

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年9月11日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	中越 正喜
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	F Wりそな国内債券インデックスファンド F Wりそな国内株式インデックスファンド F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） F Wりそな新興国債券インデックスファンド F Wりそな先進国株式インデックスファンド F Wりそな新興国株式インデックスファンド F Wりそな国内リートインデックスファンド F Wりそな先進国リートインデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	F Wりそな国内債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国債券インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな新興国株式インデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな国内リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。 F Wりそな先進国リートインデックスファンド 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

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

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

価額とします。

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

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

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

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

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2018年9月12日から2019年3月8日までとします。

・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

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

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

ファンドの基本的性格

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< FWRりそな国内株式インデックスファンド >

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< F W りそな新興国債券インデックスファンド >

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

< FWRい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			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ()	アフリカ			その他 (MSCI-KOKUSAI 指数(配当込 み、円換算ベー ス))
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< F W 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	
		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			
	年2回	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年5回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI エマージング・マーケット 指数(配当込み、円換算ベース))
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

<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	
		不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

<FWりそな先進国リートインデックスファンド>

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			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、 円換算ベース))
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(<http://www.toushin.or.jp/>)でもご覧頂けます。

ファンドの特色

1

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

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

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

2

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

■ ファンドの仕組み



3 各ファンドの運用方針は以下の通りです。

FWりそな国内債券インデックスファンド

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

*[NOMURA-BPI総合]は、野村證券株式会社が公表する、日本の公債債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

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

FWりそな国内株式インデックスファンド

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

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

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

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

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

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

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

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

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

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

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

FWりそな新興国債券インデックスファンド

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

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

2. RAM新興国債券マザーファンドを通じて、新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。
 - JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。
3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

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

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

2. RAM先進国株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式*または先進国株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)への投資を行います。
 - MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。
 - DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

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

*[MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）]は、MSCIエマージング・マーケット指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数（米ドルベース）は、MSCI Inc.が発行した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。

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

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

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

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

FWりそな国内リートインデックスファンド

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

*[東証REIT指数（配当込み）]は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託（REIT）全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。

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

- 東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。

*一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

1. 日本を除く先進国の不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）*の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

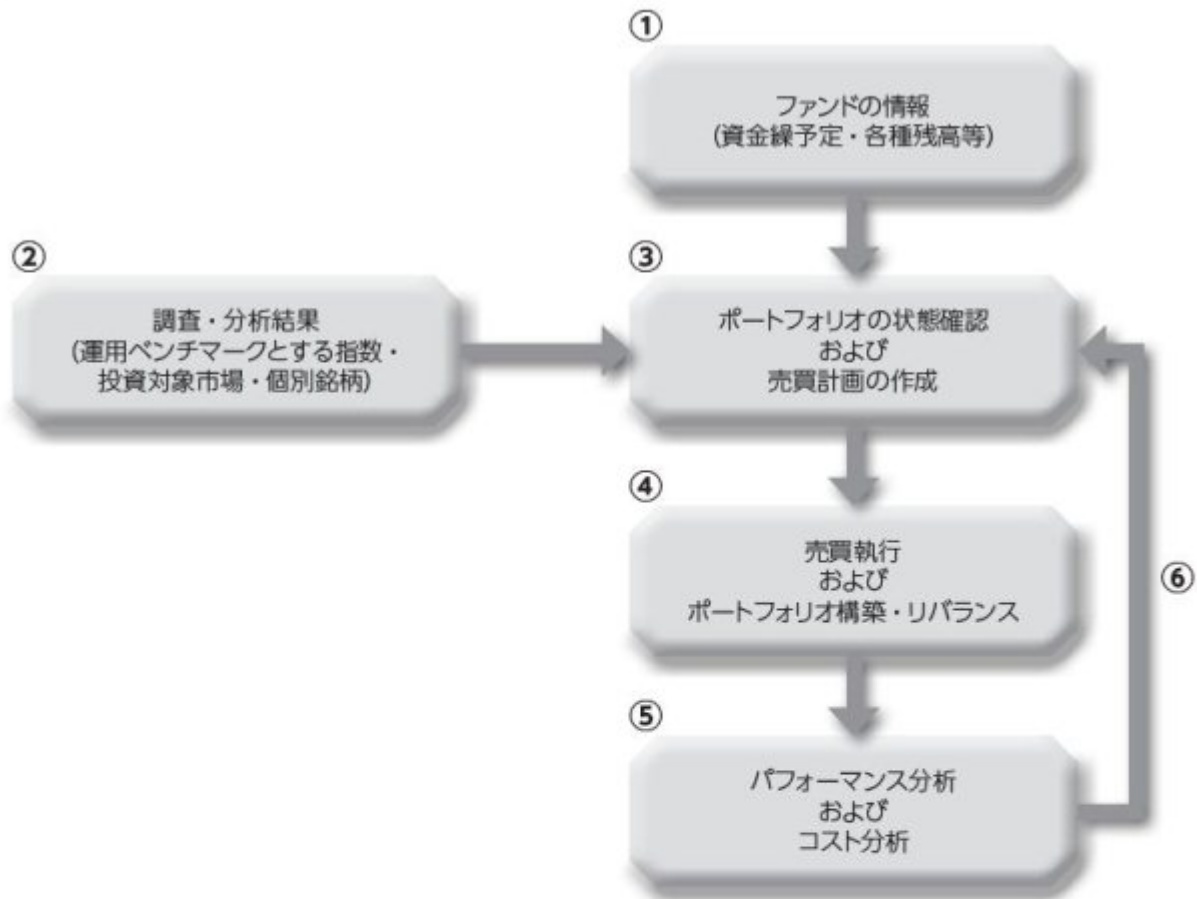
2. RAM先進国リートマザーファンドを通じて、日本を除く先進国の不動産投資信託証券*および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）への投資を行います。

- S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。

*一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

■ 運用プロセスのイメージ



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

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

■ 主な投資制限

● FWりそな国内債券インデックスファンド

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

● FWりそな国内株式インデックスファンド

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

● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

● FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

● FWりそな新興国債券インデックスファンド

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

● FWりそな先進国株式インデックスファンド

● FWりそな新興国株式インデックスファンド

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

● FWりそな国内リートインデックスファンド

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

● FWりそな先進国リートインデックスファンド

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

■ 分配方針

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

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ 各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

● RAM国内債券マザーファンド

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

● RAM国内株式マザーファンド

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

● RAM先進国債券マザーファンド

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

● RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

● RAM新興国債券マザーファンド

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

● RAM先進国株式マザーファンド

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

● RAM新興国株式マザーファンド

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

● RAM国内リートマザーファンド

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

● RAM先進国リートマザーファンド

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

信託金限度額

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

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

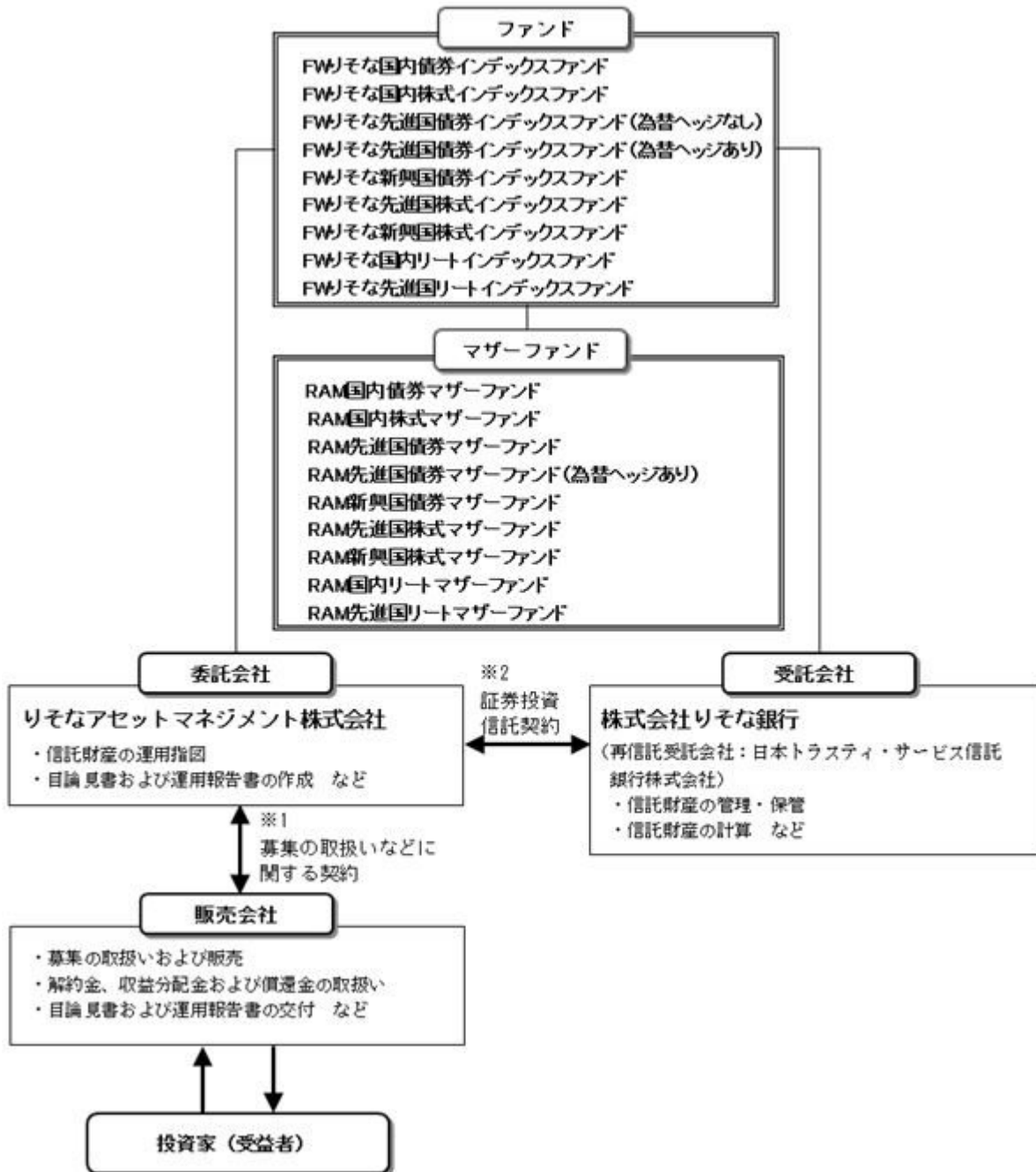
（２）【ファンドの沿革】

2017年1月5日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2018年6月末現在）

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

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

< F W りそな国内債券インデックスファンド >

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

< F W りそな国内株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、東証株価指数（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指して運用を行います。

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-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。

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

マザーファンド受益証券への投資比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

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

イメージ」をご参照ください。

（２）【投資対象】

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

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

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

債」といい、9)の証券および10)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

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

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。)
 - 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(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りそな新興国債券インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

16) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

17) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって15)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

1) 預金

2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F W りそな先進国株式インデックスファンド >

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

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せん。）

ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

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

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1) 株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 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券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

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

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

有価証券の指図範囲

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

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

るもの

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RAM国内債券マザーファンド >

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

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

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

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

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

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

< R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

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

< R A M新興国債券マザーファンド >

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

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

< R A M先進国株式マザーファンド >

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

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

< RAM新興国株式マザーファンド >

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

主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R A M国内リートマザーファンド >

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

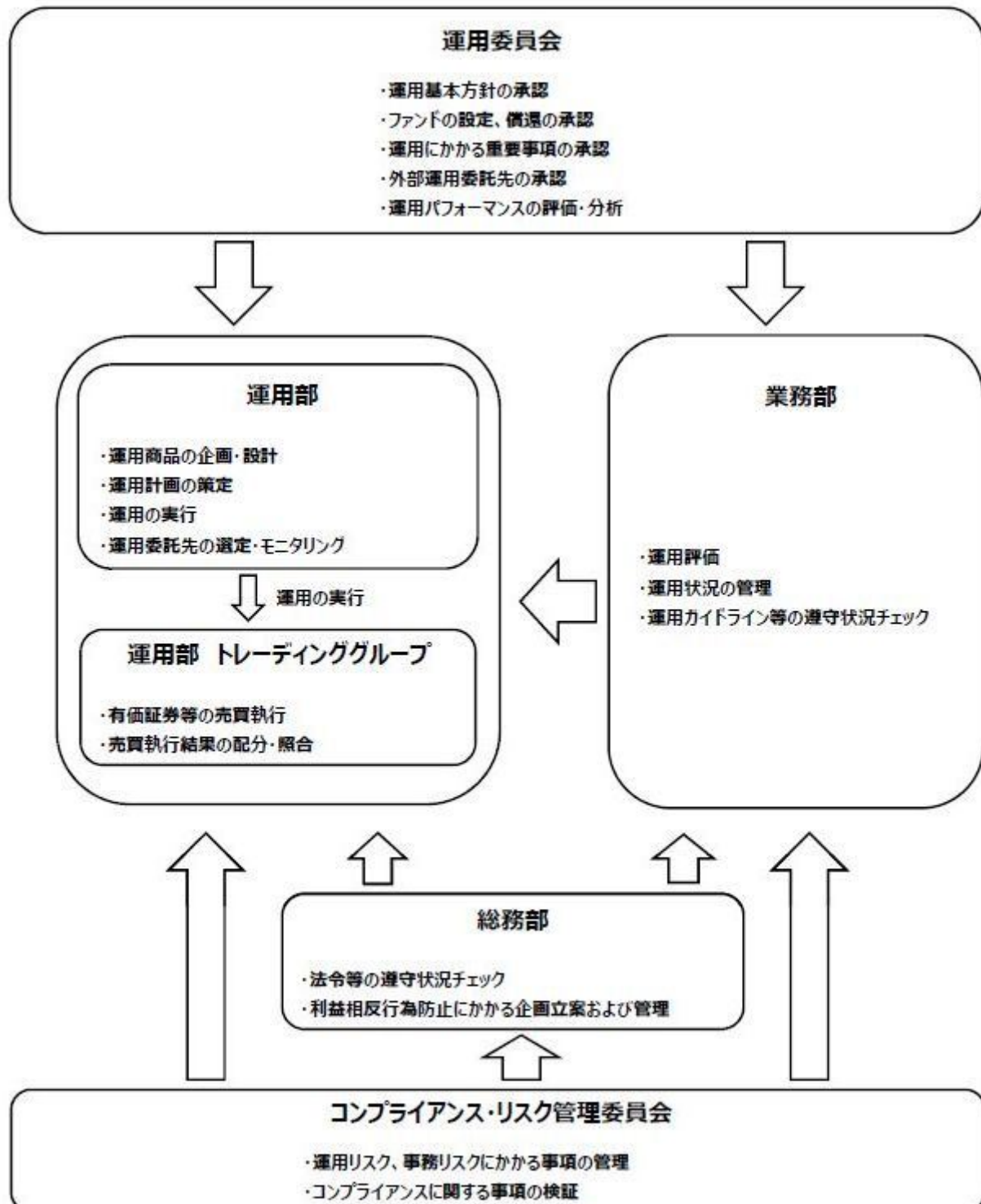
< R A M先進国リートマザーファンド >

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

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

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



コンプライアンス・リスク管理委員会は6名程度、運用委員会は6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、2018年6月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）>

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

<分配金受取りコース（一般コース）>

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<FWりそな国内債券インデックスファンド>

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、行いません。
- 4) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 7) 投資する株式の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または

登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

8) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

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

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

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

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

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

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

9) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

10) 金利先渡取引の運用指図および範囲

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

11) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

12) 資金の借入れ

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

託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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

< F Wりそな国内株式インデックスファンド >

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

す。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八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、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとし、
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとし、
6. 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

14) 資金の借入れ

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >

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

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

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

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

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

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

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

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

9) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

14) 資金の借入れ

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

< F Wりそな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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 8) 先物取引等の運用指図および範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

9)スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマ

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

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

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

11) 有価証券の貸付けの指図および範囲

- 1．委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

イ)株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ロ)公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ハ)投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

2.前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

12) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

13) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

14) 資金の借入れ

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

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

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

4.借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

7) 投資する株式の範囲

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

はありません。

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

8) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

9) スワップ取引の運用指図および範囲

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

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

11) 直物為替先渡取引の運用指図

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

12) 有価証券の貸付けの指図および範囲

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

13) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

14) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価

総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

15) 資金の借入れ

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

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の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。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株

予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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。

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) 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、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、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、
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、
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、

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、
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとし、
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとし、
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとし、
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、

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、
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< F Wりそな国内リートインデックスファンド >

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

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

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

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

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

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

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

12) 金利先渡取引の運用指図および範囲

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

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

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

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

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

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

- し、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。) ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10) で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 11) スワップ取引の運用指図および範囲
1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約

を指図するものとします。

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

13) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産

で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

14) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

15) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

16) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

< F Wりそな国内債券インデックスファンド >

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

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小さかった場合も同様です。

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >

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

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

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

市場リスク

・金利（債券価格）変動リスク

金利（債券価格）は、金融・財政政策、市場の需給、それらに関する外部評価の変化等を反映して変動します。債券価格は、一般に金利が上昇（低下）した場合は値下がり（値上がり）します。債券価格が値下がりした場合は、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-KOKUSAI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MSCIエマージング・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

リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金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。

・ 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小さかった場合も同様です。

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

（２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

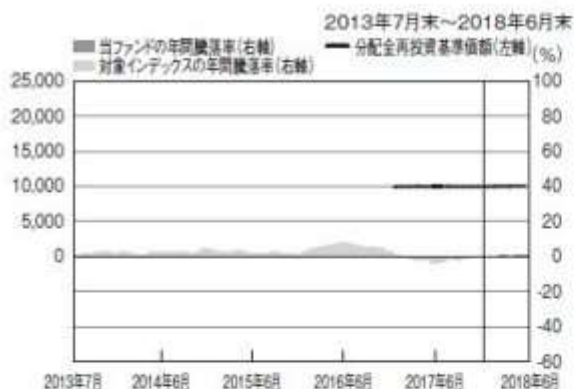
運用委員会は、運用実績等を統括し運用部に対する管理・指導を行い、コンプライアンス・リスク管理委員会では、審議事項を代表取締役または取締役会に報告します。

上記体制は2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

FWりそな国内債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

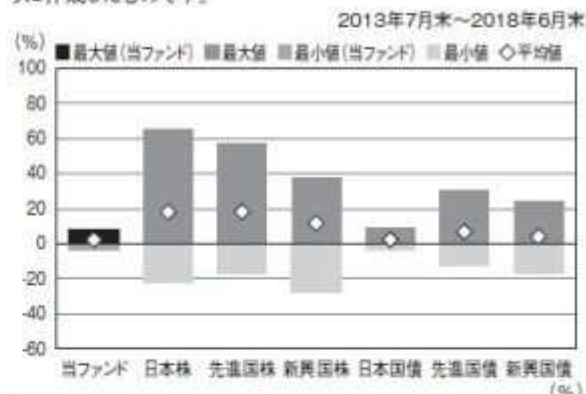


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.2	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△3.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.0	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな国内株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

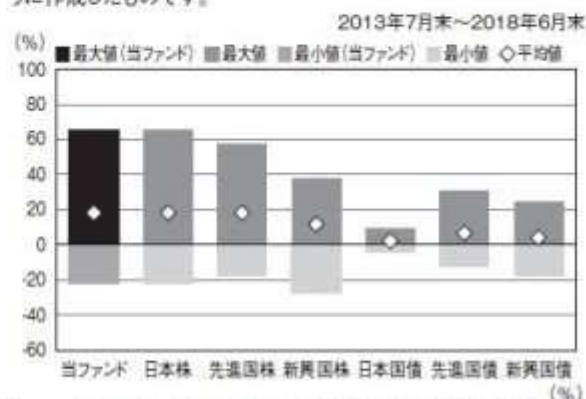


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

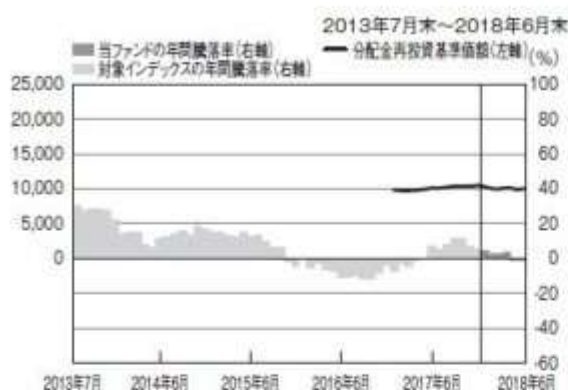


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	65.0	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△22.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	18.1	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

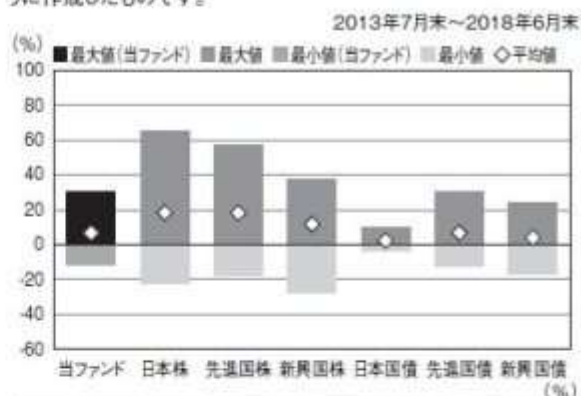


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

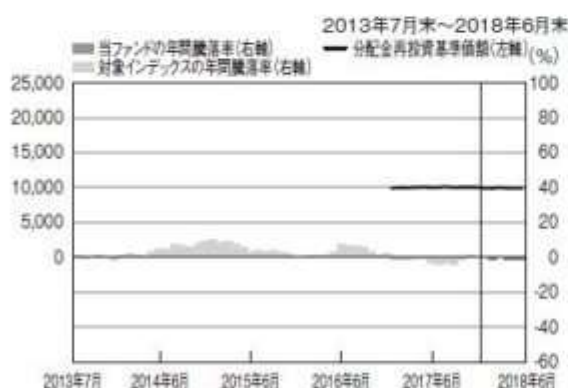


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	30.3	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△11.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	6.7	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

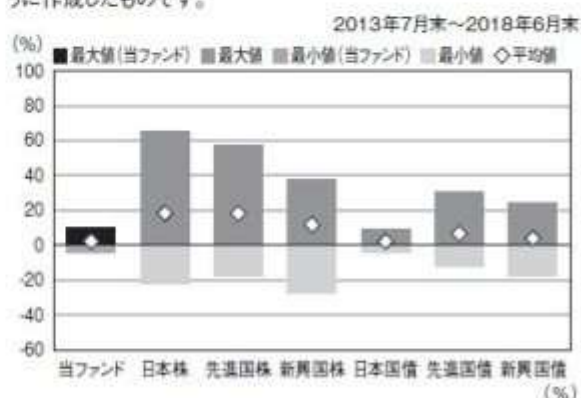


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	10.1	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△3.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.2	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな新興国債券インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	24.4	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△17.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.8	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

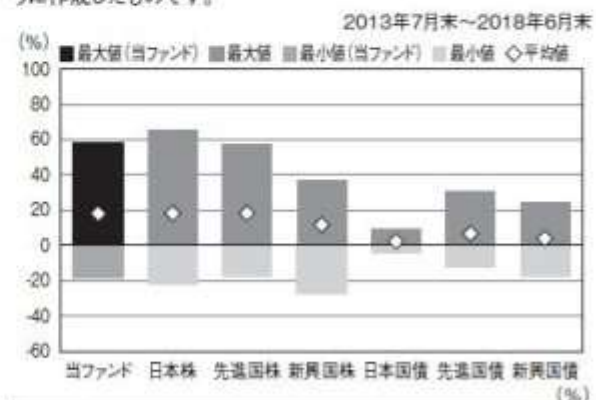


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	57.9	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△18.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	18.0	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな新興国株式インデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

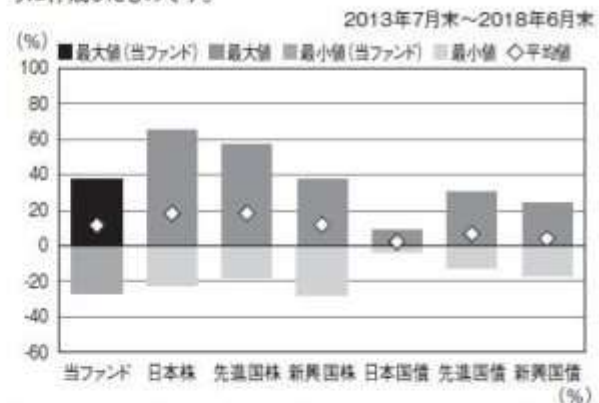


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

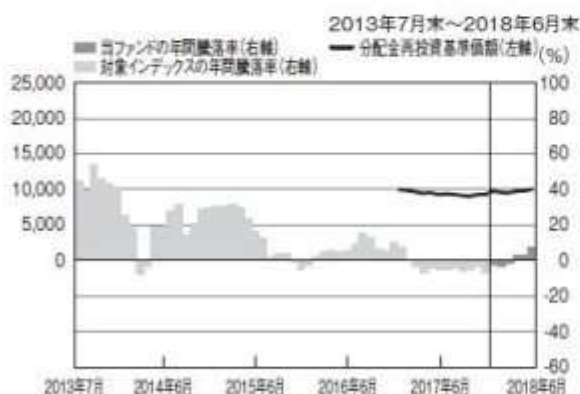


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	37.6	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△27.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	11.6	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな国内リートインデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

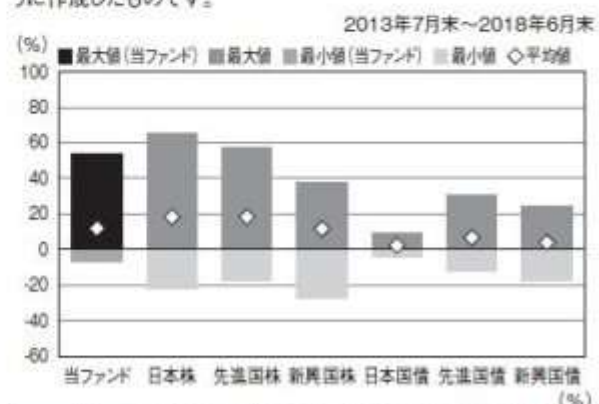


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	54.0	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△7.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	12.0	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

FWりそな先進国リートインデックスファンド

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

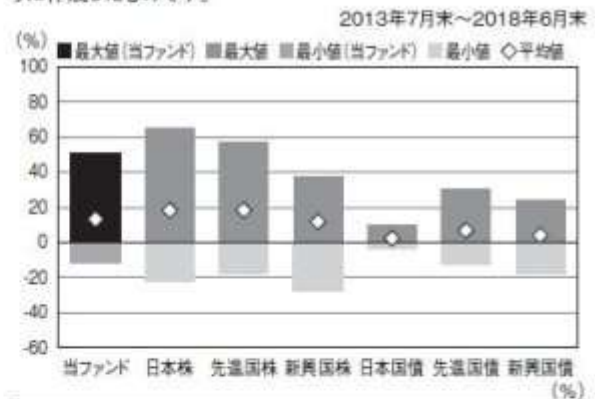


- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
 - * 年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- なお、2017年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	51.1	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	24.1
最小値	△12.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	13.3	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	4.0

- * 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。
- * 2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。
信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

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

- < F Wりそな国内債券インデックスファンド >
年率0.270%（税抜0.250%）
- < F Wりそな国内株式インデックスファンド >
年率0.324%（税抜0.300%）
- < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし） >
年率0.378%（税抜0.350%）
- < F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり） >
年率0.378%（税抜0.350%）
- < F Wりそな新興国債券インデックスファンド >
年率0.594%（税抜0.550%）
- < F Wりそな先進国株式インデックスファンド >
年率0.432%（税抜0.400%）
- < F Wりそな新興国株式インデックスファンド >
年率0.648%（税抜0.600%）
- < F Wりそな国内リートインデックスファンド >
年率0.324%（税抜0.300%）
- < F Wりそな先進国リートインデックスファンド >
年率0.432%（税抜0.400%）

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

す。)を控除した利益

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

原則として、益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

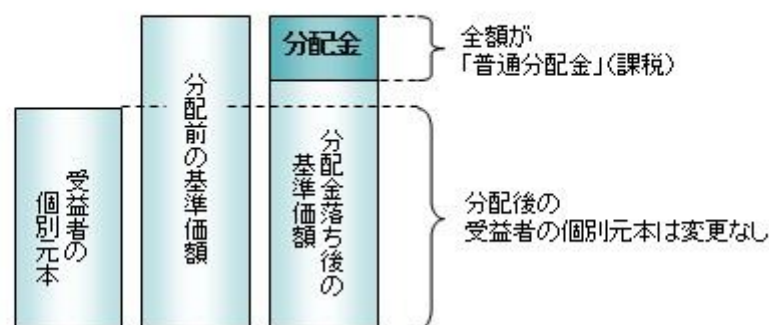
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

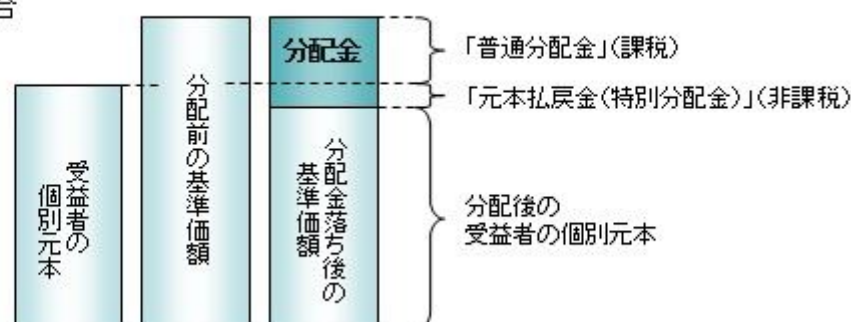
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年6月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変

更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

以下の運用状況は2018年 6月29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	43,907,580,932	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		23,294,704	0.05
合計(純資産総額)		43,930,875,636	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	42,186,376,761	1.0353	43,677,499,496	1.0408	43,907,580,932	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)	28,958	28,958	0.9997	0.9997
2017年 6月末日	14,347		0.9964	
7月末日	17,690		0.9964	
8月末日	20,106		1.0015	
9月末日	22,841		0.9976	
10月末日	26,193		0.9973	
11月末日	28,179		0.9997	
12月末日	30,435		1.0001	
2018年 1月末日	32,855		0.9982	
2月末日	34,583		1.0017	
3月末日	37,004		1.0030	
4月末日	38,794		1.0021	
5月末日	41,378		1.0041	
6月末日	43,930		1.0043	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.03
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	0.35

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	16,261,174,206	2,719,569,430

(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2018年 6月29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	14,087,540,151	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,472,025	0.08
合計（純資産総額）		14,099,012,176	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	12,040,632,608	1.1978	14,423,392,934	1.1700	14,087,540,151	99.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

【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
2017年 6月末日	5,014		1.0458	
7月末日	4,693		1.0504	

8月末日	5,323		1.0499
9月末日	6,293		1.0951
10月末日	7,287		1.1544
11月末日	7,886		1.1712
12月末日	8,577		1.1889
2018年 1月末日	8,795		1.2011
2月末日	8,983		1.1564
3月末日	9,523		1.1324
4月末日	12,836		1.1722
5月末日	13,378		1.1529
6月末日	14,099		1.1431

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	18.49
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	0.51

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	5,947,878,876	900,655,834

(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2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,841,349,096	99.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,860,891	0.06
合計（純資産総額）		9,847,209,987	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	10,271,734,784	0.9905	10,174,489,231	0.9581	9,841,349,096	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
2017年 6月末日	5,479		1.0109	
7月末日	5,315		1.0101	
8月末日	6,093		1.0241	
9月末日	6,938		1.0353	
10月末日	7,861		1.0351	
11月末日	8,436		1.0355	
12月末日	9,182		1.0480	

2018年 1月末日	9,611		1.0222
2月末日	9,939		0.9957
3月末日	10,846		1.0020
4月末日	8,850		1.0139
5月末日	9,147		0.9873
6月末日	9,847		1.0016

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	5.08
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	5.42

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	4,287,233,931	3,091,098,217

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

以下の運用状況は2018年 6月29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	43,438,680,180	99.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		19,536,564	0.04
合計（純資産総額）		43,458,216,744	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)	45,014,176,353	0.9736	43,830,298,282	0.9650	43,438,680,180	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)	28,986	28,986	1.0090	1.0090
2017年 6月末日	14,284		1.0027	
7月末日	17,567		1.0015	
8月末日	20,059		1.0100	
9月末日	22,479		1.0009	
10月末日	26,170		1.0044	
11月末日	28,118		1.0052	
12月末日	30,243		1.0037	
2018年 1月末日	32,420		0.9922	
2月末日	34,196		0.9880	
3月末日	36,978		1.0011	
4月末日	38,232		0.9914	

5月末日	40,664		0.9900
6月末日	43,458		0.9931

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	0.90
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	2.43

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	16,244,825,432	2,544,393,171

(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2018年 6月29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	1,079,720,503	99.95
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		488,468	0.05
合計(純資産総額)		1,080,208,971	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	1,027,424,592	1.1467	1,178,246,402	1.0509	1,079,720,503	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)	742	742	1.0790	1.0790
2017年 6月末日	374		1.0513	
7月末日	422		1.0553	
8月末日	496		1.0690	
9月末日	573		1.0816	
10月末日	650		1.0583	
11月末日	708		1.0625	
12月末日	795		1.0905	
2018年 1月末日	861		1.0846	
2月末日	908		1.0693	
3月末日	976		1.0684	
4月末日	1,029		1.0629	
5月末日	1,037		0.9993	
6月末日	1,080		0.9778	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.90
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	7.66

(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	735,295,511	47,003,360
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	434,127,469	48,355,911

(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2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,884,459,152	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		8,034,024	0.08
合計（純資産総額）		9,892,493,176	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	8,261,144,298	1.1993	9,908,350,672	1.1965	9,884,459,152	99.92

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.92
合 計	99.92

【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
2017年 6月末日	3,740		1.0453	
7月末日	3,409		1.0527	
8月末日	3,890		1.0485	
9月末日	4,571		1.0970	
10月末日	5,217		1.1219	
11月末日	5,629		1.1286	
12月末日	6,264		1.1624	
2018年 1月末日	6,619		1.1752	
2月末日	6,752		1.1214	
3月末日	7,000		1.0730	
4月末日	8,639		1.1209	
5月末日	9,178		1.1258	
6月末日	9,892		1.1344	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	15.07
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	0.20

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	3,914,801,760	647,916,483

(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2018年 6月29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	1,292,649,047	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,029,567	0.08
合計（純資産総額）		1,293,678,614	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新興国株式マザーファンド	1,012,413,101	1.3878	1,405,091,605	1.2768	1,292,649,047	99.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.92

合 計	99.92
-----	-------

【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
2017年 6月末日	473		1.1067	
7月末日	487		1.1526	
8月末日	577		1.1820	
9月末日	659		1.1907	
10月末日	784		1.2411	
11月末日	855		1.2571	
12月末日	951		1.2849	
2018年 1月末日	1,025		1.3354	
2月末日	1,045		1.2785	
3月末日	1,077		1.2283	
4月末日	1,237		1.2357	
5月末日	1,274		1.1949	
6月末日	1,293		1.1456	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	24.49

当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	1.26
------	-------------------------	------

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	482,976,967	85,771,010

(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2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,788,456,656	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,375,507	0.08
合計(純資産総額)		1,789,832,163	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	1,586,355,026	1.0536	1,671,490,291	1.1274	1,788,456,656	99.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

【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
2017年 6月末日	699		0.9285	
7月末日	814		0.9395	
8月末日	906		0.9298	
9月末日	1,010		0.9152	
10月末日	1,038		0.9033	
11月末日	1,139		0.9288	
12月末日	1,225		0.9281	
2018年 1月末日	1,377		0.9765	
2月末日	1,390		0.9571	
3月末日	1,452		0.9520	
4月末日	1,575		0.9763	
5月末日	1,674		0.9820	
6月末日	1,789		1.0022	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	7.25
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	6.10

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	663,732,094	173,021,961

(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りそな先進国リートインデックスファンド】

以下の運用状況は2018年 6月29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	1,877,035,423	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,377,207	0.07
合計(純資産総額)		1,878,412,630	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先進国リートマザーファンド	1,799,477,925	1.0328	1,858,513,982	1.0431	1,877,035,423	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)	1,518	1,518	1.0266	1.0266
2017年 6月末日	868		0.9830	
7月末日	926		0.9806	
8月末日	1,036		0.9737	
9月末日	1,186		0.9966	
10月末日	1,345		0.9923	
11月末日	1,454		1.0099	
12月末日	1,594		1.0313	
2018年 1月末日	1,563		0.9528	
2月末日	1,565		0.8863	
3月末日	1,842		0.9013	
4月末日	1,576		0.9277	
5月末日	1,724		0.9625	
6月末日	1,878		1.0003	

【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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年 1月 5日～2017年12月11日	2.66
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	4.39

(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
当中間期	2017年12月12日～2018年 6月11日	890,162,425	530,170,942

(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2018年 6月29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	50,397,616,700	84.32
地方債証券	日本	3,285,533,600	5.50
特殊債券	日本	3,419,005,529	5.72
社債券	日本	1,923,864,000	3.22
	フランス	100,611,000	0.17
	小計	2,024,475,000	3.39
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		640,145,296	1.07
合計(純資産総額)		59,766,776,125	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	680,000,000	101.05	687,147,800	101.01	686,929,200	0.100	2023/3/20	1.15
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	680,000,000	100.98	686,673,400	100.96	686,562,000	0.100	2022/12/20	1.15
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	661,000,000	102.93	680,428,080	103.17	681,953,700	0.400	2025/3/20	1.14
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	660,000,000	100.89	665,895,800	100.91	666,012,600	0.100	2022/9/20	1.11
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	660,000,000	100.83	665,481,400	100.85	665,649,600	0.100	2022/6/20	1.11
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	571,000,000	104.11	594,500,360	104.10	594,456,680	0.600	2024/6/20	0.99
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	570,000,000	103.70	591,116,200	103.28	588,696,000	1.200	2020/12/20	0.98
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	565,000,000	104.32	589,446,100	103.94	587,294,900	1.200	2021/6/20	0.98
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	580,000,000	100.45	582,657,700	100.95	585,562,200	0.100	2027/3/20	0.98

日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	557,000,000	104.66	582,969,290	104.51	582,165,260	0.800	2023/6/20	0.97
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	560,000,000	104.39	584,608,300	103.88	581,739,200	1.300	2021/3/20	0.97
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	560,000,000	100.58	563,279,400	100.72	564,065,600	0.100	2028/3/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	534,000,000	103.01	550,121,380	103.33	551,808,900	0.400	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	540,000,000	100.74	544,033,800	100.82	544,428,000	0.100	2022/3/20	0.91
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	530,000,000	102.91	545,449,800	102.50	543,265,900	1.000	2020/9/20	0.91
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	512,000,000	104.24	533,716,800	103.90	531,968,000	1.000	2021/12/20	0.89
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	490,000,000	104.52	512,172,900	104.24	510,820,100	1.100	2021/12/20	0.85
日本	国債証券	第308回利付国債(10年)	480,000,000	103.35	496,089,100	102.81	493,488,000	1.300	2020/6/20	0.83
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	462,000,000	103.83	479,724,000	103.82	479,648,400	0.600	2023/12/20	0.80
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	460,000,000	100.39	461,797,400	100.89	464,121,600	0.100	2027/6/20	0.78
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	450,000,000	100.63	452,840,300	101.07	454,819,500	0.100	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	450,000,000	100.61	452,761,300	101.01	454,576,500	0.100	2026/12/20	0.76
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	425,000,000	103.94	441,771,750	103.96	441,842,750	0.600	2024/3/20	0.74
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	407,000,000	104.83	426,658,900	104.72	426,214,470	0.800	2023/9/20	0.71
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	411,000,000	103.45	425,179,500	103.36	424,830,150	0.600	2023/3/20	0.71
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	420,000,000	100.66	422,800,500	101.11	424,695,600	0.100	2026/6/20	0.71
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	410,000,000	100.39	411,627,700	100.33	411,385,800	0.100	2019/12/20	0.69
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	400,000,000	100.62	402,512,000	100.67	402,680,000	0.100	2021/6/20	0.67
日本	国債証券	第388回利付国債(2年)	400,000,000	100.48	401,939,000	100.44	401,760,000	0.100	2020/5/15	0.67
日本	国債証券	第143回利付国債(20年)	335,000,000	118.81	398,024,150	119.41	400,036,900	1.600	2033/3/20	0.67

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.32
地方債証券	5.50
特殊債券	5.72
社債券	3.39
合計	98.93

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。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	19,305,652,410	98.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		264,309,561	1.35
合計（純資産総額）		19,569,961,971	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	354,752,500	1.81

(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	95,000	7,345.78	697,849,437	7,170.00	681,150,000	3.48
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	539,700	790.81	426,801,890	631.10	340,604,670	1.74
日本	株式	ソニー	電気機器	52,300	5,273.85	275,822,536	5,664.00	296,227,200	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,000	5,202.94	286,161,872	5,036.00	276,980,000	1.42
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	34,700	8,847.81	307,019,224	7,973.00	276,663,100	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	58,300	4,881.40	284,586,149	4,306.00	251,039,800	1.28
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,800	68,082.41	258,713,166	62,560.00	237,728,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	70,300	3,822.46	268,719,511	3,253.00	228,685,900	1.17
日本	株式	KDDI	情報・通信業	67,600	2,803.54	189,519,862	3,031.00	204,895,600	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,047,500	204.05	213,749,218	186.50	195,358,750	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	57,600	2,715.60	156,418,937	3,066.00	176,601,600	0.90
日本	株式	任天堂	その他製品	4,800	46,751.24	224,405,979	36,200.00	173,760,000	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	54,000	3,107.34	167,796,448	3,078.00	166,212,000	0.85

