50
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	18.42	23,946.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	17.31	3,462.00

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	9.90	63,360.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.22	21,372.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	25.15	35,210.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	79.12	63,296.00	
AIR CHINA LTD-A	800	7.76	6,208.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	5.72	59,488.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.89	6,357.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.15	55,965.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	9,900	9.39	92,961.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.72	74,592.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	14.46	11,568.00	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	20,000	1.58	31,600.00	
S F HOLDING CO LTD-A	3,500	77.85	272,475.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	76.39	76,390.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.49	4,490.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	8.42	15,998.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.49	8,980.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	50.21	5,021.00	
STO EXPRESS CO LTD-A	3,400	12.00	40,800.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	13.44	53,760.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	17.60	20,592.00	
BYD CO LTD -A	1,600	173.24	277,184.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	181.00	36,200.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	4,300	24.00	103,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	37.76	71,744.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	29.89	41,846.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	23.55	28,260.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	38.72	30,976.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	23.68	163,628.80	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	32.70	3,270.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	24.24	2,424.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	2,700	62.61	169,047.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	26.31	149,967.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	40.15	4,015.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	74.21	59,368.00	

JOYOUNG CO LTD -A	600	32.46	19,476.00
NAVINFO CO LTD-A	900	15.73	14,157.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	125.59	17,582.60
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	26.88	10,752.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	6.88	42,656.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	62.91	18,873.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.55	3,820.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	71.96	21,588.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	36.95	36,950.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	51.47	30,882.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.85	7,535.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.12	19,569.60
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	12.72	16,536.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	21.95	17,560.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	12.68	2,536.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.46	2,092.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	10.19	123,299.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	404.60	40,460.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.27	3,454.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.26	13,366.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	65.22	85,438.20
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	15.70	17,270.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.20	2,760.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	27.66	37,341.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	18.04	16,236.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	28.68	25,812.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	7.76	23,280.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,700	202.33	343,961.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	24.17	4,834.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	8.97	44,850.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	8.65	28,545.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.50	27,000.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	600	83.73	50,238.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	68.36	19,140.80
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	97.92	41,126.40

YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.51	23,281.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	48.98	34,286.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	226.04	67,812.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	65.39	32,695.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.22	4,610.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	64.01	38,406.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	8.29	19,896.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	57.95	23,180.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	119.35	47,740.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	44.51	31,157.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,300	184.10	423,430.00	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	184.99	73,996.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	28.17	25,353.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	59.80	77,740.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	17.00	42,500.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	47.40	113,760.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	40.24	169,008.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	50.96	50,960.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	195.33	273,462.00	
JIANGXI ZHENGHANG TECH -A	2,000	17.98	35,960.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	69.87	20,961.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	74.40	22,320.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,000	1,840.00	1,840,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	190.01	190,010.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	76.58	225,145.20	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	25.54	66,404.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	271.90	217,520.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	71.57	28,628.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	500	60.15	30,075.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,300	28.44	93,852.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	98.09	9,809.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	19.39	109,747.40	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,200	269.72	863,104.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	17.40	19,140.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	25.35	32,955.00	

C&S PAPER CO LTD-A	1,000	20.99	20,990.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	165.70	16,570.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	38.30	22,980.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	66.00	232,386.00	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	149.02	14,902.00	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	51.80	10,360.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	54.70	21,880.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	98.00	19,600.00	
GUANGZHOU WONFDO BIOTECH C-A	300	73.13	21,939.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	28.59	6,861.60	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	137.54	41,262.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	67.95	25,821.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	27.64	13,820.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.26	3,452.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	28.18	19,726.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	12.52	6,009.60	
OVCTEK CHINA INC-A	300	73.51	22,053.00	
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	46.50	27,900.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	19.64	3,928.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	343.13	240,191.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	233.13	23,313.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	16.70	17,368.00	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	22.96	20,664.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	273.02	54,604.00	
BEIJING Tiantan Biological-A	1,080	40.46	43,696.80	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	24.50	4,900.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	97.59	29,277.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	128.83	38,649.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	380.55	152,220.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	40.95	24,570.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	25.81	2,581.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	138.86	180,518.00	
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	33.08	19,848.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	42.25	4,225.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	30.28	6,056.00	

HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	133.58	40,074.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	43.11	33,625.80
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	21.62	15,134.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	32.81	45,934.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	88.24	368,843.20
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.95	16,950.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	22.78	20,502.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	14.48	23,168.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	42.68	21,340.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	46.37	46,370.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	38.65	25,122.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	25.25	6,565.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	55.07	66,084.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	8.07	23,403.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	18.52	16,668.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	153.90	92,340.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	27.10	2,710.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	24.64	24,640.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	20.63	4,126.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	4.75	10,450.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	13.68	2,736.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	34.82	20,892.00
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,440	108.82	156,700.80
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	21.81	21,810.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	100.33	110,363.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	238.57	143,142.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	34.42	41,648.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	33.40	59,452.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	66.06	26,424.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.23	162,469.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.99	93,313.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	11.23	16,845.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.23	52,649.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.62	125,664.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.59	84,622.00

BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.93	18,976.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	8.10	72,090.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	35.20	176,000.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.03	70,744.30
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.72	20,160.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	4.10	143,090.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,300	44.24	765,352.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	5.36	159,728.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.37	28,028.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	5.10	184,620.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	20.45	368,100.00
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	18.71	245,101.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	9.91	192,254.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.37	3,933.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	13.01	19,515.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	8.22	55,896.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	12.36	34,608.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	13.07	39,210.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	22.57	151,219.00
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	29.29	251,894.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	41.85	104,625.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.46	2,492.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	8,420	26.70	224,814.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	18.50	59,200.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	10.10	5,050.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.67	62,424.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	16.16	95,344.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	15.56	37,344.00
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	19.18	42,196.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	13.20	60,720.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	18.05	124,545.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.74	4,370.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.96	115,344.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	139.06	69,530.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.89	3,156.00

HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	18.68	102,740.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	12.03	3,609.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.37	56,079.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	12.53	20,048.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.63	28,890.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	3.83	4,596.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	11.10	57,720.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.87	12,384.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	14.12	50,832.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.44	13,600.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.79	3,116.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.17	78,584.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	16.67	71,681.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.67	2,901.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.19	19,722.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	6.10	26,230.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.36	4,680.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	15.17	19,721.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	41.75	104,375.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	37.40	164,560.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.04	3,024.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	60.69	115,311.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	6.66	23,310.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,900	87.87	782,043.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	14.07	20,120.10	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	23.29	16,303.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	13.72	49,392.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	28.66	255,074.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.72	2,688.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	34.50	27,600.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	14.17	46,761.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.33	7,596.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.36	29,016.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.36	5,152.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	16.29	135,207.00	

RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	7.07	4,242.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,400	21.50	30,100.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.80	16,020.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.19	3,828.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.88	23,392.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.16	22,196.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.34	17,034.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	16.84	67,360.00
AISINO CORP-A	200	13.42	2,684.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	27.99	13,435.20
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	34.28	3,428.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	18.99	13,293.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	800	25.60	20,480.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	75.06	15,012.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	19.83	13,881.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	9.26	3,704.00
GLODON CO LTD-A	500	68.98	34,490.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	102.47	70,601.83
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	37.71	37,710.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	32.70	26,160.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	208.31	20,831.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	62.43	24,972.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	98.65	29,595.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	28.88	11,552.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	7.41	6,669.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	21.90	19,710.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	44.84	103,490.72
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	30.80	18,480.00
ADDSINO CO LTD -A	1,700	22.69	38,573.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	63.99	57,591.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	54.53	27,265.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	5.17	177,331.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	33.95	23,765.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	15.11	39,286.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	33.45	37,464.00

FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	23.75	26,125.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	13.82	52,516.00
GOERTEK INC -A	2,000	40.03	80,060.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.84	26,048.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	14.09	35,225.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.36	3,408.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	108.75	54,375.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	7,500	43.71	327,825.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	14.42	2,884.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	24.00	24,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	28.43	17,058.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	32.68	150,328.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	7.16	16,468.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	5,533	53.05	293,525.65
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	200	549.66	109,932.00
NINESTAR CORP-A	100	30.19	3,019.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	15.12	6,048.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	28.59	28,590.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	105.77	29,615.60
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	20.38	20,380.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	45.06	40,554.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	28.90	20,230.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	36.83	25,781.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.12	4,536.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	1,876	21.50	40,334.00
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	21.51	27,963.00
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	13.00	14,300.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	104.92	73,444.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	38.10	51,816.00
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	9.92	24,800.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	19.61	31,376.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	65.35	26,140.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	73.38	22,014.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	20.41	48,984.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	51.41	25,705.00

ZTE CORP-A	2,700	32.84	88,668.00		
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	4.75	65,550.00		
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.69	20,167.00		
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	20.09	349,566.00		
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.15	6,020.00		
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.42	4,446.00		
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.74	3,792.00		
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	2,400	12.75	30,600.00		
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	8.82	58,212.00		
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.22	15,884.00		
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.39	3,773.00		
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.47	3,282.00		
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.96	6,972.00		
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.98	17,114.00		
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	540	207.26	111,920.40		
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,000	72.89	72,890.00		
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	20.34	40,680.00		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	73.37	190,762.00		
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	168.30	33,660.00		
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	26.86	118,184.00		
SG MICRO CORP-A	100	278.28	27,828.00		
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	158.50	39,625.00		
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	22.75	52,325.00		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	14.95	28,405.00		
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	27.35	21,880.00		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	112.59	56,295.00		
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	217.13	173,704.00		
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	10.29	15,435.00		
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	28.48	25,632.00		
オフショア人民元 小計	1,397,408		28,412,014.90 (454,023,998)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	14.56	23,689.12	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	29,604	35.65	1,055,382.60	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	62.40	73,257.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	13.64	51,586.48	

SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	16.88	59,080.00	
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,572	81.80	210,389.60	
SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	42.25	229,164.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	12,072	97.70	1,179,434.40	
SAUDI CEMENT	1,265	58.00	73,370.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	27.30	81,435.90	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	13.08	106,445.04	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	62.00	225,618.00	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	78.40	33,084.80	
JARIR MARKETING CO	611	174.40	106,558.40	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	123.00	49,938.00	
ALMARAI CO	3,167	55.40	175,451.80	
SAVOLA	3,337	43.55	145,326.35	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	107.00	84,102.00	
AL RAJHI BANK	16,412	74.00	1,214,488.00	
ALINMA BANK	12,351	16.54	204,285.54	
ARAB NATIONAL BANK	8,707	20.30	176,752.10	
BANK AL-JAZIRA	5,356	13.84	74,127.04	
BANK ALBILAD	5,393	27.20	146,689.60	
BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	31.80	238,913.40	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	19,926	42.65	849,843.90	
RIYAD BANK	16,646	20.50	341,243.00	
SAMBA FINANCIAL GROUP	13,662	30.10	411,226.20	
SAUDI BRITISH BANK	8,978	25.00	224,450.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	121.60	97,280.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	80.80	53,408.80	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	8.80	34,689.60	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	9.58	41,146.10	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	29.40	164,169.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	13.38	69,576.00	
SAUDI TELECOM CO	8,115	106.00	860,190.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	21.60	266,954.40	
サウジアラビアリアル 小計	240,409		9,432,747.37	(261,947,394)
	32,487,526		10,456,385,441	

合 計			(10,456,385,441)
-----	--	--	------------------

(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	45,800	945,770.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	945,770.00 (4,965,292)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	609,854.70	
	南アフリカランド 小計		48,594	609,854.70 (4,250,687)	
合計				9,215,979 (9,215,979)	

(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 61銘柄	100.0%		16.0%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.3%		1.7%
	投資証券 1銘柄		2.7%	0.0%
ブラジルリアル	株式 54銘柄	100.0%		5.0%
チリペソ	株式 14銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 14銘柄	100.0%		0.3%
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%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%		0.7%
香港ドル	株式 203銘柄	100.0%		21.9%

マレーシアリングット	株式	38銘柄	100.0%		1.6%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		2.0%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%		0.8%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		1.4%
韓国ウォン	株式	107銘柄	100.0%		13.3%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%		12.8%
インドルピー	株式	96銘柄	100.0%		9.2%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.8%		3.5%
	投資証券	1銘柄		1.2%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%		0.6%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式	464銘柄	100.0%		4.3%
サウジアラビアリアル	株式	36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）

2020年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	281,534,883
投資証券	18,611,261,860
派生商品評価勘定	45,410
未収入金	550,947,280
未収配当金	133,812,716
差入委託証拠金	78,512,500

2020年12月10日現在

流動資産合計	19,656,114,649
資産合計	19,656,114,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	669,300
前受金	795,900
未払金	556,648,210
未払解約金	32,066,000
未払利息	763
流動負債合計	590,180,173
負債合計	590,180,173
純資産の部	
元本等	
元本	16,063,275,610
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,002,658,866
元本等合計	19,065,934,476
純資産合計	19,065,934,476
負債純資産合計	19,656,114,649

## 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12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	14,237,409,000円
期中一部解約元本額	13,232,887,489円
期末元本額	16,063,275,610円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	835,777,263円

りそなラップ型ファンド(安定成長型)	561,510,588円
りそなラップ型ファンド(成長型)	530,748,485円
DCりそな グローバルバランス	17,564,111円
つみたてバランスファンド	865,223,019円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	215,183,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	111,372,843円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	67,270,289円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	5,723,539円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,323,409円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,652,785円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,803,582円
リスクコントロール・オープン	1,947,105円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	53,041,274円
FWりそな国内リートインデックスオープン	2,879,387,276円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,410,609,270円
Smart-i リートインデックス	2,423,651,944円
Smart-i 8資産バランス 安定型	32,365,492円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	88,873,260円
Smart-i 8資産バランス 成長型	83,807,047円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	215,797,442円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	190,589,381円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	111,158,702円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	72,789,964円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	187,274,695円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	30,893,365円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,242,501,192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)	1,064,821円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,817,370,199円
2. 計算日における受益権の総数	16,063,275,610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	1.1869円
(10,000口当たり純資産額)	(11,869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

2020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、運用評価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

2020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）

2020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	2020年12月10日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	3,082,690,037
合計	3,082,690,037

(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)

(2020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	450,122,890	-	449,499,000	623,890
	合計	450,122,890	-	449,499,000	623,890

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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	336	37,296,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	502	48,141,800	
	S O S i L A 物流リート投資法人	540	64,422,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	682	381,920,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,513	216,620,600	
	森ヒルズリート投資法人	2,412	330,926,400	
	産業ファンド投資法人	2,903	494,671,200	