日本	株式	ファナック	電気機器	7,400	28,465.03	210,641,258	22,005.00	162,837,000	0.83
日本	株式	花王	化学	19,200	7,773.26	149,246,698	8,450.00	162,240,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	7,000	21,161.12	148,127,906	22,960.00	160,720,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	9,400	17,478.61	164,298,961	16,625.00	156,275,000	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	32,300	4,638.18	149,813,275	4,831.00	156,041,300	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	55,100	2,761.12	152,137,881	2,822.50	155,519,750	0.79
日本	株式	キヤノン	電気機器	42,100	4,108.63	172,973,516	3,631.00	152,865,100	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,200	15,661.72	128,426,177	18,620.00	152,684,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	29,000	5,241.90	152,015,111	5,193.00	150,597,000	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	48,500	3,384.34	164,140,861	3,095.00	150,107,500	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	14,000	10,910.29	152,744,078	10,615.00	148,610,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	188,000	865.71	162,754,402	781.60	146,940,800	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	10,700	13,124.91	140,436,555	13,270.00	141,989,000	0.73
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	28,800	5,943.87	171,183,571	4,678.00	134,726,400	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	89,300	1,638.90	146,354,014	1,493.50	133,369,550	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	13,500	11,892.26	160,545,623	9,873.00	133,285,500	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	76,900	1,495.10	114,973,729	1,689.00	129,884,100	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.13
		食料品	4.44
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.31
		医薬品	4.68
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.01
		非鉄金属	0.84
		金属製品	0.62
		機械	5.09
		電気機器	13.44
		輸送用機器	8.49
		精密機器	1.71
		その他製品	2.05
		電気・ガス業	1.74
陸運業	4.33		
海運業	0.19		

	空運業	0.57
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.41
	卸売業	4.73
	小売業	4.97
	銀行業	6.57
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.23
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.40
	サービス業	4.56
合 計		98.65

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	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	20	日本円	353,620,800	346,100,000	1.77
	大阪証券取引所	ミニトピックス先物	買建	5	日本円	8,865,540	8,652,500	0.04

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

R A M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	9,741,674,018	44.09
	カナダ	454,651,861	2.06
	メキシコ	178,602,993	0.81
	ドイツ	1,592,459,663	7.21
	イタリア	2,002,548,259	9.06
	フランス	2,224,687,196	10.07
	オランダ	475,532,007	2.15
	スペイン	1,291,353,578	5.84
	ベルギー	554,625,422	2.51
	オーストリア	336,768,557	1.52
	フィンランド	143,811,761	0.65

	アイルランド	176,810,745	0.80
	イギリス	1,535,501,189	6.95
	スウェーデン	83,455,121	0.38
	ノルウェー	51,656,049	0.23
	デンマーク	127,359,682	0.58
	ポーランド	136,992,289	0.62
	オーストラリア	464,287,739	2.10
	シンガポール	84,306,021	0.38
	マレーシア	106,482,625	0.48
	南アフリカ	124,278,085	0.56
	小計	21,887,844,860	99.06
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	208,167,081	0.94
	合計（純資産総額）	22,096,011,941	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		31,579,426	0.14

(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	970,000	10,929.37	106,014,947	10,959.00	106,302,320	2.750	2028/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	10,764.42	100,109,122	10,647.24	99,019,387	2.375	2027/5/15	0.45
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	550,000	15,790.94	86,850,207	15,765.48	86,710,157	4.250	2023/10/25	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	420,000	20,427.85	85,796,993	20,642.11	86,696,886	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	820,000	10,586.56	86,809,807	10,548.36	86,496,617	1.125	2021/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	10,741.30	85,930,479	10,633.42	85,067,427	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	780,000	10,820.77	84,402,039	10,770.31	84,008,419	1.375	2020/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,673.25	84,318,732	10,550.74	83,350,882	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,541.90	83,281,014	10,473.44	82,740,208	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,834.66	83,426,946	10,731.01	82,628,801	2.000	2022/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	780,000	10,684.35	83,337,990	10,579.45	82,519,724	2.125	2025/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,672.84	82,180,918	10,697.55	82,371,155	2.250	2024/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	11,003.38	82,525,362	10,883.22	81,624,201	2.500	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	10,110.22	80,881,793	10,114.63	80,917,049	1.625	2026/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	11,195.27	79,486,477	11,053.77	78,481,830	2.750	2023/11/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	370,000	20,816.97	77,022,795	21,085.23	78,015,367	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	10,803.02	77,781,802	10,779.37	77,611,495	2.125	2022/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,840.71	76,969,047	10,852.78	77,054,767	0.750	2019/8/15	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,863.38	77,130,026	10,843.92	76,991,902	1.250	2020/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	10,086.94	77,669,438	9,982.28	76,863,568	1.500	2026/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,634.48	77,631,735	10,514.68	76,757,211	2.000	2025/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	690,000	10,916.25	75,322,167	10,860.33	74,936,304	1.625	2020/6/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,249.56	74,821,841	10,143.55	74,047,984	1.625	2026/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,462.69	74,285,135	10,361.17	73,564,374	2.000	2026/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	10,587.69	74,113,897	10,508.20	73,557,461	2.250	2027/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	670,000	10,872.97	72,848,910	10,848.89	72,687,583	1.625	2020/7/31	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	500,000	14,468.71	72,343,594	14,434.64	72,173,218	3.000	2022/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	10,567.79	71,861,038	10,565.63	71,846,313	1.125	2021/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	11,029.06	71,688,894	11,026.36	71,671,373	2.375	2020/4/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	10,950.36	70,082,360	10,917.54	69,872,316	1.500	2019/10/31	0.32

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.06
合計	99.06

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	116,700.00	12,843,644	12,895,831	0.06
	ユーロ	買建	63,000.00	8,064,970	8,057,700	0.04
	英ポンド	買建	73,500.00	10,622,344	10,625,895	0.05

(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。

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2018年 6月29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	23,781,100,335	44.15
	カナダ	1,123,763,056	2.09
	メキシコ	423,293,221	0.79
	ドイツ	3,897,473,136	7.24
	イタリア	4,924,825,798	9.14

フランス	5,475,777,914	10.17
オランダ	1,168,601,045	2.17
スペイン	3,170,729,563	5.89
ベルギー	1,362,432,651	2.53
オーストリア	801,639,519	1.49
フィンランド	350,011,671	0.65
アイルランド	397,994,128	0.74
イギリス	3,740,913,560	6.94
スウェーデン	204,875,889	0.38
ノルウェー	135,982,717	0.25
デンマーク	319,811,276	0.59
ポーランド	333,807,776	0.62
オーストラリア	1,133,948,281	2.11
シンガポール	202,498,639	0.38
マレーシア	271,650,949	0.50
南アフリカ	305,453,147	0.57
小計	53,526,584,271	99.37
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	341,643,761	0.63
合計（純資産総額）	53,868,228,032	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		73,506,955	0.14
	売建		54,250,087,862	100.71

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,160,000	10,365.36	223,891,957	10,143.55	219,100,883	1.625	2026/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	10,921.25	209,688,124	10,959.00	210,412,837	2.750	2028/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,980,000	10,809.05	214,019,274	10,550.74	208,904,743	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,950,000	10,729.26	209,220,711	10,508.20	204,910,071	2.250	2027/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,920,000	10,894.09	209,166,587	10,633.42	204,161,827	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,880,000	10,676.43	200,716,892	10,562.82	198,581,139	1.250	2021/10/31	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	940,000	21,249.81	199,748,266	21,085.23	198,201,203	5.750	2032/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,890,000	10,713.46	202,484,473	10,473.44	197,948,090	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	10,985.06	197,731,217	10,917.54	196,515,890	1.500	2019/10/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,850,000	10,826.03	200,281,612	10,579.45	195,719,858	2.125	2025/5/15	0.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,850,000	10,818.93	200,150,299	10,522.02	194,657,485	2.250	2027/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	940,000	20,873.98	196,215,489	20,642.11	194,035,889	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,930,000	10,207.81	197,010,769	9,982.28	192,658,033	1.500	2026/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,890,000	10,352.39	195,660,230	10,114.63	191,166,527	1.625	2026/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,210,000	16,005.41	193,665,502	15,765.48	190,762,345	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,760,000	10,955.91	192,824,034	10,647.24	187,391,529	2.375	2027/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,290,000	14,612.70	188,503,955	14,434.64	186,206,901	3.000	2022/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,680,000	11,297.13	189,791,790	11,053.77	185,703,486	2.750	2023/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,790,000	10,640.84	190,471,178	10,361.17	185,465,113	2.000	2026/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,730,000	10,680.67	184,775,690	10,565.63	182,785,473	1.125	2021/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,690,000	10,967.73	185,354,757	10,697.55	180,788,641	2.250	2024/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,670,000	10,907.95	182,162,905	10,816.29	180,632,123	1.375	2020/5/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,680,000	10,915.32	183,377,485	10,731.01	180,281,021	2.000	2022/11/30	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	12,873.22	184,087,070	12,575.21	179,825,622	3.750	2043/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,084.75	177,356,024	10,794.05	172,704,866	2.375	2024/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	11,233.46	172,995,387	11,068.03	170,447,794	2.625	2020/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,694.54	172,182,103	10,580.53	170,346,614	1.125	2021/6/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	10,933.47	172,748,967	10,779.37	170,314,116	2.125	2022/12/31	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	880,000	19,487.47	171,489,820	19,245.92	169,364,158	5.500	2029/4/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,783.05	173,607,169	10,514.68	169,286,451	2.000	2025/2/15	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.37
合計	99.37

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	337,900.00	37,123,011	37,341,329	0.07
	ユーロ	買建	179,000.00	22,914,756	22,894,100	0.04
	英ポンド	買建	91,800.00	13,339,641	13,271,526	0.02
	米ドル	売建	218,463,800.00	24,014,552,477	24,086,059,900	44.71
	カナダドル	売建	13,561,000.00	1,118,870,646	1,128,682,030	2.10
	メキシコペソ	売建	78,034,000.00	423,451,501	433,088,700	0.80
	ユーロ	売建	170,652,500.00	21,753,814,355	21,826,454,750	40.52
	英ポンド	売建	26,387,900.00	3,810,433,411	3,811,494,133	7.08
	スウェーデンクローナ	売建	17,047,000.00	209,729,241	208,655,280	0.39
	ノルウェークローネ	売建	10,199,000.00	137,054,162	137,482,520	0.26

デンマーククローネ	売建	18,891,000.00	323,149,446	324,169,560	0.60
ポーランドズロチ	売建	11,634,000.00	340,251,454	340,294,500	0.63
オーストラリアドル	売建	14,023,000.00	1,134,334,493	1,135,021,620	2.11
シンガポールドル	売建	2,735,700.00	220,086,495	220,633,069	0.41
マレーシアリンギット	売建	10,100,000.00	278,190,720	275,831,000	0.51
南アフリカランド	売建	40,480,000.00	320,237,280	322,220,800	0.60

(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2018年 6月29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	1,960,350,595	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,493,654	0.08
合計(純資産総額)		1,961,844,249	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		1,348,222	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	1,041,357	2,152.41	2,241,435,923	1,882.49	1,960,350,595	99.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

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	12,200.00	1,344,440	1,348,222	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	8,229,278,734	57.19
	カナダ	503,902,277	3.50
	モーリシャス	142,756	0.00
	パナマ	10,198,005	0.07
	ドイツ	484,884,371	3.37
	イタリア	99,092,199	0.69
	フランス	510,533,626	3.55
	オランダ	260,179,302	1.81
	スペイン	157,388,151	1.09
	ベルギー	54,273,712	0.38
	オーストリア	12,622,352	0.09
	ルクセンブルク	14,107,561	0.10
	フィンランド	54,494,684	0.38
	アイルランド	193,770,534	1.35
	ポルトガル	7,648,021	0.05
	イギリス	869,979,257	6.05
	スイス	435,102,802	3.02
	スウェーデン	132,566,422	0.92
	ノルウェー	38,064,184	0.26
	デンマーク	84,418,070	0.59
	ケイマン	41,290,572	0.29
リベリア	6,133,011	0.04	
オーストラリア	332,515,901	2.31	
バミューダ	45,844,244	0.32	
ニュージーランド	13,177,018	0.09	
パプアニューギニア	2,528,996	0.02	

	香港	126,150,129	0.88
	シンガポール	61,847,654	0.43
	イスラエル	27,415,448	0.19
	キュラソー	32,873,533	0.23
	ジャージー	74,806,069	0.52
	英ヴァージン諸島	2,390,768	0.02
	マン島	2,255,604	0.02
	小計	12,921,875,967	89.80
投資証券	アメリカ	243,221,576	1.69
	カナダ	590,363	0.00
	フランス	8,014,114	0.06
	イギリス	12,302,152	0.09
	オーストラリア	22,027,892	0.15
	香港	7,002,730	0.05
	シンガポール	5,371,807	0.04
	小計	298,530,634	2.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,169,780,906	8.13
合計（純資産総額）		14,390,187,507	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	901,840,586	6.27
	買建	ドイツ	214,313,202	1.49
	買建	イギリス	87,343,924	0.61

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

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		67,642,630	0.47

(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	16,778	19,343.17	324,539,779	20,505.16	344,035,742	2.39

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	24,191	10,230.26	247,480,460	10,902.56	263,743,834	1.83
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,369	156,256.36	213,914,957	188,078.28	257,479,169	1.79
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	7,947	19,987.89	158,843,819	21,691.26	172,380,477	1.20
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	11,392	12,598.84	143,526,098	11,598.96	132,135,377	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	1,047	124,151.14	129,986,244	123,165.87	128,954,675	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	14,100	9,358.96	131,961,421	9,060.96	127,759,590	0.89
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	993	124,901.12	124,026,816	124,554.26	123,682,381	0.86
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	8,913	15,138.39	134,928,485	13,485.87	120,199,648	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	32,381	3,473.64	112,480,041	3,169.18	102,621,276	0.71
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	15,590	6,768.58	105,522,283	5,928.26	92,421,577	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	6,386	13,993.85	89,364,735	13,890.45	88,704,455	0.62
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	4,274	23,143.12	98,913,729	20,680.92	88,390,289	0.61
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	6,018	13,699.61	82,444,255	14,673.07	88,302,593	0.61
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	3,238	26,426.88	85,570,250	27,071.24	87,656,695	0.61
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	10,330	8,878.60	91,716,028	8,460.14	87,393,287	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	24,559	3,864.85	94,917,064	3,558.28	87,387,862	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,967	21,733.12	86,215,322	21,578.51	85,601,963	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	15,557	5,287.75	82,261,613	5,444.09	84,693,786	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,872	4,047.65	80,435,016	4,019.23	79,870,226	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	13,892	5,733.49	79,649,717	5,622.06	78,101,719	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	16,187	4,704.49	76,151,720	4,746.58	76,833,013	0.53
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	8,438	9,365.47	79,025,918	8,627.64	72,800,085	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	1,909	37,219.73	71,052,480	36,992.21	70,618,131	0.49
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	66,953	1,079.75	72,293,133	1,026.29	68,713,851	0.48
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	3,131	18,890.50	59,146,178	21,787.43	68,216,456	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	13,602	5,117.87	69,613,345	4,805.17	65,359,974	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	小売	1,494	31,151.58	46,540,463	43,709.72	65,302,332	0.45
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	8,613	8,457.88	72,847,743	7,392.91	63,675,179	0.44
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	9,042	6,587.90	59,567,806	6,665.56	60,270,012	0.42

口.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	6.70
		素材	4.43
		資本財	6.56
		商業・専門サービス	1.01
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.29
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.66
		メディア	1.85
		小売	4.53
		食品・生活必需品小売り	1.39
		食品・飲料・タバコ	4.49
		家庭用品・パーソナル用品	1.71
		ヘルスケア機器・サービス	4.34
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.19
		銀行	8.21
		各種金融	4.10
		保険	3.48
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	10.76
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.01		
電気通信サービス	2.20		
公益事業	2.85		
半導体・半導体製造装置	2.86		
投資証券			2.07
合計			91.87

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN1809	買建	60	米ドル	8,316,087.5	919,260,314	8,158,500	901,840,586	6.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EUROSTX 1809	買建	50	ユーロ	1,726,020	220,775,222	1,675,500	214,313,202	1.49

イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1809	買建	8	英ポンド	607,695	87,866,619	604,080	87,343,924	0.61
------	--------------------	--------------	----	---	------	---------	------------	---------	------------	------

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

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	393,000.00	43,308,600	43,430,430	0.30
	カナダドル	買建	33,000.00	2,727,450	2,751,210	0.02
	ユーロ	買建	77,000.00	9,815,960	9,848,300	0.07
	英ポンド	買建	45,000.00	6,503,625	6,505,650	0.05
	スイスフラン	買建	20,000.00	2,211,800	2,217,600	0.02
	スウェーデンクローナ	買建	130,000.00	1,598,350	1,591,200	0.01
	オーストラリアドル	買建	16,000.00	1,297,120	1,298,240	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	14,605,540	0.35
	メキシコ	113,528,414	2.73
	ブラジル	233,653,206	5.63
	チリ	44,926,335	1.08
	コロンビア	18,580,933	0.45
	ペルー	1,792,926	0.04
	オランダ	1,932,792	0.05
	ルクセンブルク	3,054,829	0.07
	ギリシャ	12,188,064	0.29
	トルコ	29,844,847	0.72
	チェコ	6,990,592	0.17
	ハンガリー	10,695,079	0.26
	ポーランド	43,760,623	1.05
	ロシア	128,895,269	3.10
	ケイマン	714,033,043	17.20
	バミューダ	43,049,649	1.04
	香港	147,034,011	3.54
シンガポール	1,356,867	0.03	

	マレーシア	93,856,767	2.26
	タイ	88,257,237	2.13
	フィリピン	37,421,946	0.90
	インドネシア	75,090,380	1.81
	韓国	587,814,947	14.16
	台湾	456,841,329	11.00
	中国	392,839,367	9.46
	インド	346,965,515	8.36
	エジプト	4,472,725	0.11
	南アフリカ	238,585,370	5.75
	アラブ首長国連邦	26,209,206	0.63
	マン島	1,849,312	0.04
	小計	3,920,127,120	94.41
投資証券	メキシコ	3,854,978	0.09
	トルコ	404,280	0.01
	南アフリカ	11,590,548	0.28
	小計	15,849,806	0.38
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		216,262,616	5.21
合計（純資産総額）		4,152,239,542	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	236,758,990	5.70

(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		58,190,182	1.40
	売建		18,190,222	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	39,500	6,311.61	249,308,717	5,340.11	210,934,345	5.08
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	8,030	21,194.13	170,188,906	20,823.52	167,212,907	4.03

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	33,980	4,863.48	165,261,345	4,623.83	157,118,083	3.78
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	172,000	899.85	154,775,898	765.32	131,635,040	3.17
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	3,088	28,043.69	86,598,944	26,239.99	81,029,109	1.95
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	678,000	118.27	80,193,726	99.75	67,635,382	1.63
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	1,950	27,696.00	54,007,215	26,773.89	52,209,092	1.26
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	43,500	1,115.81	48,538,010	974.32	42,383,072	1.02
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	495,000	99.40	49,206,275	80.87	40,033,917	0.96
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	37,000	1,251.38	46,301,140	1,003.91	37,144,762	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	11,340	3,061.72	34,719,982	3,042.35	34,500,362	0.83
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	118,000	330.64	39,015,721	290.60	34,291,390	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	4,011	7,554.74	30,302,085	8,249.80	33,089,948	0.80
ブラジル	株式	VALE SA	素材	22,700	1,252.75	28,437,645	1,403.89	31,868,364	0.77
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	20,400	1,543.26	31,482,506	1,530.81	31,228,708	0.75
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	572,000	63.42	36,276,505	53.96	30,867,808	0.74
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	19,100	1,972.59	37,676,616	1,509.97	28,840,549	0.69
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	23,400	1,405.63	32,891,858	1,134.38	26,544,644	0.64
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	12,640	1,931.24	24,410,890	2,089.15	26,406,881	0.64
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	129,000	178.30	23,001,313	189.93	24,501,383	0.59
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	51,400	565.99	29,092,348	474.92	24,411,196	0.59
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	3,055	7,490.34	22,883,008	7,417.23	22,659,650	0.55
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	5,220	4,838.43	25,256,616	4,303.32	22,463,342	0.54
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	29,550	1,004.41	29,680,449	755.59	22,327,687	0.54
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	227,500	97.43	22,165,593	92.17	20,970,040	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	6,440	2,588.89	16,672,476	2,985.17	19,224,520	0.46
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,200	3,983.59	20,714,697	3,675.36	19,111,872	0.46
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	39,300	558.20	21,937,296	478.63	18,810,481	0.45
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	186,000	96.66	17,980,364	98.34	18,292,765	0.44
韓国	株式	POSCO	素材	569	36,495.69	20,766,048	31,813.59	18,101,938	0.44

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	6.79

	素材	7.17
	資本財	3.28
	商業・専門サービス	0.15
	運輸	1.46
	自動車・自動車部品	2.57
	耐久消費財・アパレル	1.02
	消費者サービス	1.30
	メディア	2.32
	小売	2.04
	食品・生活必需品小売り	1.75
	食品・飲料・タバコ	3.38
	家庭用品・パーソナル用品	1.28
	ヘルスケア機器・サービス	0.59
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.42
	銀行	15.77
	各種金融	2.43
	保険	3.40
	不動産	2.37
	ソフトウェア・サービス	13.75
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.79
	電気通信サービス	4.07
	公益事業	2.26
	半導体・半導体製造装置	5.05
投資証券		0.38
合計		94.79

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 1809	買建	41	米ドル	2,217,590	245,132,400	2,141,840	236,758,990	5.70

(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	295,000.00	32,509,000	32,600,450	0.79
	ブラジルリアル	買建	595,112.10	16,998,387	17,026,151	0.41

コロンビアペソ	買建	29,744,550.00	1,116,220	1,112,446	0.03
マレーシアリングット	買建	272,735.55	7,454,953	7,451,135	0.18
米ドル	売建	164,603.48	18,114,607	18,190,222	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国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	9,227,404,960	92.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		714,247,284	7.18
合計(純資産総額)		9,941,652,244	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	714,932,000	7.19

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,080	596,405.76	644,118,231	639,000	690,120,000	6.94
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,109	564,459.64	625,985,741	586,000	649,874,000	6.54
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,299	152,355.11	502,619,528	156,300	515,633,700	5.19
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,459	170,966.01	420,405,436	171,900	422,702,100	4.25
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,105	212,848.53	448,046,168	199,600	420,158,000	4.23
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,211	170,525.3	377,031,457	176,900	391,125,900	3.93
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,486	243,080.47	361,217,587	229,800	341,482,800	3.43
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,297	264,509.55	343,068,891	262,900	340,981,300	3.43
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,032	281,415.93	290,421,245	283,800	292,881,600	2.95
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	704	391,130.34	275,355,766	402,500	283,360,000	2.85
日本	投資証券	G L P投資法人	2,315	122,424.58	283,412,907	117,600	272,244,000	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,218	81,237.49	261,422,272	83,000	267,094,000	2.69
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	504	486,326.06	245,108,338	508,000	256,032,000	2.58
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	344	685,041.37	235,654,232	688,000	236,672,000	2.38

日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,793	72,613.56	202,809,694	72,600	202,771,800	2.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	370	488,065.08	180,584,081	504,000	186,480,000	1.88
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,198	141,051.49	168,979,691	142,100	170,235,800	1.71
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	379	453,379.6	171,830,870	445,000	168,655,000	1.70
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	743	217,499.09	161,601,830	225,700	167,695,100	1.69
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,295	123,967.83	160,538,349	123,400	159,803,000	1.61
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,058	50,686.97	155,000,768	49,900	152,594,200	1.53
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	238	620,738.72	147,735,817	636,000	151,368,000	1.52
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	998	139,601.77	139,322,574	142,700	142,414,600	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,059	120,833.64	127,962,830	127,700	135,234,300	1.36
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	757	169,037.55	127,961,428	171,600	129,901,200	1.31
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	797	163,604.31	130,392,638	158,700	126,483,900	1.27
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,007	113,319.81	114,113,050	112,400	113,186,800	1.14
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,254	85,751.73	107,532,678	89,100	111,731,400	1.12
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	748	145,363.19	108,731,671	149,000	111,452,000	1.12
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	423	249,201.33	105,412,164	261,000	110,403,000	1.11

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	92.82
合計	92.82

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	大阪証券取引所	東証REIT指数先物	買建	409	日本円	704,655,972	714,932,000	7.19

(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 - トマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	フランス	205,814,864	2.54
投資証券	アメリカ	5,808,310,445	71.61

カナダ	142,503,876	1.76
ドイツ	22,305,372	0.27
イタリア	8,309,034	0.10
フランス	191,848,347	2.37
オランダ	36,320,430	0.45
スペイン	82,104,782	1.01
ベルギー	61,286,017	0.76
アイルランド	21,852,134	0.27
イギリス	448,118,811	5.52
オーストラリア	542,717,410	6.69
ニュージーランド	34,657,507	0.43
香港	165,544,396	2.04
シンガポール	276,330,495	3.41
イスラエル	4,102,291	0.05
ガンジー	6,453,630	0.08
マン島	4,289,758	0.05
小計	7,857,054,735	96.86
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	48,723,480	0.60
合計（純資産総額）	8,111,593,079	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		8,391,170	0.10

(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	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC		19,725	17,988.59	354,825,131	18,925.55	373,306,541	4.60
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC		34,072	7,055.02	240,378,822	7,201.68	245,375,675	3.02
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE		9,508	21,728.53	206,594,867	25,305.92	240,608,708	2.97
フランス	株式	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	不動産	8,600	25,361.09	218,105,411	23,931.96	205,814,864	2.54
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC		8,796	18,612.06	163,711,752	18,947.66	166,663,630	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL		23,742	6,738.98	159,997,100	6,997.18	166,127,095	2.05
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC		23,579	6,451.79	152,126,969	6,893.27	162,536,517	2.00
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC		13,210	11,975.11	158,191,218	12,202.51	161,195,165	1.99
アメリカ	投資証券	VENTAS INC		22,845	5,972.18	136,434,584	6,349.41	145,052,445	1.79
香港	投資証券	LINK REIT		137,000	982.66	134,625,341	1,000.39	137,053,430	1.69
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC		9,907	13,523.72	133,979,548	13,810.86	136,824,265	1.69

オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP		342,068	328.17	112,258,297	356.29	121,876,229	1.50
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC		4,249	25,678.63	109,108,507	26,042.11	110,652,962	1.36
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC		46,698	2,275.12	106,243,887	2,305.86	107,679,256	1.33
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP		17,929	5,850.48	104,893,422	6,002.32	107,615,631	1.33
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		6,631	13,836.95	91,752,847	13,965.62	92,606,050	1.14
アメリカ	投資証券	GGP INC		40,703	2,502.89	101,875,472	2,264.96	92,190,854	1.14
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST		10,975	7,825.18	85,881,389	8,144.58	89,386,845	1.10
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC		7,932	9,530.29	75,594,305	11,065.05	87,768,008	1.08
アメリカ	投資証券	HCP INC		30,619	2,627.34	80,446,603	2,840.87	86,984,843	1.07
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM		7,342	10,320.51	75,773,249	11,192.17	82,172,949	1.01
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP		99,343	671.50	66,709,094	782.38	77,724,215	0.96
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP		22,612	2,877.65	65,069,625	3,203.44	72,436,393	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC		17,012	4,002.94	68,098,143	4,150.77	70,613,018	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC		17,971	3,821.72	68,680,283	3,830.21	68,832,722	0.85
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC		48,126	1,421.66	68,418,963	1,386.61	66,732,383	0.82
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST		4,689	13,339.97	62,551,162	13,946.83	65,396,694	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP		9,159	6,868.91	62,912,424	6,904.32	63,236,744	0.78
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP		5,648	10,685.87	60,353,807	11,142.43	62,932,456	0.78
イギリス	投資証券	SEGRO PLC		64,346	851.52	54,792,110	960.36	61,795,760	0.76

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	2.54
投資証券			96.86
合計			99.40

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	55,000.00	6,061,000	6,078,050	0.07
	英ポンド	買建	16,000.00	2,312,400	2,313,120	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

2018年6月29日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万円当たり、税引前)

2017年12月11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

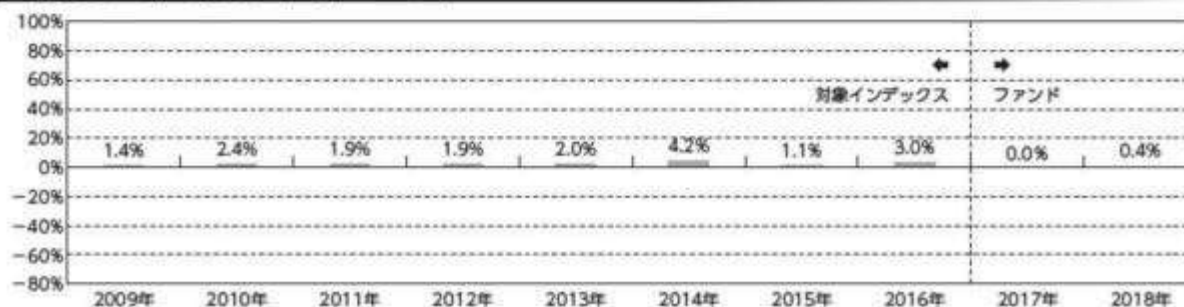
資産	組入比率
債券	98.9%
先物	0.0%
現金等	1.1%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	組入比率
1	第135回利付国債(5年)	0.10%	2023/3/20	1.1%
2	第134回利付国債(5年)	0.10%	2022/12/20	1.1%
3	第338回利付国債(10年)	0.40%	2025/3/20	1.1%
4	第133回利付国債(5年)	0.10%	2022/9/20	1.1%
5	第132回利付国債(5年)	0.10%	2022/6/20	1.1%
6	第334回利付国債(10年)	0.60%	2024/6/20	1.0%
7	第312回利付国債(10年)	1.20%	2020/12/20	1.0%
8	第315回利付国債(10年)	1.20%	2021/6/20	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	0.10%	2027/3/20	1.0%
10	第329回利付国債(10年)	0.80%	2023/6/20	1.0%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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。2018年は6月末までの騰落率です。
 ・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな国内株式インデックスファンド

2018年6月29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
—	—
—	—
—	—
—	—
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	98.6%
先物	1.8%
現金等	-0.5%
合計	100.0%

■組入上位業種

業種	組入比率
1 電気機器	13.4%
2 輸送用機器	8.5%
3 情報・通信業	7.4%
4 化学	7.3%
5 銀行業	6.6%

■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	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.7%
3	ソニー	電気機器	1.5%
4	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.3%
7	キーエンス	電気機器	1.2%
8	本田技研工業	輸送用機器	1.2%
9	KDDI	情報・通信業	1.0%
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.0%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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。2018年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)

2018年6月29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
-	-
-	-
-	-
-	-
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	99.1%
先物	0.0%
現金等	0.9%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	44.3%
ユーロ	40.2%
英ポンド	7.0%
豪ドル	2.1%
カナダドル	2.1%
その他	4.3%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	米国	2.750%	2028/2/15	0.5%
2	US TREASURY N/B	米国	2.375%	2027/5/15	0.4%
3	GOV OF FRANCE	フランス	4.250%	2023/10/25	0.4%
4	GOV OF FRANCE	フランス	4.500%	2041/4/25	0.4%
5	US TREASURY N/B	米国	1.125%	2021/8/31	0.4%
6	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2025/11/15	0.4%
7	US TREASURY N/B	米国	1.375%	2020/9/30	0.4%
8	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2027/2/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2025/8/15	0.4%
10	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2022/11/30	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・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009年から2016年までは、対象インデックス(FI世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の年間騰落率です。

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

・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2018年は6月末までの騰落率です。

・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)

2018年6月29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
—	—
—	—
—	—
—	—
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	99.4%
先物	0.0%
現金等	0.6%
合計	100.0%

■通貨別資産配分

通貨	組入比率
米ドル	44.4%
ユーロ	40.4%
英ポンド	7.0%
豪ドル	2.1%
カナダドル	2.1%
その他	4.0%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	クーポン	償還日	組入比率
1	US TREASURY N/B	米国	1.625%	2026/2/15	0.4%
2	US TREASURY N/B	米国	2.750%	2028/2/15	0.4%
3	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2027/2/15	0.4%
4	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2027/11/15	0.4%
5	US TREASURY N/B	米国	2.250%	2025/11/15	0.4%
6	US TREASURY N/B	米国	1.250%	2021/10/31	0.4%
7	GOV OF FRANCE	フランス	5.750%	2032/10/25	0.4%
8	US TREASURY N/B	米国	2.000%	2025/8/15	0.4%
9	US TREASURY N/B	米国	1.500%	2019/10/31	0.4%
10	US TREASURY N/B	米国	2.125%	2025/5/15	0.4%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009年から2016年までは、対象インデックス(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は1月5日から12月末までの騰落率です。2018年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな新興国債券インデックスファンド

2018年6月29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
—	—
—	—
—	—
—	—
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	99.9%
先物	0.0%
現金等	0.1%
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	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	米国	—	—	99.9%
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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。2018年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国株式インデックスファンド

2018年6月29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
--	--
--	--
--	--
--	--
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	91.9%
先物	8.4%
現金等	-0.2%
合計	100.0%

■国・地域別配分

国・地域	組入比率
米国	61.3%
英国	6.4%
フランス	3.9%
カナダ	3.5%
ドイツ	3.4%
その他	21.5%
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	米国	情報技術	2.4%
2	MICROSOFT CORP	米国	情報技術	1.8%
3	AMAZON.COM INC	米国	一般消費財・サービス	1.8%
4	FACEBOOK INC-A	米国	情報技術	1.2%
5	JPMORGAN CHASE & CO	米国	金融	0.9%
6	ALPHABET INC-CL C	米国	情報技術	0.9%
7	EXXON MOBIL CORP	米国	エネルギー	0.9%
8	ALPHABET INC-CL A	米国	情報技術	0.9%
9	JOHNSON & JOHNSON	米国	ヘルスクア	0.8%
10	BANK OF AMERICA CORP	米国	金融	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・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009年から2016年までは、対象インデックス(MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース))の年間騰落率です。

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

・2017年は1月5日から12月までの騰落率です。2018年は6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りそな新興国株式インデックスファンド

2018年6月29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
-	-
-	-
-	-
-	-
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	94.8%
先物	5.7%
現金等	-0.5%
合計	100.0%

■国・地域別配分

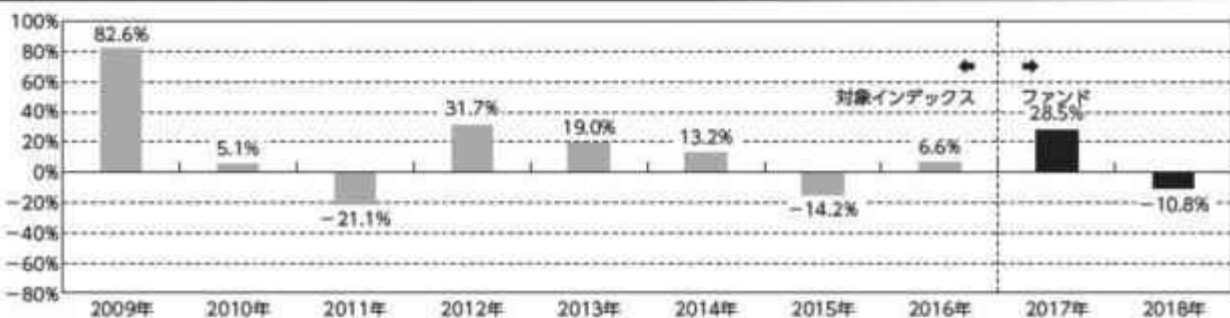
国・地域	組入比率
中国	31.1%
韓国	14.1%
台湾	11.1%
インド	8.4%
南アフリカ	6.1%
その他	29.1%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	業種	組入比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	情報技術	5.1%
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	情報技術	4.0%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	情報技術	3.8%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾	情報技術	3.2%
5	NASPER LTD-N SHS	南アフリカ	一般消費サービス	2.0%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	金融	1.6%
7	BAIDU INC - SPON ADR	中国	情報技術	1.3%
8	CHINA MOBILE LTD	中国	電気通信サービス	1.0%
9	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	金融	1.0%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	金融	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。
※国・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。
※業種は世界産業分類基準(GICS)の分類を基準としています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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))の年間収益率です。
・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月末までの期間です。2018年は6月末までの期間です。
・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

2018年6月29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
—	—
—	—
—	—
—	—
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	92.8%
先物	7.2%
現金等	-0.0%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.9%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.5%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.2%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.3%
5	日本リテールファンド投資法人	4.2%
6	オリックス不動産投資法人	3.9%
7	日本プロロジスリート投資法人	3.4%
8	大和ハウスリート投資法人	3.4%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	2.9%
10	日本プライムリアルティ投資法人	2.9%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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。2018年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

FWりそな先進国リートインデックスファンド

2018年6月29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
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ポートフォリオの状況

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

■国・地域別配分

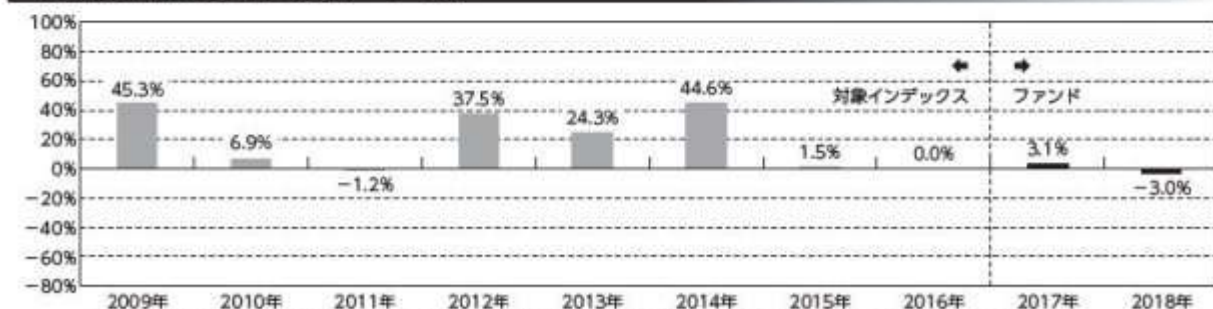
国・地域	組入比率
米国	71.6%
オーストラリア	6.7%
英国	5.7%
フランス	4.9%
シンガポール	3.3%
その他	7.9%
合計	100.0%

■組入上位銘柄

	銘柄名	国・地域	組入比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	4.6%
2	PROLOGIS INC	米国	3.0%
3	PUBLIC STORAGE	米国	3.0%
4	UNIBAIL RODAMCO WESTFIELD	フランス	2.5%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米国	2.1%
6	EQUITY RESIDENTIAL	米国	2.0%
7	WELLTOWER INC	米国	2.0%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	米国	2.0%
9	VENTAS INC	米国	1.8%
10	LINK REIT	香港	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・地域はインデックスの国・地域分類を基準に表示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



・2009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。2018年は6月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)＞と＜分配金受取

りコース(一般コース) > の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

< 分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース) >

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

< 分配金受取りコース(一般コース) >

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

< F W I 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 I 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 I りそな新興国債券インデックスファンド >

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

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

(7) 申込単位

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

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし) >

< F Wりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり) >

< F Wりそな新興国債券インデックスファンド >

< F Wりそな先進国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

< F Wりそな新興国株式インデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・香港の銀行の休業日

・香港証券取引所の休業日

< F Wりそな先進国リートインデックスファンド >

・ニューヨークの銀行の休業日

・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日

・シドニーの銀行の休業日

・オーストラリア証券取引所の休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、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、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（7）解約単位

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

（8）解約代金の支払い

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

基準額の計算日（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。

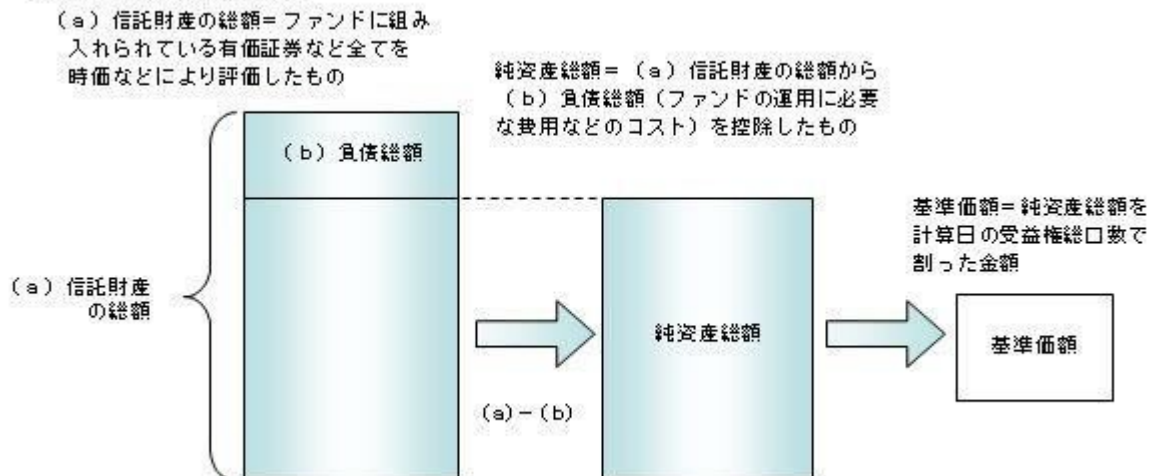
3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準額の算出

- ・基準額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準額とは、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

基準額計算日の基準額で評価します。

国内上場株式

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

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

^{*} 外国公社債については、基準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、基準額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更など

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

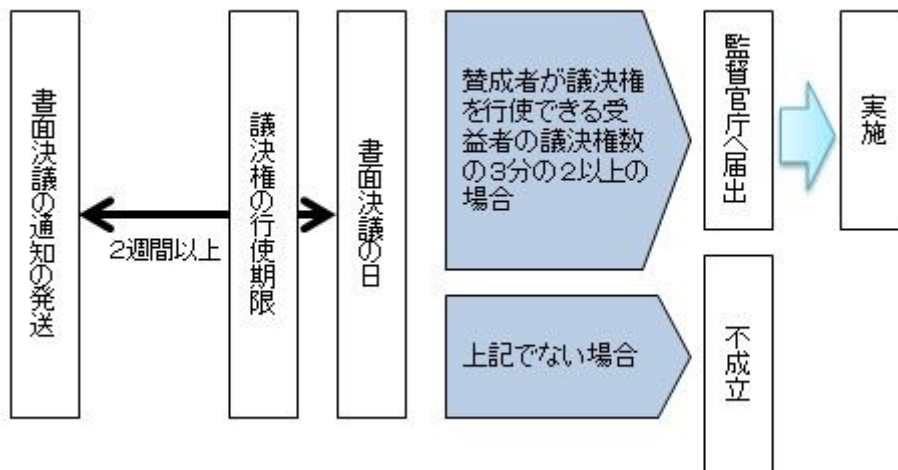
2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

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

書面決議

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

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

- ・委託会社は、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、原則として知っ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1期計算期間(平成29年1月5日から平成29年12月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	113,358,019
親投資信託受益証券	28,941,038,662
流動資産合計	29,054,396,681
資産合計	29,054,396,681
負債の部	
流動負債	
未払解約金	68,271,601
未払受託者報酬	3,163,314
未払委託者報酬	23,197,585
未払利息	307
その他未払費用	1,054,358
流動負債合計	95,687,165
負債合計	95,687,165
純資産の部	
元本等	
元本	28,966,582,797
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,873,281
（分配準備積立金）	80,681,100
元本等合計	28,958,709,516
純資産合計	28,958,709,516
負債純資産合計	29,054,396,681

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	98,939,162
営業収益合計	98,939,162
営業費用	
支払利息	47,284
受託者報酬	4,334,667
委託者報酬	31,787,484
その他費用	1,444,777
営業費用合計	37,614,212
営業利益又は営業損失（ ）	61,324,950
経常利益又は経常損失（ ）	61,324,950
当期純利益又は当期純損失（ ）	61,324,950
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,917,481
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,418,862
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,418,862
剰余金減少額又は欠損金増加額	71,699,612
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	71,699,612
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,873,281

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	30,909,545,686円
期中一部解約元本額	1,943,062,889円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	28,966,582,797口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	7,873,281円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9997円
(10,000口当たり純資産額)	(9,997円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	80,681,100円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	20,520,336円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	101,201,436円
F 当ファンドの期末残存口数	28,966,582,797口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	34円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成29年12月11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>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	98,822,073
合計	98,822,073

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	27,975,871,109	28,941,038,662	
合計		27,975,871,109	28,941,038,662	

(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1期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		33,241,320
親投資信託受益証券		8,181,157,860
流動資産合計		8,214,399,180
資産合計		8,214,399,180
負債の部		
流動負債		
未払解約金		19,314,568
未払受託者報酬		861,317
未払委託者報酬		7,751,781
未払利息		90
その他未払費用		287,033
流動負債合計		28,214,789
負債合計		28,214,789
純資産の部		
元本等		
元本		6,908,921,204
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,277,263,187
（分配準備積立金）		968,388,243
元本等合計		8,186,184,391
純資産合計		8,186,184,391
負債純資産合計		8,214,399,180

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,068,058,160
営業収益合計	1,068,058,160
営業費用	
支払利息	16,797
受託者報酬	1,257,972
委託者報酬	11,321,591
その他費用	419,220
営業費用合計	13,015,580
営業利益又は営業損失（ ）	1,055,042,580
経常利益又は経常損失（ ）	1,055,042,580
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,055,042,580
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	86,654,337
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	319,657,816
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	319,657,816
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,782,872
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,782,872
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,277,263,187

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	8,464,338,150円
期中一部解約元本額	1,555,516,946円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	6,908,921,204口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1849円
(10,000口当たり純資産額)	(11,849円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	80,856,744円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	887,531,499円
C 収益調整金額	308,874,944円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	1,277,263,187円
F 当ファンドの期末残存口数	6,908,921,204口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,848円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11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>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成29年12月11日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,019,035,541
合計	1,019,035,541

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	6,757,936,445	8,181,157,860	
合計		6,757,936,445	8,181,157,860	

(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

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1期 平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	33,056,561
親投資信託受益証券	8,782,505,894
流動資産合計	8,815,562,455
資産合計	8,815,562,455
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15,609,154
未払受託者報酬	956,092
未払委託者報酬	10,198,297
未払利息	89
その他未払費用	318,615
流動負債合計	27,082,247
負債合計	27,082,247
純資産の部	
元本等	
元本	8,363,296,428
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	425,183,780
（分配準備積立金）	406,052,664
元本等合計	8,788,480,208
純資産合計	8,788,480,208
負債純資産合計	8,815,562,455

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	475,906,394
営業収益合計	475,906,394
営業費用	
支払利息	17,431
受託者報酬	1,388,579
委託者報酬	14,811,531
その他費用	462,758
営業費用合計	16,680,299
営業利益又は営業損失（ ）	459,226,095
経常利益又は経常損失（ ）	459,226,095
当期純利益又は当期純損失（ ）	459,226,095
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	53,173,431
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,691,944
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,691,944
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,560,828
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,560,828
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	425,183,780

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	9,815,951,299円
期中一部解約元本額	1,452,754,871円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	8,363,296,428口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0508円
(10,000口当たり純資産額)	(10,508円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	92,385,191円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	313,667,473円
C 収益調整金額	19,131,116円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	425,183,780円
F 当ファンドの期末残存口数	8,363,296,428口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	508円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11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、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>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期</p> <p>平成29年12月11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</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお</p> <p>ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額</p> <p>が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11日</p>
<p>該当事項はありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	445,836,900
合計	445,836,900

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	8,755,364,265	8,782,505,894	
合計		8,755,364,265	8,782,505,894	

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

【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		109,473,132
親投資信託受益証券		28,968,298,282
流動資産合計		29,077,771,414
資産合計		29,077,771,414
負債の部		
流動負債		
未払解約金		53,397,603
未払受託者報酬		3,145,353
未払委託者報酬		33,550,403
未払利息		296
その他未払費用		1,048,368
流動負債合計		91,142,023
負債合計		91,142,023
純資産の部		
元本等		
元本		28,727,931,088
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		258,698,303
（分配準備積立金）		242,919,590
元本等合計		28,986,629,391
純資産合計		28,986,629,391
負債純資産合計		29,077,771,414

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	286,198,782
営業収益合計	286,198,782
営業費用	
支払利息	45,607
受託者報酬	4,299,516
委託者報酬	45,861,459
その他費用	1,433,059
営業費用合計	51,639,641
営業利益又は営業損失（ ）	234,559,141
経常利益又は経常損失（ ）	234,559,141
当期純利益又は当期純損失（ ）	234,559,141
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	11,461,263
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,600,425
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,337,220
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	34,263,205
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	258,698,303

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	30,662,348,431円
期中一部解約元本額	1,934,517,343円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	28,727,931,088口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0090円
(10,000口当たり純資産額)	(10,090円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	242,919,590円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	43,842,173円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	286,761,763円
F 当ファンドの期末残存口数	28,727,931,088口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	99円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期

自 平成29年 1月 5日

至 平成29年12月11日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第1期

平成29年12月11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

親投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

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）

第1期

自 平成29年 1月 5日

至 平成29年12月11日

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券		286,198,782
合計		286,198,782

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先進国債マザーファンド（為替ヘッジあり）	29,607,827,353	28,968,298,282	
合計		29,607,827,353	28,968,298,282	

（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「FWりそな先進国リートインデックスファンド」の参考に記載しております。

【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,784,089
親投資信託受益証券	741,996,402
流動資産合計	744,780,491
資産合計	744,780,491
負債の部	
流動負債	
未払解約金	646,497
未払受託者報酬	78,607
未払委託者報酬	1,362,456
未払利息	7
その他未払費用	26,122
流動負債合計	2,113,689
負債合計	2,113,689
純資産の部	
元本等	
元本	688,292,151
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,374,651
（分配準備積立金）	22,828,921
元本等合計	742,666,802
純資産合計	742,666,802
負債純資産合計	744,780,491

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	26,396,902
営業収益合計	26,396,902
営業費用	
支払利息	1,648
受託者報酬	107,765
委託者報酬	1,867,785
その他費用	35,806
営業費用合計	2,013,004
営業利益又は営業損失（ ）	24,383,898
経常利益又は経常損失（ ）	24,383,898
当期純利益又は当期純損失（ ）	24,383,898
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,554,977
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,967,252
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	32,967,252
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,421,522
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,421,522
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,374,651

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	735,195,511円
期中一部解約元本額	47,003,360円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	688,292,151口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0790円
(10,000口当たり純資産額)	(10,790円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	17,646,634円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	5,182,287円
C 収益調整金額	31,545,730円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	54,374,651円
F 当ファンドの期末残存口数	688,292,151口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	789円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11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、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期</p> <p>平成29年12月11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</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお</p> <p>ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額</p> <p>が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11日</p>
<p>該当事項はありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	26,333,014
合計	26,333,014

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	641,920,930	741,996,402	
合計		641,920,930	741,996,402	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	24,871,972
親投資信託受益証券	5,908,106,045
流動資産合計	5,932,978,017
資産合計	5,932,978,017
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,545,338
未払受託者報酬	624,640
未払委託者報酬	7,703,853
未払利息	67
その他未払費用	208,135
流動負債合計	20,082,033
負債合計	20,082,033
純資産の部	
元本等	
元本	5,138,361,469
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	774,534,515
(分配準備積立金)	519,346,148
元本等合計	5,912,895,984
純資産合計	5,912,895,984
負債純資産合計	5,932,978,017

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	594,506,345
営業収益合計	594,506,345
営業費用	
支払利息	11,896
受託者報酬	919,364
委託者報酬	11,338,794
その他費用	306,355
営業費用合計	12,576,409
営業利益又は営業損失（ ）	581,929,936
経常利益又は経常損失（ ）	581,929,936
当期純利益又は当期純損失（ ）	581,929,936
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	62,583,788
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	277,880,885
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	277,880,885
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,692,518
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,692,518
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	774,534,515

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	6,405,595,993円
期中一部解約元本額	1,267,334,524円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,138,361,469口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1507円
(10,000口当たり純資産額)	(11,507円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	59,643,645円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	459,702,503円
C 収益調整金額	255,188,367円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	774,534,515円
F 当ファンドの期末残存口数	5,138,361,469口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,507円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11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>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成29年12月11日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	555,710,165
合計	555,710,165

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	4,879,506,149	5,908,106,045	
合計		4,879,506,149	5,908,106,045	

(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1期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,750,950
親投資信託受益証券		872,794,346
流動資産合計		876,545,296
資産合計		876,545,296
負債の部		
流動負債		
未払解約金		910,879
未払受託者報酬		92,539
未払委託者報酬		1,758,146
未払利息		10
その他未払費用		30,773
流動負債合計		2,792,347
負債合計		2,792,347
純資産の部		
元本等		
元本		701,866,069
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()		171,886,880
(分配準備積立金)		79,216,581
元本等合計		873,752,949
純資産合計		873,752,949
負債純資産合計		876,545,296

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	90,994,646
営業収益合計	90,994,646
営業費用	
支払利息	2,204
受託者報酬	129,170
委託者報酬	2,454,133
その他費用	42,958
営業費用合計	2,628,465
営業利益又は営業損失（ ）	88,366,181
経常利益又は経常損失（ ）	88,366,181
当期純利益又は当期純損失（ ）	88,366,181
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	9,149,600
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,983,514
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	100,983,514
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,313,215
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,313,215
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	171,886,880

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	814,558,599円
期中一部解約元本額	112,792,530円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	701,866,069口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2449円
(10,000口当たり純資産額)	(12,449円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	5,047,583円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	74,168,998円
C 収益調整金額	92,670,299円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	171,886,880円
F 当ファンドの期末残存口数	701,866,069口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	2,448円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11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、投資信託受益証券の価格変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期</p> <p>平成29年12月11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</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第1期</p> <p>自 平成29年 1月 5日</p> <p>至 平成29年12月11日</p>
<p>該当事項はありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券		86,767,278
合計		86,767,278

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	631,315,983	872,794,346	
合計		631,315,983	872,794,346	

(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。

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,797,430
親投資信託受益証券		1,167,364,918
流動資産合計		1,172,162,348
資産合計		1,172,162,348
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,402,648
未払受託者報酬		134,123
未払委託者報酬		1,207,082
未払利息		13
その他未払費用		44,623
流動負債合計		3,788,489
負債合計		3,788,489
純資産の部		
元本等		
元本		1,259,761,806
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		91,387,947
（分配準備積立金）		20,117,809
元本等合計		1,168,373,859
純資産合計		1,168,373,859
負債純資産合計		1,172,162,348

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	22,434,782
営業収益合計	22,434,782
営業費用	
支払利息	2,512
受託者報酬	192,860
委託者報酬	1,735,693
その他費用	64,175
営業費用合計	1,995,240
営業利益又は営業損失（ ）	24,430,022
経常利益又は経常損失（ ）	24,430,022
当期純利益又は当期純損失（ ）	24,430,022
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	6,076,630
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,231,499
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,231,499
剰余金減少額又は欠損金増加額	81,266,054
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	81,266,054
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	91,387,947

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	1,436,631,064円
期中一部解約元本額	176,969,258円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,259,761,806口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	91,387,947円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9275円
(10,000口当たり純資産額)	(9,275円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	20,117,809円
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	2,935,344円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	23,053,153円
F 当ファンドの期末残存口数	1,259,761,806口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	182円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11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、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>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 平成29年12月11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>

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日</p>
<p>該当事項はありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	18,905,446
合計	18,905,446

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	1,121,064,937	1,167,364,918	
合計		1,121,064,937	1,167,364,918	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,127,600
親投資信託受益証券	1,517,068,515
流動資産合計	1,523,196,115
資産合計	1,523,196,115
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,032,374
未払受託者報酬	164,908
未払委託者報酬	2,033,803
未払利息	16
その他未払費用	54,888
流動負債合計	4,285,989
負債合計	4,285,989
純資産の部	
元本等	
元本	1,479,548,942
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,361,184
（分配準備積立金）	71,146,872
元本等合計	1,518,910,126
純資産合計	1,518,910,126
負債純資産合計	1,523,196,115

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	78,068,815
営業収益合計	78,068,815
営業費用	
支払利息	2,923
受託者報酬	234,170
委託者報酬	2,888,125
その他費用	77,943
営業費用合計	3,203,161
営業利益又は営業損失（ ）	74,865,654
経常利益又は経常損失（ ）	74,865,654
当期純利益又は当期純損失（ ）	74,865,654
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,718,782
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,092
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,092
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,159,780
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,159,780
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,361,184

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（平成29年 1月 5日）から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000円
期中追加設定元本額	1,618,231,745円
期中一部解約元本額	138,782,803円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	1,479,548,942口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0266円
(10,000口当たり純資産額)	(10,266円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	26,454,030円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	44,692,842円
C 収益調整金額	4,406,339円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	75,553,211円
F 当ファンドの期末残存口数	1,479,548,942口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	510円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期

自 平成29年 1月 5日

至 平成29年12月11日

1.金融商品に対する取組方針

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第1期

平成29年12月11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

親投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

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）

第1期

自 平成29年 1月 5日

至 平成29年12月11日

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成29年 1月 5日 至 平成29年12月11日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	76,150,000
合計	76,150,000

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 - トマザーファンド	1,420,476,138	1,517,068,515	
合計		1,420,476,138	1,517,068,515	

(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。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	351,835
コール・ローン	382,783,678
国債証券	37,265,952,930
地方債証券	2,584,592,900
特殊債券	2,447,253,190
社債券	1,616,595,000
未収利息	105,519,436
前払費用	16,516,156
流動資産合計	44,419,565,125
資産合計	44,419,565,125
負債の部	
流動負債	
未払金	187,538,600
未払解約金	420,000
未払利息	1,038
流動負債合計	187,959,638
負債合計	187,959,638
純資産の部	
元本等	
元本	42,755,412,735
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,476,192,752
元本等合計	44,231,605,487
純資産合計	44,231,605,487

平成29年12月11日現在

負債純資産合計

44,419,565,125

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)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	15,631,690,165円
期中追加設定元本額	33,589,661,961円
期中一部解約元本額	6,465,939,391円
期末元本額	42,755,412,735円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,759,785,734円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	678,671,147円
りそなラップ型ファンド(成長型)	283,045,773円
DCりそな グローバルバランス	56,943,166円
つみたてバランスファンド	88,473円
FWりそな国内債券インデックスファンド	27,975,871,109円
Smart-i 国内債券インデックス	96,707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)	910,626円
2. 計算日における受益権の総数	42,755,412,735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	1.0345円
(10,000口当たり純資産額)	(10,345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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	48,278,530
地方債証券	5,301,600
特殊債券	4,276,140
社債券	780,000
合計	58,636,270

(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3 7 2 回利付国債(2年)	220,000,000	220,624,800	
	第3 7 3 回利付国債(2年)	260,000,000	260,795,600	
	第3 7 4 回利付国債(2年)	370,000,000	371,206,200	
	第3 7 5 回利付国債(2年)	220,000,000	220,765,600	
	第3 7 6 回利付国債(2年)	170,000,000	170,627,300	
	第3 7 7 回利付国債(2年)	150,000,000	150,588,000	
	第3 7 8 回利付国債(2年)	250,000,000	251,032,500	
	第3 7 9 回利付国債(2年)	170,000,000	170,739,500	
	第3 8 0 回利付国債(2年)	250,000,000	251,142,500	
	第3 8 1 回利付国債(2年)	170,000,000	170,814,300	
	第3 8 2 回利付国債(2年)	80,000,000	80,400,800	
	第1 1 7 回利付国債(5年)	127,000,000	127,554,990	
	第1 1 8 回利付国債(5年)	206,000,000	207,079,440	
	第1 1 9 回利付国債(5年)	100,000,000	100,372,000	

第120回利付国債（5年）	179,000,000	180,095,480
第121回利付国債（5年）	190,000,000	190,824,600
第122回利付国債（5年）	410,000,000	411,988,500
第123回利付国債（5年）	395,000,000	397,152,750
第124回利付国債（5年）	285,000,000	286,690,050
第125回利付国債（5年）	371,000,000	373,474,570
第126回利付国債（5年）	380,000,000	382,648,600
第127回利付国債（5年）	350,000,000	352,579,500
第128回利付国債（5年）	320,000,000	322,544,000
第129回利付国債（5年）	310,000,000	312,582,300
第130回利付国債（5年）	350,000,000	353,038,000
第131回利付国債（5年）	540,000,000	544,973,400
第132回利付国債（5年）	580,000,000	585,660,800
第133回利付国債（5年）	480,000,000	485,064,000
第1回利付国債（40年）	40,000,000	56,840,400
第2回利付国債（40年）	50,000,000	68,622,500
第3回利付国債（40年）	60,000,000	82,708,800
第4回利付国債（40年）	90,000,000	124,577,100
第5回利付国債（40年）	70,000,000	93,090,900
第6回利付国債（40年）	120,000,000	156,307,200
第7回利付国債（40年）	90,000,000	111,825,900
第8回利付国債（40年）	100,000,000	114,753,000
第9回利付国債（40年）	150,000,000	123,721,500
第10回利付国債（40年）	100,000,000	97,870,000
第299回利付国債（10年）	100,000,000	101,832,000
第300回利付国債（10年）	50,000,000	51,042,500
第301回利付国債（10年）	70,000,000	71,751,400
第302回利付国債（10年）	20,000,000	20,470,000
第303回利付国債（10年）	80,000,000	82,192,800
第304回利付国債（10年）	40,000,000	41,025,600
第305回利付国債（10年）	370,000,000	380,785,500
第306回利付国債（10年）	280,000,000	289,766,400
第307回利付国債（10年）	250,000,000	258,152,500
第308回利付国債（10年）	310,000,000	321,197,200
第309回利付国債（10年）	120,000,000	123,728,400
第310回利付国債（10年）	230,000,000	237,189,800
第311回利付国債（10年）	40,000,000	41,028,400
第312回利付国債（10年）	440,000,000	457,595,600
第313回利付国債（10年）	330,000,000	345,361,500
第314回利付国債（10年）	60,000,000	62,409,600
第315回利付国債（10年）	355,000,000	371,553,650
第316回利付国債（10年）	100,000,000	104,309,000

第317回利付国債(10年)	100,000,000	104,620,000
第318回利付国債(10年)	236,000,000	246,008,760
第319回利付国債(10年)	200,000,000	209,810,000
第320回利付国債(10年)	242,000,000	252,894,840
第321回利付国債(10年)	141,000,000	147,738,390
第322回利付国債(10年)	120,000,000	125,221,200
第323回利付国債(10年)	90,000,000	94,126,500
第324回利付国債(10年)	133,000,000	138,494,230
第325回利付国債(10年)	370,000,000	386,050,600
第326回利付国債(10年)	280,000,000	291,225,200
第327回利付国債(10年)	207,000,000	216,341,910
第328回利付国債(10年)	461,000,000	477,955,580
第329回利付国債(10年)	477,000,000	500,401,620
第330回利付国債(10年)	247,000,000	259,673,570
第331回利付国債(10年)	90,000,000	93,573,900
第332回利付国債(10年)	402,000,000	418,530,240
第333回利付国債(10年)	325,000,000	338,809,250
第334回利付国債(10年)	431,000,000	449,903,660
第335回利付国債(10年)	85,000,000	88,264,850
第336回利付国債(10年)	140,000,000	145,628,000
第337回利付国債(10年)	50,000,000	51,286,500
第338回利付国債(10年)	561,000,000	579,827,160
第339回利付国債(10年)	325,000,000	335,907,000
第340回利付国債(10年)	444,000,000	459,224,760
第341回利付国債(10年)	210,000,000	215,655,300
第342回利付国債(10年)	210,000,000	212,173,500
第343回利付国債(10年)	410,000,000	414,018,000
第344回利付国債(10年)	460,000,000	464,236,600
第345回利付国債(10年)	260,000,000	262,225,600
第346回利付国債(10年)	410,000,000	413,222,600
第347回利付国債(10年)	340,000,000	342,580,600
第348回利付国債(10年)	350,000,000	352,383,500
第1回利付国債(30年)	10,000,000	13,110,300
第11回利付国債(30年)	10,000,000	12,075,800
第12回利付国債(30年)	10,000,000	12,691,200
第13回利付国債(30年)	20,000,000	25,100,800
第14回利付国債(30年)	20,000,000	26,390,800
第15回利付国債(30年)	20,000,000	26,756,200
第16回利付国債(30年)	20,000,000	26,790,000
第17回利付国債(30年)	20,000,000	26,521,600
第18回利付国債(30年)	60,000,000	78,601,800
第19回利付国債(30年)	50,000,000	65,605,500
第20回利付国債(30年)	20,000,000	26,968,000

第2 1 回利付国債(30年)	50,000,000	65,746,000	
第2 2 回利付国債(30年)	50,000,000	67,585,500	
第2 3 回利付国債(30年)	60,000,000	81,163,200	
第2 4 回利付国債(30年)	20,000,000	27,096,200	
第2 5 回利付国債(30年)	20,000,000	26,389,800	
第2 6 回利付国債(30年)	25,000,000	33,464,750	
第2 7 回利付国債(30年)	105,000,000	142,781,100	
第2 8 回利付国債(30年)	100,000,000	136,425,000	
第2 9 回利付国債(30年)	110,000,000	148,486,800	
第3 0 回利付国債(30年)	110,000,000	146,789,500	
第3 1 回利付国債(30年)	120,000,000	158,186,400	
第3 2 回利付国債(30年)	135,000,000	181,144,350	
第3 3 回利付国債(30年)	150,000,000	192,261,000	
第3 4 回利付国債(30年)	145,000,000	192,364,250	
第3 5 回利付国債(30年)	186,000,000	239,175,540	
第3 6 回利付国債(30年)	155,000,000	199,694,250	
第3 7 回利付国債(30年)	160,000,000	202,884,800	
第3 8 回利付国債(30年)	100,000,000	124,686,000	
第3 9 回利付国債(30年)	110,000,000	139,789,100	
第4 0 回利付国債(30年)	85,000,000	106,107,200	
第4 1 回利付国債(30年)	85,000,000	104,166,650	
第4 2 回利付国債(30年)	110,000,000	134,853,400	
第4 3 回利付国債(30年)	100,000,000	122,640,000	
第4 4 回利付国債(30年)	100,000,000	122,683,000	
第4 5 回利付国債(30年)	120,000,000	141,490,800	
第4 6 回利付国債(30年)	130,000,000	153,284,300	
第4 7 回利付国債(30年)	130,000,000	156,633,100	
第4 8 回利付国債(30年)	143,000,000	165,312,290	
第4 9 回利付国債(30年)	120,000,000	138,702,000	
第5 0 回利付国債(30年)	140,000,000	140,484,400	
第5 1 回利付国債(30年)	120,000,000	104,970,000	
第5 2 回利付国債(30年)	140,000,000	129,420,200	
第5 3 回利付国債(30年)	90,000,000	85,357,800	
第5 4 回利付国債(30年)	100,000,000	99,881,000	
第5 5 回利付国債(30年)	20,000,000	19,952,200	
第5 6 回利付国債(30年)	130,000,000	129,532,000	
第4 6 回利付国債(20年)	10,000,000	10,589,800	
第4 7 回利付国債(20年)	10,000,000	10,646,800	
第4 8 回利付国債(20年)	20,000,000	21,592,400	
第4 9 回利付国債(20年)	30,000,000	32,192,400	
第5 0 回利付国債(20年)	10,000,000	10,665,100	
第5 1 回利付国債(20年)	20,000,000	21,499,000	

第5 2 回利付国債(20年)	40,000,000	43,356,800
第5 3 回利付国債(20年)	20,000,000	21,784,200
第5 4 回利付国債(20年)	10,000,000	10,932,500
第5 6 回利付国債(20年)	10,000,000	10,955,500
第5 7 回利付国債(20年)	10,000,000	10,907,600
第5 8 回利付国債(20年)	50,000,000	54,792,500
第5 9 回利付国債(20年)	40,000,000	43,632,000
第6 0 回利付国債(20年)	30,000,000	32,269,800
第6 1 回利付国債(20年)	50,000,000	52,897,000
第6 2 回利付国債(20年)	20,000,000	20,987,000
第6 3 回利付国債(20年)	10,000,000	11,048,000
第6 4 回利付国債(20年)	20,000,000	22,301,800
第6 5 回利付国債(20年)	20,000,000	22,388,200
第6 7 回利付国債(20年)	20,000,000	22,486,600
第6 9 回利付国債(20年)	20,000,000	22,738,400
第7 0 回利付国債(20年)	40,000,000	46,453,600
第7 1 回利付国債(20年)	20,000,000	22,965,000
第7 2 回利付国債(20年)	10,000,000	11,468,200
第7 3 回利付国債(20年)	30,000,000	34,356,000
第7 5 回利付国債(20年)	20,000,000	23,135,600
第7 6 回利付国債(20年)	20,000,000	22,843,800
第7 7 回利付国債(20年)	20,000,000	22,989,800
第7 8 回利付国債(20年)	20,000,000	22,934,200
第7 9 回利付国債(20年)	20,000,000	23,085,200
第8 0 回利付国債(20年)	130,000,000	151,034,000
第8 1 回利付国債(20年)	30,000,000	34,756,200
第8 2 回利付国債(20年)	40,000,000	46,653,200
第8 3 回利付国債(20年)	10,000,000	11,707,400
第8 4 回利付国債(20年)	20,000,000	23,254,200
第8 5 回利付国債(20年)	50,000,000	58,776,000
第8 6 回利付国債(20年)	20,000,000	23,841,600
第8 7 回利付国債(20年)	10,000,000	11,838,000
第8 8 回利付国債(20年)	45,000,000	53,861,400
第8 9 回利付国債(20年)	20,000,000	23,768,000
第9 0 回利付国債(20年)	50,000,000	59,646,500
第9 1 回利付国債(20年)	10,000,000	12,017,000
第9 2 回利付国債(20年)	105,000,000	124,830,300
第9 3 回利付国債(20年)	20,000,000	23,673,200
第9 4 回利付国債(20年)	50,000,000	59,646,000
第9 5 回利付国債(20年)	35,000,000	42,580,650
第9 6 回利付国債(20年)	20,000,000	23,951,800
第9 7 回利付国債(20年)	50,000,000	60,569,000
第9 8 回利付国債(20年)	70,000,000	84,114,800

第99回利付国債(20年)	125,000,000	150,696,250	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	184,156,580	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	24,800,200	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	180,368,400	
第103回利付国債(20年)	20,000,000	24,669,400	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	12,125,800	
第105回利付国債(20年)	102,000,000	124,066,680	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	49,080,800	
第108回利付国債(20年)	190,000,000	227,646,600	
第109回利付国債(20年)	90,000,000	108,107,100	
第110回利付国債(20年)	65,000,000	79,526,200	
第111回利付国債(20年)	130,000,000	160,993,300	
第112回利付国債(20年)	55,000,000	67,486,650	
第113回利付国債(20年)	185,000,000	227,511,150	
第114回利付国債(20年)	110,000,000	135,644,300	
第115回利付国債(20年)	60,000,000	74,697,600	
第116回利付国債(20年)	120,000,000	149,808,000	
第117回利付国債(20年)	105,000,000	129,816,750	
第118回利付国債(20年)	121,000,000	148,412,550	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	72,119,400	
第120回利付国債(20年)	50,000,000	58,871,500	
第121回利付国債(20年)	185,000,000	225,000,700	
第122回利付国債(20年)	20,000,000	24,074,400	
第123回利付国債(20年)	185,000,000	230,184,400	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	61,576,000	
第125回利付国債(20年)	150,000,000	189,012,000	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	61,710,000	
第128回利付国債(20年)	205,000,000	250,702,700	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	24,195,800	
第130回利付国債(20年)	130,000,000	157,556,100	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	35,958,000	
第132回利付国債(20年)	120,000,000	143,956,800	
第133回利付国債(20年)	95,000,000	115,334,750	
第134回利付国債(20年)	75,000,000	91,200,750	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	48,055,200	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	95,007,200	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	204,532,100	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	58,714,500	
第139回利付国債(20年)	30,000,000	35,648,700	
第140回利付国債(20年)	220,000,000	264,871,200	
第141回利付国債(20年)	105,000,000	126,489,300	
第142回利付国債(20年)	50,000,000	60,997,500	

	第143回利付国債(20年)	255,000,000	303,832,500
	第145回利付国債(20年)	205,000,000	247,371,450
	第146回利付国債(20年)	220,000,000	265,775,400
	第147回利付国債(20年)	225,000,000	268,474,500
	第148回利付国債(20年)	195,000,000	229,686,600
	第149回利付国債(20年)	260,000,000	306,209,800
	第150回利付国債(20年)	220,000,000	255,578,400
	第151回利付国債(20年)	245,000,000	276,450,650
	第152回利付国債(20年)	190,000,000	214,202,200
	第153回利付国債(20年)	180,000,000	205,846,200
	第154回利付国債(20年)	218,000,000	245,507,240
	第155回利付国債(20年)	190,000,000	207,244,400
	第156回利付国債(20年)	160,000,000	157,585,600
	第157回利付国債(20年)	210,000,000	198,815,400
	第158回利付国債(20年)	200,000,000	199,314,000
	第159回利付国債(20年)	210,000,000	212,721,600
	第160回利付国債(20年)	250,000,000	257,202,500
	第161回利付国債(20年)	180,000,000	181,425,600
	第162回利付国債(20年)	150,000,000	150,933,000
	国債証券合計	34,271,000,000	37,265,952,930
地方債証券	第678回東京都公募公債	100,000,000	102,752,000
	第680回東京都公募公債	100,000,000	103,107,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	104,410,000
	第729回東京都公募公債	100,000,000	104,032,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,124,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,884,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	102,608,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	99,631,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	114,860,900
	平成27年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	100,345,000
	平成20年度第10回愛知県公募公債	100,000,000	101,883,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	103,909,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,242,000
	平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,264,000
	平成21年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,348,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,272,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	103,657,000
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,581,000
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,991,000
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,322,000
	平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	102,704,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,701,000

	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,211,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,779,000	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,975,000	
	地方債証券合計	2,510,000,000	2,584,592,900	
特殊債券	第27回道路債券	100,000,000	114,531,000	
	第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,986,000	
	第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,558,130	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	118,688,820	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	131,521,200	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,140,000	
	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	100,135,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	132,220,970	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,576,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,833,000	
	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,718,000	
	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,380,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	120,047,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,819,000	99,268,626	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,466,000	99,569,444	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,972,000	
	い第772号商工債	100,000,000	100,268,000	
	第310回信金中金債	100,000,000	100,445,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	103,077,000	
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,016,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,739,000	
	第61回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,598,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,965,000	
	特殊債券合計	2,367,285,000	2,447,253,190	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,101,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,908,000	
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,884,000	
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,090,000	
	第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,712,000	
	第151回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,256,000	
	第37回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,347,000	
	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	99,605,000	

第49回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,702,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,485,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,817,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,219,000	
第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,940,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,663,000	
第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,605,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,261,000	
社債券合計	1,600,000,000	1,616,595,000	
合計		43,914,394,020	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	329,303,397
株式	12,639,765,270
派生商品評価勘定	3,509,826
未収配当金	2,251,718
差入委託証拠金	7,114,500
流動資産合計	12,981,944,711
資産合計	12,981,944,711
負債の部	
流動負債	
前受金	2,064,750
未払金	90,431,448
未払解約金	70,000
未払利息	893
流動負債合計	92,567,091
負債合計	92,567,091
純資産の部	
元本等	
元本	10,646,785,404
剰余金	

平成29年12月11日現在

剰余金又は欠損金（ ）	2,242,592,216
元本等合計	12,889,377,620
純資産合計	12,889,377,620
負債純資産合計	12,981,944,711

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)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	3,888,683,836円
期中追加設定元本額	11,825,877,190円
期中一部解約元本額	5,067,775,622円
期末元本額	10,646,785,404円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,727,638,784円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,108,542,515円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,044,750,522円
DCりそな グローバルバランス	7,192,349円
つみたてバランスファンド	116,618円
FWりそな国内株式インデックスファンド	6,757,936,445円
Smart-i TOPIXインデックス	94,682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)	513,489円
2. 計算日における受益権の総数	10,646,785,404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	1.2106円
(10,000口当たり純資産額)	(12,106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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,482,356,050
合計		1,482,356,050

（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）

（平成29年12月11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	273,496,674	-	277,006,500	3,509,826
	合計	273,496,674	-	277,006,500	3,509,826

（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	200	3,975.00	795,000	
日本水産	6,000	599.00	3,594,000	
マルハニチロ	1,000	3,425.00	3,425,000	
カネコ種苗	100	1,768.00	176,800	
サカタのタネ	800	3,925.00	3,140,000	
ホクト	500	2,052.00	1,026,000	
ホクリヨウ	100	1,179.00	117,900	
住石ホールディングス	1,000	148.00	148,000	
日鉄鉱業	200	7,360.00	1,472,000	
三井松島産業	300	1,491.00	447,300	
国際石油開発帝石	26,500	1,296.50	34,357,250	
日本海洋掘削	200	2,202.00	440,400	
石油資源開発	900	2,701.00	2,430,900	
K&Oエナジーグループ	300	1,857.00	557,100	
ショーボンドホールディングス	500	7,820.00	3,910,000	
ミライト・ホールディングス	1,700	1,534.00	2,607,800	
タマホーム	400	725.00	290,000	
サンヨーホームズ	200	838.00	167,600	
ファーストコーポレーション	100	1,312.00	131,200	
ベステラ	100	2,120.00	212,000	
インバスターズクラウド	100	6,990.00	699,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,431.00	143,100	
安藤・間	4,200	923.00	3,876,600	
東急建設	2,100	1,149.00	2,412,900	
コムシスホールディングス	1,900	3,065.00	5,823,500	
ミサワホーム	400	1,023.00	409,200	
ビーアールホールディングス	400	435.00	174,000	
高松コンストラクショングループ	400	3,030.00	1,212,000	
東建コーポレーション	200	14,750.00	2,950,000	
ソネック	100	826.00	82,600	

ヤマウラ	200	889.00	177,800	
大成建設	5,600	6,050.00	33,880,000	
大林組	16,400	1,381.00	22,648,400	
清水建設	16,600	1,237.00	20,534,200	
飛島建設	4,600	162.00	745,200	
長谷工コーポレーション	6,300	1,773.00	11,169,900	
松井建設	600	968.00	580,800	
銭高組	100	6,330.00	633,000	
鹿島建設	24,000	1,139.00	27,336,000	
不動テトラ	3,900	190.00	741,000	
大末建設	200	1,171.00	234,200	
鉄建建設	400	3,365.00	1,346,000	
西松建設	1,300	3,220.00	4,186,000	
三井住友建設	3,800	627.00	2,382,600	
大豊建設	2,000	571.00	1,142,000	
前田建設工業	3,800	1,634.00	6,209,200	
佐田建設	100	449.00	44,900	
ナカノフドー建設	400	617.00	246,800	
奥村組	900	4,580.00	4,122,000	
東鉄工業	700	3,695.00	2,586,500	
イチケン	200	2,427.00	485,400	
浅沼組	2,000	418.00	836,000	
戸田建設	6,000	875.00	5,250,000	
熊谷組	800	3,135.00	2,508,000	
青木あすなろ建設	300	1,010.00	303,000	
北野建設	1,000	412.00	412,000	
植木組	100	2,750.00	275,000	
三井ホーム	1,000	706.00	706,000	
矢作建設工業	700	979.00	685,300	
ピーエス三菱	600	907.00	544,200	
日本ハウスホールディングス	800	647.00	517,600	
大東建託	2,000	22,785.00	45,570,000	
新日本建設	500	982.00	491,000	
N I P P O	1,000	2,642.00	2,642,000	
東亜道路工業	100	4,355.00	435,500	
前田道路	2,000	2,676.00	5,352,000	

日本道路	200	6,780.00	1,356,000	
東亜建設工業	400	3,055.00	1,222,000	
若築建設	300	1,740.00	522,000	
東洋建設	1,700	632.00	1,074,400	
五洋建設	6,300	872.00	5,493,600	
世紀東急工業	700	623.00	436,100	
福田組	200	7,030.00	1,406,000	
住友林業	3,400	1,997.00	6,789,800	
日本基礎技術	600	422.00	253,200	
日成ビルド工業	800	1,430.00	1,144,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	1,000	80.00	80,000	
巴コーポレーション	600	669.00	401,400	
大和ハウス工業	16,200	4,299.00	69,643,800	
ライト工業	1,000	1,321.00	1,321,000	
積水ハウス	17,800	2,076.50	36,961,700	
日特建設	400	740.00	296,000	
北陸電気工事	200	1,095.00	219,000	
ユアテック	1,000	965.00	965,000	
西部電気工業	100	2,930.00	293,000	
四電工	100	2,977.00	297,700	
中電工	800	3,220.00	2,576,000	
関電工	2,200	1,125.00	2,475,000	
きんでん	3,600	1,873.00	6,742,800	
東京エネシス	600	1,288.00	772,800	
トーエネック	200	3,250.00	650,000	
住友電設	400	2,402.00	960,800	
日本電設工業	900	2,394.00	2,154,600	
協和エクシオ	1,900	2,634.00	5,004,600	
新日本空調	400	1,538.00	615,200	
N D S	100	4,315.00	431,500	
九電工	1,100	5,330.00	5,863,000	
三機工業	1,200	1,377.00	1,652,400	
日揮	4,700	2,004.00	9,418,800	
中外炉工業	200	2,267.00	453,400	
ヤマト	400	860.00	344,000	
太平電業	500	2,653.00	1,326,500	

高砂熱学工業	1,500	2,052.00	3,078,000	
三晃金属工業	100	4,165.00	416,500	
朝日工業社	100	3,420.00	342,000	
明星工業	800	812.00	649,600	
大気社	700	3,695.00	2,586,500	
ダイダン	400	3,060.00	1,224,000	
日比谷総合設備	600	2,310.00	1,386,000	
東芝プラントシステム	1,200	2,138.00	2,565,600	
OSJBホールディングス	1,900	328.00	623,200	
東洋エンジニアリング	600	1,247.00	748,200	
千代田化工建設	3,400	743.00	2,526,200	
新興プランテック	900	1,185.00	1,066,500	
日本製粉	1,600	1,713.00	2,740,800	
日清製粉グループ本社	6,000	2,289.00	13,734,000	
日東富士製粉	100	4,685.00	468,500	
昭和産業	400	2,883.00	1,153,200	
鳥越製粉	400	1,044.00	417,600	
中部飼料	600	2,405.00	1,443,000	
フィード・ワン	3,000	280.00	840,000	
東洋精糖	100	1,207.00	120,700	
日本甜菜製糖	300	2,732.00	819,600	
三井製糖	400	4,585.00	1,834,000	
塩水港精糖	600	267.00	160,200	
日新製糖	200	2,188.00	437,600	
森永製菓	1,200	5,730.00	6,876,000	
中村屋	100	5,060.00	506,000	
江崎グリコ	1,400	5,760.00	8,064,000	
名糖産業	200	1,565.00	313,000	
不二家	300	2,831.00	849,300	
山崎製パン	4,000	2,234.00	8,936,000	
第一屋製パン	100	1,262.00	126,200	
モロゾフ	100	7,770.00	777,000	
亀田製菓	300	5,480.00	1,644,000	
寿スピリッツ	500	5,770.00	2,885,000	
カルビー	2,200	3,905.00	8,591,000	
森永乳業	1,000	4,875.00	4,875,000	

六甲バター	200	2,876.00	575,200
ヤクルト本社	2,900	8,660.00	25,114,000
明治ホールディングス	3,200	10,150.00	32,480,000
雪印メグミルク	1,200	3,245.00	3,894,000
プリマハム	4,000	854.00	3,416,000
日本ハム	4,000	2,753.00	11,012,000
林兼産業	200	903.00	180,600
丸大食品	3,000	504.00	1,512,000
S Foods	300	5,070.00	1,521,000
伊藤ハム米久ホールディングス	3,000	1,018.00	3,054,000
サッポロホールディングス	1,800	3,590.00	6,462,000
アサヒグループホールディングス	10,300	5,743.00	59,152,900
キリンホールディングス	23,500	2,863.00	67,280,500
宝ホールディングス	3,900	1,293.00	5,042,700
オエノンホールディングス	1,200	380.00	456,000
養命酒製造	200	2,485.00	497,000
コカ・コーラボトラーズジャパン	3,400	4,320.00	14,688,000
サントリー食品インターナショナル	3,700	5,090.00	18,833,000
ダイトーグループホールディングス	300	5,880.00	1,764,000
伊藤園	1,600	4,445.00	7,112,000
キーコーヒー	500	2,147.00	1,073,500
ユニカフェ	100	1,319.00	131,900
ジャパンフーズ	100	1,460.00	146,000
日清オイリオグループ	600	3,490.00	2,094,000
不二製油グループ本社	1,300	3,330.00	4,329,000
かどや製油	100	6,920.00	692,000
J - オイルミルズ	300	4,005.00	1,201,500
キッコーマン	3,800	4,690.00	17,822,000
味の素	11,200	2,181.50	24,432,800
キュービー	2,700	2,998.00	8,094,600
ハウス食品グループ本社	1,900	3,845.00	7,305,500
カゴメ	2,000	4,230.00	8,460,000
焼津水産化学工業	200	1,224.00	244,800
アリアケジャパン	500	10,480.00	5,240,000
ピエトロ	100	1,704.00	170,400
エバラ食品工業	100	2,112.00	211,200