アドバンス・レジデンス投資法人	1,950	581,490,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,340	235,304,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,029	416,230,500	
G L P 投資法人	6,416	997,046,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	896	254,374,400	
日本プロロジスリート投資法人	3,107	975,598,000	
星野リゾート・リート投資法人	312	154,440,000	
O n e リート投資法人	320	78,336,000	
イオンリート投資法人	2,083	255,792,400	
ヒューリックリート投資法人	1,653	237,040,200	
日本リート投資法人	667	239,119,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13,192	186,402,960	
積水ハウス・リート投資法人	6,040	460,852,000	
トーセイ・リート投資法人	454	48,941,200	
ケネディクス商業リート投資法人	755	181,426,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	438	54,706,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	395	41,159,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	6,640	908,352,000	
いちごホテルリート投資法人	359	25,273,600	
ラサールロジポート投資法人	2,288	351,208,000	
スターアジア不動産投資法人	2,110	101,491,000	
マリモ地方創生リート投資法人	192	21,753,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	717	349,537,500	
大江戸温泉リート投資法人	331	23,467,900	
投資法人みらい	2,218	83,396,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	445	50,685,500	
三菱地所物流リート投資法人	462	180,873,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	560	86,016,000	
ザイマックス・リート投資法人	315	28,665,000	
タカラレーベン不動産投資法人	617	54,419,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	796	101,888,000	
日本ビルファンド投資法人	2,311	1,340,380,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,053	1,125,044,000	
日本リテールファンド投資法人	3,858	674,378,400	
オリックス不動産投資法人	4,091	648,423,500	
日本プライムリアルティ投資法人	1,278	410,238,000	
プレミア投資法人	1,855	222,414,500	
東急リアル・エステート投資法人	1,377	207,927,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,426	141,031,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,392	527,918,400	
森トラスト総合リート投資法人	1,468	186,876,400	
インヴィンシブル投資法人	8,586	300,510,000	

フロンティア不動産投資法人	681	259,461,000	
平和不動産リート投資法人	1,260	151,452,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,342	391,461,400	
福岡リート投資法人	1,062	155,370,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	635	421,640,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,704	116,042,400	
大和証券オフィス投資法人	437	266,133,000	
阪急阪神リート投資法人	928	113,308,800	
スターツプロシード投資法人	320	61,344,000	
大和ハウスリート投資法人	2,930	718,143,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,615	355,887,000	
大和証券りビング投資法人	2,681	247,992,500	
ジャパンエクセレント投資法人	1,905	228,600,000	
合計	124,180	18,611,261,860	

(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)

2020年12月10日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	20,298,620
コール・ローン	580,865,696
株式	15,843,794
投資証券	21,820,850,360
未収入金	21,252,441
未収配当金	29,655,785
流動資産合計	22,488,766,696
資産合計	22,488,766,696
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,066
未払金	3,933,784
未払解約金	575,529,000
未払利息	1,575
流動負債合計	579,465,425

2020年12月10日現在

負債合計	579,465,425
純資産の部	
元本等	
元本	21,475,319,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	433,981,416
元本等合計	21,909,301,271
純資産合計	21,909,301,271
負債純資産合計	22,488,766,696

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年12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	20,418,248,753円
期中一部解約元本額	16,740,995,554円
期末元本額	21,475,319,855円

期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	548,410,029円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	670,931,661円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,827,955,425円
DCりそな グローバルバランス	6,473,852円
つみたてバランスファンド	511,166,385円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	303,641,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	147,932,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	88,370,262円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	7,313,334円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,626,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,202,319円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,022,720円
リスクコントロール・オープン	9,096,226円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	61,856,513円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	7,822,546,021円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,993,305,218円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,342,855,313円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,598,779円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	104,531,586円
Smart-i 8資産バランス 成長型	114,435,509円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	497,506,890円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	446,093,517円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	259,210,130円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	170,376,885円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	435,398,632円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	71,809,719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)	1,728,990円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,979,923,839円
2. 計算日における受益権の総数	21,475,319,855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	1.0202円
(10,000口当たり純資産額)	(10,202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

2020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、運用評価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

2020年12月10日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2.時価の算定方法

株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020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	2020年12月10日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	1,891,113	
投資証券	787,714,846	
合計	785,823,733	

(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)

(2020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	23,414,416	-	23,413,350	1,066
	米ドル	17,204,880	-	17,204,550	330
	オーストラリアドル	6,209,536	-	6,208,800	736
合計		23,414,416	-	23,413,350	1,066

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	84,000	2.43	204,120.00	
オーストラリアドル 小計		84,000		204,120.00 (15,843,794)	
合計		84,000		15,843,794 (15,843,794)	

(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	ACADIA REALTY TRUST	14,937	221,067.60	
		AGREE REALTY CORP	9,065	597,020.90	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,500	204,500.00	
		ALEXANDER'S INC	368	102,896.48	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,993	3,424,001.18	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,032	236,301.44	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,521	1,010,462.16	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	145,910.16	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,545	1,317,161.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	35,324	1,186,886.40	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,440	1,043,040.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	37,004	485,862.52	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	108,400.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,954	3,987,143.30	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	39,432.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,121	2,423,678.08	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	28,901	337,852.69	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,166	814,695.84	

BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	153,043.10	
BRT APARTMENTS CORP	877	12,839.28	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,638	1,635,681.78	
CARETRUST REIT INC	16,311	344,814.54	
CHATHAM LODGING TRUST	8,481	100,415.04	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	24,000.00	
CITY OFFICE REIT INC	8,644	82,636.64	
CLIPPER REALTY INC	1,350	8,761.50	
COLONY CAPITAL INC	83,392	409,454.72	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,342	279,298.48	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	175,218.40	
CORECIVIC INC	19,484	150,221.64	
COREPOINT LODGING INC	7,200	50,256.00	
CORESITE REALTY CORP	7,274	872,225.34	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,032	487,980.48	
COUSINS PROPERTIES INC	25,121	840,799.87	
CUBESMART	32,827	1,063,266.53	
CYRUSONE INC	19,856	1,303,546.40	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,147	294,347.14	
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,781	5,940,084.75	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,700	178,794.00	
DOUGLAS EMMETT INC	27,969	890,253.27	
DUKE REALTY CORP	62,892	2,400,587.64	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,562	295,380.36	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,667	885,577.61	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23,545	224,148.40	
EPR PROPERTIES	12,750	442,170.00	
EQUINIX INC	15,079	10,229,593.60	
EQUITY COMMONWEALTH	20,578	545,317.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,938	1,737,148.14	
EQUITY RESIDENTIAL	58,305	3,572,347.35	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,356	365,343.80	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,094	2,775,496.92	

EXTRA SPACE STORAGE INC	21,914	2,465,325.00	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	27,408.19	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,663	1,057,950.73	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,692	899,350.32	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,967	348,479.04	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	76,592.10	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8,641	139,897.79	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,212	1,501,087.56	
GEO GROUP INC/THE	20,721	194,984.61	
GETTY REALTY CORP	6,175	178,704.50	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	112,995.62	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	37,496.69	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	106,577.90	
GLOBAL NET LEASE INC	14,650	252,566.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,153	682,087.38	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	37,372	967,934.80	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	91,807	2,799,195.43	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	36,059.33	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,632	695,758.72	
HOST HOTELS & RESORTS INC	120,045	1,822,283.10	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,162	679,165.52	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	16,204	214,540.96	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	254,300.56	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,740	590,508.60	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,204	160,076.52	
INVITATION HOMES INC	95,351	2,783,295.69	
IRON MOUNTAIN INC	48,868	1,483,632.48	
JBG SMITH PROPERTIES	19,096	606,679.92	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	83,780.00	
KILROY REALTY CORP	17,800	1,091,140.00	
KIMCO REALTY CORP	73,357	1,095,220.01	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,299	216,772.84	
LEXINGTON REALTY TRUST	46,638	498,560.22	
LIFE STORAGE INC	7,924	889,548.24	
LTC PROPERTIES INC	6,620	255,465.80	

MACERICH CO/THE	18,631	227,484.51	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	204,736.78	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	229,400	172,050.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	90,288	1,859,932.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,470	2,392,863.00	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	16,650	253,746.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,099	1,185,298.62	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,777	365,879.15	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,723	524,160.01	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	72,682.20	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,657	159,737.76	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	8,219	194,872.49	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,789	1,468,939.43	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	45,348.70	
PARAMOUNT GROUP INC	30,707	288,031.66	
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,976	725,564.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,088	423,426.96	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,625	631,631.25	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,377	350,796.57	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	55,186.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	71,161.36	
PRIME US REIT	85,000	66,300.00	
PROLOGIS INC	125,735	12,124,626.05	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,377	458,056.28	
PUBLIC STORAGE	25,863	5,680,549.32	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,492	604,968.72	
REALTY INCOME CORP	58,674	3,560,925.06	
REGENCY CENTERS CORP	26,729	1,274,973.30	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,999	278,386.08	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,537	328,833.00	
RETAIL VALUE INC	1,615	23,950.45	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,504	1,013,053.44	
RLJ LODGING TRUST	28,086	382,812.18	
RPT REALTY	15,048	123,393.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,343	625,700.71	

SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,837	618,356.75	
SAFEHOLD INC	2,352	160,571.04	
SAUL CENTERS INC	2,130	70,801.20	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,386	91,777.44	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	357,976.48	
SIMON PROPERTY GROUP INC	55,341	5,027,176.44	
SITE CENTERS CORP	25,468	265,885.92	
SL GREEN REALTY CORP	12,485	774,569.40	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,542	707,819.70	
STAG INDUSTRIAL INC	25,404	771,265.44	
STORE CAPITAL CORP	38,667	1,261,704.21	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	182,022.40	
SUN COMMUNITIES INC	16,725	2,438,337.75	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	36,008	397,528.32	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	183,816.00	
TAUBMAN CENTERS INC	10,856	465,830.96	
TERRENO REALTY CORP	11,652	660,668.40	
UDR INC	50,122	1,985,833.64	
UMH PROPERTIES INC	7,056	108,591.84	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	139,874.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	251,692.00	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	78,629.07	
VENTAS INC	63,667	3,153,426.51	
VEREIT INC	182,762	1,387,163.58	
VICI PROPERTIES INC	90,746	2,308,578.24	
VORNADO REALTY TRUST	26,700	1,059,456.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	21,495.74	
WASHINGTON REIT	14,875	345,992.50	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,396	456,462.48	
WELLTOWER INC	71,169	4,627,408.38	
WHITESTONE REIT	7,716	65,508.84	
WP CAREY INC	29,527	2,050,354.88	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	302,925.28	
米ドル 小計	4,305,020	152,773,577.31	(15,931,228,641)

カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,077	403,080.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,597	136,173.57	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	38,115.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	145,543.44	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,021	696,983.91	
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,437	351,612.10	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,780	118,094.60	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	123,762.30	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	136,266.39	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	166,345.34	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	82,181.94	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	273,270.24	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,168	395,041.92	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,154	324,850.62	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	159,721.74	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	145,465.32	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	66,861.80	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	61,475.06	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	196,887.50	
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	35,100.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,023	450,458.13	
	SLATE GROCERY REIT	1,920	22,080.00	
	SLATE OFFICE REIT	4,169	17,343.04	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	292,437.42	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	155,940.36		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	30,192.00		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,500	116,480.00		
	カナダドル 小計	287,353	5,141,763.74	(418,282,480)
ユーロ	AEDIFICA	5,531	516,042.30	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	29,755	435,018.10	
	ALTAREA	659	85,933.60	
	BEFIMMO	4,584	180,380.40	
	CARE PROPERTY INVEST	4,100	110,495.00	
	CARMILA	8,000	95,360.00	

	COFINIMMO	4,616	560,382.40
	COVIVIO	8,176	622,193.60
	CROMWELL EUROPEAN REIT	214,500	100,815.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,385	82,498.20
	GECINA SA	9,187	1,173,179.90
	HAMBORNER REIT AG	12,779	115,126.01
	HIBERNIA REIT PLC	108,886	127,832.16
	ICADE	5,146	335,004.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	18,293.94
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,787	357,057.51
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	95,218.20
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	107,429.09
	KLEPIERRE	34,603	657,283.98
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	55,367.91
	MERCIALYS	7,081	49,248.35
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	59,085	470,021.17
	MONTEA	1,671	154,400.40
	NSI NV	3,090	102,279.00
	RETAIL ESTATES	1,989	118,345.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,372	1,427,094.32
	VASTNED RETAIL NV	3,660	84,546.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,072	611,835.84
	WERELDHAVE NV	7,169	84,307.44
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,300	117,070.00
	ユーロ 小計	726,564	9,050,059.92 (1,140,036,048)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	15,000.00
	ASSURA PLC	445,319	326,418.82
	BIG YELLOW GROUP PLC	29,464	318,505.84
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	117,735.00
	BRITISH LAND CO PLC	159,920	805,996.80
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	217,484.10
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	117,158.08
	CUSTODIAN REIT PLC	77,000	66,451.00
	DERWENT LONDON PLC	18,948	603,683.28
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	74,984.29

	GCP STUDENT LIVING PLC	75,000	105,750.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	45,464	299,789.61	
	HAMMERSON PLC	687,112	178,992.67	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	64,500.00	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,608	918,649.99	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	153,042	342,507.99	
	LXI REIT PLC	81,711	95,928.71	
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	48,091.75	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	74,292.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	218,711	303,570.86	
	RDI REIT PLC	48,350	43,515.00	
	REGIONAL REIT LTD	68,961	55,030.87	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	34,857	264,913.20	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	39,175.88	
	SEGRO PLC	202,116	1,827,937.10	
	SHAFTESBURY PLC	41,622	238,285.95	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	40,227.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	115,000	122,187.50	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	55,339	57,275.86	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,477	454,928.22	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,710	94,436.07	
	UNITE GROUP PLC	67,553	726,194.75	
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	162,428.80	
	英債券 小計	4,218,236	9,222,026.99 (1,286,196,104)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	69,607	205,340.65	
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	80,296.05	
	ARENA REIT	52,557	152,415.30	
	AVENTUS GROUP	62,000	161,200.00	
	BWP TRUST	86,381	372,302.11	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	68,504	211,677.36	
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	151,819.56	
	CHARTER HALL GROUP	79,314	1,126,258.80	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	355,112.68	

	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	315,341.25
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	177,239.59
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	293,674.31
	DEXUS	185,512	1,782,770.32
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	100,210.28
	GOODMAN GROUP	283,053	5,143,073.01
	GPT GROUP	331,528	1,554,866.32
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	186,818.12
	HOME CONSORTIUM	24,000	96,960.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	12,000	15,000.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	93,662.40
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	235,024.29
	IRONGATE GROUP	96,000	120,480.00
	MIRVAC GROUP	670,152	1,782,604.32
	NATIONAL STORAGE REIT	165,638	336,245.14
	RURAL FUNDS GROUP	53,895	132,581.70
	SCENTRE GROUP	884,141	2,546,326.08
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	177,242	453,739.52
	STOCKLAND	406,172	1,754,663.04
	VICINITY CENTRES	656,128	1,141,662.72
	WAYPOINT REIT LTD	126,935	347,801.90
	オーストラリアドル 小計	5,346,289	21,427,166.82 (1,663,176,688)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	224,848.48
	GOODMAN PROPERTY TRUST	185,763	444,902.38
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	326,199.15
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	315,759.70
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	54,548	165,553.18
	ニュージーランドドル 小計	844,555	1,477,262.89 (108,106,098)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,514,240.00
	FORTUNE REIT	247,000	1,785,810.00
	LINK REIT	351,700	24,407,980.00
	PROSPERITY REIT	226,000	558,220.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	152,000	583,680.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	1,012,500.00