ニチレイ	2,300	3,245.00	7,463,500	
東洋水産	2,700	4,845.00	13,081,500	
イトアンド	100	4,110.00	411,000	
大冷	100	2,031.00	203,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	6,330.00	633,000	
日清食品ホールディングス	2,100	8,310.00	17,451,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,410.00	1,410,000	
一正蒲鉾	200	1,291.00	258,200	
フジッコ	500	2,565.00	1,282,500	
ロック・フィールド	500	2,018.00	1,009,000	
日本たばこ産業	30,300	3,730.00	113,019,000	
ケンコーマヨネーズ	300	3,490.00	1,047,000	
わらべや日洋ホールディングス	300	3,130.00	939,000	
なとり	200	2,060.00	412,000	
イフジ産業	100	801.00	80,100	
北の達人コーポレーション	400	1,160.00	464,000	
ユーグレナ	1,800	1,061.00	1,909,800	
ミヨシ油脂	200	1,548.00	309,600	
理研ビタミン	200	4,555.00	911,000	
片倉工業	600	1,344.00	806,400	
ゲンゼ	400	5,790.00	2,316,000	
東洋紡	1,900	2,085.00	3,961,500	
ユニチカ	1,500	847.00	1,270,500	
富士紡ホールディングス	300	3,600.00	1,080,000	
倉敷紡績	5,000	347.00	1,735,000	
シキボウ	200	1,443.00	288,600	
日本毛織	1,400	1,044.00	1,461,600	
ダイトウボウ	1,000	118.00	118,000	
トーア紡コーポレーション	200	640.00	128,000	
ダイドーリミテッド	200	443.00	88,600	
帝国繊維	500	2,214.00	1,107,000	
帝人	4,200	2,492.00	10,466,400	
東レ	37,100	1,066.50	39,567,150	
サカイオーベックス	100	2,631.00	263,100	
住江織物	100	3,060.00	306,000	
日本フェルト	300	509.00	152,700	

イチカワ	1,000	358.00	358,000	
日東製網	100	1,824.00	182,400	
アツギ	300	1,314.00	394,200	
ダイニック	200	1,144.00	228,800	
セーレン	1,200	2,068.00	2,481,600	
ソトー	100	1,143.00	114,300	
東海染工	100	1,430.00	143,000	
小松精練	700	922.00	645,400	
ワコールホールディングス	1,400	3,620.00	5,068,000	
ホギメディカル	300	8,320.00	2,496,000	
レナウン	700	186.00	130,200	
クラウディアホールディングス	100	590.00	59,000	
T S Iホールディングス	1,800	853.00	1,535,400	
三陽商会	200	2,258.00	451,600	
ナイガイ	100	558.00	55,800	
オンワードホールディングス	3,000	959.00	2,877,000	
ルック	1,000	396.00	396,000	
キムラタン	100	49.00	4,900	
ゴールドウイン	200	8,340.00	1,668,000	
デサント	1,100	1,866.00	2,052,600	
キング	200	681.00	136,200	
ヤマトインターナショナル	300	448.00	134,400	
特種東海製紙	300	4,055.00	1,216,500	
王子ホールディングス	22,000	706.00	15,532,000	
日本製紙	2,300	2,133.00	4,905,900	
三菱製紙	700	734.00	513,800	
北越紀州製紙	2,800	642.00	1,797,600	
中越パルプ工業	200	2,079.00	415,800	
巴川製紙所	1,000	294.00	294,000	
大王製紙	2,000	1,464.00	2,928,000	
阿波製紙	100	744.00	74,400	
レンゴー	4,700	748.00	3,515,600	
トモク	300	2,097.00	629,100	
ザ・バック	400	3,750.00	1,500,000	
クラレ	8,600	2,156.00	18,541,600	
旭化成	31,900	1,432.00	45,680,800	

共和レザー	300	1,010.00	303,000	
昭和電工	3,400	4,200.00	14,280,000	
住友化学	38,000	790.00	30,020,000	
住友精化	200	6,330.00	1,266,000	
日産化学工業	3,000	4,625.00	13,875,000	
ラサ工業	100	2,214.00	221,400	
クレハ	400	7,520.00	3,008,000	
多木化学	100	5,670.00	567,000	
テイカ	400	2,920.00	1,168,000	
石原産業	900	2,018.00	1,816,200	
片倉コープアグリ	200	1,450.00	290,000	
日東エフシー	300	808.00	242,400	
日本曹達	4,000	740.00	2,960,000	
東ソー	7,400	2,528.00	18,707,200	
トクヤマ	1,500	3,425.00	5,137,500	
セントラル硝子	1,100	2,403.00	2,643,300	
東亜合成	3,000	1,435.00	4,305,000	
大阪ソーダ	400	2,891.00	1,156,400	
関東電化工業	1,200	1,286.00	1,543,200	
デンカ	1,900	4,285.00	8,141,500	
信越化学工業	8,500	12,060.00	102,510,000	
日本カーバイド工業	200	2,140.00	428,000	
堺化学工業	300	2,543.00	762,900	
エア・ウォーター	4,200	2,424.00	10,180,800	
大陽日酸	3,900	1,576.00	6,146,400	
日本化学工業	200	2,482.00	496,400	
東邦アセチレン	100	1,640.00	164,000	
日本パーカライズニング	2,600	1,867.00	4,854,200	
高压ガス工業	700	935.00	654,500	
チタン工業	100	2,543.00	254,300	
四国化成工業	700	1,784.00	1,248,800	
戸田工業	100	4,290.00	429,000	
ステラ ケミファ	300	3,740.00	1,122,000	
保土谷化学工業	200	6,500.00	1,300,000	
日本触媒	800	8,010.00	6,408,000	
大日精化工業	400	5,400.00	2,160,000	

カネカ	7,000	1,003.00	7,021,000	
三菱瓦斯化学	4,400	3,160.00	13,904,000	
三井化学	4,700	3,620.00	17,014,000	
J S R	5,200	2,313.00	12,027,600	
東京応化工業	900	4,820.00	4,338,000	
大阪有機化学工業	300	1,281.00	384,300	
三菱ケミカルホールディングス	34,200	1,253.50	42,869,700	
K Hネオケム	800	2,704.00	2,163,200	
ダイセル	6,900	1,356.00	9,356,400	
住友ベークライト	4,000	960.00	3,840,000	
積水化学工業	10,600	2,276.00	24,125,600	
日本ゼオン	4,300	1,582.00	6,802,600	
アイカ工業	1,400	4,105.00	5,747,000	
宇部興産	2,600	3,270.00	8,502,000	
積水樹脂	800	2,277.00	1,821,600	
タキロンシーアイ	1,000	789.00	789,000	
旭有機材	300	1,820.00	546,000	
日立化成	2,500	2,921.00	7,302,500	
ニチバン	300	3,000.00	900,000	
リケンテクノス	1,000	631.00	631,000	
大倉工業	1,000	683.00	683,000	
積水化成品工業	600	1,420.00	852,000	
群栄化学工業	100	3,765.00	376,500	
タイガースポリマー	200	823.00	164,600	
ミライアル	100	2,000.00	200,000	
ダイキアクシス	200	1,679.00	335,800	
ダイキョーニシカワ	1,000	1,825.00	1,825,000	
竹本容器	100	2,246.00	224,600	
日本化薬	3,300	1,697.00	5,600,100	
カーリットホールディングス	400	1,143.00	457,200	
日本精化	400	1,159.00	463,600	
扶桑化学工業	400	3,230.00	1,292,000	
A D E K A	2,200	1,981.00	4,358,200	
日油	2,000	3,015.00	6,030,000	
新日本理化	600	254.00	152,400	
ハリマ化成グループ	400	896.00	358,400	

花王	12,000	7,733.00	92,796,000	
第一工業製薬	1,000	807.00	807,000	
日華化学	200	1,300.00	260,000	
ニイタカ	100	1,849.00	184,900	
三洋化成工業	300	5,900.00	1,770,000	
有機合成薬品工業	200	296.00	59,200	
大日本塗料	500	1,935.00	967,500	
日本ペイントホールディングス	4,000	3,575.00	14,300,000	
関西ペイント	5,400	2,963.00	16,000,200	
神東塗料	600	270.00	162,000	
中国塗料	1,400	976.00	1,366,400	
日本特殊塗料	300	2,144.00	643,200	
藤倉化成	600	694.00	416,400	
太陽ホールディングス	400	5,060.00	2,024,000	
D I C	2,000	4,310.00	8,620,000	
サカティンクス	1,000	1,894.00	1,894,000	
東洋インキS Cホールディングス	5,000	659.00	3,295,000	
T & K T O K A	300	1,451.00	435,300	
富士フイルムホールディングス	10,100	4,732.00	47,793,200	
資生堂	9,100	5,514.00	50,177,400	
ライオン	6,800	2,124.00	14,443,200	
高砂香料工業	300	3,540.00	1,062,000	
マンダム	1,000	3,800.00	3,800,000	
ミルボン	300	8,010.00	2,403,000	
ファンケル	1,200	3,335.00	4,002,000	
コーセー	800	17,430.00	13,944,000	
コタ	200	1,544.00	308,800	
シーズ・ホールディングス	700	4,845.00	3,391,500	
シーボン	100	3,695.00	369,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	2,100	4,165.00	8,746,500	
ノエビアホールディングス	300	8,250.00	2,475,000	
アジュバンコスメジャパン	100	1,017.00	101,700	
エステー	300	2,913.00	873,900	
アグロ カネショウ	200	1,950.00	390,000	
コニシ	800	2,070.00	1,656,000	
長谷川香料	600	2,328.00	1,396,800	

星光PMC	200	1,194.00	238,800
小林製薬	1,400	7,200.00	10,080,000
荒川化学工業	400	2,328.00	931,200
メック	400	2,476.00	990,400
日本高純度化学	100	2,647.00	264,700
タカラバイオ	1,300	1,501.00	1,951,300
JCU	300	5,580.00	1,674,000
新田ゼラチン	300	798.00	239,400
OATアグリオ	100	2,773.00	277,300
デクセリアルズ	1,300	1,423.00	1,849,900
アース製薬	400	5,800.00	2,320,000
北興化学工業	500	724.00	362,000
大成ラミック	100	3,150.00	315,000
クミアイ化学工業	2,200	847.00	1,863,400
日本農薬	1,300	684.00	889,200
アキレス	300	2,378.00	713,400
有沢製作所	800	1,247.00	997,600
日東電工	3,700	10,320.00	38,184,000
レック	300	2,865.00	859,500
きもと	600	313.00	187,800
藤森工業	400	3,770.00	1,508,000
前澤化成工業	300	1,241.00	372,300
JSP	300	3,880.00	1,164,000
エフピコ	400	6,130.00	2,452,000
天馬	400	2,103.00	841,200
信越ポリマー	1,000	1,225.00	1,225,000
東リ	1,100	423.00	465,300
ニフコ	900	7,400.00	6,660,000
日本バルカー工業	400	2,876.00	1,150,400
ユニ・チャーム	10,400	2,991.00	31,106,400
協和発酵キリン	6,100	2,129.00	12,986,900
武田薬品工業	18,000	6,180.00	111,240,000
アステラス製薬	50,200	1,436.00	72,087,200
大日本住友製薬	3,600	1,622.00	5,839,200
塩野義製薬	7,000	6,238.00	43,666,000
田辺三菱製薬	5,900	2,413.00	14,236,700

わかもと製薬	1,000	284.00	284,000	
あすか製薬	600	2,074.00	1,244,400	
日本新薬	1,300	7,930.00	10,309,000	
ビオフェルミン製薬	100	3,075.00	307,500	
中外製薬	5,100	5,930.00	30,243,000	
科研製薬	900	5,770.00	5,193,000	
エーザイ	5,800	6,673.00	38,703,400	
ロート製薬	2,700	3,055.00	8,248,500	
小野薬品工業	11,600	2,540.00	29,464,000	
久光製薬	1,400	6,480.00	9,072,000	
持田製薬	400	8,160.00	3,264,000	
参天製薬	9,200	1,895.00	17,434,000	
扶桑薬品工業	200	2,816.00	563,200	
日本ケミファ	100	4,990.00	499,000	
ツムラ	1,700	3,710.00	6,307,000	
日医工	1,200	1,696.00	2,035,200	
キッセイ薬品工業	900	3,165.00	2,848,500	
生化学工業	900	1,685.00	1,516,500	
栄研化学	400	5,300.00	2,120,000	
日水製薬	200	1,556.00	311,200	
鳥居薬品	300	3,070.00	921,000	
JCRファーマ	300	4,835.00	1,450,500	
東和薬品	200	5,980.00	1,196,000	
富士製薬工業	200	4,265.00	853,000	
沢井製薬	900	5,120.00	4,608,000	
ゼリア新薬工業	1,000	2,169.00	2,169,000	
第一三共	13,900	2,762.50	38,398,750	
キョーリン製薬ホールディングス	1,400	2,122.00	2,970,800	
大幸薬品	200	2,384.00	476,800	
ダイト	300	3,345.00	1,003,500	
大塚ホールディングス	10,100	4,946.00	49,954,600	
大正製薬ホールディングス	1,100	8,890.00	9,779,000	
ペプチドリーム	2,000	3,635.00	7,270,000	
日本コークス工業	3,500	123.00	430,500	
昭和シェル石油	4,500	1,534.00	6,903,000	
ニチレキ	600	1,453.00	871,800	

ユシロ化学工業	300	1,631.00	489,300
ビーピー・カストロール	200	2,304.00	460,800
富士石油	1,100	538.00	591,800
MORESCO	200	2,099.00	419,800
出光興産	4,100	4,075.00	16,707,500
JXTGホールディングス	77,800	676.30	52,616,140
コスモエネルギーホールディングス	1,400	3,590.00	5,026,000
横浜ゴム	2,800	2,593.00	7,260,400
東洋ゴム工業	2,900	2,309.00	6,696,100
ブリヂストン	17,300	5,127.00	88,697,100
住友ゴム工業	4,800	2,028.00	9,734,400
藤倉ゴム工業	400	952.00	380,800
オカモト	2,000	1,138.00	2,276,000
フコク	200	1,094.00	218,800
ニッタ	500	4,295.00	2,147,500
住友理工	900	1,178.00	1,060,200
三ツ星ベルト	1,000	1,467.00	1,467,000
バンドー化学	800	1,289.00	1,031,200
日東紡績	700	3,275.00	2,292,500
旭硝子	5,000	4,780.00	23,900,000
日本板硝子	2,300	1,006.00	2,313,800
石塚硝子	100	2,843.00	284,300
日本山村硝子	2,000	191.00	382,000
日本電気硝子	2,100	4,430.00	9,303,000
オハラ	200	2,958.00	591,600
住友大阪セメント	10,000	547.00	5,470,000
太平洋セメント	3,100	4,995.00	15,484,500
日本ヒューム	300	766.00	229,800
日本コンクリート工業	800	494.00	395,200
三谷セキサン	200	2,683.00	536,600
アジアパイルホールディングス	600	718.00	430,800
東海カーボン	4,400	1,208.00	5,315,200
日本カーボン	300	4,555.00	1,366,500
東洋炭素	300	3,430.00	1,029,000
ノリタケカンパニーリミテド	300	5,880.00	1,764,000
TOTO	3,800	6,300.00	23,940,000

日本碍子	5,900	2,120.00	12,508,000
日本特殊陶業	4,200	2,569.00	10,789,800
ダントーホールディングス	1,000	154.00	154,000
MARUWA	200	7,410.00	1,482,000
品川リフラクトリーズ	100	3,315.00	331,500
黒崎播磨	100	4,715.00	471,500
ヨータイ	400	612.00	244,800
イソライト工業	200	1,086.00	217,200
東京窯業	300	412.00	123,600
ニッカトー	200	906.00	181,200
フジインコーポレーテッド	400	2,479.00	991,600
エーアンドエーマテリアル	100	1,406.00	140,600
ニチアス	3,000	1,470.00	4,410,000
ニチハ	700	4,335.00	3,034,500
新日鐵住金	21,600	2,858.50	61,743,600
神戸製鋼所	7,400	1,065.00	7,881,000
中山製鋼所	600	745.00	447,000
合同製鐵	300	2,236.00	670,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	13,000	2,749.00	35,737,000
日新製鋼	1,300	1,783.00	2,317,900
東京製鐵	2,500	1,063.00	2,657,500
共英製鋼	500	2,133.00	1,066,500
大和工業	1,100	3,270.00	3,597,000
東京鐵鋼	200	1,964.00	392,800
大阪製鐵	300	2,322.00	696,600
淀川製鋼所	700	3,425.00	2,397,500
東洋鋼鈹	1,100	467.00	513,700
丸一鋼管	1,700	3,215.00	5,465,500
モリ工業	300	3,535.00	1,060,500
大同特殊鋼	900	6,860.00	6,174,000
日本高周波鋼業	200	915.00	183,000
日本冶金工業	3,400	226.00	768,400
山陽特殊製鋼	600	2,871.00	1,722,600
愛知製鋼	300	4,550.00	1,365,000
日立金属	5,200	1,492.00	7,758,400
日本金属	100	2,530.00	253,000

大平洋金属	300	2,872.00	861,600
新日本電工	2,700	449.00	1,212,300
栗本鐵工所	300	2,335.00	700,500
虹技	100	2,125.00	212,500
日本鑄鉄管	2,000	178.00	356,000
三菱製鋼	400	2,696.00	1,078,400
日亜鋼業	700	327.00	228,900
日本精線	100	5,400.00	540,000
シンニッタン	300	766.00	229,800
新家工業	100	2,187.00	218,700
大紀アルミニウム工業所	800	774.00	619,200
日本軽金属ホールディングス	13,900	305.00	4,239,500
三井金属鉱業	1,300	6,050.00	7,865,000
東邦亜鉛	300	5,600.00	1,680,000
三菱マテリアル	3,100	3,735.00	11,578,500
住友金属鉱山	6,200	4,339.00	26,901,800
DOWAホールディングス	1,200	4,250.00	5,100,000
古河機械金属	800	2,202.00	1,761,600
エス・サイエンス	1,700	97.00	164,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	500	1,923.00	961,500
東邦チタニウム	800	1,053.00	842,400
UACJ	700	2,886.00	2,020,200
古河電気工業	1,600	5,690.00	9,104,000
住友電気工業	18,000	1,858.00	33,444,000
フジクラ	5,800	1,014.00	5,881,200
昭和電線ホールディングス	600	984.00	590,400
東京特殊電線	100	2,641.00	264,100
タツタ電線	900	881.00	792,900
沖電線	100	3,640.00	364,000
カナレ電気	100	2,560.00	256,000
平河ヒューテック	200	1,358.00	271,600
リョービ	600	3,010.00	1,806,000
アーレスティ	500	912.00	456,000
アサヒホールディングス	800	1,952.00	1,561,600
稲葉製作所	300	1,426.00	427,800
宮地エンジニアリンググループ	100	2,558.00	255,800

トーカロ	300	4,675.00	1,402,500	
アルファコ	100	2,303.00	230,300	
SUMCO	4,500	2,853.00	12,838,500	
川田テクノロジーズ	100	6,210.00	621,000	
RS Technologies	100	4,590.00	459,000	
東洋製罐グループホールディングス	3,300	1,851.00	6,108,300	
ホッカンホールディングス	1,000	454.00	454,000	
コロナ	200	1,399.00	279,800	
横河ブリッジホールディングス	900	2,548.00	2,293,200	
駒井ハルテック	100	2,653.00	265,300	
高田機工	100	3,285.00	328,500	
三和ホールディングス	4,600	1,516.00	6,973,600	
文化シャッター	1,400	1,095.00	1,533,000	
三協立山	700	1,674.00	1,171,800	
アルインコ	300	1,245.00	373,500	
東洋シャッター	100	624.00	62,400	
LIXILグループ	7,100	3,020.00	21,442,000	
日本フィルコン	300	776.00	232,800	
ノーリツ	1,100	2,164.00	2,380,400	
長府製作所	500	2,655.00	1,327,500	
リンナイ	900	10,040.00	9,036,000	
ダイニチ工業	200	842.00	168,400	
日東精工	600	677.00	406,200	
三洋工業	100	2,168.00	216,800	
岡部	900	1,057.00	951,300	
ジーテクト	500	2,286.00	1,143,000	
中国工業	100	896.00	89,600	
東プレ	900	3,240.00	2,916,000	
高周波熱錬	900	1,205.00	1,084,500	
東京製綱	300	1,629.00	488,700	
サンコール	200	689.00	137,800	
モリテック スチール	200	613.00	122,600	
パイオラックス	700	3,295.00	2,306,500	
エイチワン	300	1,764.00	529,200	
日本発條	4,800	1,243.00	5,966,400	
中央発條	100	3,765.00	376,500	

アドバネクス	100	3,375.00	337,500
立川ブラインド工業	200	1,368.00	273,600
三益半導体工業	400	2,008.00	803,200
日本ドライケミカル	100	2,424.00	242,400
日本製鋼所	1,600	3,575.00	5,720,000
三浦工業	2,100	2,801.00	5,882,100
タクマ	1,600	1,629.00	2,606,400
ツガミ	1,000	1,215.00	1,215,000
オークマ	600	7,150.00	4,290,000
東芝機械	3,000	799.00	2,397,000
アマダホールディングス	7,400	1,520.00	11,248,000
アイダエンジニアリング	1,300	1,342.00	1,744,600
滝澤鉄工所	100	2,092.00	209,200
富士機械製造	1,400	2,111.00	2,955,400
牧野フライス製作所	2,000	1,105.00	2,210,000
オーエスジー	2,200	2,281.00	5,018,200
ダイジェット工業	100	1,892.00	189,200
旭ダイヤモンド工業	1,500	1,194.00	1,791,000
D M G 森精機	2,700	2,284.00	6,166,800
ソディック	1,000	1,436.00	1,436,000
ディスコ	700	25,380.00	17,766,000
日東工器	300	2,927.00	878,100
日進工具	100	2,528.00	252,800
パンチ工業	200	2,447.00	489,400
富士ダイス	200	1,104.00	220,800
豊和工業	200	1,790.00	358,000
O K K	200	1,280.00	256,000
石川製作所	100	3,315.00	331,500
東洋機械金属	300	894.00	268,200
津田駒工業	1,000	191.00	191,000
エンシュウ	1,000	153.00	153,000
島精機製作所	600	6,970.00	4,182,000
N C ホールディングス	100	825.00	82,500
フリュー	300	1,054.00	316,200
ヤマシンフィルタ	700	1,429.00	1,000,300
日阪製作所	700	1,230.00	861,000

やまびこ	1,000	1,690.00	1,690,000	
平田機工	100	12,220.00	1,222,000	
ペガサスミシン製造	400	772.00	308,800	
ナプテスコ	2,700	4,455.00	12,028,500	
三井海洋開発	600	2,657.00	1,594,200	
レオン自動機	400	1,714.00	685,600	
S M C	1,500	47,000.00	70,500,000	
新川	400	1,010.00	404,000	
ホソカワミクロン	200	7,850.00	1,570,000	
ユニオンツール	200	4,415.00	883,000	
オイレス工業	600	2,282.00	1,369,200	
日精エー・エス・ピー機械	200	6,940.00	1,388,000	
サトーホールディングス	600	3,365.00	2,019,000	
技研製作所	300	3,070.00	921,000	
日本エアージェット	100	943.00	94,300	
日精樹脂工業	400	1,678.00	671,200	
オカダアイヨン	100	2,132.00	213,200	
ワイエイシーホールディングス	200	1,084.00	216,800	
小松製作所	23,600	3,821.00	90,175,600	
住友重機械工業	2,800	4,735.00	13,258,000	
日立建機	2,300	3,915.00	9,004,500	
日工	100	2,309.00	230,900	
巴工業	200	2,108.00	421,600	
井関農機	500	2,801.00	1,400,500	
T O W A	400	2,089.00	835,600	
丸山製作所	100	2,118.00	211,800	
北川鉄工所	200	3,030.00	606,000	
ローツェ	200	2,661.00	532,200	
タカキタ	200	841.00	168,200	
クボタ	26,300	2,115.50	55,637,650	
荏原実業	100	2,001.00	200,100	
三菱化工機	200	2,313.00	462,600	
月島機械	900	1,290.00	1,161,000	
帝国電機製作所	300	1,513.00	453,900	
東京機械製作所	100	590.00	59,000	
新東工業	1,100	1,414.00	1,555,400	

澁谷工業	400	4,320.00	1,728,000	
アイチ コーポレーション	800	810.00	648,000	
小森コーポレーション	1,200	1,517.00	1,820,400	
鶴見製作所	400	2,005.00	802,000	
住友精密工業	1,000	375.00	375,000	
酒井重工業	100	4,615.00	461,500	
荏原製作所	2,000	4,290.00	8,580,000	
石井鐵工所	100	1,728.00	172,800	
西島製作所	500	1,145.00	572,500	
北越工業	500	1,305.00	652,500	
ダイキン工業	6,700	13,360.00	89,512,000	
オルガノ	200	3,080.00	616,000	
トーヨーカネツ	300	4,355.00	1,306,500	
栗田工業	2,700	3,495.00	9,436,500	
椿本チエイン	3,000	882.00	2,646,000	
大同工業	200	1,681.00	336,200	
木村化工機	400	574.00	229,600	
アネスト岩田	800	1,200.00	960,000	
ダイフク	2,400	6,010.00	14,424,000	
サムコ	100	1,258.00	125,800	
加藤製作所	300	3,110.00	933,000	
油研工業	100	2,758.00	275,800	
タダノ	2,400	1,830.00	4,392,000	
フジテック	1,500	1,644.00	2,466,000	
C K D	1,400	2,438.00	3,413,200	
キトー	500	1,698.00	849,000	
平和	1,500	1,989.00	2,983,500	
理想科学工業	500	2,111.00	1,055,500	
S A N K Y O	1,200	3,575.00	4,290,000	
日本金銭機械	400	1,143.00	457,200	
マースエンジニアリング	300	2,367.00	710,100	
福島工業	300	5,220.00	1,566,000	
オーイズミ	100	522.00	52,200	
ダイコク電機	200	1,767.00	353,400	
竹内製作所	800	2,460.00	1,968,000	
アマノ	1,500	2,936.00	4,404,000	

J U K I	700	1,918.00	1,342,600	
サンデンホールディングス	600	2,142.00	1,285,200	
蛇の目ミシン工業	400	841.00	336,400	
マックス	700	1,596.00	1,117,200	
グローリー	1,500	4,310.00	6,465,000	
新晃工業	500	2,119.00	1,059,500	
大和冷機工業	700	1,327.00	928,900	
セガサミーホールディングス	4,800	1,398.00	6,710,400	
日本ピストンリング	200	2,238.00	447,600	
リケン	200	6,370.00	1,274,000	
T P R	600	3,645.00	2,187,000	
ツバキ・ナカシマ	500	2,540.00	1,270,000	
ホシザキ	1,500	10,060.00	15,090,000	
大豊工業	400	1,707.00	682,800	
日本精工	10,000	1,668.00	16,680,000	
N T N	11,100	538.00	5,971,800	
ジェイテクト	5,200	1,909.00	9,926,800	
不二越	5,000	715.00	3,575,000	
日本トムソン	1,500	735.00	1,102,500	
T H K	3,000	4,060.00	12,180,000	
ユーシン精機	200	3,165.00	633,000	
前澤給装工業	200	1,886.00	377,200	
イーグル工業	600	1,960.00	1,176,000	
前澤工業	200	424.00	84,800	
日本ピラー工業	500	1,589.00	794,500	
キッツ	2,100	842.00	1,768,200	
マキタ	6,400	4,640.00	29,696,000	
日立造船	3,700	584.00	2,160,800	
三菱重工業	8,200	4,223.00	34,628,600	
I H I	3,800	3,620.00	13,756,000	
スター精密	800	1,857.00	1,485,600	
日清紡ホールディングス	3,000	1,543.00	4,629,000	
イビデン	2,900	1,743.00	5,054,700	
コニカミノルタ	11,400	1,110.00	12,654,000	
ブラザー工業	6,000	2,826.00	16,956,000	
ミネベアミツミ	9,000	2,350.00	21,150,000	

日立製作所	117,000	856.70	100,233,900
三菱電機	48,800	1,866.00	91,060,800
富士電機	15,000	809.00	12,135,000
東洋電機製造	200	1,852.00	370,400
安川電機	5,700	4,935.00	28,129,500
シンフォニアテクノロジー	3,000	432.00	1,296,000
明電舎	4,000	476.00	1,904,000
オリジン電気	200	1,720.00	344,000
山洋電気	200	7,970.00	1,594,000
デンヨー	500	1,951.00	975,500
東芝テック	4,000	698.00	2,792,000
芝浦メカトロニクス	1,000	443.00	443,000
マブチモーター	1,400	6,120.00	8,568,000
日本電産	5,900	15,835.00	93,426,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,709.00	541,800
東光高岳	200	1,855.00	371,000
ダブル・スコープ	700	2,240.00	1,568,000
宮越ホールディングス	100	716.00	71,600
ダイヘン	3,000	1,010.00	3,030,000
田淵電機	900	342.00	307,800
ヤーマン	600	2,134.00	1,280,400
JVCケンウッド	3,400	356.00	1,210,400
ミマキエンジニアリング	500	1,077.00	538,500
第一精工	200	3,030.00	606,000
日新電機	1,100	1,354.00	1,489,400
大崎電気工業	1,000	819.00	819,000
オムロン	5,200	6,540.00	34,008,000
日東工業	800	1,827.00	1,461,600
I D E C	600	2,589.00	1,553,400
不二電機工業	100	1,416.00	141,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,000	561.00	5,049,000
サクサホールディングス	100	2,027.00	202,700
メルコホールディングス	300	3,800.00	1,140,000
テクノメディカ	100	1,990.00	199,000
日本電気	6,300	3,040.00	19,152,000
富士通	50,000	825.00	41,250,000

沖電気工業	1,900	1,621.00	3,079,900	
岩崎通信機	200	833.00	166,600	
電気興業	300	2,922.00	876,600	
サンケン電気	3,000	668.00	2,004,000	
ナカヨ	200	1,977.00	395,400	
アイホン	200	1,950.00	390,000	
ルネサスエレクトロニクス	2,500	1,365.00	3,412,500	
セイコーエプソン	7,200	2,746.00	19,771,200	
ワコム	3,700	616.00	2,279,200	
アルバック	800	7,380.00	5,904,000	
アクセル	100	876.00	87,600	
E I Z O	500	5,150.00	2,575,000	
ジャパンディスプレイ	9,700	218.00	2,114,600	
日本信号	1,300	1,200.00	1,560,000	
京三製作所	1,000	642.00	642,000	
能美防災	600	2,027.00	1,216,200	
ホーチキ	400	2,435.00	974,000	
エレコム	400	2,561.00	1,024,400	
パナソニック	55,800	1,606.00	89,614,800	
アンリツ	3,500	1,189.00	4,161,500	
富士通ゼネラル	1,500	2,355.00	3,532,500	
日立国際電気	800	3,120.00	2,496,000	
ソニー	32,600	5,065.00	165,119,000	
T D K	2,600	9,110.00	23,686,000	
帝国通信工業	200	1,289.00	257,800	
タムラ製作所	1,800	782.00	1,407,600	
アルプス電気	4,200	3,280.00	13,776,000	
池上通信機	1,000	180.00	180,000	
パイオニア	7,900	214.00	1,690,600	
日本電波工業	400	776.00	310,400	
鈴木	200	1,133.00	226,600	
日本トリム	100	5,500.00	550,000	
ローランド ディー . ジー .	300	3,140.00	942,000	
フォスター電機	600	2,675.00	1,605,000	
クラリオン	3,000	427.00	1,281,000	
S M K	1,000	510.00	510,000	

ヨコオ	300	1,491.00	447,300	
ティアック	3,000	47.00	141,000	
ホシデン	1,200	1,722.00	2,066,400	
ヒロセ電機	800	16,250.00	13,000,000	
日本航空電子工業	1,000	1,971.00	1,971,000	
TOA	500	1,402.00	701,000	
マクセルホールディングス	1,000	2,439.00	2,439,000	
古野電気	600	805.00	483,000	
ユニデンホールディングス	1,000	301.00	301,000	
アルパイン	1,200	2,359.00	2,830,800	
スミダコーポレーション	500	1,925.00	962,500	
アイコム	300	2,744.00	823,200	
リオン	200	2,309.00	461,800	
本多通信工業	400	1,089.00	435,600	
船井電機	400	858.00	343,200	
横河電機	4,800	2,125.00	10,200,000	
新電元工業	200	8,280.00	1,656,000	
アズビル	1,500	4,915.00	7,372,500	
東亜ディーケーケー	300	979.00	293,700	
日本光電工業	2,000	2,592.00	5,184,000	
チノー	200	1,706.00	341,200	
共和電業	600	465.00	279,000	
日本電子材料	300	583.00	174,900	
堀場製作所	1,000	6,870.00	6,870,000	
アドバンテスト	2,700	2,201.00	5,942,700	
小野測器	300	734.00	220,200	
エスベック	500	2,741.00	1,370,500	
キーエンス	2,400	63,510.00	152,424,000	
日置電機	200	2,800.00	560,000	
シスメックス	3,800	8,610.00	32,718,000	
日本マイクロニクス	800	1,144.00	915,200	
メガチップス	400	3,240.00	1,296,000	
OBARA GROUP	300	7,680.00	2,304,000	
澤藤電機	100	2,374.00	237,400	
コーセル	600	1,539.00	923,400	
イリソ電子工業	400	6,910.00	2,764,000	

新日本無線	300	967.00	290,100	
オプテックスグループ	400	5,010.00	2,004,000	
千代田インテグレ	200	2,842.00	568,400	
アイ・オー・データ機器	200	1,038.00	207,600	
レーザーテック	1,100	2,806.00	3,086,600	
スタンレー電気	3,700	4,505.00	16,668,500	
岩崎電気	200	1,689.00	337,800	
ウシオ電機	3,000	1,598.00	4,794,000	
岡谷電機産業	400	515.00	206,000	
ハリオス テクノ ホールディング	400	994.00	397,600	
日本セラミック	500	3,025.00	1,512,500	
遠藤照明	200	1,260.00	252,000	
古河電池	400	1,049.00	419,600	
双信電機	200	801.00	160,200	
山一電機	400	2,086.00	834,400	
図研	300	1,952.00	585,600	
日本電子	2,000	621.00	1,242,000	
カシオ計算機	3,900	1,673.00	6,524,700	
ファナック	4,600	27,060.00	124,476,000	
日本シイエムケイ	800	1,003.00	802,400	
エンプラス	200	4,630.00	926,000	
大真空	200	1,686.00	337,200	
ローム	2,200	12,030.00	26,466,000	
浜松ホトニクス	3,600	3,820.00	13,752,000	
三井ハイテック	700	2,107.00	1,474,900	
新光電気工業	1,800	876.00	1,576,800	
京セラ	8,000	7,782.00	62,256,000	
太陽誘電	2,200	1,778.00	3,911,600	
村田製作所	5,100	15,050.00	76,755,000	
ユーシン	600	767.00	460,200	
双葉電子工業	800	2,306.00	1,844,800	
北陸電気工業	200	1,749.00	349,800	
ニチコン	1,500	1,459.00	2,188,500	
日本ケミコン	400	3,715.00	1,486,000	
K O A	700	2,210.00	1,547,000	
市光工業	700	1,000.00	700,000	

小糸製作所	2,900	7,860.00	22,794,000	
ミツバ	900	1,543.00	1,388,700	
S C R E E Nホールディングス	900	9,820.00	8,838,000	
キャノン電子	500	2,500.00	1,250,000	
キャノン	26,300	4,374.00	115,036,200	
リコー	14,600	1,031.00	15,052,600	
M U T O Hホールディングス	100	2,497.00	249,700	
東京エレクトロン	3,300	21,230.00	70,059,000	
トヨタ紡織	1,400	2,306.00	3,228,400	
芦森工業	100	2,944.00	294,400	
ユニプレス	1,000	2,993.00	2,993,000	
豊田自動織機	4,000	6,960.00	27,840,000	
モリタホールディングス	800	2,038.00	1,630,400	
三櫻工業	600	851.00	510,600	
デンソー	10,800	6,265.00	67,662,000	
東海理化電機製作所	1,300	2,287.00	2,973,100	
三井造船	1,800	1,643.00	2,957,400	
川崎重工業	3,800	3,675.00	13,965,000	
名村造船所	1,400	677.00	947,800	
サノヤスホールディングス	400	291.00	116,400	
日本車輛製造	2,000	343.00	686,000	
三菱ロジスネクスト	500	937.00	468,500	
近畿車輛	100	2,793.00	279,300	
日産自動車	57,600	1,093.50	62,985,600	
いすゞ自動車	14,100	1,779.00	25,083,900	
トヨタ自動車	59,400	7,047.00	418,591,800	
日野自動車	6,900	1,407.00	9,708,300	
三菱自動車工業	17,900	814.00	14,570,600	
エフテック	300	1,722.00	516,600	
レシップホールディングス	200	929.00	185,800	
G M B	100	2,273.00	227,300	
ファルテック	100	1,446.00	144,600	
武蔵精密工業	500	3,385.00	1,692,500	
日産車体	1,900	1,156.00	2,196,400	
新明和工業	2,100	1,061.00	2,228,100	
極東開発工業	900	1,960.00	1,764,000	

日信工業	1,000	2,154.00	2,154,000	
トピー工業	400	3,450.00	1,380,000	
ティラド	200	4,095.00	819,000	
曙ブレーキ工業	1,700	334.00	567,800	
タチエス	800	2,112.00	1,689,600	
N O K	2,600	2,621.00	6,814,600	
フタバ産業	1,500	1,024.00	1,536,000	
K Y B	500	6,390.00	3,195,000	
大同メタル工業	600	1,032.00	619,200	
プレス工業	2,500	667.00	1,667,500	
ミクニ	500	745.00	372,500	
太平洋工業	1,000	1,605.00	1,605,000	
ケーヒン	1,100	2,169.00	2,385,900	
河西工業	600	1,800.00	1,080,000	
アイシン精機	4,000	6,070.00	24,280,000	
富士機工	400	739.00	295,600	
マツダ	15,300	1,500.50	22,957,650	
今仙電機製作所	400	1,352.00	540,800	
本田技研工業	43,900	3,789.00	166,337,100	
スズキ	9,700	6,472.00	62,778,400	
S U B A R U	15,200	3,703.00	56,285,600	
安永	200	2,645.00	529,000	
ヤマハ発動機	6,900	3,585.00	24,736,500	
ショーワ	1,300	1,385.00	1,800,500	
T B K	500	533.00	266,500	
エクセディ	600	3,445.00	2,067,000	
豊田合成	1,800	2,806.00	5,050,800	
愛三工業	800	1,253.00	1,002,400	
盟和産業	100	1,300.00	130,000	
ヨロズ	500	2,448.00	1,224,000	
エフ・シー・シー	800	2,875.00	2,300,000	
シマノ	2,000	15,840.00	31,680,000	
テイ・エス テック	1,100	4,585.00	5,043,500	
ジャムコ	300	2,831.00	849,300	
テルモ	7,500	5,240.00	39,300,000	
クリエートメディック	200	1,267.00	253,400	

日機装	1,600	1,044.00	1,670,400
島津製作所	5,800	2,592.00	15,033,600
JMS	500	632.00	316,000
クボテック	100	585.00	58,500
長野計器	400	1,282.00	512,800
ブイ・テクノロジー	100	18,300.00	1,830,000
東京計器	300	1,388.00	416,400
愛知時計電機	100	4,310.00	431,000
インターアクション	200	981.00	196,200
オーバル	400	305.00	122,000
東京精密	900	4,625.00	4,162,500
マニー	600	3,305.00	1,983,000
ニコン	8,500	2,331.00	19,813,500
トプコン	2,600	2,412.00	6,271,200
オリンパス	7,300	4,315.00	31,499,500
理研計器	500	2,484.00	1,242,000
タムロン	400	2,473.00	989,200
HOYA	10,000	5,651.00	56,510,000
シード	100	4,690.00	469,000
ノーリツ鋼機	500	2,348.00	1,174,000
エー・アンド・デイ	400	743.00	297,200
シチズン時計	5,600	839.00	4,698,400
リズム時計工業	200	2,336.00	467,200
大研医器	400	770.00	308,000
メニコン	300	6,350.00	1,905,000
松風	200	1,458.00	291,600
セイコーホールディングス	800	3,270.00	2,616,000
ニプロ	3,300	1,560.00	5,148,000
中本パックス	100	3,545.00	354,500
スノーピーク	200	1,492.00	298,400
パラマウントベッドホールディングス	500	5,340.00	2,670,000
トランザクション	200	1,013.00	202,600
SHO-BI	100	434.00	43,400
ニホンフラッシュ	200	2,613.00	522,600
前田工織	500	2,090.00	1,045,000
永大産業	1,000	567.00	567,000

アートネイチャー	500	800.00	400,000
ダンロップスポーツ	300	1,588.00	476,400
バンダイナムコホールディングス	5,000	3,735.00	18,675,000
アイフィスジャパン	100	611.00	61,100
共立印刷	700	372.00	260,400
S H O E I	200	4,675.00	935,000
フランスベッドホールディングス	600	1,048.00	628,800
パイロットコーポレーション	900	5,390.00	4,851,000
萩原工業	200	1,944.00	388,800
トッパン・フォームズ	1,000	1,223.00	1,223,000
フジシールインターナショナル	1,100	3,855.00	4,240,500
タカラトミー	2,000	1,536.00	3,072,000
廣済堂	400	432.00	172,800
A s - m e エステール	100	1,135.00	113,500
アーク	1,200	130.00	156,000
タカノ	200	1,181.00	236,200
プロネクサス	500	1,399.00	699,500
ホクシン	100	201.00	20,100
ウッドワン	200	1,568.00	313,600
大建工業	400	2,861.00	1,144,400
凸版印刷	14,000	1,031.00	14,434,000
大日本印刷	6,400	2,477.00	15,852,800
図書印刷	400	998.00	399,200
共同印刷	100	3,665.00	366,500
N I S S H A	1,000	3,385.00	3,385,000
光村印刷	100	2,445.00	244,500
宝印刷	200	1,771.00	354,200
アシックス	4,800	1,650.00	7,920,000
ツツミ	200	2,131.00	426,200
小松ウオール工業	200	2,454.00	490,800
ヤマハ	3,300	4,130.00	13,629,000
河合楽器製作所	200	2,564.00	512,800
クリナップ	400	877.00	350,800
ピジョン	3,000	4,540.00	13,620,000
兼松サステック	100	2,127.00	212,700
キングジム	400	1,009.00	403,600

リンテック	1,200	3,110.00	3,732,000	
イトーキ	1,000	841.00	841,000	
任天堂	3,000	44,380.00	133,140,000	
三菱鉛筆	800	2,427.00	1,941,600	
タカラスタANDARD	900	1,791.00	1,611,900	
コクヨ	2,300	2,128.00	4,894,400	
ナカバヤシ	500	727.00	363,500	
グローブライド	200	2,000.00	400,000	
岡村製作所	1,600	1,465.00	2,344,000	
美津濃	500	3,350.00	1,675,000	
東京電力ホールディングス	38,600	455.00	17,563,000	
中部電力	14,900	1,408.50	20,986,650	
関西電力	19,800	1,479.00	29,284,200	
中国電力	6,700	1,233.00	8,261,100	
北陸電力	4,800	970.00	4,656,000	
東北電力	11,400	1,499.00	17,088,600	
四国電力	4,400	1,509.00	6,639,600	
九州電力	10,800	1,265.00	13,662,000	
北海道電力	4,900	796.00	3,900,400	
沖縄電力	900	2,919.00	2,627,100	
電源開発	3,900	3,170.00	12,363,000	
エフオン	300	1,515.00	454,500	
イーレックス	700	1,055.00	738,500	
東京瓦斯	10,400	2,638.00	27,435,200	
大阪瓦斯	9,400	2,224.00	20,905,600	
東邦瓦斯	2,400	3,140.00	7,536,000	
北海道瓦斯	1,000	296.00	296,000	
広島ガス	1,100	368.00	404,800	
西部瓦斯	600	2,692.00	1,615,200	
静岡ガス	1,300	962.00	1,250,600	
メタウォーター	300	2,824.00	847,200	
SBSホールディングス	400	1,016.00	406,400	
東武鉄道	5,200	3,735.00	19,422,000	
相鉄ホールディングス	1,600	2,987.00	4,779,200	
東京急行電鉄	13,200	1,828.00	24,129,600	
京浜急行電鉄	6,700	2,169.00	14,532,300	

小田急電鉄	7,200	2,464.00	17,740,800	
京王電鉄	2,700	5,200.00	14,040,000	
京成電鉄	3,400	3,760.00	12,784,000	
富士急行	700	3,255.00	2,278,500	
新京成電鉄	200	2,115.00	423,000	
東日本旅客鉄道	8,800	11,255.00	99,044,000	
西日本旅客鉄道	4,400	8,413.00	37,017,200	
東海旅客鉄道	4,400	21,155.00	93,082,000	
西武ホールディングス	6,200	2,117.00	13,125,400	
鴻池運輸	600	1,905.00	1,143,000	
西日本鉄道	1,400	3,020.00	4,228,000	
ハマキョウレックス	300	3,110.00	933,000	
サカイ引越センター	300	5,680.00	1,704,000	
近鉄グループホールディングス	4,600	4,475.00	20,585,000	
阪急阪神ホールディングス	6,200	4,590.00	28,458,000	
南海電気鉄道	2,200	2,844.00	6,256,800	
京阪ホールディングス	2,000	3,335.00	6,670,000	
神戸電鉄	100	3,905.00	390,500	
名古屋鉄道	3,600	2,835.00	10,206,000	
山陽電気鉄道	300	2,864.00	859,200	
日本通運	1,800	7,350.00	13,230,000	
ヤマトホールディングス	8,100	2,370.00	19,197,000	
山九	1,200	4,815.00	5,778,000	
丸運	100	334.00	33,400	
丸全昭和運輸	2,000	508.00	1,016,000	
センコーグループホールディングス	2,700	835.00	2,254,500	
トナミホールディングス	100	5,630.00	563,000	
ニッコンホールディングス	1,700	3,050.00	5,185,000	
日本石油輸送	100	3,775.00	377,500	
福山通運	700	4,130.00	2,891,000	
セイノーホールディングス	3,400	1,844.00	6,269,600	
神奈川中央交通	100	3,675.00	367,500	
日立物流	1,100	2,975.00	3,272,500	
丸和運輸機関	300	3,210.00	963,000	
C & F ロジホールディングス	500	1,597.00	798,500	
九州旅客鉄道	3,900	3,525.00	13,747,500	

日本郵船	3,800	2,704.00	10,275,200
商船三井	2,900	3,655.00	10,599,500
川崎汽船	2,100	2,879.00	6,045,900
N Sユナイテッド海運	200	2,735.00	547,000
明治海運	400	460.00	184,000
飯野海運	2,200	608.00	1,337,600
共栄タンカー	100	2,171.00	217,100
乾汽船	300	758.00	227,400
日本航空	8,600	4,295.00	36,937,000
A N Aホールディングス	9,100	4,678.00	42,569,800
パスコ	1,000	328.00	328,000
ランコム	100	7,890.00	789,000
日新	400	3,080.00	1,232,000
三菱倉庫	1,600	3,045.00	4,872,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	371.00	1,113,000
住友倉庫	3,000	818.00	2,454,000
澁澤倉庫	300	2,034.00	610,200
東陽倉庫	700	328.00	229,600
日本トランスシティ	1,000	467.00	467,000
ケイヒン	100	1,651.00	165,100
中央倉庫	300	1,187.00	356,100
川西倉庫	100	2,847.00	284,700
安田倉庫	400	920.00	368,000
東洋埠頭	200	1,854.00	370,800
宇徳	300	536.00	160,800
上組	2,900	2,621.00	7,600,900
サンリツ	100	890.00	89,000
キムラユニティー	100	1,187.00	118,700
キューソー流通システム	100	3,190.00	319,000
郵船ロジスティクス	400	1,501.00	600,400
近鉄エクスプレス	900	2,344.00	2,109,600
東海運	200	414.00	82,800
エーアイティー	300	1,381.00	414,300
内外トランスライン	100	1,991.00	199,100
日本コンセプト	100	1,285.00	128,500
N E C ネットズエスアイ	500	2,878.00	1,439,000

システナ	400	3,715.00	1,486,000	
デジタルアーツ	200	4,860.00	972,000	
新日鉄住金ソリューションズ	800	2,864.00	2,291,200	
キューブシステム	200	819.00	163,800	
コア	200	1,568.00	313,600	
ソフトクリエイトホールディングス	200	1,544.00	308,800	
T I S	1,600	3,970.00	6,352,000	
ネオス	100	425.00	42,500	
電算システム	200	2,154.00	430,800	
グリー	2,900	748.00	2,169,200	
コーエーテクモホールディングス	800	2,281.00	1,824,800	
三菱総合研究所	200	3,750.00	750,000	
ボルテージ	100	1,086.00	108,600	
電算	100	2,451.00	245,100	
A G S	200	886.00	177,200	
ファインデックス	400	772.00	308,800	
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,427.00	242,700	
ブレインパッド	100	1,440.00	144,000	
K L a b	900	1,845.00	1,660,500	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	300	1,925.00	577,500	
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,086.00	108,600	
ネクソン	5,400	3,200.00	17,280,000	
アイスタイル	1,000	922.00	922,000	
エムアップ	100	1,388.00	138,800	
エイチーム	300	3,210.00	963,000	
テクノスジャパン	400	974.00	389,600	
e n i s h	100	1,587.00	158,700	
コロプラ	1,500	1,196.00	1,794,000	
モバイルクリエイト	300	405.00	121,500	
オルトプラス	200	1,261.00	252,200	
ブロードリーフ	1,100	1,111.00	1,222,100	
ハーツユナイテッドグループ	200	1,782.00	356,400	
メディアドゥホールディングス	100	2,482.00	248,200	
ブイキューブ	200	528.00	105,600	
サイバーリンクス	100	1,365.00	136,500	

ディー・エル・イー	100	555.00	55,500
フィックスターズ	100	5,580.00	558,000
VOYAGE GROUP	200	1,488.00	297,600
オブティム	100	2,562.00	256,200
セレス	100	1,817.00	181,700
ベリサーブ	100	3,870.00	387,000
ティーガイア	500	2,597.00	1,298,500
セック	100	2,524.00	252,400
日本アジアグループ	400	467.00	186,800
豆蔵ホールディングス	300	1,253.00	375,900
テクマトリックス	200	1,762.00	352,400
プロシップ	100	2,191.00	219,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	12,800	291.00	3,724,800
GMOペイメントゲートウェイ	300	8,370.00	2,511,000
ザッパラス	200	425.00	85,000
システムリサーチ	100	2,110.00	211,000
インターネットイニシアティブ	800	2,111.00	1,688,800
さくらインターネット	500	856.00	428,000
ヴィンクス	100	1,232.00	123,200
GMOクラウド	100	2,443.00	244,300
SRAホールディングス	300	3,565.00	1,069,500
Minor iソリューションズ	100	1,481.00	148,100
システムインテグレータ	100	919.00	91,900
朝日ネット	400	532.00	212,800
アドソル日進	200	1,272.00	254,400
フリービット	300	900.00	270,000
コムチュア	300	2,824.00	847,200
サイバーコム	100	1,095.00	109,500
メディカル・データ・ビジョン	200	2,269.00	453,800
gumi	500	1,024.00	512,000
ショーケース・ティービー	100	1,600.00	160,000
モバイルファクトリー	100	1,356.00	135,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,968.00	196,800
PCIホールディングス	100	3,060.00	306,000
パイプドHD	100	1,201.00	120,100
アイビーシー	100	1,211.00	121,100

オーブンドア	100	6,500.00	650,000
アカツキ	100	7,220.00	722,000
L I N E	1,400	5,010.00	7,014,000
シンクロ・フード	100	1,899.00	189,900
オークネット	100	1,443.00	144,300
A O I T Y O H o l d i n g s	400	1,284.00	513,600
マクロミル	600	2,767.00	1,660,200
ソルクシーズ	200	830.00	166,000
フェイス	200	1,334.00	266,800
ハイマックス	100	1,680.00	168,000
野村総合研究所	3,200	5,150.00	16,480,000
サイバネットシステム	300	729.00	218,700
C E ホールディングス	200	823.00	164,600
日本システム技術	100	1,318.00	131,800
インテージホールディングス	500	1,382.00	691,000
東邦システムサイエンス	200	795.00	159,000
ソースネクスト	300	1,395.00	418,500
フォーカスシステムズ	200	894.00	178,800
クレスコ	100	4,825.00	482,500
フジ・メディア・ホールディングス	5,000	1,696.00	8,480,000
オービック	1,500	8,100.00	12,150,000
ジャストシステム	800	2,251.00	1,800,800
T D C ソフト	200	1,096.00	219,200
ヤフー	34,500	510.00	17,595,000
トレンドマイクロ	2,400	6,530.00	15,672,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,357.00	135,700
日本オラクル	800	10,580.00	8,464,000
アルファシステムズ	100	2,423.00	242,300
フューチャー	600	1,266.00	759,600
C A C H o l d i n g s	300	1,070.00	321,000
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,832.00	366,400
トーセ	100	2,055.00	205,500
オービックビジネスコンサルタント	200	6,060.00	1,212,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	4,795.00	5,274,500
アイティフォー	500	754.00	377,000
東計電算	100	3,390.00	339,000

エクスネット	200	910.00	182,000	
大塚商会	1,400	8,490.00	11,886,000	
サイボウズ	500	496.00	248,000	
ソフトブレーン	400	413.00	165,200	
電通国際情報サービス	300	2,426.00	727,800	
デジタルガレージ	900	3,100.00	2,790,000	
E Mシステムズ	100	2,512.00	251,200	
ウェザーニューズ	200	3,420.00	684,000	
C I J	400	710.00	284,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,792.00	179,200	
日本エンタープライズ	600	244.00	146,400	
WOWOW	200	3,335.00	667,000	
スカラ	300	736.00	220,800	
イマジカ・ロボット ホールディングス	400	944.00	377,600	
ネットワンシステムズ	1,900	1,687.00	3,205,300	
システムソフト	1,200	141.00	169,200	
アルゴグラフィックス	200	3,505.00	701,000	
マーベラス	800	1,051.00	840,800	
エイベックス	900	1,683.00	1,514,700	
日本ユニシス	1,300	2,202.00	2,862,600	
兼松エレクトロニクス	300	3,320.00	996,000	
東京放送ホールディングス	2,900	2,767.00	8,024,300	
日本テレビホールディングス	4,400	2,043.00	8,989,200	
朝日放送	400	879.00	351,600	
テレビ朝日ホールディングス	1,300	2,366.00	3,075,800	
スカパー J S A Tホールディングス	3,500	501.00	1,753,500	
テレビ東京ホールディングス	400	2,485.00	994,000	
日本BS放送	100	1,309.00	130,900	
ビジョン	100	2,694.00	269,400	
USEN - NEXT HOLDINGS	100	1,053.00	105,300	
ワイヤレスゲート	200	1,362.00	272,400	
コネクシオ	300	2,303.00	690,900	
日本通信	3,600	114.00	410,400	
クロップス	100	1,044.00	104,400	
日本電信電話	34,400	5,754.00	197,937,600	
K D D I	43,200	3,235.00	139,752,000	

光通信	600	16,130.00	9,678,000	
NTTドコモ	35,500	2,889.50	102,577,250	
エムティーアイ	600	657.00	394,200	
GMOインターネット	1,700	1,920.00	3,264,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	100	719.00	71,900	
カドカワ	1,400	1,320.00	1,848,000	
学研ホールディングス	200	4,280.00	856,000	
ゼンリン	600	3,810.00	2,286,000	
昭文社	200	765.00	153,000	
インプレスホールディングス	100	169.00	16,900	
アイネット	200	1,736.00	347,200	
松竹	300	18,890.00	5,667,000	
東宝	3,200	3,865.00	12,368,000	
東映	200	11,720.00	2,344,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	14,800	1,342.00	19,861,600	
ピー・シー・エー	100	1,755.00	175,500	
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,675.00	167,500	
D T S	500	3,640.00	1,820,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,200	5,310.00	11,682,000	
シーイーシー	300	2,690.00	807,000	
カプコン	1,000	3,480.00	3,480,000	
アイ・エス・ピー	100	1,266.00	126,600	
ジャステック	300	1,267.00	380,100	
S C S K	1,200	5,120.00	6,144,000	
日本システムウエア	100	2,395.00	239,500	
アイネス	600	1,123.00	673,800	
T K C	400	3,985.00	1,594,000	
富士ソフト	700	3,545.00	2,481,500	
N S D	800	2,352.00	1,881,600	
コナミホールディングス	2,000	6,300.00	12,600,000	
福井コンピュータホールディングス	100	3,565.00	356,500	
J B C Cホールディングス	400	1,139.00	455,600	
ミロク情報サービス	400	2,987.00	1,194,800	
ソフトバンクグループ	21,700	9,483.00	205,781,100	
ハウスイ	100	1,203.00	120,300	
高千穂交易	200	1,165.00	233,000	

伊藤忠食品	100	6,250.00	625,000	
エレマテック	200	2,650.00	530,000	
JALUX	200	2,822.00	564,400	
あらた	300	6,010.00	1,803,000	
トーメンデバイス	100	3,345.00	334,500	
東京エレクトロン デバイス	200	2,007.00	401,400	
フィールズ	400	1,233.00	493,200	
双日	28,000	325.00	9,100,000	
アルフレッサ ホールディングス	5,300	2,521.00	13,361,300	
横浜冷凍	1,100	1,189.00	1,307,900	
神栄	100	1,522.00	152,200	
ラサ商事	200	929.00	185,800	
ラクーン	300	818.00	245,400	
アルコニックス	500	2,135.00	1,067,500	
神戸物産	300	5,100.00	1,530,000	
ペッパーフードサービス	300	6,100.00	1,830,000	
あい ホールディングス	700	2,772.00	1,940,400	
ディーブイエックス	200	1,363.00	272,600	
ダイワボウホールディングス	400	4,560.00	1,824,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	900	2,401.00	2,160,900	
ラクト・ジャパン	100	4,440.00	444,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	800	976.00	780,800	
八洲電機	400	1,009.00	403,600	
メディアスホールディングス	100	2,492.00	249,200	
UKCホールディングス	300	2,022.00	606,600	
ジューテックホールディングス	100	1,335.00	133,500	
大光	100	987.00	98,700	
OCHIホールディングス	100	1,445.00	144,500	
TOKAIホールディングス	2,400	879.00	2,109,600	
大阪工機	100	1,156.00	115,600	
三洋貿易	200	2,518.00	503,600	
ビューティガレージ	100	2,227.00	222,700	
ウイン・パートナーズ	300	1,328.00	398,400	
ミタチ産業	100	1,512.00	151,200	
シップヘルスケアホールディングス	1,000	3,605.00	3,605,000	
明治電機工業	100	1,777.00	177,700	

デリカフーズホールディングス	100	1,505.00	150,500
スターティア	200	1,071.00	214,200
コメダホールディングス	800	1,985.00	1,588,000
富士興産	300	578.00	173,400
協栄産業	100	2,150.00	215,000
小野建	400	2,011.00	804,400
佐鳥電機	300	1,022.00	306,600
エコートレーディング	100	692.00	69,200
伯東	300	1,883.00	564,900
コンドーテック	400	1,064.00	425,600
中山福	200	788.00	157,600
ナガイレーベン	700	2,700.00	1,890,000
三菱食品	500	3,455.00	1,727,500
松田産業	400	1,816.00	726,400
第一興商	700	5,430.00	3,801,000
メディバルホールディングス	4,800	2,201.00	10,564,800
S P K	100	3,210.00	321,000
萩原電気	200	3,330.00	666,000
アズワン	400	6,690.00	2,676,000
スズデン	100	1,662.00	166,200
尾家産業	200	1,294.00	258,800
シモジマ	300	1,198.00	359,400
ドウシシャ	500	2,291.00	1,145,500
小津産業	100	2,230.00	223,000
高速	300	1,265.00	379,500
たけびし	200	1,886.00	377,200
黒田電気	500	2,719.00	1,359,500
リックス	100	1,834.00	183,400
丸文	400	1,059.00	423,600
ハビネット	300	1,941.00	582,300
橋本総業ホールディングス	100	1,748.00	174,800
日本ライフライン	700	4,450.00	3,115,000
エクセル	200	2,561.00	512,200
マルカキカイ	200	2,172.00	434,400
I D O M	1,400	845.00	1,183,000
日本エム・ディ・エム	300	887.00	266,100

進和	300	2,623.00	786,900
エスケイジャパン	100	468.00	46,800
ダイترون	200	2,420.00	484,000
シークス	300	4,735.00	1,420,500
田中商事	100	790.00	79,000
オーハシテクニカ	200	1,706.00	341,200
白銅	200	2,243.00	448,600
伊藤忠商事	35,200	1,948.50	68,587,200
丸紅	39,300	749.50	29,455,350
高島	100	2,183.00	218,300
長瀬産業	2,900	2,007.00	5,820,300
蝶理	300	2,085.00	625,500
豊田通商	5,400	4,365.00	23,571,000
三共生興	700	480.00	336,000
兼松	2,000	1,398.00	2,796,000
ツカモトコーポレーション	100	1,301.00	130,100
三井物産	40,900	1,703.00	69,652,700
日本紙パルプ商事	300	4,210.00	1,263,000
日立ハイテクノロジーズ	1,700	4,725.00	8,032,500
カメイ	600	1,826.00	1,095,600
東都水産	100	2,011.00	201,100
OUGホールディングス	100	2,688.00	268,800
スターゼン	200	5,380.00	1,076,000
山善	1,800	1,291.00	2,323,800
椿本興業	100	2,771.00	277,100
住友商事	30,300	1,840.00	55,752,000
内田洋行	200	3,230.00	646,000
三菱商事	33,700	2,914.50	98,218,650
第一実業	200	3,405.00	681,000
キャノンマーケティングジャパン	1,400	2,960.00	4,144,000
西華産業	300	2,750.00	825,000
佐藤商事	400	1,253.00	501,200
菱洋エレクトロ	400	1,912.00	764,800
東京産業	500	522.00	261,000
ユアサ商事	500	3,990.00	1,995,000
神鋼商事	100	2,930.00	293,000

小林産業	200	392.00	78,400	
阪和興業	900	4,565.00	4,108,500	
正栄食品工業	300	4,885.00	1,465,500	
カナデン	400	1,400.00	560,000	
菱電商事	300	1,742.00	522,600	
フルサト工業	200	1,845.00	369,000	
岩谷産業	1,100	3,500.00	3,850,000	
すてきナイスグループ	100	1,551.00	155,100	
昭光通商	2,000	123.00	246,000	
ニチモウ	100	1,948.00	194,800	
極東貿易	1,000	449.00	449,000	
イワキ	1,000	477.00	477,000	
三愛石油	1,200	1,558.00	1,869,600	
稲畑産業	1,100	1,689.00	1,857,900	
G S Iクレオス	100	1,641.00	164,100	
明和産業	400	465.00	186,000	
ワキタ	1,000	1,298.00	1,298,000	
東邦ホールディングス	1,400	2,401.00	3,361,400	
サンゲツ	1,600	2,051.00	3,281,600	
ミツウロコグループホールディングス	600	809.00	485,400	
シナネンホールディングス	200	2,539.00	507,800	
伊藤忠エネクス	1,000	1,104.00	1,104,000	
サンリオ	1,400	1,872.00	2,620,800	
サンワテクノス	300	2,129.00	638,700	
リョーサン	600	4,165.00	2,499,000	
新光商事	500	1,958.00	979,000	
トーヨー	200	2,757.00	551,400	
三信電気	400	1,757.00	702,800	
東陽テクニカ	500	976.00	488,000	
モスフードサービス	600	3,430.00	2,058,000	
加賀電子	400	3,190.00	1,276,000	
ソーダニッカ	400	590.00	236,000	
立花エレテック	300	1,922.00	576,600	
フォーバル	200	813.00	162,600	
P A L T A C	700	4,960.00	3,472,000	
三谷産業	400	425.00	170,000	

太平洋興発	200	1,015.00	203,000
西本Wismettacホールディングス	100	4,010.00	401,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,665.00	166,500
ヤマタネ	200	2,252.00	450,400
丸紅建材リース	1,000	238.00	238,000
日鉄住金物産	400	6,050.00	2,420,000
トラスコ中山	1,000	3,210.00	3,210,000
オートバックスセブン	1,900	2,140.00	4,066,000
モリト	400	1,059.00	423,600
加藤産業	800	4,110.00	3,288,000
イノテック	400	1,146.00	458,400
イエローハット	400	3,295.00	1,318,000
JKホールディングス	400	995.00	398,000
日伝	400	2,307.00	922,800
北沢産業	600	290.00	174,000
杉本商事	200	1,729.00	345,800
因幡電機産業	600	5,080.00	3,048,000
バイテックホールディングス	200	1,718.00	343,600
ミスミグループ本社	5,600	3,310.00	18,536,000
アルテック	200	399.00	79,800
タキヒヨー	200	2,391.00	478,200
蔵王産業	100	1,852.00	185,200
スズケン	2,200	4,545.00	9,999,000
ジェコス	300	1,403.00	420,900
ルネサスイーストン	400	714.00	285,600
ローソン	1,200	7,850.00	9,420,000
サンエー	400	5,410.00	2,164,000
カワチ薬品	400	2,817.00	1,126,800
エービーシー・マート	900	6,410.00	5,769,000
ハードオフコーポレーション	200	1,250.00	250,000
アスクル	500	3,250.00	1,625,000
ゲオホールディングス	900	2,229.00	2,006,100
アダストリア	800	2,541.00	2,032,800
ジーフット	200	779.00	155,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	734.00	73,400
くらコーポレーション	300	5,470.00	1,641,000

キャンドウ	200	1,805.00	361,000	
パルグループホールディングス	200	3,535.00	707,000	
エディオン	1,800	1,329.00	2,392,200	
サーラコーポレーション	800	698.00	558,400	
ワッツ	200	1,195.00	239,000	
ハローズ	200	2,678.00	535,600	
あみやき亭	100	5,070.00	507,000	
ひらまつ	600	570.00	342,000	
ゲンキー	200	4,010.00	802,000	
大黒天物産	100	5,260.00	526,000	
ハニーズホールディングス	500	1,165.00	582,500	
ファーマライズホールディングス	100	608.00	60,800	
アルペン	400	2,433.00	973,200	
クオール	500	2,229.00	1,114,500	
ジinz	300	5,780.00	1,734,000	
ビックカメラ	2,800	1,603.00	4,488,400	
D C Mホールディングス	2,600	1,093.00	2,841,800	
Monotaro	1,700	3,295.00	5,601,500	
東京一番フーズ	100	609.00	60,900	
D Dホールディングス	100	4,725.00	472,500	
きちり	200	813.00	162,600	
アークランドサービスホールディングス	400	2,701.00	1,080,400	
J . フロント リテイリング	5,800	1,972.00	11,437,600	
ドトール・日レスホールディングス	900	2,766.00	2,489,400	
マツモトキヨシホールディングス	1,000	9,420.00	9,420,000	
ブロンコビリー	300	3,470.00	1,041,000	
スタートトゥデイ	4,700	3,550.00	16,685,000	
トレジャー・ファクトリー	100	995.00	99,500	
物語コーポレーション	100	9,810.00	981,000	
ココカラファイン	500	7,300.00	3,650,000	
三越伊勢丹ホールディングス	9,000	1,373.00	12,357,000	
Hamee	100	1,752.00	175,200	
ウエルシアホールディングス	1,300	5,040.00	6,552,000	
クリエイトSDホールディングス	700	2,963.00	2,074,100	
丸善CHIホールディングス	400	348.00	139,200	
ミサワ	100	509.00	50,900	

ティーライフ	100	1,370.00	137,000	
エー・ピーカンパニー	100	905.00	90,500	
チムニー	100	2,867.00	286,700	
シュッピン	100	3,195.00	319,500	
ネクステージ	600	840.00	504,000	
ジョイフル本田	800	3,415.00	2,732,000	
鳥貴族	200	3,540.00	708,000	
麒麟堂ホールディングス	200	2,026.00	405,200	
ホットランド	300	1,539.00	461,700	
すかいらーく	3,000	1,667.00	5,001,000	
綿半ホールディングス	200	2,943.00	588,600	
ヨシックス	100	3,460.00	346,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,600	1,186.00	1,897,600	
ブックオフコーポレーション	200	821.00	164,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	1,051.00	210,200	
B E E N O S	100	1,814.00	181,400	
あさひ	300	1,382.00	414,600	
日本調剤	200	3,620.00	724,000	
コスモス薬品	200	24,990.00	4,998,000	
トーエル	200	1,080.00	216,000	
一六堂	100	511.00	51,100	
オンリー	100	944.00	94,400	
セブン&アイ・ホールディングス	20,200	4,696.00	94,859,200	
薬王堂	200	3,505.00	701,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,300	1,283.00	1,667,900	
ツルハホールディングス	1,000	16,410.00	16,410,000	
サンマルクホールディングス	300	3,045.00	913,500	
フェリシモ	100	1,390.00	139,000	
トリドールホールディングス	600	3,945.00	2,367,000	
T O K Y O B A S E	100	4,930.00	493,000	
サツドラホールディングス	100	2,012.00	201,200	
ダイユー・リックホールディングス	200	1,186.00	237,200	
バロックジャパンリミテッド	400	964.00	385,600	
クスリのアオキホールディングス	400	6,910.00	2,764,000	
スシローグローバルホールディングス	400	4,310.00	1,724,000	

LIXILビバ	500	1,949.00	974,500	
メディカルシステムネットワーク	500	698.00	349,000	
総合メディカル	200	5,870.00	1,174,000	
はるやまホールディングス	200	1,027.00	205,400	
ノジマ	900	2,646.00	2,381,400	
カッパ・クリエイト	600	1,281.00	768,600	
ライトオン	400	908.00	363,200	
ジーンズメイト	100	988.00	98,800	
良品計画	600	36,550.00	21,930,000	
三城ホールディングス	500	477.00	238,500	
アドヴァン	500	1,067.00	533,500	
アルピス	100	4,180.00	418,000	
コナカ	500	628.00	314,000	
ハウス オブ ローゼ	100	1,817.00	181,700	
G - 7ホールディングス	100	2,664.00	266,400	
イオン北海道	400	727.00	290,800	
コジマ	700	381.00	266,700	
ヒマラヤ	100	1,092.00	109,200	
コーナン商事	800	2,446.00	1,956,800	
エコス	200	1,224.00	244,800	
ワタミ	600	1,604.00	962,400	
マルシェ	100	800.00	80,000	
ドンキホーテホールディングス	3,100	5,770.00	17,887,000	
西松屋チェーン	1,000	1,371.00	1,371,000	
ゼンショーホールディングス	2,400	1,954.00	4,689,600	
幸楽苑ホールディングス	300	1,800.00	540,000	
ハークスレイ	200	1,196.00	239,200	
サイゼリヤ	700	3,810.00	2,667,000	
V Tホールディングス	1,500	567.00	850,500	
魚力	100	1,178.00	117,800	
ポブラ	100	713.00	71,300	
フジ・コーポレーション	100	2,242.00	224,200	
ユナイテッドアローズ	600	4,550.00	2,730,000	
ハイデイ日高	500	3,630.00	1,815,000	
京都きもの友禅	300	802.00	240,600	
コロワイド	1,600	2,173.00	3,476,800	

ピーシーデボコーポレーション	700	858.00	600,600	
壱番屋	300	4,485.00	1,345,500	
トップカルチャー	100	502.00	50,200	
P L A N T	100	1,369.00	136,900	
スギホールディングス	1,100	5,840.00	6,424,000	
ヴィア・ホールディングス	400	751.00	300,400	
スクロール	600	491.00	294,600	
ヨンドシーホールディングス	500	2,969.00	1,484,500	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,500	7,750.00	11,625,000	
木曽路	600	2,756.00	1,653,600	
S R S ホールディングス	500	938.00	469,000	
千趣会	800	680.00	544,000	
タカキュー	100	228.00	22,800	
ケーヨー	800	738.00	590,400	
上新電機	600	4,160.00	2,496,000	
日本瓦斯	900	3,965.00	3,568,500	
ロイヤルホールディングス	800	3,210.00	2,568,000	
東天紅	100	2,480.00	248,000	
いなげや	500	1,855.00	927,500	
島忠	1,300	3,360.00	4,368,000	
チヨダ	600	3,035.00	1,821,000	
ライフコーポレーション	400	3,120.00	1,248,000	
リンガーハット	600	2,565.00	1,539,000	
さが美	1,000	135.00	135,000	
M r M a x H D	500	847.00	423,500	
テンアライド	300	499.00	149,700	
A O K I ホールディングス	1,000	1,716.00	1,716,000	
オークワ	1,000	1,164.00	1,164,000	
コメリ	800	3,235.00	2,588,000	
青山商事	900	4,305.00	3,874,500	
しまむら	600	13,550.00	8,130,000	
はせがわ	200	504.00	100,800	
高島屋	8,000	1,137.00	9,096,000	
松屋	1,000	1,428.00	1,428,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,300	2,217.00	5,099,100	
近鉄百貨店	200	3,920.00	784,000	

パルコ	500	1,559.00	779,500
丸井グループ	4,600	2,016.00	9,273,600
アクシアル リテイリング	400	4,215.00	1,686,000
井筒屋	200	460.00	92,000
イオン	18,400	1,903.50	35,024,400
イズミ	900	6,760.00	6,084,000
東武ストア	100	3,005.00	300,500
平和堂	1,000	2,526.00	2,526,000
フジ	500	2,447.00	1,223,500
ヤオコー	500	5,470.00	2,735,000
ゼビオホールディングス	700	2,158.00	1,510,600
ケーズホールディングス	2,100	3,030.00	6,363,000
O l y m p i c グループ	200	590.00	118,000
日産東京販売ホールディングス	600	406.00	243,600
アインホールディングス	700	7,400.00	5,180,000
元気寿司	100	4,065.00	406,500
ヤマダ電機	15,900	635.00	10,096,500
アークランドサカモト	800	1,893.00	1,514,400
ニトリホールディングス	1,900	17,725.00	33,677,500
グルメ杵屋	1,000	1,145.00	1,145,000
愛眼	200	575.00	115,000
ケーユーホールディングス	200	1,257.00	251,400
吉野家ホールディングス	1,500	1,919.00	2,878,500
松屋フーズ	200	4,250.00	850,000
サガミチェーン	600	1,409.00	845,400
関西スーパーマーケット	400	1,284.00	513,600
王将フードサービス	400	5,150.00	2,060,000
プレナス	500	2,413.00	1,206,500
ミニストップ	400	2,423.00	969,200
アークス	900	2,634.00	2,370,600
パローホールディングス	1,100	2,680.00	2,948,000
藤久	100	1,743.00	174,300
ベルク	200	6,590.00	1,318,000
大庄	300	1,732.00	519,600
ファーストリテイリング	800	44,630.00	35,704,000
サンドラッグ	2,000	5,360.00	10,720,000

サクスパー ホールディングス	400	1,387.00	554,800	
ヤマザワ	100	1,739.00	173,900	
やまや	100	3,085.00	308,500	
ペルーナ	1,200	1,321.00	1,585,200	
島根銀行	200	1,358.00	271,600	
じもとホールディングス	2,900	190.00	551,000	
めぶきフィナンシャルグループ	24,800	461.00	11,432,800	
東京TYフィナンシャルグループ	700	3,055.00	2,138,500	
九州フィナンシャルグループ	7,800	673.00	5,249,400	
ゆうちょ銀行	13,600	1,447.00	19,679,200	
富山第一銀行	1,100	518.00	569,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	29,000	664.00	19,256,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	3,300	1,306.00	4,309,800	
新生銀行	4,200	1,866.00	7,837,200	
あおぞら銀行	2,900	4,440.00	12,876,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	340,200	794.90	270,424,980	
りそなホールディングス	52,800	614.20	32,429,760	
三井住友トラスト・ホールディングス	9,500	4,273.00	40,593,500	
三井住友フィナンシャルグループ	36,500	4,733.00	172,754,500	
第四銀行	600	4,990.00	2,994,000	
北越銀行	500	2,512.00	1,256,000	
千葉銀行	17,000	906.00	15,402,000	
群馬銀行	9,600	677.00	6,499,200	
武蔵野銀行	800	3,625.00	2,900,000	
千葉興業銀行	1,300	587.00	763,100	
筑波銀行	1,800	389.00	700,200	
七十七銀行	1,500	2,740.00	4,110,000	
青森銀行	400	3,520.00	1,408,000	
秋田銀行	300	3,085.00	925,500	
山形銀行	600	2,495.00	1,497,000	
岩手銀行	400	4,500.00	1,800,000	
東邦銀行	4,200	403.00	1,692,600	
東北銀行	300	1,529.00	458,700	
みちのく銀行	300	1,814.00	544,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	20,000	605.00	12,100,000	
静岡銀行	13,000	1,118.00	14,534,000	

十六銀行	700	3,360.00	2,352,000	
スルガ銀行	4,900	2,370.00	11,613,000	
八十二銀行	8,500	647.00	5,499,500	
山梨中央銀行	3,000	483.00	1,449,000	
大垣共立銀行	800	2,859.00	2,287,200	
福井銀行	400	2,747.00	1,098,800	
北國銀行	500	4,430.00	2,215,000	
清水銀行	200	3,265.00	653,000	
富山銀行	100	4,240.00	424,000	
滋賀銀行	5,000	587.00	2,935,000	
南都銀行	600	3,090.00	1,854,000	
百五銀行	4,500	530.00	2,385,000	
京都銀行	1,800	5,940.00	10,692,000	
紀陽銀行	1,800	1,832.00	3,297,600	
三重銀行	200	2,592.00	518,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	3,200	1,736.00	5,555,200	
広島銀行	6,900	895.00	6,175,500	
山陰合同銀行	2,800	1,032.00	2,889,600	
中国銀行	3,300	1,520.00	5,016,000	
鳥取銀行	200	1,798.00	359,600	
伊予銀行	6,700	908.00	6,083,600	
百十四銀行	5,000	368.00	1,840,000	
四国銀行	700	1,566.00	1,096,200	
阿波銀行	4,000	698.00	2,792,000	
大分銀行	300	4,445.00	1,333,500	
宮崎銀行	400	3,665.00	1,466,000	
佐賀銀行	300	2,574.00	772,200	
十八銀行	3,000	299.00	897,000	
沖縄銀行	500	4,410.00	2,205,000	
琉球銀行	900	1,627.00	1,464,300	
セブン銀行	17,600	383.00	6,740,800	
みずほフィナンシャルグループ	654,300	203.30	133,019,190	
高知銀行	200	1,318.00	263,600	
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,359.00	6,795,000	
長野銀行	200	1,956.00	391,200	
名古屋銀行	400	4,350.00	1,740,000	

北洋銀行	7,000	366.00	2,562,000	
愛知銀行	200	5,360.00	1,072,000	
第三銀行	300	1,854.00	556,200	
中京銀行	200	2,326.00	465,200	
大光銀行	200	2,485.00	497,000	
愛媛銀行	700	1,366.00	956,200	
トマト銀行	200	1,554.00	310,800	
みなと銀行	400	2,110.00	844,000	
京葉銀行	4,000	518.00	2,072,000	
関西アーバン銀行	600	1,457.00	874,200	
栃木銀行	2,400	482.00	1,156,800	
北日本銀行	200	3,060.00	612,000	
東和銀行	800	1,394.00	1,115,200	
福島銀行	500	940.00	470,000	
大東銀行	200	1,671.00	334,200	
トモニホールディングス	3,900	594.00	2,316,600	
フィデアホールディングス	4,400	198.00	871,200	
池田泉州ホールディングス	5,000	409.00	2,045,000	
F P G	1,700	1,387.00	2,357,900	
S B Iホールディングス	5,500	2,166.00	11,913,000	
日本アジア投資	300	419.00	125,700	
ジャフコ	700	6,220.00	4,354,000	
大和証券グループ本社	41,000	696.00	28,536,000	
野村ホールディングス	86,700	663.50	57,525,450	
岡三証券グループ	4,000	689.00	2,756,000	
丸三証券	1,500	1,036.00	1,554,000	
東洋証券	2,000	315.00	630,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5,500	709.00	3,899,500	
光世証券	100	1,508.00	150,800	
水戸証券	1,300	413.00	536,900	
いちよし証券	1,000	1,272.00	1,272,000	
松井証券	2,300	959.00	2,205,700	
だいこう証券ビジネス	200	701.00	140,200	
マネックスグループ	4,800	328.00	1,574,400	
カブドットコム証券	2,900	338.00	980,200	
極東証券	700	1,649.00	1,154,300	

岩井コスモホールディングス	500	1,418.00	709,000
藍澤証券	800	748.00	598,400
マネーパートナーズグループ	500	451.00	225,500
小林洋行	100	287.00	28,700
かんぽ生命保険	1,800	2,640.00	4,752,000
S O M P Oホールディングス	9,400	4,438.00	41,717,200
アニコム ホールディングス	300	3,380.00	1,014,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	12,600	3,663.00	46,153,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	4,000	1,954.00	7,816,000
第一生命ホールディングス	27,200	2,350.50	63,933,600
東京海上ホールディングス	18,100	5,078.00	91,911,800
T & Dホールディングス	14,900	1,922.00	28,637,800
アドバンスクリエイト	100	1,951.00	195,100
全国保証	1,400	5,000.00	7,000,000
クレディセゾン	3,600	2,108.00	7,588,800
アクリーティブ	400	392.00	156,800
芙蓉総合リース	600	7,360.00	4,416,000
興銀リース	900	2,835.00	2,551,500
東京センチュリー	1,000	5,220.00	5,220,000
日本証券金融	1,800	615.00	1,107,000
アイフル	7,800	400.00	3,120,000
ポケットカード	300	1,067.00	320,100
リコーリース	400	3,850.00	1,540,000
イオンフィナンシャルサービス	3,400	2,501.00	8,503,400
アコム	9,300	476.00	4,426,800
ジャックス	600	2,550.00	1,530,000
オリエントコーポレーション	10,000	181.00	1,810,000
日立キャピタル	1,300	2,759.00	3,586,700
アプラスフィナンシャル	1,700	107.00	181,900
オリックス	32,100	1,901.00	61,022,100
三菱U F Jリース	12,000	668.00	8,016,000
日本取引所グループ	14,100	2,001.00	28,214,100
イー・ギャランティ	100	3,205.00	320,500
アサックス	100	1,874.00	187,400
N E Cキャピタルソリューション	200	2,235.00	447,000