	香港ドル 小計	1,584,700	29,862,430.00 (401,649,683)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	97,320.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	104,244.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	536,000	1,565,120.00
	ASCOTT TRUST	307,496	316,720.88
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	766,332	1,593,970.56
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	179,000	229,120.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	116,300	148,864.00
	EC WORLD REIT	50,000	35,750.00
	ESR REIT	390,700	158,233.50
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	98,523.00
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	107,400	43,497.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,100	416,482.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	73,535.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	446,979	603,421.65
	IREIT GLOBAL	55,000	35,200.00
	KEPPEL DC REIT	226,100	612,731.00
	KEPPEL REIT	297,300	312,165.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	99,456.50
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	16,724.40
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	368,000	765,440.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	281,300	804,518.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	444,300	853,056.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	357,300	339,435.00
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	169,480.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62,900	239,020.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	56,835.50
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	75,982.50
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	165,900	84,609.00
	SPH REIT	161,200	134,602.00
	STARHILL GLOBAL REIT	251,500	120,720.00
	SUNTEC REIT	354,800	525,104.00
	シンガポールドル 小計	7,684,507	10,729,880.49 (837,037,977)

韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	81,588,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	64,960,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,600	62,092,000.00	
韓国ウォン 小計		40,200	208,640,000.00	(20,092,032)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	29,265	469,410.60	
イスラエルシェケル 小計		29,265	469,410.60	(15,044,609)
合計			21,820,850,360	(21,820,850,360)

(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	投資証券 155銘柄		100.0%	73.0%
カナダドル	投資証券 27銘柄		100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 30銘柄		100.0%	5.2%
英ポンド	投資証券 34銘柄		100.0%	5.9%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	0.9%		0.1%
	投資証券 30銘柄		99.1%	7.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄		100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 31銘柄		100.0%	3.8%
韓国ウォン	投資証券 3銘柄		100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄		100.0%	0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年12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	47,617,167,280円
負債総額	75,158,695円
純資産総額（ - ）	47,542,008,585円
発行済口数	47,156,507,890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	22,425,992,873円
負債総額	34,951,082円
純資産総額（ - ）	22,391,041,791円
発行済口数	17,878,345,154口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2524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	20,391,680,433円
負債総額	4,345,403円
純資産総額（ - ）	20,387,335,030円
発行済口数	18,462,373,924口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1043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	110,010,530,090円
負債総額	23,465,899円

純資産総額（ - ）	109,987,064,191円
発行済口数	100,554,956,907口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0938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	1,041,358,881円
負債総額	660,385円
純資産総額（ - ）	1,040,698,496円
発行済口数	1,043,285,582口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9975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	32,810,695,739円
負債総額	7,904,793円
純資産総額（ - ）	32,802,790,946円
発行済口数	22,883,782,629口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4335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	3,112,315,036円
負債総額	1,973,107円
純資産総額（ - ）	3,110,341,929円
発行済口数	2,339,852,721口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3293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	1,805,594,293円
------	----------------

負債総額	3,933,477円
純資産総額（ - ）	1,801,660,816円
発行済口数	1,630,180,035口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1052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	4,135,491,820円
負債総額	1,006,858円
純資産総額（ - ）	4,134,484,962円
発行済口数	4,263,537,029口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9697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	82,298,281,261円
負債総額	1,578円
純資産総額（ - ）	82,298,279,683円
発行済口数	78,206,362,783口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0523円

## RAM国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	45,144,211,181円
負債総額	205,437,763円
純資産総額（ - ）	44,938,773,418円
発行済口数	34,759,940,307口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2928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	29,422,780,678円
負債総額	405円
純資産総額（ - ）	29,422,780,273円
発行済口数	27,580,007,536口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0668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	208,600,415,554円
負債総額	2,185,719,941円
純資産総額（ - ）	206,414,695,613円
発行済口数	192,307,594,409口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0734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	4,999,824,717円
負債総額	22,075,078円
純資産総額（ - ）	4,977,749,639円
発行済口数	4,572,553,373口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0886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	77,219,548,175円
負債総額	388,948円
純資産総額（ - ）	77,219,159,227円
発行済口数	50,499,622,494口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5291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	12,664,818,115円
負債総額	1,763,915円
純資産総額（ - ）	12,663,054,200円
発行済口数	8,405,920,661口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5064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	19,816,319,317円
負債総額	7,483,898円
純資産総額（ - ）	19,808,835,419円
発行済口数	15,798,439,718口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2538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	21,956,897,112円
負債総額	9,956,563円
純資産総額（ - ）	21,946,940,549円
発行済口数	21,465,003,002口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0225円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律

の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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12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12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12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	85	864,812
単位型株式投資信託	6	110,891
合計	91	975,704

## 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。

また、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）並びに同規則第38条及び第57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) 財務諸表及び中間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、第6期事業年度に係る中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）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り中間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	769,705
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。

## (1)中間貸借対照表

(単位:千円)