いちご	6,700	431.00	2,887,700
日本駐車場開発	5,400	181.00	977,400
ヒューリック	10,000	1,245.00	12,450,000
三栄建築設計	200	2,592.00	518,400
スター・マイカ	200	1,675.00	335,000
野村不動産ホールディングス	3,200	2,574.00	8,236,800
三重交通グループホールディングス	900	484.00	435,600
サムティ	400	1,632.00	652,800
ディア・ライフ	400	655.00	262,000
コーセーアールイー	100	1,297.00	129,700
エー・ディー・ワークス	6,000	40.00	240,000
日本商業開発	300	1,710.00	513,000
プレサンスコーポレーション	700	1,476.00	1,033,200
ユニゾホールディングス	600	2,988.00	1,792,800
THEグローバル社	200	794.00	158,800
日本管理センター	300	1,515.00	454,500
サンセイランディック	100	1,027.00	102,700
エストラスト	100	1,227.00	122,700
フージャースホールディングス	600	1,233.00	739,800
オープンハウス	800	5,540.00	4,432,000
東急不動産ホールディングス	11,500	818.00	9,407,000
飯田グループホールディングス	4,000	2,119.00	8,476,000
ムゲンエステート	300	1,162.00	348,600
ファーストブラザーズ	100	1,057.00	105,700
ハウスドゥ	100	2,247.00	224,700
シーアールイー	100	1,565.00	156,500
ケイアイスター不動産	200	2,735.00	547,000
パーク24	2,700	2,858.00	7,716,600
パラカ	200	2,446.00	489,200
三井不動産	24,000	2,550.00	61,200,000
三菱地所	35,800	1,998.00	71,528,400
平和不動産	900	2,105.00	1,894,500
東京建物	5,200	1,590.00	8,268,000
ダイビル	1,200	1,260.00	1,512,000
京阪神ビルディング	800	860.00	688,000
住友不動産	12,000	3,760.00	45,120,000

大京	800	2,205.00	1,764,000
テ-オーシー	1,600	957.00	1,531,200
東京楽天地	100	5,950.00	595,000
レオパレス21	5,800	928.00	5,382,400
スターツコーポレーション	700	2,830.00	1,981,000
フジ住宅	600	857.00	514,200
空港施設	500	658.00	329,000
明和地所	200	863.00	172,600
ゴールドクレスト	400	2,279.00	911,600
日本エスリード	200	2,467.00	493,400
日神不動産	600	924.00	554,400
日本エスコン	800	692.00	553,600
タカラレーベン	2,200	498.00	1,095,600
サンヨーハウジング名古屋	200	1,197.00	239,400
イオンモール	3,100	2,151.00	6,668,100
ファースト住建	200	1,783.00	356,600
ランド	100	16.00	1,600
トーセイ	600	1,097.00	658,200
穴吹興産	100	3,005.00	300,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,000	1,261.00	3,783,000
サンフロンティア不動産	500	1,541.00	770,500
エフ・ジェー・ネクスト	400	1,017.00	406,800
インテリックス	100	1,104.00	110,400
ランドビジネス	100	318.00	31,800
グランディハウス	400	575.00	230,000
日本空港ビルデング	1,400	4,245.00	5,943,000
日本工営	300	3,670.00	1,101,000
LIFULL	1,500	1,034.00	1,551,000
ジェイエイシーリクルートメント	400	2,174.00	869,600
日本M&Aセンター	1,600	5,590.00	8,944,000
メンバーズ	100	720.00	72,000
中広	100	759.00	75,900
タケエイ	500	1,301.00	650,500
トラスト・テック	200	3,475.00	695,000
コシダカホールディングス	200	5,140.00	1,028,000
パソナグループ	400	1,888.00	755,200

C D S	100	1,352.00	135,200
リンクアンドモチベーション	800	860.00	688,000
G C A	500	1,116.00	558,000
エス・エム・エス	900	3,685.00	3,316,500
パーソルホールディングス	4,300	2,712.00	11,661,600
リニカル	300	1,592.00	477,600
クックパッド	1,400	624.00	873,600
エスクリ	100	1,110.00	111,000
アイ・ケイ・ケイ	200	889.00	177,800
学情	200	1,692.00	338,400
スタジオアリス	200	2,772.00	554,400
シミックホールディングス	200	1,788.00	357,600
N J S	100	1,551.00	155,100
総合警備保障	1,900	6,130.00	11,647,000
カカクコム	3,600	1,773.00	6,382,800
アイロムグループ	100	1,624.00	162,400
セントケア・ホールディング	300	823.00	246,900
サイネックス	100	891.00	89,100
ルネサンス	200	1,914.00	382,800
ディップ	600	3,005.00	1,803,000
オプトホールディング	300	1,296.00	388,800
新日本科学	500	581.00	290,500
ツクイ	1,000	1,013.00	1,013,000
キャリアデザインセンター	100	2,456.00	245,600
エムスリー	4,900	3,775.00	18,497,500
ツカダ・グローバルホールディング	300	664.00	199,200
プラス	100	1,162.00	116,200
アウトソーシング	1,300	2,012.00	2,615,600
ウェルネット	400	1,209.00	483,600
ワールドホールディングス	200	3,095.00	619,000
ディー・エヌ・エー	2,500	2,409.00	6,022,500
博報堂D Yホールディングス	6,500	1,515.00	9,847,500
ぐるなび	700	1,358.00	950,600
エスアールジータカミヤ	500	652.00	326,000
ジャパンベストレスキューシステム	500	607.00	303,500
ファンコミュニケーションズ	1,200	964.00	1,156,800

ライク	200	2,347.00	469,400
ビジネス・ブレイクスルー	100	477.00	47,700
WDBホールディングス	200	3,465.00	693,000
ティア	200	1,038.00	207,600
CDG	100	1,909.00	190,900
バリューコマース	400	772.00	308,800
インフォマート	2,300	647.00	1,488,100
J Pホールディングス	1,300	352.00	457,600
エコナックホールディングス	500	125.00	62,500
E P Sホールディングス	700	2,481.00	1,736,700
レグス	100	916.00	91,600
プレステージ・インターナショナル	900	1,378.00	1,240,200
アミューズ	300	3,150.00	945,000
ドリームインキュベータ	100	2,300.00	230,000
クイック	300	1,821.00	546,300
T A C	100	362.00	36,200
ケネディクス	6,400	746.00	4,774,400
電通	5,700	4,960.00	28,272,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	1,252.00	250,400
ぴあ	200	6,750.00	1,350,000
イオンファンタジー	100	4,780.00	478,000
シーティーエス	500	842.00	421,000
ネクシィーズグループ	100	1,850.00	185,000
みらかホールディングス	1,400	4,810.00	6,734,000
アルプス技研	200	3,845.00	769,000
サニックス	600	228.00	136,800
ダイオーズ	100	1,390.00	139,000
日本空調サービス	400	801.00	320,400
オリエンタルランド	5,500	10,670.00	58,685,000
ダスキン	1,200	2,952.00	3,542,400
明光ネットワークジャパン	600	1,344.00	806,400
ファルコホールディングス	200	1,731.00	346,200
秀英予備校	100	482.00	48,200
田谷	100	668.00	66,800
ラウンドワン	1,400	1,796.00	2,514,400
リゾートトラスト	2,000	2,427.00	4,854,000

ビー・エム・エル	600	2,787.00	1,672,200
ワタベウェディング	100	635.00	63,500
りらいあコミュニケーションズ	700	1,274.00	891,800
リソー教育	700	859.00	601,300
早稲田アカデミー	100	1,710.00	171,000
ユー・エス・エス	5,700	2,427.00	13,833,900
東京個別指導学院	100	1,105.00	110,500
サイバーエージェント	3,100	4,150.00	12,865,000
楽天	23,800	1,137.50	27,072,500
クリーク・アンド・リバー社	200	1,146.00	229,200
テー・オー・ダブリュー	400	962.00	384,800
セントラルスポーツ	200	4,295.00	859,000
フルキャストホールディングス	400	2,230.00	892,000
リソルホールディングス	100	3,995.00	399,500
テクノプロ・ホールディングス	800	5,710.00	4,568,000
アトラ	100	693.00	69,300
インターワークス	100	1,137.00	113,700
Keeper 技研	100	1,270.00	127,000
ファーストロジック	100	2,538.00	253,800
三機サービス	100	1,345.00	134,500
デザインワン・ジャパン	100	1,364.00	136,400
イー・ガーディアン	200	2,365.00	473,000
リブセンス	200	499.00	99,800
ジャパンマテリアル	400	3,545.00	1,418,000
ベクトル	600	1,648.00	988,800
ウチヤマホールディングス	300	557.00	167,100
ライクキッズネクスト	100	2,701.00	270,100
キャリアリンク	100	568.00	56,800
I B J	300	1,098.00	329,400
アサンテ	100	1,959.00	195,900
N・フィールド	200	1,478.00	295,600
バリューHR	100	5,190.00	519,000
M&Aキャピタルパートナーズ	100	7,010.00	701,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	1,186.00	237,200
E R Iホールディングス	100	937.00	93,700
アピスト	100	5,390.00	539,000

ウィルグループ	200	1,635.00	327,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	500	596.00	298,000	
日本ビューホテル	100	1,384.00	138,400	
リクルートホールディングス	36,000	2,705.50	97,398,000	
エラン	200	1,314.00	262,800	
土木管理総合試験所	200	829.00	165,800	
日本郵政	26,500	1,285.00	34,052,500	
ベルシステム24ホールディングス	800	1,448.00	1,158,400	
鎌倉新書	100	2,000.00	200,000	
一蔵	100	1,107.00	110,700	
LITALICO	100	2,109.00	210,900	
グローバルグループ	100	1,954.00	195,400	
エボラブルアジア	100	2,200.00	220,000	
ストライク	100	5,120.00	512,000	
ソラスト	300	2,725.00	817,500	
インソース	100	2,842.00	284,200	
リログループ	2,500	2,964.00	7,410,000	
東祥	300	3,510.00	1,053,000	
エイチ・アイ・エス	700	3,985.00	2,789,500	
ラックランド	100	2,260.00	226,000	
共立メンテナンス	800	4,355.00	3,484,000	
イチネンホールディングス	500	1,607.00	803,500	
建設技術研究所	300	1,216.00	364,800	
スペース	200	1,796.00	359,200	
燦ホールディングス	100	3,360.00	336,000	
スバル興業	100	7,600.00	760,000	
東京テアトル	200	1,518.00	303,600	
タナベ経営	100	1,660.00	166,000	
ナガワ	100	4,890.00	489,000	
よみうりランド	100	5,030.00	503,000	
東京都競馬	400	3,855.00	1,542,000	
常磐興産	200	1,885.00	377,000	
カナモト	700	3,580.00	2,506,000	
東京ドーム	1,900	1,116.00	2,120,400	
西尾レントオール	400	3,785.00	1,514,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	1,000	35.00	35,000	

トランス・コスモス	500	2,747.00	1,373,500	
乃村工藝社	1,100	2,572.00	2,829,200	
藤田観光	200	3,615.00	723,000	
KNT - CTホールディングス	300	1,686.00	505,800	
日本管財	500	1,992.00	996,000	
トーカイ	200	4,965.00	993,000	
白洋舎	100	4,085.00	408,500	
セコム	5,000	8,573.00	42,865,000	
セントラル警備保障	200	2,077.00	415,400	
丹青社	900	1,301.00	1,170,900	
メイテック	600	5,760.00	3,456,000	
アサツー ディ・ケイ	900	3,605.00	3,244,500	
応用地質	500	1,494.00	747,000	
船井総研ホールディングス	600	3,725.00	2,235,000	
進学会ホールディングス	300	705.00	211,500	
オオバ	300	511.00	153,300	
いであ	100	1,172.00	117,200	
学究社	100	1,604.00	160,400	
ベネッセホールディングス	1,700	4,155.00	7,063,500	
イオンディライト	600	4,180.00	2,508,000	
ナック	300	970.00	291,000	
ニチイ学館	900	1,470.00	1,323,000	
ダイセキ	800	3,025.00	2,420,000	
ステップ	200	1,742.00	348,400	
合 計	5,866,700		12,639,765,270	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	58,586,545
コール・ローン	85,453,946
国債証券	18,999,120,157
派生商品評価勘定	437,831
未収利息	107,793,393
前払費用	22,295,240
流動資産合計	19,273,687,112
資産合計	19,273,687,112
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,771
未払金	107,192,051
未払解約金	120,000
未払利息	231
流動負債合計	107,334,053
負債合計	107,334,053
純資産の部	
元本等	
元本	19,107,771,611
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,581,448
元本等合計	19,166,353,059
純資産合計	19,166,353,059
負債純資産合計	19,273,687,112

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	8,424,902,552円
期中追加設定元本額	13,942,748,441円
期中一部解約元本額	3,259,879,382円
期末元本額	19,107,771,611円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,992,615,464円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,247,568,087円
りそなラップ型ファンド(成長型)	99,442,293円
DCりそな グローバルバランス	12,285,584円
つみたてバランスファンド	23,060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)	8,755,364,265円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	103,622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)	369,236円
2. 計算日における受益権の総数	19,107,771,611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	1.0031円
(10,000口当たり純資産額)	(10,031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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		94,443,621
合計		94,443,621

(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)

(平成29年12月11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	72,398,385	-	72,818,492	420,107
	米ドル	33,368,391	-	33,590,518	222,127
	カナダドル	2,758,584	-	2,774,818	16,234
	ユーロ	30,360,450	-	30,559,920	199,470
	英ポンド	5,910,960	-	5,893,236	17,724
	売建	2,496,234	-	2,500,281	4,047
	マレーシアリンギット	2,496,234	-	2,500,281	4,047
合計		74,894,619	-	75,318,773	416,060

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	330,000.00	327,840.81	
		US TREASURY N/B	220,000.00	218,981.62	
		US TREASURY N/B	220,000.00	218,938.72	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,087,317.51	
		US TREASURY N/B	210,000.00	208,892.67	
		US TREASURY N/B	290,000.00	286,680.95	
		US TREASURY N/B	280,000.00	277,954.60	
		US TREASURY N/B	480,000.00	478,631.04	
		US TREASURY N/B	240,000.00	237,742.08	
		US TREASURY N/B	350,000.00	349,405.35	
		US TREASURY N/B	280,000.00	278,266.52	
		US TREASURY N/B	930,000.00	919,047.39	
		US TREASURY N/B	500,000.00	499,033.00	
		US TREASURY N/B	250,000.00	246,899.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	508,037.52	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,808.50	
		US TREASURY N/B	260,000.00	256,557.08	
		US TREASURY N/B	390,000.00	385,437.39	
		US TREASURY N/B	250,000.00	247,978.50	
		US TREASURY N/B	230,000.00	226,280.44	
		US TREASURY N/B	610,000.00	601,231.25	
		US TREASURY N/B	330,000.00	329,207.34	

US TREASURY N/B	250,000.00	248,413.00	
US TREASURY N/B	390,000.00	383,380.53	
US TREASURY N/B	400,000.00	398,804.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,263.70	
US TREASURY N/B	350,000.00	344,353.80	
US TREASURY N/B	370,000.00	369,674.77	
US TREASURY N/B	440,000.00	436,682.84	
US TREASURY N/B	380,000.00	374,493.04	
US TREASURY N/B	640,000.00	636,412.80	
US TREASURY N/B	550,000.00	541,685.65	
US TREASURY N/B	250,000.00	257,475.50	
US TREASURY N/B	380,000.00	377,721.52	
US TREASURY N/B	240,000.00	236,250.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,410.10	
US TREASURY N/B	410,000.00	404,330.52	
US TREASURY N/B	200,000.00	198,203.20	
US TREASURY N/B	420,000.00	415,045.26	
US TREASURY N/B	230,000.00	227,789.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	311,543.10	
US TREASURY N/B	480,000.00	475,218.72	
US TREASURY N/B	260,000.00	258,730.42	
US TREASURY N/B	590,000.00	580,585.37	
US TREASURY N/B	230,000.00	228,131.25	
US TREASURY N/B	350,000.00	346,048.85	
US TREASURY N/B	380,000.00	394,784.28	
US TREASURY N/B	290,000.00	287,552.98	
US TREASURY N/B	500,000.00	494,121.00	
US TREASURY N/B	230,000.00	227,960.59	
US TREASURY N/B	690,000.00	685,795.14	
US TREASURY N/B	250,000.00	247,597.75	
US TREASURY N/B	670,000.00	665,668.45	
US TREASURY N/B	450,000.00	458,586.90	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,000.00	
US TREASURY N/B	540,000.00	532,627.92	
US TREASURY N/B	410,000.00	404,410.47	

US TREASURY N/B	480,000.00	473,165.76
US TREASURY N/B	400,000.00	396,929.60
US TREASURY N/B	240,000.00	238,950.00
US TREASURY N/B	430,000.00	423,491.09
US TREASURY N/B	530,000.00	540,579.33
US TREASURY N/B	170,000.00	169,223.10
US TREASURY N/B	210,000.00	210,467.67
US TREASURY N/B	460,000.00	456,002.14
US TREASURY N/B	500,000.00	497,158.00
US TREASURY N/B	490,000.00	481,357.87
US TREASURY N/B	430,000.00	452,213.80
US TREASURY N/B	470,000.00	457,671.90
US TREASURY N/B	400,000.00	390,742.00
US TREASURY N/B	300,000.00	302,583.90
US TREASURY N/B	300,000.00	293,988.30
US TREASURY N/B	280,000.00	282,471.84
US TREASURY N/B	280,000.00	290,489.08
US TREASURY N/B	350,000.00	350,027.30
US TREASURY N/B	560,000.00	548,111.20
US TREASURY N/B	550,000.00	533,295.95
US TREASURY N/B	490,000.00	474,534.62
US TREASURY N/B	400,000.00	401,406.40
US TREASURY N/B	520,000.00	503,028.76
US TREASURY N/B	320,000.00	309,212.48
US TREASURY N/B	250,000.00	250,761.75
US TREASURY N/B	560,000.00	543,265.52
US TREASURY N/B	940,000.00	938,788.34
US TREASURY N/B	300,000.00	296,396.40
US TREASURY N/B	290,000.00	288,232.74
US TREASURY N/B	600,000.00	598,207.20
US TREASURY N/B	300,000.00	293,191.50
US TREASURY N/B	340,000.00	337,190.92
US TREASURY N/B	270,000.00	269,377.65
US TREASURY N/B	320,000.00	315,824.96
US TREASURY N/B	150,000.00	148,690.50

US TREASURY N/B	130,000.00	128,177.01	
US TREASURY N/B	310,000.00	307,112.04	
US TREASURY N/B	920,000.00	906,487.04	
US TREASURY N/B	180,000.00	178,231.68	
US TREASURY N/B	120,000.00	118,310.16	
US TREASURY N/B	210,000.00	207,986.10	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,458.90	
US TREASURY N/B	130,000.00	130,035.49	
US TREASURY N/B	280,000.00	275,488.36	
US TREASURY N/B	490,000.00	487,358.41	
US TREASURY N/B	280,000.00	276,839.08	
US TREASURY N/B	480,000.00	469,781.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,543.10	
US TREASURY N/B	280,000.00	273,678.16	
US TREASURY N/B	270,000.00	265,253.94	
US TREASURY N/B	350,000.00	345,802.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,402.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,089.90	
US TREASURY N/B	330,000.00	322,162.50	
US TREASURY N/B	320,000.00	317,849.92	
US TREASURY N/B	220,000.00	219,664.94	
US TREASURY N/B	260,000.00	254,723.82	
US TREASURY N/B	510,000.00	505,836.36	
US TREASURY N/B	280,000.00	270,703.16	
US TREASURY N/B	290,000.00	280,167.26	
US TREASURY N/B	230,000.00	223,396.47	
US TREASURY N/B	470,000.00	459,479.99	
US TREASURY N/B	230,000.00	223,252.72	
US TREASURY N/B	310,000.00	296,667.52	
US TREASURY N/B	350,000.00	332,308.55	
US TREASURY N/B	460,000.00	467,214.64	
US TREASURY N/B	260,000.00	248,289.86	
US TREASURY N/B	340,000.00	324,460.98	
US TREASURY N/B	250,000.00	241,865.25	
US TREASURY N/B	570,000.00	587,044.14	

US TREASURY N/B	340,000.00	338,253.42	
US TREASURY N/B	270,000.00	270,121.23	
US TREASURY N/B	290,000.00	289,994.20	
US TREASURY N/B	420,000.00	432,001.08	
US TREASURY N/B	240,000.00	238,143.84	
US TREASURY N/B	290,000.00	287,587.20	
US TREASURY N/B	290,000.00	285,349.85	
US TREASURY N/B	620,000.00	628,440.06	
US TREASURY N/B	330,000.00	324,605.16	
US TREASURY N/B	270,000.00	265,406.76	
US TREASURY N/B	270,000.00	267,368.58	
US TREASURY N/B	680,000.00	683,798.48	
US TREASURY N/B	300,000.00	292,447.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,871.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	199,504.00	
US TREASURY N/B	640,000.00	638,187.52	
US TREASURY N/B	630,000.00	617,228.01	
US TREASURY N/B	630,000.00	621,854.10	
US TREASURY N/B	670,000.00	654,440.59	
US TREASURY N/B	650,000.00	645,645.65	
US TREASURY N/B	660,000.00	624,331.62	
US TREASURY N/B	640,000.00	604,087.68	
US TREASURY N/B	640,000.00	596,625.28	
US TREASURY N/B	700,000.00	678,958.70	
US TREASURY N/B	630,000.00	623,072.52	
US TREASURY N/B	620,000.00	619,455.02	
US TREASURY N/B	750,000.00	740,889.00	
US TREASURY N/B	220,000.00	217,443.38	
US TREASURY N/B	150,000.00	193,684.50	
US TREASURY N/B	120,000.00	153,164.04	
US TREASURY N/B	70,000.00	98,541.38	
US TREASURY N/B	190,000.00	252,655.54	
US TREASURY N/B	200,000.00	257,855.40	
US TREASURY N/B	60,000.00	76,658.22	
US TREASURY N/B	200,000.00	259,796.80	

US TREASURY N/B	100,000.00	113,923.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,341.80	
US TREASURY N/B	510,000.00	676,497.15	
US TREASURY N/B	130,000.00	167,113.44	
US TREASURY N/B	140,000.00	168,161.28	
US TREASURY N/B	130,000.00	164,612.50	
US TREASURY N/B	150,000.00	203,144.55	
US TREASURY N/B	130,000.00	167,740.56	
US TREASURY N/B	130,000.00	153,554.83	
US TREASURY N/B	130,000.00	139,183.85	
US TREASURY N/B	180,000.00	192,649.14	
US TREASURY N/B	110,000.00	115,252.94	
US TREASURY N/B	220,000.00	220,352.44	
US TREASURY N/B	520,000.00	520,466.96	
US TREASURY N/B	170,000.00	181,730.68	
US TREASURY N/B	350,000.00	357,929.60	
US TREASURY N/B	360,000.00	418,162.32	
US TREASURY N/B	370,000.00	438,797.06	
US TREASURY N/B	740,000.00	860,827.94	
US TREASURY N/B	190,000.00	212,124.55	
US TREASURY N/B	370,000.00	395,611.03	
US TREASURY N/B	330,000.00	344,927.22	
US TREASURY N/B	430,000.00	407,626.67	
US TREASURY N/B	410,000.00	428,305.68	
US TREASURY N/B	380,000.00	387,659.28	
US TREASURY N/B	410,000.00	428,145.78	
US TREASURY N/B	380,000.00	359,322.68	
US TREASURY N/B	510,000.00	481,969.89	
US TREASURY N/B	380,000.00	340,337.50	
US TREASURY N/B	370,000.00	377,262.73	
US TREASURY N/B	370,000.00	386,469.44	
US TREASURY N/B	380,000.00	396,929.38	
US TREASURY N/B	400,000.00	397,648.40	
US TREASURY N/B	140,000.00	139,302.80	
米ドル 小計	71,460,000.00	71,867,630.31	

カナダドル	GOV OF CANADA	130,000.00	128,715.60
	GOV OF CANADA	100,000.00	100,443.00
	GOV OF CANADA	180,000.00	178,320.60
	GOV OF CANADA	120,000.00	124,000.80
	GOV OF CANADA	170,000.00	167,999.10
	GOV OF CANADA	180,000.00	180,828.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	139,349.00
	GOV OF CANADA	60,000.00	59,649.60
	GOV OF CANADA	220,000.00	219,876.80
	GOV OF CANADA	170,000.00	178,068.20
	GOV OF CANADA	250,000.00	244,732.50
	GOV OF CANADA	200,000.00	194,758.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	116,098.40
	GOV OF CANADA	120,000.00	116,306.40
	GOV OF CANADA	190,000.00	181,203.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	115,231.60
	GOV OF CANADA	130,000.00	126,074.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	90,216.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	138,516.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	146,391.00
	GOV OF CANADA	130,000.00	134,162.60
	GOV OF CANADA	160,000.00	155,870.40
	GOV OF CANADA	110,000.00	101,733.50
	GOV OF CANADA	60,000.00	91,830.00
	GOV OF CANADA	100,000.00	100,807.00
	GOV OF CANADA	90,000.00	125,023.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	178,674.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	174,757.20
	GOV OF CANADA	150,000.00	199,791.00
	GOV OF CANADA	160,000.00	203,456.00
GOV OF CANADA	140,000.00	158,074.00	
GOV OF CANADA	50,000.00	58,899.00	
	カナダドル 小計	4,340,000.00	4,629,855.80 (409,186,655)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	1,720,000.00	1,740,829.20

	UNITED MEXICAN STATE	2,220,000.00	2,132,509.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,860,000.00	2,916,570.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,760,000.00	2,704,441.20
	UNITED MEXICAN STATE	1,990,000.00	1,939,095.80
	UNITED MEXICAN STATE	770,000.00	800,353.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,380,000.00	2,744,639.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,660,000.00	1,506,997.80
	UNITED MEXICAN STATE	1,570,000.00	1,592,482.40
	UNITED MEXICAN STATE	1,060,000.00	1,155,601.40
	UNITED MEXICAN STATE	1,400,000.00	1,441,034.00
	UNITED MEXICAN STATE	810,000.00	832,347.90
	UNITED MEXICAN STATE	1,010,000.00	1,259,894.20
	UNITED MEXICAN STATE	950,000.00	1,042,425.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,860,000.00	1,893,945.00
	UNITED MEXICAN STATE	450,000.00	470,209.05
	メキシコペソ 小計	25,470,000.00	26,173,377.25 (157,040,263)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	106,374.50
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	83,199.20
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	122,046.00
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	134,086.20
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	126,786.44
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	70,658.04
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	81,279.28
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	94,886.80
	GOV OF AUSTRIA	50,000.00	50,422.05
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	144,638.00
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	122,409.65
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	183,719.51
	GOV OF AUSTRIA	50,000.00	69,378.40
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	145,029.64
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	100,614.30
	GOV OF AUSTRIA	80,000.00	125,086.00
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	122,207.50
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	154,760.00

GOV OF AUSTRIA	80,000.00	113,650.40
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	41,062.04
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	69,029.04
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	33,227.16
GOV OF AUSTRIA	20,000.00	18,200.46
GOV OF BELGIUM	110,000.00	116,667.98
GOV OF BELGIUM	140,000.00	149,207.52
GOV OF BELGIUM	190,000.00	213,281.65
GOV OF BELGIUM	160,000.00	188,999.84
GOV OF BELGIUM	140,000.00	166,807.76
GOV OF BELGIUM	140,000.00	170,970.80
GOV OF BELGIUM	140,000.00	159,088.44
GOV OF BELGIUM	50,000.00	50,886.60
GOV OF BELGIUM	120,000.00	140,503.44
GOV OF BELGIUM	70,000.00	72,051.00
GOV OF BELGIUM	200,000.00	209,327.60
GOV OF BELGIUM	100,000.00	135,400.30
GOV OF BELGIUM	170,000.00	179,569.13
GOV OF BELGIUM	130,000.00	133,713.32
GOV OF BELGIUM	140,000.00	211,238.58
GOV OF BELGIUM	200,000.00	203,485.20
GOV OF BELGIUM	60,000.00	85,574.04
GOV OF BELGIUM	120,000.00	156,064.92
GOV OF BELGIUM	170,000.00	278,142.61
GOV OF BELGIUM	20,000.00	20,892.58
GOV OF BELGIUM	120,000.00	134,591.88
GOV OF BELGIUM	130,000.00	207,994.02
GOV OF BELGIUM	100,000.00	152,854.40
GOV OF BELGIUM	70,000.00	70,958.02
GOV OF BELGIUM	20,000.00	22,982.88
GOV OF BELGIUM	20,000.00	22,179.12
GOV OF FINLAND	110,000.00	118,833.99
GOV OF FINLAND	110,000.00	112,988.81
GOV OF FINLAND	40,000.00	45,423.28
GOV OF FINLAND	30,000.00	30,452.52

GOV OF FINLAND	60,000.00	65,585.64	
GOV OF FINLAND	50,000.00	54,510.60	
GOV OF FINLAND	40,000.00	40,225.08	
GOV OF FINLAND	40,000.00	45,117.20	
GOV OF FINLAND	110,000.00	116,019.31	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,263.00	
GOV OF FINLAND	40,000.00	40,202.04	
GOV OF FINLAND	30,000.00	37,052.07	
GOV OF FINLAND	70,000.00	70,278.95	
GOV OF FINLAND	40,000.00	53,851.60	
GOV OF FRANCE	280,000.00	282,393.16	
GOV OF FRANCE	180,000.00	192,283.74	
GOV OF FRANCE	250,000.00	256,214.75	
GOV OF FRANCE	270,000.00	292,768.29	
GOV OF FRANCE	370,000.00	378,590.29	
GOV OF FRANCE	170,000.00	172,343.62	
GOV OF FRANCE	170,000.00	186,742.62	
GOV OF FRANCE	480,000.00	487,162.08	
GOV OF FRANCE	290,000.00	315,749.97	
GOV OF FRANCE	470,000.00	480,857.00	
GOV OF FRANCE	380,000.00	435,043.00	
GOV OF FRANCE	230,000.00	233,642.05	
GOV OF FRANCE	400,000.00	457,586.00	
GOV OF FRANCE	440,000.00	505,149.04	
GOV OF FRANCE	240,000.00	243,270.00	
GOV OF FRANCE	320,000.00	359,452.80	
GOV OF FRANCE	160,000.00	161,360.00	
GOV OF FRANCE	460,000.00	508,701.58	
GOV OF FRANCE	430,000.00	541,835.69	
GOV OF FRANCE	330,000.00	378,931.74	
GOV OF FRANCE	350,000.00	391,291.25	
GOV OF FRANCE	320,000.00	328,916.48	
GOV OF FRANCE	290,000.00	424,470.68	
GOV OF FRANCE	310,000.00	329,597.58	
GOV OF FRANCE	290,000.00	369,109.68	

GOV OF FRANCE	350,000.00	356,199.55	
GOV OF FRANCE	280,000.00	276,993.08	
GOV OF FRANCE	320,000.00	335,753.60	
GOV OF FRANCE	390,000.00	474,842.55	
GOV OF FRANCE	100,000.00	101,307.60	
GOV OF FRANCE	300,000.00	460,485.00	
GOV OF FRANCE	330,000.00	397,094.94	
GOV OF FRANCE	320,000.00	345,150.72	
GOV OF FRANCE	320,000.00	536,223.68	
GOV OF FRANCE	260,000.00	413,357.62	
GOV OF FRANCE	220,000.00	222,033.24	
GOV OF FRANCE	250,000.00	378,582.75	
GOV OF FRANCE	120,000.00	130,335.48	
GOV OF FRANCE	300,000.00	492,868.50	
GOV OF FRANCE	240,000.00	335,142.00	
GOV OF FRANCE	150,000.00	164,584.80	
GOV OF FRANCE	140,000.00	230,589.24	
GOV OF FRANCE	130,000.00	220,277.20	
GOV OF FRANCE	70,000.00	70,074.20	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,199.85	
GOV OF GERMANY	150,000.00	157,371.00	
GOV OF GERMANY	290,000.00	296,347.23	
GOV OF GERMANY	100,000.00	101,032.10	
GOV OF GERMANY	130,000.00	132,304.64	
GOV OF GERMANY	150,000.00	151,862.40	
GOV OF GERMANY	180,000.00	192,235.14	
GOV OF GERMANY	140,000.00	141,950.90	
GOV OF GERMANY	190,000.00	193,641.73	
GOV OF GERMANY	200,000.00	216,741.00	
GOV OF GERMANY	230,000.00	233,906.55	
GOV OF GERMANY	230,000.00	252,051.71	
GOV OF GERMANY	160,000.00	172,969.12	
GOV OF GERMANY	230,000.00	236,060.96	
GOV OF GERMANY	190,000.00	208,556.73	
GOV OF GERMANY	230,000.00	234,694.30	

GOV OF GERMANY	190,000.00	216,314.05	
GOV OF GERMANY	160,000.00	176,990.88	
GOV OF GERMANY	170,000.00	173,542.29	
GOV OF GERMANY	200,000.00	220,645.80	
GOV OF GERMANY	200,000.00	204,051.00	
GOV OF GERMANY	220,000.00	242,327.36	
GOV OF GERMANY	190,000.00	207,447.51	
GOV OF GERMANY	170,000.00	173,114.91	
GOV OF GERMANY	160,000.00	175,334.56	
GOV OF GERMANY	180,000.00	197,632.80	
GOV OF GERMANY	180,000.00	203,170.68	
GOV OF GERMANY	260,000.00	291,358.86	
GOV OF GERMANY	210,000.00	232,422.96	
GOV OF GERMANY	190,000.00	204,279.45	
GOV OF GERMANY	240,000.00	249,552.00	
GOV OF GERMANY	230,000.00	247,664.23	
GOV OF GERMANY	310,000.00	320,787.07	
GOV OF GERMANY	260,000.00	256,701.38	
GOV OF GERMANY	240,000.00	240,682.08	
GOV OF GERMANY	110,000.00	175,136.50	
GOV OF GERMANY	250,000.00	254,764.25	
GOV OF GERMANY	140,000.00	214,018.84	
GOV OF GERMANY	130,000.00	189,058.74	
GOV OF GERMANY	60,000.00	100,882.56	
GOV OF GERMANY	200,000.00	325,466.60	
GOV OF GERMANY	220,000.00	358,769.62	
GOV OF GERMANY	220,000.00	343,094.18	
GOV OF GERMANY	150,000.00	248,936.25	
GOV OF GERMANY	150,000.00	267,527.85	
GOV OF GERMANY	140,000.00	209,104.00	
GOV OF GERMANY	230,000.00	307,374.07	
GOV OF GERMANY	220,000.00	297,103.84	
GOV OF GERMANY	30,000.00	30,864.24	
GOV OF IRELAND	100,000.00	107,700.20	
GOV OF IRELAND	50,000.00	56,104.75	

GOV OF IRELAND	90,000.00	100,966.86	
GOV OF IRELAND	80,000.00	92,869.20	
GOV OF IRELAND	60,000.00	62,813.82	
GOV OF IRELAND	40,000.00	40,292.72	
GOV OF IRELAND	70,000.00	84,759.50	
GOV OF IRELAND	80,000.00	96,635.28	
GOV OF IRELAND	120,000.00	164,179.20	
GOV OF IRELAND	120,000.00	125,115.00	
GOV OF IRELAND	80,000.00	93,676.80	
GOV OF IRELAND	40,000.00	42,152.80	
GOV OF IRELAND	80,000.00	86,731.60	
GOV OF ITALY	170,000.00	176,466.63	
GOV OF ITALY	140,000.00	148,378.30	
GOV OF ITALY	280,000.00	281,847.72	
GOV OF ITALY	260,000.00	270,455.12	
GOV OF ITALY	110,000.00	113,404.06	
GOV OF ITALY	330,000.00	356,379.54	
GOV OF ITALY	150,000.00	151,145.85	
GOV OF ITALY	140,000.00	143,866.80	
GOV OF ITALY	160,000.00	176,568.80	
GOV OF ITALY	100,000.00	110,202.30	
GOV OF ITALY	390,000.00	398,853.00	
GOV OF ITALY	160,000.00	162,224.96	
GOV OF ITALY	230,000.00	256,162.96	
GOV OF ITALY	80,000.00	80,747.76	
GOV OF ITALY	220,000.00	224,917.00	
GOV OF ITALY	210,000.00	235,696.65	
GOV OF ITALY	230,000.00	259,231.85	
GOV OF ITALY	230,000.00	233,656.54	
GOV OF ITALY	250,000.00	283,310.50	
GOV OF ITALY	120,000.00	140,734.08	
GOV OF ITALY	230,000.00	232,183.62	
GOV OF ITALY	270,000.00	291,222.81	
GOV OF ITALY	170,000.00	203,905.65	
GOV OF ITALY	180,000.00	186,930.72	

GOV OF ITALY	170,000.00	177,599.34	
GOV OF ITALY	130,000.00	133,053.44	
GOV OF ITALY	80,000.00	99,153.84	
GOV OF ITALY	310,000.00	325,094.52	
GOV OF ITALY	190,000.00	236,409.59	
GOV OF ITALY	270,000.00	275,400.00	
GOV OF ITALY	90,000.00	108,646.65	
GOV OF ITALY	360,000.00	441,816.84	
GOV OF ITALY	250,000.00	248,637.00	
GOV OF ITALY	210,000.00	256,130.70	
GOV OF ITALY	200,000.00	211,383.20	
GOV OF ITALY	190,000.00	223,715.50	
GOV OF ITALY	40,000.00	41,008.80	
GOV OF ITALY	230,000.00	251,959.02	
GOV OF ITALY	210,000.00	266,501.76	
GOV OF ITALY	180,000.00	183,843.72	
GOV OF ITALY	220,000.00	231,359.04	
GOV OF ITALY	210,000.00	261,557.52	
GOV OF ITALY	270,000.00	273,766.77	
GOV OF ITALY	280,000.00	274,701.84	
GOV OF ITALY	190,000.00	200,256.39	
GOV OF ITALY	130,000.00	134,875.26	
GOV OF ITALY	260,000.00	376,364.04	
GOV OF ITALY	220,000.00	284,271.24	
GOV OF ITALY	350,000.00	476,161.00	
GOV OF ITALY	230,000.00	268,544.32	
GOV OF ITALY	170,000.00	249,061.05	
GOV OF ITALY	250,000.00	236,609.00	
GOV OF ITALY	220,000.00	320,817.64	
GOV OF ITALY	100,000.00	102,781.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	275,445.00	
GOV OF ITALY	160,000.00	156,776.00	
GOV OF ITALY	300,000.00	372,594.60	
GOV OF ITALY	200,000.00	280,655.40	
GOV OF ITALY	210,000.00	292,344.99	

GOV OF ITALY	170,000.00	233,080.03	
GOV OF ITALY	130,000.00	142,355.46	
GOV OF ITALY	150,000.00	147,434.25	
GOV OF ITALY	90,000.00	100,359.00	
GOV OF ITALY	50,000.00	46,957.30	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	153,379.50	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	172,236.00	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	163,255.84	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	144,172.34	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	170,743.35	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	172,976.70	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	145,880.28	
GOV OF NETHERLANDS	100,000.00	120,854.70	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	199,842.12	
GOV OF NETHERLANDS	60,000.00	60,351.18	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	181,871.68	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	161,844.64	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	153,411.45	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	175,782.72	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	181,123.32	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	162,555.38	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	233,278.80	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	222,395.04	
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	181,801.62	
GOV OF SPAIN	220,000.00	221,580.26	
GOV OF SPAIN	170,000.00	177,382.93	
GOV OF SPAIN	200,000.00	216,241.00	
GOV OF SPAIN	170,000.00	184,988.05	
GOV OF SPAIN	350,000.00	362,636.05	
GOV OF SPAIN	90,000.00	99,149.49	
GOV OF SPAIN	310,000.00	321,062.97	
GOV OF SPAIN	140,000.00	160,229.02	
GOV OF SPAIN	80,000.00	80,289.68	
GOV OF SPAIN	230,000.00	273,166.17	
GOV OF SPAIN	230,000.00	236,502.79	

	GOV OF SPAIN	210,000.00	260,309.07	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	252,982.75	
	GOV OF SPAIN	70,000.00	70,559.86	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	264,121.62	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	281,887.31	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	213,427.69	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	251,662.11	
	GOV OF SPAIN	220,000.00	249,769.96	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	189,778.14	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	268,265.76	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	271,797.75	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	192,152.70	
	GOV OF SPAIN	190,000.00	264,636.56	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	242,706.72	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	183,604.68	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	160,998.08	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	218,182.56	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	335,132.54	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	235,306.10	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	269,580.06	
	GOV OF SPAIN	70,000.00	72,858.66	
	GOV OF SPAIN	190,000.00	249,832.90	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	230,888.00	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	226,310.72	
	GOV OF SPAIN	130,000.00	195,067.47	
	GOV OF SPAIN	120,000.00	126,240.60	
	GOV OF SPAIN	90,000.00	100,831.50	
	ユーロ 小計	50,940,000.00	59,004,244.09 (7,894,767,859)	
英ポンド	UK TREASURY	170,000.00	178,473.31	
	UK TREASURY	260,000.00	265,236.40	
	UK TREASURY	200,000.00	211,410.00	
	UK TREASURY	170,000.00	186,204.40	
	UK TREASURY	250,000.00	259,462.50	
	UK TREASURY	170,000.00	184,926.00	

UK TREASURY	340,000.00	349,419.02	
UK TREASURY	210,000.00	234,234.00	
UK TREASURY	80,000.00	91,144.00	
UK TREASURY	290,000.00	286,507.53	
UK TREASURY	250,000.00	261,468.00	
UK TREASURY	150,000.00	148,648.80	
UK TREASURY	160,000.00	172,224.00	
UK TREASURY	150,000.00	167,238.00	
UK TREASURY	180,000.00	230,004.00	
UK TREASURY	200,000.00	213,620.80	
UK TREASURY	200,000.00	205,340.00	
UK TREASURY	220,000.00	218,911.00	
UK TREASURY	120,000.00	153,357.00	
UK TREASURY	70,000.00	103,317.48	
UK TREASURY	170,000.00	234,978.76	
UK TREASURY	160,000.00	214,784.64	
UK TREASURY	240,000.00	337,751.04	
UK TREASURY	190,000.00	264,132.30	
UK TREASURY	80,000.00	78,991.92	
UK TREASURY	160,000.00	242,257.92	
UK TREASURY	120,000.00	172,003.92	
UK TREASURY	190,000.00	275,541.80	
UK TREASURY	160,000.00	244,313.60	
UK TREASURY	230,000.00	294,814.00	
UK TREASURY	280,000.00	376,348.00	
UK TREASURY	150,000.00	230,005.50	
UK TREASURY	170,000.00	156,745.44	
UK TREASURY	130,000.00	206,831.30	
UK TREASURY	170,000.00	256,982.88	
UK TREASURY	150,000.00	255,307.50	
UK TREASURY	110,000.00	111,266.10	
UK TREASURY	130,000.00	220,431.38	
UK TREASURY	180,000.00	229,618.44	
UK TREASURY	170,000.00	277,310.80	
英bond 小計	7,180,000.00	8,801,563.48	(1,340,390,102)

スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	930,000.00	990,070.56
	GOV OF SWEDEN	900,000.00	1,048,787.10
	GOV OF SWEDEN	1,080,000.00	1,261,971.36
	GOV OF SWEDEN	860,000.00	935,071.98
	GOV OF SWEDEN	620,000.00	723,726.00
	GOV OF SWEDEN	620,000.00	650,637.92
	GOV OF SWEDEN	530,000.00	534,125.52
	GOV OF SWEDEN	410,000.00	569,364.13
スウェーデンクローナ 小計		5,950,000.00	6,713,754.57 (90,232,861)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	870,000.00	920,247.72
	GOV OF NORWAY	640,000.00	703,062.40
	GOV OF NORWAY	650,000.00	680,860.70
	GOV OF NORWAY	240,000.00	266,122.80
	GOV OF NORWAY	450,000.00	463,884.75
	GOV OF NORWAY	440,000.00	444,236.32
	GOV OF NORWAY	340,000.00	348,056.64
ノルウェークローネ 小計		3,630,000.00	3,826,471.33 (52,346,127)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	860,000.00	937,253.80
	GOV OF DENMARK	200,000.00	204,558.40
	GOV OF DENMARK	880,000.00	998,477.04
	GOV OF DENMARK	580,000.00	636,159.08
	GOV OF DENMARK	990,000.00	1,120,116.69
	GOV OF DENMARK	430,000.00	435,239.12
	GOV OF DENMARK	1,250,000.00	2,144,672.50
デンマーククローネ 小計		5,190,000.00	6,476,476.63 (116,447,049)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	340,000.00	349,384.00
	GOV OF POLAND	160,000.00	171,360.00
	GOV OF POLAND	320,000.00	317,664.00
	GOV OF POLAND	200,000.00	218,260.00
	GOV OF POLAND	320,000.00	318,080.00
	GOV OF POLAND	350,000.00	343,805.00
	GOV OF POLAND	180,000.00	203,004.00

	GOV OF POLAND	200,000.00	198,140.00
	GOV OF POLAND	310,000.00	354,485.00
	GOV OF POLAND	260,000.00	277,251.00
	GOV OF POLAND	280,000.00	283,570.00
	GOV OF POLAND	410,000.00	390,176.50
	GOV OF POLAND	310,000.00	291,291.50
	GOV OF POLAND	80,000.00	100,580.00
	ポーランドズロチ 小計	3,720,000.00	3,817,051.00 (121,687,585)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	177,367.29
	GOV OF AUSTRALIA	290,000.00	295,005.40
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	254,418.00
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	268,472.88
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	348,409.00
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	159,533.60
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	254,709.84
	GOV OF AUSTRALIA	30,000.00	30,097.98
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	268,087.08
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	266,705.14
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	285,556.86
	GOV OF AUSTRALIA	300,000.00	340,501.80
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	320,618.79
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	275,296.86
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	252,466.76
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	202,971.00
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	201,698.49
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	157,349.92
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	68,113.29
	GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	121,939.51
	GOV OF AUSTRALIA	60,000.00	61,433.16
	GOV OF AUSTRALIA	100,000.00	95,026.00
	オーストラリアドル 小計	4,410,000.00	4,705,778.65 (401,920,554)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,048.95
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	70,154.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,360.00

	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	62,712.00	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	61,224.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,577.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,139.50	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	53,240.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	31,500.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	42,720.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,960.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	40,480.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	56,073.50	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,900.00	
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	21,340.00	
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	22,617.80	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,448.75	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	31,485.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,675.50	
	シンガポールドドル 小計	850,000.00	883,656.00 (74,200,594)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,032.40	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	276,210.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,450.00	
	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	110,841.39	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	122,760.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,200.00	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,342.88	
	GOV OF MALAYSIA	50,000.00	49,296.80	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,022.80	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	157,409.28	
	GOV OF MALAYSIA	30,000.00	30,048.36	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,500.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,729.40	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	247,553.50	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,159.80	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	176,945.04	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	119,157.60	

	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	152,220.96	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	169,830.00	
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	84,216.60	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	67,424.35	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	80,400.00	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	78,298.40	
	マレーシアリングット 小計	2,780,000.00	2,769,049.56	(77,007,268)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	270,000.00	270,931.50	
	GOV OF SOUTH AFRICA	480,000.00	472,425.60	
	GOV OF SOUTH AFRICA	540,000.00	515,349.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	830,000.00	799,281.70	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	2,087,246.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,030,000.00	906,586.43	
	GOV OF SOUTH AFRICA	890,000.00	710,104.30	
	GOV OF SOUTH AFRICA	790,000.00	693,554.43	
	GOV OF SOUTH AFRICA	640,000.00	580,714.88	
	GOV OF SOUTH AFRICA	730,000.00	505,107.44	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,040,000.00	901,164.16	
	GOV OF SOUTH AFRICA	550,000.00	492,700.45	
	GOV OF SOUTH AFRICA	800,000.00	542,440.00	
	GOV OF SOUTH AFRICA	830,000.00	718,336.78	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,570,000.00	1,358,992.00	
	南アフリカランド 小計	12,930,000.00	11,554,934.67	(96,137,056)
合計			18,999,120,157	(18,999,120,157)

(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 196銘柄	100.0%	42.9%

カナダドル	国債証券	32銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	290銘柄	100.0%	41.6%
英ポンド	国債証券	40銘柄	100.0%	7.1%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.6%
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	22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券	23銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	147,283,911
コール・ローン	241,926,653
国債証券	39,232,674,934
派生商品評価勘定	3,070,668
未収利息	218,786,557
前払費用	59,238,944
流動資産合計	39,902,981,667
資産合計	39,902,981,667
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	412,612,136

平成29年12月11日現在

未払金	339,148,547
未払利息	656
流動負債合計	751,761,339
負債合計	751,761,339
純資産の部	
元本等	
元本	40,017,360,273
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	866,139,945
元本等合計	39,151,220,328
純資産合計	39,151,220,328
負債純資産合計	39,902,981,667

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月11日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	199,600,000円
期中追加設定元本額	40,017,391,356円
期中一部解約元本額	199,631,083円
期末元本額	40,017,360,273円
期末元本の内訳	
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）	29,607,827,353円
S m a r t - i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	306,372円

先進国債券インデックスファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	10,408,260,639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）	965,909円
2. 計算日における受益権の総数	40,017,360,273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	866,139,945円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9784円
(10,000口当たり純資産額)	(9,784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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		95,181,326
合計		95,181,326

(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)

(平成29年12月11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	229,255,045	-	230,748,584	1,493,539
	米ドル	77,286,350	-	77,805,970	519,620

メキシコペソ	20,208,033	-	20,266,566	58,533
ユーロ	69,415,051	-	69,843,600	428,549
英ポンド	19,176,018	-	19,400,472	224,454
スウェーデンク ローナ	22,053,360	-	22,201,536	148,176
オーストラリアド ル	21,116,233	-	21,230,440	114,207
売建	39,015,058,225	-	39,426,093,232	411,035,007
米ドル	16,663,687,076	-	16,907,607,720	243,920,644
カナダドル	835,986,871	-	848,674,640	12,687,769
メキシコペソ	349,648,713	-	348,370,880	1,277,833
ユーロ	16,251,872,652	-	16,362,822,040	110,949,388
英ポンド	2,750,239,908	-	2,780,663,600	30,423,692
スウェーデンク ローナ	191,640,795	-	192,380,160	739,365
ノルウェークロー ネ	115,330,965	-	115,962,610	631,645
デンマーククロー ネ	232,959,852	-	232,876,960	82,892
ポーランドズロチ	253,514,221	-	255,549,060	2,034,839
オーストラリアド ル	847,455,929	-	851,849,390	4,393,461
シンガポールドル	156,781,394	-	158,170,350	1,388,956
マレーシアリン ギット	172,261,634	-	174,879,122	2,617,488
南アフリカランド	193,678,215	-	196,286,700	2,608,485
合計	39,244,313,270	-	39,656,841,816	409,541,468

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,221,952.11	
		US TREASURY N/B	410,000.00	408,102.11	
		US TREASURY N/B	1,630,000.00	1,622,136.88	
		US TREASURY N/B	520,000.00	516,668.88	
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,057,391.34	
		US TREASURY N/B	550,000.00	547,099.85	
		US TREASURY N/B	980,000.00	968,783.90	
		US TREASURY N/B	600,000.00	595,617.00	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,086,891.32	
		US TREASURY N/B	460,000.00	455,672.32	
		US TREASURY N/B	880,000.00	878,504.88	
		US TREASURY N/B	510,000.00	506,842.59	
		US TREASURY N/B	530,000.00	523,758.19	
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,347,389.10	
		US TREASURY N/B	380,000.00	375,287.24	
		US TREASURY N/B	650,000.00	662,593.75	
		US TREASURY N/B	960,000.00	956,305.92	
		US TREASURY N/B	460,000.00	456,639.70	
		US TREASURY N/B	460,000.00	453,908.68	
		US TREASURY N/B	480,000.00	474,384.48	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,071,267.12	
		US TREASURY N/B	630,000.00	619,811.64	
		US TREASURY N/B	250,000.00	246,406.25	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,087,381.82	
US TREASURY N/B	480,000.00	476,952.96			

US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,277,935.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,012.00	
US TREASURY N/B	470,000.00	465,713.13	
US TREASURY N/B	400,000.00	393,547.20	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,079,050.68	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,230.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	394,203.20	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,441,872.75	
US TREASURY N/B	650,000.00	640,173.95	
US TREASURY N/B	470,000.00	484,053.94	
US TREASURY N/B	620,000.00	616,282.48	
US TREASURY N/B	700,000.00	689,062.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	396,546.80	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,242,576.72	
US TREASURY N/B	560,000.00	554,968.96	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,146,315.48	
US TREASURY N/B	510,000.00	505,099.41	
US TREASURY N/B	880,000.00	913,859.76	
US TREASURY N/B	990,000.00	980,138.61	
US TREASURY N/B	400,000.00	398,046.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,043.00	
US TREASURY N/B	520,000.00	515,775.00	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,166,678.98	
US TREASURY N/B	700,000.00	727,234.20	
US TREASURY N/B	360,000.00	356,962.32	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,353,891.54	
US TREASURY N/B	560,000.00	555,034.48	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,321,894.98	
US TREASURY N/B	500,000.00	495,195.50	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,202,177.35	
US TREASURY N/B	700,000.00	713,357.40	
US TREASURY N/B	580,000.00	574,200.00	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,124,436.72	
US TREASURY N/B	440,000.00	434,001.48	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,064,622.96	

US TREASURY N/B	500,000.00	496,162.00	
US TREASURY N/B	430,000.00	428,118.75	
US TREASURY N/B	780,000.00	768,193.14	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,213,753.59	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,715.00	
US TREASURY N/B	560,000.00	561,247.12	
US TREASURY N/B	680,000.00	674,090.12	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,103,690.76	
US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,188,659.23	
US TREASURY N/B	910,000.00	957,010.60	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,256,163.30	
US TREASURY N/B	620,000.00	605,650.10	
US TREASURY N/B	600,000.00	605,167.80	
US TREASURY N/B	650,000.00	636,974.65	
US TREASURY N/B	630,000.00	635,561.64	
US TREASURY N/B	560,000.00	580,978.16	
US TREASURY N/B	600,000.00	600,046.80	
US TREASURY N/B	770,000.00	753,652.90	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,231,428.83	
US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,210,547.50	
US TREASURY N/B	870,000.00	873,058.92	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,131,814.71	
US TREASURY N/B	840,000.00	811,682.76	
US TREASURY N/B	510,000.00	511,553.97	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,076,829.87	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,338,272.74	
US TREASURY N/B	700,000.00	691,591.60	
US TREASURY N/B	570,000.00	566,526.42	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,435,697.28	
US TREASURY N/B	640,000.00	625,475.20	
US TREASURY N/B	540,000.00	535,538.52	
US TREASURY N/B	610,000.00	608,593.95	
US TREASURY N/B	650,000.00	641,519.45	
US TREASURY N/B	550,000.00	545,198.50	
US TREASURY N/B	600,000.00	591,586.20	

US TREASURY N/B	600,000.00	594,410.40
US TREASURY N/B	730,000.00	719,277.76
US TREASURY N/B	610,000.00	604,007.36
US TREASURY N/B	400,000.00	394,367.20
US TREASURY N/B	650,000.00	643,766.50
US TREASURY N/B	760,000.00	748,495.88
US TREASURY N/B	440,000.00	440,120.12
US TREASURY N/B	700,000.00	688,720.90
US TREASURY N/B	730,000.00	726,064.57
US TREASURY N/B	600,000.00	593,226.60
US TREASURY N/B	630,000.00	616,587.93
US TREASURY N/B	560,000.00	553,547.12
US TREASURY N/B	710,000.00	693,969.62
US TREASURY N/B	520,000.00	510,859.44
US TREASURY N/B	650,000.00	642,205.20
US TREASURY N/B	520,000.00	513,764.16
US TREASURY N/B	640,000.00	635,925.12
US TREASURY N/B	630,000.00	615,037.50
US TREASURY N/B	840,000.00	834,356.04
US TREASURY N/B	680,000.00	678,964.36
US TREASURY N/B	460,000.00	450,665.22
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,031,509.44
US TREASURY N/B	850,000.00	821,777.45
US TREASURY N/B	520,000.00	502,368.88
US TREASURY N/B	580,000.00	563,347.62
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,114,483.38
US TREASURY N/B	500,000.00	485,332.00
US TREASURY N/B	440,000.00	421,076.48
US TREASURY N/B	600,000.00	569,671.80
US TREASURY N/B	970,000.00	985,213.48
US TREASURY N/B	580,000.00	553,877.38
US TREASURY N/B	580,000.00	553,492.26
US TREASURY N/B	550,000.00	532,103.55
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,101,995.14
US TREASURY N/B	600,000.00	596,917.80

US TREASURY N/B	560,000.00	560,251.44
US TREASURY N/B	600,000.00	599,988.00
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,110,859.92
US TREASURY N/B	510,000.00	506,055.66
US TREASURY N/B	500,000.00	495,840.00
US TREASURY N/B	570,000.00	560,860.05
US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,297,424.64
US TREASURY N/B	610,000.00	600,027.72
US TREASURY N/B	590,000.00	579,962.92
US TREASURY N/B	480,000.00	475,321.92
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,357,541.10
US TREASURY N/B	670,000.00	653,132.08
US TREASURY N/B	550,000.00	544,263.50
US TREASURY N/B	660,000.00	658,363.20
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,336,205.12
US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,214,861.48
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,312,803.10
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,406,558.88
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,311,157.32
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,333,799.37
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,264,808.58
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,202,572.83
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,377,316.22
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,345,045.44
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,228,918.83
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,373,114.28
US TREASURY N/B	550,000.00	543,608.45
US TREASURY N/B	110,000.00	142,035.30
US TREASURY N/B	380,000.00	485,019.46
US TREASURY N/B	130,000.00	183,005.42
US TREASURY N/B	230,000.00	305,846.18
US TREASURY N/B	480,000.00	618,852.96
US TREASURY N/B	190,000.00	242,751.03
US TREASURY N/B	100,000.00	129,898.40
US TREASURY N/B	260,000.00	296,201.88

US TREASURY N/B	170,000.00	214,442.42
US TREASURY N/B	340,000.00	443,162.12
US TREASURY N/B	330,000.00	423,437.85
US TREASURY N/B	500,000.00	663,232.50
US TREASURY N/B	380,000.00	488,485.44
US TREASURY N/B	370,000.00	444,426.24
US TREASURY N/B	300,000.00	379,875.00
US TREASURY N/B	400,000.00	541,718.80
US TREASURY N/B	260,000.00	335,481.12
US TREASURY N/B	290,000.00	342,545.39
US TREASURY N/B	290,000.00	310,487.05
US TREASURY N/B	410,000.00	438,811.93
US TREASURY N/B	250,000.00	261,938.50
US TREASURY N/B	500,000.00	500,801.00
US TREASURY N/B	530,000.00	530,475.94
US TREASURY N/B	630,000.00	673,472.52
US TREASURY N/B	830,000.00	848,804.48
US TREASURY N/B	750,000.00	871,171.50
US TREASURY N/B	800,000.00	948,750.40
US TREASURY N/B	860,000.00	1,000,421.66
US TREASURY N/B	850,000.00	948,978.25
US TREASURY N/B	800,000.00	855,375.20
US TREASURY N/B	880,000.00	919,805.92
US TREASURY N/B	860,000.00	815,253.34
US TREASURY N/B	900,000.00	940,183.20
US TREASURY N/B	910,000.00	928,341.96
US TREASURY N/B	780,000.00	814,521.24
US TREASURY N/B	760,000.00	718,645.36
US TREASURY N/B	790,000.00	746,580.81
US TREASURY N/B	810,000.00	725,456.25
US TREASURY N/B	800,000.00	815,703.20
US TREASURY N/B	720,000.00	752,048.64
US TREASURY N/B	840,000.00	877,422.84
US TREASURY N/B	790,000.00	785,355.59
US TREASURY N/B	340,000.00	338,306.80

	米ドル 小計	147,490,000.00	148,339,396.79 (16,858,772,445)
カナダドル	GOV OF CANADA	350,000.00	346,542.00
	GOV OF CANADA	190,000.00	190,841.70
	GOV OF CANADA	290,000.00	287,294.30
	GOV OF CANADA	380,000.00	392,669.20
	GOV OF CANADA	280,000.00	276,704.40
	GOV OF CANADA	360,000.00	361,656.00
	GOV OF CANADA	290,000.00	288,651.50
	GOV OF CANADA	160,000.00	159,065.60
	GOV OF CANADA	420,000.00	419,764.80
	GOV OF CANADA	300,000.00	314,238.00
	GOV OF CANADA	550,000.00	538,411.50
	GOV OF CANADA	400,000.00	389,516.00
	GOV OF CANADA	220,000.00	232,196.80
	GOV OF CANADA	330,000.00	319,842.60
	GOV OF CANADA	310,000.00	295,647.00
	GOV OF CANADA	290,000.00	303,792.40
	GOV OF CANADA	290,000.00	281,242.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	150,360.00
	GOV OF CANADA	290,000.00	286,926.00
	GOV OF CANADA	280,000.00	292,782.00
	GOV OF CANADA	270,000.00	278,645.40
	GOV OF CANADA	290,000.00	282,515.10
	GOV OF CANADA	400,000.00	369,940.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	141,129.80
	GOV OF CANADA	180,000.00	250,047.00
	GOV OF CANADA	230,000.00	342,458.50
	GOV OF CANADA	290,000.00	422,329.90
GOV OF CANADA	330,000.00	439,540.20	
GOV OF CANADA	320,000.00	406,912.00	
GOV OF CANADA	300,000.00	338,730.00	
GOV OF CANADA	100,000.00	117,798.00	
	カナダドル 小計	8,980,000.00	9,518,189.70 (841,217,605)

メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,900,000.00	3,947,229.00	
	UNITED MEXICAN STATE	4,590,000.00	4,409,108.10	
	UNITED MEXICAN STATE	5,530,000.00	5,639,383.40	
	UNITED MEXICAN STATE	6,360,000.00	6,231,973.20	
	UNITED MEXICAN STATE	4,640,000.00	4,521,308.80	
	UNITED MEXICAN STATE	1,650,000.00	1,715,043.00	
	UNITED MEXICAN STATE	5,670,000.00	6,538,700.70	
	UNITED MEXICAN STATE	3,460,000.00	3,141,091.80	
	UNITED MEXICAN STATE	2,650,000.00	2,687,948.00	
	UNITED MEXICAN STATE	2,110,000.00	2,300,300.90	
	UNITED MEXICAN STATE	2,540,000.00	2,614,447.40	
	UNITED MEXICAN STATE	1,920,000.00	1,972,972.80	
	UNITED MEXICAN STATE	2,050,000.00	2,557,211.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,870,000.00	2,051,932.30	
	UNITED MEXICAN STATE	4,160,000.00	4,235,920.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,160,000.00	1,212,094.44	
	メキシコペソ 小計	54,260,000.00	55,776,664.84	(334,659,989)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	276,573.70	
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	155,998.50	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	132,216.50	
	GOV OF AUSTRIA	270,000.00	301,693.95	
	GOV OF AUSTRIA	340,000.00	391,885.36	
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	176,645.10	
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	101,599.10	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	213,495.30	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	161,350.56	
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	233,646.00	
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	233,691.15	
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	226,947.63	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	263,637.92	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	227,903.72	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	191,167.17	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	297,079.25	
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	207,752.75	

GOV OF AUSTRIA	240,000.00	371,424.00
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	227,300.80
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	82,124.08
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	138,058.08
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	66,454.32
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	45,501.15
GOV OF BELGIUM	230,000.00	243,942.14
GOV OF BELGIUM	270,000.00	287,757.36
GOV OF BELGIUM	430,000.00	482,690.05
GOV OF BELGIUM	370,000.00	437,062.13
GOV OF BELGIUM	260,000.00	309,785.84
GOV OF BELGIUM	330,000.00	403,002.60
GOV OF BELGIUM	280,000.00	318,176.88
GOV OF BELGIUM	110,000.00	111,950.52
GOV OF BELGIUM	270,000.00	316,132.74
GOV OF BELGIUM	150,000.00	154,395.00
GOV OF BELGIUM	340,000.00	355,856.92
GOV OF BELGIUM	230,000.00	311,420.69
GOV OF BELGIUM	280,000.00	295,760.92
GOV OF BELGIUM	250,000.00	257,141.00
GOV OF BELGIUM	380,000.00	573,361.86
GOV OF BELGIUM	210,000.00	213,659.46
GOV OF BELGIUM	170,000.00	242,459.78
GOV OF BELGIUM	150,000.00	195,081.15
GOV OF BELGIUM	400,000.00	654,453.20
GOV OF BELGIUM	40,000.00	41,785.16
GOV OF BELGIUM	150,000.00	168,239.85
GOV OF BELGIUM	350,000.00	559,983.90
GOV OF BELGIUM	180,000.00	275,137.92
GOV OF BELGIUM	190,000.00	192,600.34
GOV OF BELGIUM	80,000.00	91,931.52
GOV OF BELGIUM	60,000.00	66,537.36
GOV OF FINLAND	100,000.00	108,030.90
GOV OF FINLAND	140,000.00	153,258.00
GOV OF FINLAND	150,000.00	154,075.65

GOV OF FINLAND	120,000.00	136,269.84
GOV OF FINLAND	70,000.00	71,055.88
GOV OF FINLAND	110,000.00	120,240.34
GOV OF FINLAND	150,000.00	163,531.80
GOV OF FINLAND	80,000.00	80,450.16
GOV OF FINLAND	110,000.00	124,072.30
GOV OF FINLAND	100,000.00	129,133.20
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,377.68
GOV OF FINLAND	110,000.00	112,315.50
GOV OF FINLAND	80,000.00	80,404.08
GOV OF FINLAND	90,000.00	111,156.21
GOV OF FINLAND	90,000.00	90,358.65
GOV OF FINLAND	110,000.00	148,091.90
GOV OF FRANCE	400,000.00	403,418.80
GOV OF FRANCE	600,000.00	640,945.80
GOV OF FRANCE	460,000.00	471,435.14
GOV OF FRANCE	870,000.00	943,364.49
GOV OF FRANCE	550,000.00	562,769.35
GOV OF FRANCE	580,000.00	587,995.88
GOV OF FRANCE	810,000.00	889,773.66
GOV OF FRANCE	470,000.00	477,012.87
GOV OF FRANCE	740,000.00	805,706.82
GOV OF FRANCE	480,000.00	491,088.00
GOV OF FRANCE	760,000.00	870,086.00
GOV OF FRANCE	440,000.00	446,967.40
GOV OF FRANCE	820,000.00	938,051.30
GOV OF FRANCE	860,000.00	987,336.76
GOV OF FRANCE	540,000.00	547,357.50
GOV OF FRANCE	870,000.00	977,262.30
GOV OF FRANCE	250,000.00	252,125.00
GOV OF FRANCE	720,000.00	796,228.56
GOV OF FRANCE	1,020,000.00	1,285,284.66
GOV OF FRANCE	660,000.00	757,863.48
GOV OF FRANCE	750,000.00	838,481.25
GOV OF FRANCE	710,000.00	729,783.44

GOV OF FRANCE	530,000.00	775,756.76	
GOV OF FRANCE	620,000.00	659,195.16	
GOV OF FRANCE	740,000.00	941,866.08	
GOV OF FRANCE	530,000.00	539,387.89	
GOV OF FRANCE	590,000.00	583,663.99	
GOV OF FRANCE	600,000.00	629,538.00	
GOV OF FRANCE	790,000.00	961,860.55	
GOV OF FRANCE	210,000.00	212,745.96	
GOV OF FRANCE	570,000.00	874,921.50	
GOV OF FRANCE	640,000.00	770,123.52	
GOV OF FRANCE	720,000.00	776,589.12	
GOV OF FRANCE	660,000.00	1,105,961.34	
GOV OF FRANCE	580,000.00	922,105.46	
GOV OF FRANCE	460,000.00	464,251.32	
GOV OF FRANCE	510,000.00	772,308.81	
GOV OF FRANCE	160,000.00	173,780.64	
GOV OF FRANCE	680,000.00	1,117,168.60	
GOV OF FRANCE	490,000.00	684,248.25	
GOV OF FRANCE	320,000.00	351,114.24	
GOV OF FRANCE	300,000.00	494,119.80	
GOV OF FRANCE	260,000.00	440,554.40	
GOV OF FRANCE	140,000.00	140,148.40	
GOV OF GERMANY	260,000.00	262,079.74	
GOV OF GERMANY	470,000.00	493,095.80	
GOV OF GERMANY	330,000.00	337,222.71	
GOV OF GERMANY	260,000.00	262,683.46	
GOV OF GERMANY	350,000.00	356,204.80	
GOV OF GERMANY	330,000.00	334,097.28	
GOV OF GERMANY	480,000.00	512,627.04	
GOV OF GERMANY	250,000.00	253,483.75	
GOV OF GERMANY	320,000.00	326,133.44	
GOV OF GERMANY	110,000.00	111,678.82	
GOV OF GERMANY	410,000.00	444,319.05	
GOV OF GERMANY	420,000.00	427,133.70	
GOV OF GERMANY	480,000.00	526,020.96	

GOV OF GERMANY	360,000.00	389,180.52	
GOV OF GERMANY	420,000.00	431,067.84	
GOV OF GERMANY	410,000.00	450,043.47	
GOV OF GERMANY	420,000.00	428,572.20	
GOV OF GERMANY	370,000.00	421,243.15	
GOV OF GERMANY	310,000.00	342,919.83	
GOV OF GERMANY	440,000.00	449,168.28	
GOV OF GERMANY	410,000.00	452,323.89	
GOV OF GERMANY	380,000.00	387,696.90	
GOV OF GERMANY	610,000.00	671,907.68	
GOV OF GERMANY	350,000.00	382,140.15	
GOV OF GERMANY	320,000.00	325,863.36	
GOV OF GERMANY	370,000.00	405,461.17	
GOV OF GERMANY	390,000.00	428,204.40	
GOV OF GERMANY	530,000.00	598,224.78	
GOV OF GERMANY	410,000.00	459,450.51	
GOV OF GERMANY	350,000.00	387,371.60	
GOV OF GERMANY	420,000.00	451,565.10	
GOV OF GERMANY	510,000.00	530,298.00	
GOV OF GERMANY	480,000.00	516,864.48	
GOV OF GERMANY	560,000.00	579,486.32	
GOV OF GERMANY	520,000.00	513,402.76	
GOV OF GERMANY	540,000.00	541,534.68	
GOV OF GERMANY	250,000.00	398,037.50	
GOV OF GERMANY	420,000.00	428,003.94	
GOV OF GERMANY	270,000.00	412,750.62	
GOV OF GERMANY	240,000.00	349,031.52	
GOV OF GERMANY	210,000.00	353,088.96	
GOV OF GERMANY	340,000.00	553,293.22	
GOV OF GERMANY	420,000.00	684,923.82	
GOV OF GERMANY	490,000.00	764,164.31	
GOV OF GERMANY	260,000.00	431,489.50	
GOV OF GERMANY	340,000.00	606,396.46	
GOV OF GERMANY	320,000.00	477,952.00	
GOV OF GERMANY	450,000.00	601,384.05	

GOV OF GERMANY	480,000.00	648,226.56
GOV OF GERMANY	80,000.00	82,304.64
GOV OF IRELAND	160,000.00	172,320.32
GOV OF IRELAND	120,000.00	134,651.40
GOV OF IRELAND	220,000.00	246,807.88
GOV OF IRELAND	150,000.00	174,129.75
GOV OF IRELAND	170,000.00	177,972.49
GOV OF IRELAND	80,000.00	80,585.44
GOV OF IRELAND	140,000.00	169,519.00
GOV OF IRELAND	150,000.00	181,191.15
GOV OF IRELAND	220,000.00	300,995.20
GOV OF IRELAND	230,000.00	239,803.75
GOV OF IRELAND	180,000.00	210,772.80
GOV OF IRELAND	110,000.00	115,920.20
GOV OF IRELAND	170,000.00	184,304.65
GOV OF ITALY	380,000.00	394,454.82
GOV OF ITALY	510,000.00	537,183.00
GOV OF ITALY	480,000.00	508,725.60
GOV OF ITALY	230,000.00	231,517.77
GOV OF ITALY	370,000.00	384,878.44
GOV OF ITALY	320,000.00	329,902.72
GOV OF ITALY	380,000.00	410,376.44
GOV OF ITALY	410,000.00	413,131.99
GOV OF ITALY	280,000.00	287,733.60
GOV OF ITALY	490,000.00	540,741.95
GOV OF ITALY	460,000.00	506,930.58
GOV OF ITALY	400,000.00	409,080.00
GOV OF ITALY	320,000.00	324,449.92
GOV OF ITALY	560,000.00	623,701.12
GOV OF ITALY	120,000.00	121,121.64
GOV OF ITALY	310,000.00	316,928.50
GOV OF ITALY	460,000.00	516,287.90
GOV OF ITALY	350,000.00	394,483.25
GOV OF ITALY	400,000.00	406,359.20
GOV OF ITALY	540,000.00	611,950.68

GOV OF ITALY	520,000.00	609,847.68
GOV OF ITALY	290,000.00	292,753.26
GOV OF ITALY	360,000.00	388,297.08
GOV OF ITALY	380,000.00	455,789.10
GOV OF ITALY	350,000.00	363,476.40
GOV OF ITALY	400,000.00	417,880.80
GOV OF ITALY	280,000.00	286,576.64
GOV OF ITALY	500,000.00	619,711.50
GOV OF ITALY	350,000.00	367,042.20
GOV OF ITALY	400,000.00	497,704.40
GOV OF ITALY	330,000.00	336,600.00
GOV OF ITALY	550,000.00	663,951.75
GOV OF ITALY	510,000.00	625,907.19
GOV OF ITALY	440,000.00	437,601.12
GOV OF ITALY	450,000.00	548,851.50
GOV OF ITALY	350,000.00	369,920.60
GOV OF ITALY	400,000.00	470,980.00
GOV OF ITALY	210,000.00	215,296.20
GOV OF ITALY	400,000.00	438,189.60
GOV OF ITALY	540,000.00	685,290.24
GOV OF ITALY	410,000.00	418,755.14
GOV OF ITALY	350,000.00	368,071.20
GOV OF ITALY	710,000.00	884,313.52
GOV OF ITALY	350,000.00	354,882.85
GOV OF ITALY	410,000.00	402,241.98
GOV OF ITALY	370,000.00	389,972.97
GOV OF ITALY	260,000.00	269,750.52
GOV OF ITALY	520,000.00	752,728.08
GOV OF ITALY	440,000.00	568,542.48
GOV OF ITALY	600,000.00	816,276.00
GOV OF ITALY	440,000.00	513,736.96
GOV OF ITALY	570,000.00	835,087.05
GOV OF ITALY	440,000.00	416,431.84
GOV OF ITALY	440,000.00	641,635.28
GOV OF ITALY	200,000.00	205,562.40

GOV OF ITALY	520,000.00	716,157.00	
GOV OF ITALY	290,000.00	284,156.50	
GOV OF ITALY	540,000.00	670,670.28	
GOV OF ITALY	440,000.00	617,441.88	
GOV OF ITALY	450,000.00	626,453.55	
GOV OF ITALY	370,000.00	507,291.83	
GOV OF ITALY	310,000.00	339,463.02	
GOV OF ITALY	320,000.00	314,526.40	
GOV OF ITALY	150,000.00	167,265.00	
GOV OF ITALY	120,000.00	112,697.52	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	316,984.30	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	312,177.75	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	316,308.19	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	332,705.40	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	375,635.37	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	325,603.20	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	336,646.80	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	386,735.04	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	344,172.54	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	120,702.36	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	341,009.40	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	313,573.99	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	317,050.33	
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	351,565.44	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	407,527.47	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	375,127.80	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	466,557.60	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	476,560.80	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	377,587.98	
GOV OF SPAIN	360,000.00	362,585.88	
GOV OF SPAIN	450,000.00	469,543.05	
GOV OF SPAIN	420,000.00	454,106.10	
GOV OF SPAIN	440,000.00	478,792.60	
GOV OF SPAIN	460,000.00	476,607.38	
GOV OF SPAIN	450,000.00	495,747.45	

GOV OF SPAIN	380,000.00	393,561.06	
GOV OF SPAIN	380,000.00	434,907.34	
GOV OF SPAIN	280,000.00	281,013.88	
GOV OF SPAIN	470,000.00	558,209.13	
GOV OF SPAIN	430,000.00	442,157.39	
GOV OF SPAIN	450,000.00	557,805.15	
GOV OF SPAIN	440,000.00	445,249.64	
GOV OF SPAIN	130,000.00	131,039.74	
GOV OF SPAIN	450,000.00	565,974.90	
GOV OF SPAIN	400,000.00	490,238.80	
GOV OF SPAIN	390,000.00	489,628.23	
GOV OF SPAIN	400,000.00	479,356.40	
GOV OF SPAIN	470,000.00	533,599.46	
GOV OF SPAIN	400,000.00	421,729.20	
GOV OF SPAIN	480,000.00	613,178.88	
GOV OF SPAIN	400,000.00	434,876.40	
GOV OF SPAIN	390,000.00	416,330.85	
GOV OF SPAIN	380,000.00	529,273.12	
GOV OF SPAIN	480,000.00	485,413.44	
GOV OF SPAIN	330,000.00	336,608.58	
GOV OF SPAIN	360,000.00	362,245.68	
GOV OF SPAIN	370,000.00	504,547.17	
GOV OF SPAIN	500,000.00	728,549.00	
GOV OF SPAIN	380,000.00	388,766.60	
GOV OF SPAIN	410,000.00	614,043.47	
GOV OF SPAIN	160,000.00	166,534.08	
GOV OF SPAIN	410,000.00	539,113.10	
GOV OF SPAIN	340,000.00	490,637.00	
GOV OF SPAIN	360,000.00	509,199.12	
GOV OF SPAIN	260,000.00	390,134.94	
GOV OF SPAIN	280,000.00	294,561.40	
GOV OF SPAIN	150,000.00	168,052.50	
	ユーロ 小計	104,230,000.00	121,697,682.97 (16,283,149,981)
英ポンド	UK TREASURY	370,000.00	388,441.91

UK TREASURY	650,000.00	663,091.00
UK TREASURY	320,000.00	338,256.00
UK TREASURY	330,000.00	361,455.60
UK TREASURY	540,000.00	560,439.00
UK TREASURY	370,000.00	402,486.00
UK TREASURY	820,000.00	842,716.46
UK TREASURY	330,000.00	368,082.00
UK TREASURY	250,000.00	284,825.00
UK TREASURY	530,000.00	523,617.21
UK TREASURY	500,000.00	522,936.00
UK TREASURY	250,000.00	247,748.00
UK TREASURY	350,000.00	376,740.00
UK TREASURY	310,000.00	345,625.20
UK TREASURY	340,000.00	434,452.00
UK TREASURY	430,000.00	459,284.72
UK TREASURY	380,000.00	390,146.00
UK TREASURY	450,000.00	447,772.50
UK TREASURY	250,000.00	319,493.75
UK TREASURY	190,000.00	280,433.16
UK TREASURY	290,000.00	400,846.12
UK TREASURY	330,000.00	442,993.32
UK TREASURY	420,000.00	591,064.32
UK TREASURY	420,000.00	583,871.40
UK TREASURY	220,000.00	217,227.78
UK TREASURY	280,000.00	423,951.36
UK TREASURY	290,000.00	415,676.14
UK TREASURY	360,000.00	522,079.20
UK TREASURY	410,000.00	626,053.60
UK TREASURY	490,000.00	628,082.00
UK TREASURY	430,000.00	577,963.00
UK TREASURY	320,000.00	490,678.40
UK TREASURY	390,000.00	359,592.48
UK TREASURY	310,000.00	493,213.10
UK TREASURY	320,000.00	483,732.48
UK TREASURY	350,000.00	595,717.50

	UK TREASURY	200,000.00	202,302.00	
	UK TREASURY	300,000.00	508,687.80	
	UK TREASURY	370,000.00	471,993.46	
	UK TREASURY	340,000.00	554,621.60	
	英ポンド 小計	14,800,000.00	18,148,388.57 (2,763,818,095)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,970,000.00	2,097,246.24	
	GOV OF SWEDEN	1,810,000.00	2,109,227.39	
	GOV OF SWEDEN	2,360,000.00	2,757,641.12	
	GOV OF SWEDEN	2,050,000.00	2,228,950.65	
	GOV OF SWEDEN	1,140,000.00	1,330,722.00	
	GOV OF SWEDEN	1,200,000.00	1,259,299.20	
	GOV OF SWEDEN	1,040,000.00	1,048,095.36	
	GOV OF SWEDEN	940,000.00	1,305,371.42	
	スウェーデンクローナ 小計	12,510,000.00	14,136,553.38 (189,995,277)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,530,000.00	1,618,366.68	
	GOV OF NORWAY	1,780,000.00	1,955,392.30	
	GOV OF NORWAY	1,200,000.00	1,256,973.60	
	GOV OF NORWAY	1,030,000.00	1,142,110.35	
	GOV OF NORWAY	840,000.00	865,918.20	
	GOV OF NORWAY	840,000.00	848,087.52	
	GOV OF NORWAY	600,000.00	614,217.60	
	ノルウェークローネ 小計	7,820,000.00	8,301,066.25 (113,558,586)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,630,000.00	1,776,422.90	
	GOV OF DENMARK	450,000.00	460,256.40	
	GOV OF DENMARK	1,920,000.00	2,178,495.36	
	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,173,603.82	
	GOV OF DENMARK	1,920,000.00	2,172,347.52	
	GOV OF DENMARK	880,000.00	890,721.92	
	GOV OF DENMARK	2,510,000.00	4,306,502.38	
	デンマーククローネ 小計	10,380,000.00	12,958,350.30 (232,991,138)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	850,000.00	873,460.00	
	GOV OF POLAND	340,000.00	364,140.00	

	GOV OF POLAND	790,000.00	784,233.00	
	GOV OF POLAND	310,000.00	338,303.00	
	GOV OF POLAND	640,000.00	636,160.00	
	GOV OF POLAND	630,000.00	618,849.00	
	GOV OF POLAND	320,000.00	360,896.00	
	GOV OF POLAND	680,000.00	673,676.00	
	GOV OF POLAND	310,000.00	354,485.00	
	GOV OF POLAND	130,000.00	128,895.00	
	GOV OF POLAND	640,000.00	682,464.00	
	GOV OF POLAND	580,000.00	587,395.00	
	GOV OF POLAND	840,000.00	799,386.00	
	GOV OF POLAND	600,000.00	563,790.00	
	GOV OF POLAND	140,000.00	176,015.00	
	ポーランドズロチ 小計	7,800,000.00	7,942,147.00	(253,195,646)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	438,201.54	
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	437,421.80	
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	625,444.25	
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	546,889.20	
	GOV OF AUSTRALIA	620,000.00	696,818.00	
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	309,096.35	
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	578,886.00	
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	130,424.58	
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	547,830.12	
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	584,699.73	
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	602,842.26	
	GOV OF AUSTRALIA	640,000.00	726,403.84	
	GOV OF AUSTRALIA	580,000.00	688,736.66	
	GOV OF AUSTRALIA	620,000.00	632,163.16	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	407,830.92	
	GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	426,239.10	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	435,244.11	
	GOV OF AUSTRALIA	270,000.00	326,803.68	
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	126,496.11	
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	266,049.84	

	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	143,344.04
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	209,057.20
	オーストラリアドル 小計	9,250,000.00	9,886,922.49 (844,442,049)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	162,397.60
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	140,308.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	101,200.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	73,164.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	132,652.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	78,872.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	60,279.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,536.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	115,500.00
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	160,200.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	82,240.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	80,960.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	145,791.10
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	32,100.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	106,700.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	113,089.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	29,448.75
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	94,455.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	84,280.80
	シンガポールドル 小計	1,790,000.00	1,868,173.25 (156,870,507)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,342.12
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	413,690.00
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	317,130.00
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	210,945.00
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	172,151.86
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	201,529.80
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	286,440.00
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	213,150.00
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	140,280.00
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	343,261.28
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	128,171.68

	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	180,041.04
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	334,494.72
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,161.20
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	152,250.00
	GOV OF MALAYSIA	360,000.00	362,625.84
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	326,770.62
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	192,203.62
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	206,435.88
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	84,285.63
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	129,087.40
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	161,734.77
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	279,720.00
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	204,769.11
	GOV OF MALAYSIA	380,000.00	355,581.20
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	86,688.45
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	122,309.40
	GOV OF MALAYSIA	90,000.00	90,450.00
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	215,320.60
	マレーシアリングット 小計	6,170,000.00	6,143,021.22 (170,837,420)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	740,000.00	742,553.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,120,000.00	1,102,326.40
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,110,000.00	1,059,328.50
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,300,000.00	1,251,887.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,720,000.00	4,002,348.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,050,000.00	1,804,371.05
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,880,000.00	1,499,995.60
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,590,000.00	1,395,888.03
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,160,000.00	1,052,545.72
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,090,000.00	1,446,129.52
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,790,000.00	1,551,042.16
	GOV OF SOUTH AFRICA	700,000.00	627,073.30
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,760,000.00	1,193,368.00
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,960,000.00	1,696,313.36
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,670,000.00	2,311,152.00