		第6期中間会計期間 (2020年9月30日現在)	
資産の部			
流動資産			
預金			2,260,421
前払費用			147,264
未収入金			247
未収委託者報酬			763,034
未収運用受託報酬			2,414,786
未収投資助言報酬			405,399
流動資産計			5,991,153
固定資産			
有形固定資産			
建物	1		4,437
器具備品	1		18,016
有形固定資産計			22,454
無形固定資産			
ソフトウェア			13,023
無形固定資産計			13,023
投資その他の資産			
投資有価証券			12,358
繰延税金資産			87,613
投資その他の資産計			99,972
固定資産計			135,449
資産合計			6,126,603

(単位:千円)

		第6期中間会計期間 (2020年9月30日現在)	
負債の部			
流動負債			
未払金			
未払手数料			274,799
その他未払金			678,644
未払費用			92,385
未払法人税等			153,032
未払消費税等	2		186,565
賞与引当金			167,456
預り金			824
流動負債計			1,553,708
負債合計			1,553,708
純資産の部			

株主資本	
資本金	1,000,000
資本剰余金	
資本準備金	490,000
資本剰余金計	490,000
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	3,082,368
利益剰余金計	3,082,368
株主資本計	4,572,368
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	526
評価・換算差額等計	526
純資産合計	4,572,895
負債・純資産合計	6,126,603

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	1,615,328
運用受託報酬	2,227,738
投資助言報酬	403,885
営業収益計	4,246,952
営業費用	
支払手数料	527,367
広告宣伝費	17,661
調査費	
調査費	597,857
委託調査費	51,583
図書費	270
委託計算費	98,908
事務委託費	11,940
営業雑経費	
印刷費	32,679
協会費	2,573
諸会費	1,510
その他	30,051
営業費用計	1,372,402
一般管理費	
給料	
役員報酬	55,705
給料・手当	533,076
賞与	9,130
賞与引当金繰入額	167,456
旅費交通費	1,630
租税公課	33,348
不動産賃借料	48,858
固定資産減価償却費	9,288

諸経費	131,422
一般管理費計	989,916
営業利益	1,884,632
営業外収益	
受取配当金	50
雑収入	311
営業外収益計	361
営業外費用	
投資有価証券売却損	277
営業外費用計	277
経常利益	1,884,716
税引前中間純利益	1,884,716
法人税、住民税及び事業税	596,131
法人税等調整額	15,732
法人税等計	580,399
中間純利益	1,304,317

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当中間期変動額						
当中間純利益				1,304,317	1,304,317	1,304,317
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	1,304,317	1,304,317	1,304,317
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	3,082,368	3,082,368	4,572,368

	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	433	433	3,267,617
当中間期変動額			
当中間純利益			1,304,317
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	960	960	960
当中間期変動額合計	960	960	1,305,277
当中間期末残高	526	526	4,572,895

## （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

中間会計期間末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、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

## 4. その他中間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。

## 注記事項

### (中間貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	第6期中間会計期間 (2020年9月30日)
建物	1,112千円
器具備品	14,674千円

#### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

### (中間損益計算書関係)

#### 1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	第6期中間会計期間 (2020年9月30日)
有形固定資産	3,578千円
無形固定資産	5,710千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
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．金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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。

第6期中間会計期間（2020年9月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
（1）預金	2,260,421	2,260,421	-
（2）未収委託者報酬	763,034	763,034	-
（3）未収運用受託報酬	2,414,786	2,414,786	-
（4）未収投資助言報酬	405,399	405,399	-
資産計	5,843,641	5,843,641	-
（1）未払手数料	274,799	274,799	-
（2）その他未払金	678,644	678,644	-
負債計	953,443	953,443	-

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

（1）預金、（2）未収委託者報酬、（3）未収運用受託報酬、（4）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

（1）未払手数料、（2）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。

（セグメント情報等）

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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中間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中間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中間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	2,445,827

## 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。

## (1株当たり情報)

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
1株当たり純資産額	1,154円77銭
1株当たり中間純利益金額	329円37銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益(千円)	1,304,317
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	1,304,317
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000

## (重要な後発事象)

第6期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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  
該当事項はありません。
- (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	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

#### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

( 2 ) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 3月10日	有価証券届出書
2020年 3月10日	有価証券報告書
2020年 9月10日	有価証券届出書
2020年 9月10日	半期報告書

## 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 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、「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。

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、FWRりそな国内債券インデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

## 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

### 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内株式インデックスファンドの2019年12月11日から2020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。

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、FWRりそな国内株式インデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

### 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

### 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2019年12月11日から2020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。

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、FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

### 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

### 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2019年12月11日から2020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。

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、FWRりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

### 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 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、「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。

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、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

## 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 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、「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。

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、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

## 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 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、「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。

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、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

## 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

### 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、「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。

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、FWRりそな国内リートインデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

### 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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

2021年2月3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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

## 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな先進国リートインデックスファンドの2019年12月11日から2020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。

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、FWRりそな先進国リートインデックスファンドの2020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、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、りそなアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、継続企業の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。

## 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、継続企業の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、ファンド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、経営者に対して、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。

#### 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. X B R 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12月4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

## 中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第6期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

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、りそなアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。

- ・ 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中間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、継続企業の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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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、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おりません。