	南アフリカランド 小計	25,640,000.00	22,736,321.64 (189,166,196)
	合計		39,232,674,934 (39,232,674,934)

(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 200銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 294銘柄	100.0%	41.5%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	7.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
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 22銘柄	100.0%	2.2%
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 29銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	10,112,442
コール・ローン	4,646,105
投資信託受益証券	1,511,662,002
派生商品評価勘定	10,419
流動資産合計	1,526,430,968
資産合計	1,526,430,968
負債の部	
流動負債	
未払金	7,262,608
未払利息	12
流動負債合計	7,262,620
負債合計	7,262,620
純資産の部	
元本等	
元本	1,314,276,430
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	204,891,918
元本等合計	1,519,168,348
純資産合計	1,519,168,348
負債純資産合計	1,526,430,968

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	694,359,517円
期中追加設定元本額	906,010,751円
期中一部解約元本額	286,093,838円
期末元本額	1,314,276,430円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	370,942,602円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	215,811,256円
りそなラップ型ファンド（成長型）	84,002,906円
DCりそな グローバルバランス	1,503,376円
つみたてバランスファンド	20,016円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	641,920,930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）	75,344円
2. 計算日における受益権の総数	1,314,276,430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	1.1559円
(10,000口当たり純資産額)	(11,559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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11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)

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在
	損益に含まれた評価差額(円)

投資信託受益証券	26,804,958
合計	26,804,958

(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)

(平成29年12月11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	3,796,521	-	3,806,940	10,419
	米ドル	3,796,521	-	3,806,940	10,419
	合計	3,796,521	-	3,806,940	10,419

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	VANECK VECTORS J.P. MORGAN EM	711,285	13,301,029.50	
		米ドル 小計	711,285	13,301,029.50 (1,511,662,002)	
合計				1,511,662,002 (1,511,662,002)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	596,080,047
コール・ローン	22,606,444

平成29年12月11日現在

株式	7,648,672,583
投資証券	197,899,098
派生商品評価勘定	12,098,208
未収入金	1,107,188
未収配当金	13,604,959
差入委託証拠金	105,754,151
流動資産合計	8,597,822,678
資産合計	8,597,822,678
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,516,921
未払解約金	70,000
未払利息	61
流動負債合計	1,586,982
負債合計	1,586,982
純資産の部	
元本等	
元本	7,099,520,268
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,496,715,428
元本等合計	8,596,235,696
純資産合計	8,596,235,696
負債純資産合計	8,597,822,678

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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>原則として、約定日基準で計上しております。</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)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	2,146,764,339円
期中追加設定元本額	6,954,669,620円
期中一部解約元本額	2,001,913,691円
期末元本額	7,099,520,268円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	826,476,006円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	205,327,811円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,183,453,038円
DCりそな グローバルバランス	3,369,118円
つみたてバランスファンド	76,716円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	4,879,506,149円
Smart-i 先進国株式インデックス	821,644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）	489,786円
2. 計算日における受益権の総数	7,099,520,268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	1.2108円
(10,000口当たり純資産額)	(12,108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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。	

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11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）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

株式	618,157,456
投資証券	8,182,367
合計	626,339,823

(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)

(平成29年12月11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	757,041,120	-	767,576,923	10,535,803
	合計	757,041,120	-	767,576,923	10,535,803

(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)

(平成29年12月11日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	20,039,516	-	20,085,000	45,484
	米ドル	14,052,796	-	14,091,360	38,564
	ユーロ	4,001,100	-	4,014,000	12,900
	英ポンド	1,985,620	-	1,979,640	5,980
	合計	20,039,516	-	20,085,000	45,484

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	1,141	47.92	54,676.72	
	ANDEAVOR	268	111.04	29,758.72	
	ANTERO RESOURCES CORP	124	18.23	2,260.52	
	APACHE CORP	822	40.70	33,455.40	
	BAKER HUGHES A GE CO	768	30.26	23,239.68	
	CABOT OIL & GAS CORP	853	27.75	23,670.75	
	CHENIERE ENERGY INC	414	47.40	19,623.60	
	CHEVRON CORP	3,718	119.92	445,862.56	
	CIMAREX ENERGY CO	108	111.90	12,085.20	
	CONCHO RESOURCES INC	276	140.21	38,697.96	
	CONOCOPHILLIPS	2,204	51.57	113,660.28	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	47.93	3,642.68	
	DEVON ENERGY CORP	896	38.05	34,092.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	90	110.77	9,969.30	
	EOG RESOURCES INC	1,180	100.39	118,460.20	
	EQT CORP	585	56.38	32,982.30	
	EXXON MOBIL CORP	8,211	82.66	678,721.26	
	HALLIBURTON CO	1,736	43.99	76,366.64	
HELMERICH & PAYNE	153	58.01	8,875.53		

HESS CORP	389	45.49	17,695.61
HOLLYFRONTIER CORP	136	45.69	6,213.84
KINDER MORGAN INC	3,711	17.79	66,018.69
MARATHON OIL CORP	1,142	15.15	17,301.30
MARATHON PETROLEUM CORP	1,066	64.75	69,023.50
NATIONAL OILWELL VARCO INC	490	32.62	15,983.80
NEWFIELD EXPLORATION CO	288	29.39	8,464.32
NOBLE ENERGY INC	1,056	26.94	28,448.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,495	68.87	102,960.65
ONEOK INC	654	53.01	34,668.54
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	140	26.10	3,654.00
PHILLIPS 66	873	99.55	86,907.15
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	320	155.90	49,888.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	200	20.63	4,126.00
RANGE RESOURCES CORP	139	16.08	2,235.12
SCHLUMBERGER LTD	2,608	63.54	165,712.32
TARGA RESOURCES CORP	380	45.36	17,236.80
TECHNIPFMC PLC	550	27.35	15,042.50
VALERO ENERGY CORP	743	87.60	65,086.80
WILLIAMS COS INC	1,330	28.55	37,971.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	468	160.92	75,310.56
ALBEMARLE CORP	169	130.60	22,071.40
AVERY DENNISON CORP	182	113.73	20,698.86
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	486	32.41	15,751.26
BALL CORP	640	39.60	25,344.00
CELANESE CORP-SERIES A	209	106.54	22,266.86
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	358	39.26	14,055.08
CHEMOURS CO/THE	410	47.64	19,532.40
CROWN HOLDINGS INC	195	58.80	11,466.00
DOWDUPONT INC	4,570	70.73	323,236.10
EASTMAN CHEMICAL CO	233	92.18	21,477.94
ECOLAB INC	483	135.33	65,364.39
FMC CORP	298	88.81	26,465.38
FREEMPORT-MCMORAN INC	2,596	14.97	38,862.12
INTERNATIONAL PAPER CO	621	56.91	35,341.11

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	150	153.04	22,956.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	582	107.14	62,355.48
MARTIN MARIETTA MATERIALS	89	214.10	19,054.90
MONSANTO CO	898	117.30	105,335.40
MOSAIC CO/THE	652	23.62	15,400.24
NEWMONT MINING CORP	942	35.40	33,346.80
NUCOR CORP	518	60.17	31,168.06
PACKAGING CORP OF AMERICA	123	118.34	14,555.82
PPG INDUSTRIES INC	510	115.92	59,119.20
PRAXAIR INC	528	151.41	79,944.48
SEALED AIR CORP	224	47.79	10,704.96
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	144	408.85	58,874.40
STEEL DYNAMICS INC	360	40.70	14,652.00
VULCAN MATERIALS CO	253	125.88	31,847.64
WESTROCK CO	411	64.42	26,476.62
WR GRACE & CO	57	70.26	4,004.82
3M CO	1,178	238.13	280,517.14
ACUITY BRANDS INC	59	171.65	10,127.35
AERCAP HOLDINGS NV	312	52.36	16,336.32
AGCO CORP	54	72.46	3,912.84
ALLEGION PLC	150	82.46	12,369.00
AMETEK INC	386	71.74	27,691.64
ARCONIC INC	745	24.47	18,230.15
BOEING CO/THE	1,114	285.90	318,492.60
CATERPILLAR INC	1,196	143.86	172,056.56
CUMMINS INC	294	170.88	50,238.72
DEERE & CO	495	151.58	75,032.10
DOVER CORP	342	98.60	33,721.20
EATON CORP PLC	821	77.29	63,455.09
EMERSON ELECTRIC CO	1,179	66.55	78,462.45
FASTENAL CO	545	53.78	29,310.10
FLOWSERVE CORP	106	42.13	4,465.78
FLUOR CORP	200	50.38	10,076.00
FORTIVE CORP	563	73.69	41,487.47
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	289	68.22	19,715.58

GENERAL DYNAMICS CORP	526	201.07	105,762.82
GENERAL ELECTRIC CO	16,639	17.71	294,676.69
HD SUPPLY HOLDINGS INC	300	39.32	11,796.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,444	153.66	221,885.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	92	237.01	21,804.92
IDEX CORP	120	132.64	15,916.80
ILLINOIS TOOL WORKS	568	166.49	94,566.32
INGERSOLL-RAND PLC	473	87.61	41,439.53
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	205	68.51	14,044.55
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	400	62.10	24,840.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	500	40.20	20,100.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,854	37.41	69,358.14
L3 TECHNOLOGIES INC	181	193.85	35,086.85
LENNOX INTERNATIONAL INC	60	206.66	12,399.60
LOCKHEED MARTIN CORP	523	315.85	165,189.55
MASCO CORP	622	42.72	26,571.84
MIDDLEBY CORP	87	125.61	10,928.07
NORTHROP GRUMMAN CORP	303	305.67	92,618.01
OWENS CORNING	260	88.59	23,033.40
PACCAR INC	648	71.97	46,636.56
PARKER HANNIFIN CORP	246	192.98	47,473.08
PENTAIR PLC	284	69.95	19,865.80
RAYTHEON COMPANY	531	188.07	99,865.17
ROCKWELL AUTOMATION INC	232	192.86	44,743.52
ROCKWELL COLLINS INC	301	134.61	40,517.61
ROPER TECHNOLOGIES INC	188	260.58	48,989.04
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	348	48.05	16,721.40
SMITH (A.O.) CORP	204	62.22	12,692.88
SNAP-ON INC	133	172.19	22,901.27
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	270	84.95	22,936.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	267	167.66	44,765.22
TEXTRON INC	496	54.84	27,200.64
TRANSDIGM GROUP INC	99	274.62	27,187.38
UNITED RENTALS INC	159	164.00	26,076.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,533	122.81	188,267.73

WABCO HOLDINGS INC	114	144.02	16,418.28
WABTEC CORP	127	76.23	9,681.21
WW GRAINGER INC	132	223.91	29,556.12
XYLEM INC	256	68.19	17,456.64
CINTAS CORP	206	159.18	32,791.08
EQUIFAX INC	169	117.40	19,840.60
IHS MARKIT LTD	700	45.59	31,913.00
MANPOWERGROUP INC	138	127.96	17,658.48
NIELSEN HOLDINGS PLC	633	37.95	24,022.35
REPUBLIC SERVICES INC	514	65.14	33,481.96
ROBERT HALF INTL INC	346	54.68	18,919.28
ROLLINS INC	155	46.00	7,130.00
STERICYCLE INC	149	66.58	9,920.42
TRANSUNION	340	55.61	18,907.40
VERISK ANALYTICS INC	263	96.16	25,290.08
WASTE CONNECTIONS INC	498	68.66	34,192.68
WASTE MANAGEMENT INC	897	84.57	75,859.29
AMERCO	6	381.12	2,286.72
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	51.02	10,101.96
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	227	88.38	20,062.26
CSX CORP	1,705	56.46	96,264.30
DELTA AIR LINES INC	359	53.46	19,192.14
EXPEDITORS INTL WASH INC	289	64.46	18,628.94
FEDEX CORP	530	240.73	127,586.90
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	216	112.51	24,302.16
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	4,000	0.40	1,620.00
KANSAS CITY SOUTHERN	173	111.74	19,331.02
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	250	43.11	10,777.50
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	115	65.37	7,517.55
NORFOLK SOUTHERN CORP	532	140.82	74,916.24
OLD DOMINION FREIGHT LINE	150	130.50	19,575.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	380	63.33	24,065.40
UNION PACIFIC CORP	1,476	129.11	190,566.36
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	121	63.55	7,689.55
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,279	119.56	152,917.24

APTIV PLC	562	85.22	47,893.64
AUTOLIV INC	196	128.65	25,215.40
BORGWARNER INC	458	53.76	24,622.08
FORD MOTOR CO	7,251	12.61	91,435.11
GENERAL MOTORS CO	2,614	42.02	109,840.28
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	537	31.75	17,049.75
HARLEY-DAVIDSON INC	232	51.19	11,876.08
LEAR CORP	108	177.07	19,123.56
TESLA INC	255	315.13	80,358.15
DR HORTON INC	798	50.78	40,522.44
GARMIN LTD	173	62.27	10,772.71
HANESBRANDS INC	521	20.75	10,810.75
HASBRO INC	187	91.36	17,084.32
LEGGETT & PLATT INC	366	46.30	16,945.80
LENNAR CORP-A	295	62.18	18,343.10
LULULEMON ATHLETICA INC	133	73.77	9,811.41
MATTEL INC	408	15.04	6,136.32
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	242	61.81	14,958.02
MOHAWK INDUSTRIES INC	139	280.57	38,999.23
NEWELL RUBBERMAID INC	885	30.96	27,399.60
NIKE INC -CL B	2,591	61.30	158,828.30
NVR INC	8	3,392.68	27,141.44
POLARIS INDUSTRIES INC	141	133.70	18,851.70
PULTEGROUP INC	567	34.10	19,334.70
PVH CORP	147	135.40	19,903.80
RALPH LAUREN CORP	48	102.34	4,912.32
TAPESTRY INC	501	42.26	21,172.26
TOLL BROTHERS INC	362	47.87	17,328.94
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	13.63	5,574.67
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	152	12.19	1,852.88
VF CORP	712	73.35	52,225.20
WHIRLPOOL CORP	121	169.70	20,533.70
ARAMARK	577	42.69	24,632.13
CARNIVAL CORP	590	66.91	39,476.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	32	315.90	10,108.80

DARDEN RESTAURANTS INC	299	86.41	25,836.59
DOMINO'S PIZZA INC	95	183.91	17,471.45
H&R BLOCK INC	571	27.22	15,542.62
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	309	78.38	24,219.42
LAS VEGAS SANDS CORP	706	70.36	49,674.16
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	644	129.32	83,282.08
MCDONALD'S CORP	1,520	173.15	263,188.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	400	25.85	10,340.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	860	33.18	28,534.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	372	55.03	20,471.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	298	125.23	37,318.54
STARBUCKS CORP	2,743	58.61	160,767.23
VAIL RESORTS INC	63	225.49	14,205.87
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	186	113.05	21,027.30
WYNN RESORTS LTD	189	159.54	30,153.06
YUM! BRANDS INC	563	83.32	46,909.16
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	677	57.47	38,907.19
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	410	324.50	133,045.00
COMCAST CORP-CLASS A	9,214	37.95	349,671.30
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	122	19.66	2,398.52
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	320	18.40	5,888.00
DISH NETWORK CORP-A	555	48.59	26,967.45
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	688	20.22	13,911.36
LIBERTY BROADBAND-C	265	84.67	22,437.55
LIBERTY GLOBAL PLC-A	356	30.77	10,954.12
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	922	29.87	27,540.14
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	450	34.63	15,583.50
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	267	42.15	11,254.05
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	75	42.34	3,175.50
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	330	43.35	14,305.50
NEWS CORP - CLASS A	910	16.55	15,060.50
OMNICOM GROUP	382	73.48	28,069.36
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	196	81.85	16,042.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,258	5.64	12,735.12
TIME WARNER INC	1,479	90.71	134,160.09

TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	893	32.97	29,442.21
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	2,126	33.30	70,795.80
VIACOM INC-CLASS B	842	29.29	24,662.18
WALT DISNEY CO/THE	2,886	104.23	300,807.78
ADVANCE AUTO PARTS INC	120	100.31	12,037.20
AMAZON.COM INC	788	1,162.00	915,656.00
AUTONATION INC	61	55.59	3,390.99
AUTOZONE INC	62	721.89	44,757.18
BEST BUY CO INC	535	63.79	34,127.65
CARMAX INC	405	67.48	27,329.40
DOLLAR GENERAL CORP	448	93.38	41,834.24
DOLLAR TREE INC	455	108.67	49,444.85
EXPEDIA INC	261	117.54	30,677.94
GAP INC/THE	196	33.49	6,564.04
GENUINE PARTS CO	344	94.85	32,628.40
HOME DEPOT INC	2,308	183.41	423,310.28
KOHL'S CORP	264	49.78	13,141.92
L BRANDS INC	333	57.28	19,074.24
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	963	24.79	23,872.77
LKQ CORP	553	40.22	22,241.66
LOWE'S COS INC	1,639	85.60	140,298.40
MACY'S INC	437	25.80	11,274.60
NETFLIX INC	818	188.54	154,225.72
NORDSTROM INC	105	45.78	4,806.90
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	138	251.07	34,647.66
PRICELINE GROUP INC/THE	92	1,719.84	158,225.28
ROSS STORES INC	735	76.89	56,514.15
TARGET CORP	875	61.37	53,698.75
TIFFANY & CO	209	95.75	20,011.75
TJX COMPANIES INC	1,261	73.88	93,162.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	279	67.66	18,877.14
TRIPADVISOR INC	171	34.50	5,899.50
ULTA BEAUTY INC	132	224.54	29,639.28
COSTCO WHOLESALE CORP	839	188.07	157,790.73
CVS HEALTH CORP	2,060	73.09	150,565.40

KROGER CO	2,016	26.68	53,786.88
SYSCO CORP	859	62.64	53,807.76
WAL-MART STORES INC	2,820	96.55	272,271.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,755	71.55	125,570.25
ALTRIA GROUP INC	3,748	71.54	268,131.92
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,005	41.51	41,717.55
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	390	66.48	25,927.20
BUNGE LTD	267	69.79	18,633.93
CAMPBELL SOUP CO	216	48.95	10,573.20
COCA-COLA CO/THE	7,847	45.31	355,547.57
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	500	38.77	19,385.00
CONAGRA BRANDS INC	682	37.25	25,404.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	305	217.98	66,483.90
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	304	94.15	28,621.60
GENERAL MILLS INC	1,011	55.84	56,454.24
HERSHEY CO/THE	232	113.20	26,262.40
HORMEL FOODS CORP	384	37.24	14,300.16
INGREDION INC	99	139.89	13,849.11
JM SMUCKER CO/THE	154	118.61	18,265.94
KELLOGG CO	544	66.53	36,192.32
KRAFT HEINZ CO/THE	1,242	78.48	97,472.16
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	215	101.16	21,749.40
MOLSON COORS BREWING CO -B	283	80.14	22,679.62
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	2,818	42.65	120,187.70
MONSTER BEVERAGE CORP	811	63.22	51,271.42
PEPSICO INC	2,769	116.57	322,782.33
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,016	106.59	321,475.44
TYSON FOODS INC-CL A	555	83.62	46,409.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	444	48.40	21,489.60
CLOROX COMPANY	167	145.23	24,253.41
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,622	73.32	118,925.04
COTY INC-CL A	785	17.78	13,957.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	412	125.63	51,759.56
KIMBERLY-CLARK CORP	749	120.11	89,962.39
PROCTER & GAMBLE CO/THE	4,971	90.37	449,229.27

SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	25	114.47	2,861.75
ABBOTT LABORATORIES	3,240	54.64	177,033.60
AETNA INC	685	182.73	125,170.05
ALIGN TECHNOLOGY INC	157	238.43	37,433.51
AMERISOURCEBERGEN CORP	269	86.70	23,322.30
ANTHEM INC	472	224.85	106,129.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	882	64.05	56,492.10
BECTON DICKINSON AND CO	468	219.68	102,810.24
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,492	25.77	64,218.84
CARDINAL HEALTH INC	638	58.89	37,571.82
CENTENE CORP	258	101.34	26,145.72
CERNER CORP	615	70.42	43,308.30
CIGNA CORP	514	209.97	107,924.58
COOPER COS INC/THE	115	226.56	26,054.40
CR BARD INC	133	332.80	44,262.40
DANAHER CORP	1,275	93.18	118,804.50
DAVITA INC	162	67.71	10,969.02
DENTSPLY SIRONA INC	402	64.90	26,089.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	394	118.03	46,503.82
ENVISION HEALTHCARE CORP	130	32.07	4,169.10
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,219	68.15	83,074.85
HCA HEALTHCARE INC	603	84.84	51,158.52
HENRY SCHEIN INC	244	67.90	16,567.60
HOLOGIC INC	584	42.69	24,930.96
HUMANA INC	290	256.49	74,382.10
IDEXX LABORATORIES INC	119	160.57	19,107.83
INTUITIVE SURGICAL INC	201	379.61	76,301.61
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	220	156.26	34,377.20
MCKESSON CORP	418	152.57	63,774.26
MEDTRONIC PLC	2,552	81.07	206,890.64
QUEST DIAGNOSTICS INC	265	97.09	25,728.85
RESMED INC	274	86.37	23,665.38
STRYKER CORP	648	151.93	98,450.64
TELEFLEX INC	104	252.76	26,287.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,886	223.91	422,294.26

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	92	111.56	10,263.52
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	128	111.98	14,333.44
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	170	56.06	9,530.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	379	113.38	42,971.02
ABBVIE INC	3,102	95.95	297,636.90
AGILENT TECHNOLOGIES INC	643	67.38	43,325.34
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	444	114.46	50,820.24
ALKERMES PLC	258	52.88	13,643.04
ALLERGAN PLC	623	167.80	104,539.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	190	130.89	24,869.10
AMGEN INC	1,430	175.41	250,836.30
BIOGEN INC	395	325.77	128,679.15
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	282	81.99	23,121.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,208	62.42	200,243.36
CELGENE CORP	1,429	106.09	151,602.61
ELI LILLY & CO	1,861	86.45	160,883.45
GILEAD SCIENCES INC	2,404	74.22	178,424.88
ILLUMINA INC	264	217.65	57,459.60
INCYTE CORP	352	96.58	33,996.16
IQVIA HOLDINGS INC	199	101.35	20,168.65
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	128	138.97	17,788.16
JOHNSON & JOHNSON	5,144	140.59	723,194.96
MERCK & CO. INC.	5,253	55.57	291,909.21
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	51	623.19	31,782.69
MYLAN NV	897	38.67	34,686.99
PERRIGO CO PLC	194	85.60	16,606.40
PFIZER INC	11,463	35.74	409,687.62
REGENERON PHARMACEUTICALS	155	380.78	59,020.90
SEATTLE GENETICS INC	146	59.26	8,651.96
TESARO INC	60	84.39	5,063.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,265	16.06	20,315.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	791	187.96	148,676.36
UNITED THERAPEUTICS CORP	22	136.21	2,996.62
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	508	143.61	72,953.88
WATERS CORP	143	199.29	28,498.47

ZOETIS INC	975	71.88	70,083.00
BANK OF AMERICA CORP	19,372	29.05	562,756.60
BB&T CORP	1,667	49.81	83,033.27
CIT GROUP INC	280	49.84	13,955.20
CITIGROUP INC	5,283	75.71	399,975.93
CITIZENS FINANCIAL GROUP	832	41.74	34,727.68
COMERICA INC	363	85.40	31,000.20
EAST WEST BANCORP INC	220	60.35	13,277.00
FIFTH THIRD BANCORP	1,551	30.37	47,103.87
FIRST REPUBLIC BANK/CA	252	92.79	23,383.08
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,480	14.85	21,978.00
JPMORGAN CHASE & CO	6,742	105.93	714,180.06
KEYCORP	2,236	19.89	44,474.04
M & T BANK CORP	280	171.72	48,081.60
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	1,054	13.35	14,070.90
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	251	18.84	4,728.84
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	933	143.80	134,165.40
REGIONS FINANCIAL CORP	1,883	17.08	32,161.64
SIGNATURE BANK	41	137.57	5,640.37
SUNTRUST BANKS INC	893	65.20	58,223.60
SVB FINANCIAL GROUP	80	232.27	18,581.60
US BANCORP	3,112	55.36	172,280.32
WELLS FARGO & CO	9,083	59.31	538,712.73
ZIONS BANCORPORATION	310	50.93	15,788.30
AFFILIATED MANAGERS GROUP	110	200.43	22,047.30
ALLY FINANCIAL INC	599	28.65	17,161.35
AMERICAN EXPRESS CO	1,451	98.55	142,996.05
AMERIPRISE FINANCIAL INC	280	169.86	47,560.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,991	54.67	108,847.97
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2,472	196.44	485,599.68
BLACKROCK INC	249	515.49	128,357.01
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	841	95.79	80,559.39
CBOE GLOBAL MARKETS INC	155	125.27	19,416.85
CME GROUP INC	599	152.82	91,539.18
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	818	73.80	60,368.40

E*TRADE FINANCIAL CORP	369	50.38	18,590.22
EATON VANCE CORP	92	56.84	5,229.28
FRANKLIN RESOURCES INC	499	44.67	22,290.33
GOLDMAN SACHS GROUP INC	743	250.35	186,010.05
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,263	70.93	89,584.59
INVESCO LTD	662	37.67	24,937.54
LEUCADIA NATIONAL CORP	455	26.10	11,875.50
MOODY'S CORP	321	152.39	48,917.19
MORGAN STANLEY	2,633	52.89	139,259.37
MSCI INC	208	127.71	26,563.68
NASDAQ INC	153	78.78	12,053.34
NORTHERN TRUST CORP	395	97.73	38,603.35
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	238	89.49	21,298.62
S&P GLOBAL INC	547	171.21	93,651.87
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,502	51.39	128,577.78
SEI INVESTMENTS COMPANY	208	71.22	14,813.76
STATE STREET CORP	745	97.67	72,764.15
SYNCHRONY FINANCIAL	1,646	37.50	61,725.00
T ROWE PRICE GROUP INC	447	102.75	45,929.25
TD AMERITRADE HOLDING CORP	481	52.75	25,372.75
VOYA FINANCIAL INC	272	46.15	12,552.80
AFLAC INC	809	88.16	71,321.44
ALLEGHANY CORP	36	585.72	21,085.92
ALLSTATE CORP	742	102.50	76,055.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	118	104.79	12,365.22
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,789	59.51	106,463.39
AON PLC	550	138.49	76,169.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	194	92.01	17,849.94
ARTHUR J GALLAGHER & CO	294	65.69	19,312.86
ASSURANT INC	53	99.13	5,253.89
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	120	51.50	6,180.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	77	50.25	3,869.25
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	121	60.20	7,284.20
CHUBB LTD	954	150.05	143,147.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	248	74.40	18,451.20

EVEREST RE GROUP LTD	97	212.28	20,591.16
FNF GROUP	407	40.08	16,312.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	605	55.17	33,377.85
LINCOLN NATIONAL CORP	405	78.54	31,808.70
LOEWS CORP	637	49.84	31,748.08
MARKEL CORP	22	1,110.94	24,440.68
MARSH & MCLENNAN COS	929	84.13	78,156.77
METLIFE INC	1,637	53.76	88,005.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	618	71.76	44,347.68
PROGRESSIVE CORP	1,171	54.99	64,393.29
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	774	117.15	90,674.10
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	150	161.86	24,279.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	35	126.72	4,435.20
TORCHMARK CORP	167	89.95	15,021.65
TRAVELERS COS INC/THE	563	133.75	75,301.25
UNUM GROUP	535	57.49	30,757.15
WILLIS TOWERS WATSON PLC	226	155.46	35,133.96
WR BERKLEY CORP	80	70.40	5,632.00
XL GROUP LTD	354	36.87	13,051.98
CBRE GROUP INC - A	684	43.62	29,836.08
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,000	7.21	14,420.00
JONES LANG LASALLE INC	107	150.09	16,059.63
ACCENTURE PLC-CL A	1,156	150.53	174,012.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,500	62.43	93,645.00
ADOBE SYSTEMS INC	930	173.57	161,420.10
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	366	56.50	20,679.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	66	233.05	15,381.30
ALPHABET INC-CL A	555	1,049.38	582,405.90
ALPHABET INC-CL C	615	1,037.05	637,785.75
ANSYS INC	114	146.13	16,658.82
AUTODESK INC	351	107.16	37,613.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING	788	116.02	91,423.76
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	160	89.53	14,324.80
CA INC	570	33.48	19,083.60
CADENCE DESIGN SYS INC	389	43.56	16,944.84

CDK GLOBAL INC	185	70.73	13,085.05
CHECK POINT SOFTWARE TECH	274	104.78	28,709.72
CITRIX SYSTEMS INC	333	87.59	29,167.47
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,026	71.82	73,687.32
COSTAR GROUP INC	49	292.34	14,324.66
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	301	77.25	23,252.25
DXC TECHNOLOGY CO	511	95.93	49,020.23
EBAY INC	2,148	37.65	80,872.20
ELECTRONIC ARTS INC	555	105.27	58,424.85
FACEBOOK INC-A	4,564	179.00	816,956.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	586	95.85	56,168.10
FIRST DATA CORP- CLASS A	880	16.52	14,537.60
FISERV INC	442	131.72	58,220.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	152	186.43	28,337.36
FORTINET INC	118	41.95	4,950.10
GARTNER INC	124	120.71	14,968.04
GLOBAL PAYMENTS INC	246	99.37	24,445.02
IAC/INTERACTIVECORP	160	123.91	19,825.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,755	154.81	271,691.55
INTUIT INC	481	155.23	74,665.63
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	120	117.29	14,074.80
LEIDOS HOLDINGS INC	220	64.13	14,108.60
MASTERCARD INC-CLASS A	1,862	149.89	279,095.18
MERCADOLIBRE INC	50	276.45	13,822.50
MICROSOFT CORP	14,028	84.16	1,180,596.48
ORACLE CORP	6,095	49.60	302,312.00
PAYCHEX INC	677	69.01	46,719.77
PAYPAL HOLDINGS INC	2,297	72.91	167,474.27
RED HAT INC	375	125.29	46,983.75
SABRE CORP	168	19.30	3,242.40
SALESFORCE.COM INC	1,291	103.44	133,541.04
SERVICENOW INC	356	121.81	43,364.36
SPLUNK INC	225	80.42	18,094.50
SQUARE INC - A	560	38.09	21,330.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	260	40.63	10,563.80

SYMANTEC CORP	1,086	27.98	30,386.28
SYNOPSYS INC	247	90.51	22,355.97
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	230	106.81	24,566.30
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	219	76.58	16,771.02
TWITTER INC	1,320	21.10	27,852.00
VANTIV INC - CL A	290	74.76	21,680.40
VERISIGN INC	129	112.98	14,574.42
VISA INC-CLASS A SHARES	3,569	112.60	401,869.40
VMWARE INC-CLASS A	160	119.57	19,131.20
WESTERN UNION CO	599	19.39	11,614.61
WORKDAY INC-CLASS A	236	104.85	24,744.60
ZILLOW GROUP INC - C	92	40.18	3,696.56
AMPHENOL CORP-CL A	502	89.34	44,848.68
APPLE INC	9,880	169.37	1,673,375.60
ARISTA NETWORKS INC	75	222.79	16,709.25
ARROW ELECTRONICS INC	224	77.88	17,445.12
AVNET INC	107	39.14	4,187.98
CDW CORP/DE	193	69.76	13,463.68
CISCO SYSTEMS INC	9,745	37.61	366,509.45
COGNEX CORP	380	64.38	24,464.40
COMMSCOPE HOLDING CO INC	300	37.91	11,373.00
CORNING INC	1,557	32.35	50,368.95
F5 NETWORKS INC	76	132.74	10,088.24
FLEX LTD	752	17.84	13,415.68
FLIR SYSTEMS INC	111	46.39	5,149.29
HARRIS CORP	200	143.25	28,650.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,369	14.34	48,311.46
HP INC	3,470	21.07	73,112.90
IPG PHOTONICS CORP	85	205.26	17,447.10
JUNIPER NETWORKS INC	766	28.38	21,739.08
MOTOROLA SOLUTIONS INC	310	92.52	28,681.20
NETAPP INC	498	58.26	29,013.48
PALO ALTO NETWORKS INC	166	143.89	23,885.74
SEAGATE TECHNOLOGY	457	40.49	18,503.93
TE CONNECTIVITY LTD	644	94.82	61,064.08

TRIMBLE INC	334	41.21	13,764.14
WESTERN DIGITAL CORP	598	81.47	48,719.06
XEROX CORP	555	29.59	16,422.45
AT&T INC	11,764	36.73	432,091.72
CENTURYLINK INC	1,497	14.67	21,960.99
SPRINT CORP	1,246	5.44	6,778.24
T-MOBILE US INC	550	62.54	34,397.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	7,914	51.09	404,326.26
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	418	34.42	14,387.56
AES CORP	1,018	10.76	10,953.68
ALLIANT ENERGY CORP	517	44.94	23,233.98
AMEREN CORPORATION	514	63.19	32,479.66
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,061	76.93	81,622.73
AMERICAN WATER WORKS CO INC	401	91.52	36,699.52
ATMOS ENERGY CORP	123	91.80	11,291.40
CENTERPOINT ENERGY INC	646	28.91	18,675.86
CMS ENERGY CORP	427	49.87	21,294.49
CONSOLIDATED EDISON INC	618	88.92	54,952.56
DOMINION ENERGY INC	1,224	83.88	102,669.12
DTE ENERGY COMPANY	378	115.49	43,655.22
DUKE ENERGY CORP	1,441	88.05	126,880.05
EDISON INTERNATIONAL	660	71.80	47,388.00
ENTERGY CORP	355	84.04	29,834.20
EVERSOURCE ENERGY	554	65.22	36,131.88
EXELON CORP	1,841	41.05	75,573.05
FIRSTENERGY CORP	867	32.83	28,463.61
NEXTERA ENERGY INC	962	159.03	152,986.86
NISOURCE INC	683	27.14	18,536.62
OGE ENERGY CORP	204	34.46	7,029.84
P G & E CORP	1,085	53.46	58,004.10
PINNACLE WEST CAPITAL	237	90.75	21,507.75
PPL CORP	1,403	34.50	48,403.50
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	946	51.93	49,125.78
SCANA CORP	146	45.78	6,683.88
SEMPRA ENERGY	481	116.69	56,127.89

	SOUTHERN CO/THE	1,932	51.06	98,647.92	
	UGI CORP	199	49.60	9,870.40	
	VISTRA ENERGY CORP	650	17.75	11,537.50	
	WEC ENERGY GROUP INC	508	68.96	35,031.68	
	WESTAR ENERGY INC	198	56.76	11,238.48	
	XCEL ENERGY INC	951	51.20	48,691.20	
	ADVANCED MICRO DEVICES	1,550	9.94	15,407.00	
	ANALOG DEVICES INC	763	85.52	65,251.76	
	APPLIED MATERIALS INC	2,177	51.43	111,963.11	
	BROADCOM LTD	806	259.91	209,487.46	
	INTEL CORP	9,104	43.35	394,658.40	
	KLA-TENCOR CORP	336	103.98	34,937.28	
	LAM RESEARCH CORP	294	186.46	54,819.24	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	908	22.04	20,012.32	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	419	51.89	21,741.91	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	408	87.41	35,663.28	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,049	43.21	88,537.29	
	NVIDIA CORP	1,186	191.49	227,107.14	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	509	115.29	58,682.61	
	QORVO INC	172	67.88	11,675.36	
	QUALCOMM INC	2,785	64.24	178,908.40	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	338	96.28	32,542.64	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,953	98.02	191,433.06	
	XILINX INC	371	68.54	25,428.34	
	米ドル 小計	578,364		44,031,974.12	(5,004,233,858)
カナダドル	ALTAGAS LTD	131	28.84	3,778.04	
	ARC RESOURCES LTD	570	14.50	8,265.00	
	CAMECO CORP	601	13.33	8,011.33	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,075	44.85	93,063.75	
	CENOVUS ENERGY INC	1,425	12.15	17,313.75	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	815	9.08	7,400.20	
	ENBRIDGE INC	3,131	49.34	154,483.54	
	ENCANA CORP	2,330	15.17	35,346.10	
	HUSKY ENERGY INC	291	15.93	4,635.63	

IMPERIAL OIL LTD	422	39.45	16,647.90
INTER PIPELINE LTD	811	27.62	22,399.82
KEYERA CORP	288	34.64	9,976.32
PEMBINA PIPELINE CORP	1,135	45.28	51,392.80
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	32.14	16,616.38
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	460	17.21	7,916.60
SUNCOR ENERGY INC	3,202	44.25	141,688.50
TOURMALINE OIL CORP	465	21.88	10,174.20
TRANSCANADA CORP	1,852	62.99	116,657.48
VERMILION ENERGY INC	90	42.10	3,789.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	559	55.08	30,789.72
AGRIUM INC	267	136.49	36,442.83
BARRICK GOLD CORP	2,217	17.57	38,952.69
CCL INDUSTRIES INC - CL B	250	59.15	14,787.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,487	15.10	22,453.70
FRANCO-NEVADA CORP	401	100.01	40,104.01
GOLDCORP INC	1,929	15.39	29,687.31
KINROSS GOLD CORP	3,281	5.00	16,405.00
LUNDIN MINING CORP	1,800	7.06	12,708.00
METHANEX CORP	72	68.25	4,914.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	1,943	24.33	47,273.19
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,260	29.59	37,283.40
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	828	3.87	3,204.36
WEST FRASER TIMBER CO LTD	55	76.57	4,211.35
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	632	27.01	17,070.32
BOMBARDIER INC-B	1,571	3.19	5,011.49
CAE INC	219	22.43	4,912.17
FINNING INTERNATIONAL INC	136	30.39	4,133.04
SNC-LAVALIN GROUP INC	347	56.38	19,563.86
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,411	103.08	145,445.88
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	316	231.73	73,226.68
LINAMAR CORP	39	67.78	2,643.42
MAGNA INTERNATIONAL INC	682	72.24	49,267.68
GILDAN ACTIVEWEAR INC	486	41.32	20,081.52
RESTAURANT BRANDS INTERN	430	78.10	33,583.00

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,007	29.39	29,595.73
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	120	164.18	19,701.60
DOLLARAMA INC	195	158.68	30,942.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	880	66.49	58,511.20
EMPIRE CO LTD 'A'	133	25.85	3,438.05
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	68	24.51	1,666.68
LOBLAW COMPANIES LTD	413	68.19	28,162.47
METRO INC	286	40.83	11,677.38
WESTON (GEORGE) LTD	52	110.77	5,760.04
SAPUTO INC	344	44.21	15,208.24
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	450	25.36	11,412.00
BANK OF MONTREAL	1,166	100.91	117,661.06
BANK OF NOVA SCOTIA	2,398	83.60	200,472.80
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	894	119.65	106,967.10
NATIONAL BANK OF CANADA	723	64.14	46,373.22
ROYAL BANK OF CANADA	2,713	102.47	278,001.11
TORONTO-DOMINION BANK	3,421	72.85	249,219.85
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,770	55.77	98,712.90
CI FINANCIAL CORP	775	29.23	22,653.25
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	313	9.44	2,954.72
IGM FINANCIAL INC	81	44.27	3,585.87
ONEX CORPORATION	102	95.54	9,745.08
THOMSON REUTERS CORP	652	56.98	37,150.96
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	52	673.05	34,998.60
GREAT-WEST LIFECO INC	448	35.14	15,742.72
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	304	60.00	18,240.00
INTACT FINANCIAL CORP	223	106.57	23,765.11
MANULIFE FINANCIAL CORP	3,646	26.86	97,931.56
POWER CORP OF CANADA	597	32.41	19,348.77
POWER FINANCIAL CORP	385	35.28	13,582.80
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,340	52.43	70,256.20
FIRST CAPITAL REALTY INC	101	20.90	2,110.90
CGI GROUP INC - CLASS A	498	68.59	34,157.82
CONSTELLATION SOFTWARE INC	37	785.00	29,045.00
OPEN TEXT CORP	442	41.79	18,471.18

	SHOPIFY INC - CLASS A	128	129.50	16,576.00
	BLACKBERRY LTD	1,407	13.18	18,544.26
	BCE INC	404	62.28	25,161.12
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	805	64.87	52,220.35
	TELUS CORP	320	48.13	15,401.60
	ATCO LTD -CLASS I	63	45.73	2,880.99
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	105	38.83	4,077.15
	EMERA INC	50	48.13	2,406.50
	FORTIS INC	819	47.44	38,853.36
	HYDRO ONE LTD	550	22.73	12,501.50
	カナダドル 小計	74,909		3,399,559.86 (300,453,100)
ユーロ	ENAGAS SA	618	25.08	15,502.53
	ENI SPA	4,588	13.90	63,773.20
	GALP ENERGIA SGPS SA	766	15.56	11,918.96
	NESTE OYJ	294	51.00	14,994.00
	OMV AG	261	52.49	13,699.89
	REPSOL SA	2,543	15.47	39,352.92
	SNAM SPA	5,331	4.31	22,976.61
	TENARIS SA	1,257	12.67	15,926.19
	TOTAL SA	4,695	47.02	220,782.37
	VOPAK	56	35.87	2,009.00
	AIR LIQUIDE SA	828	107.85	89,299.80
	AKZO NOBEL	561	74.24	41,648.64
	ARCELORMITTAL	1,270	26.45	33,597.85
	ARKEMA	100	101.45	10,145.00
	BASF SE	1,808	94.29	170,490.78
	COVESTRO AG	277	83.98	23,264.12
	CRH PLC	1,673	29.92	50,056.16
	EVONIK INDUSTRIES AG	393	32.03	12,589.36
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	43.55	2,438.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	329	90.65	29,826.48
	IMERYS SA	29	77.63	2,251.27
	K+S AG-REG	153	19.62	3,001.86
	KONINKLIJKE DSM NV	286	80.00	22,880.00

LANXESS AG	133	63.14	8,398.81
LINDE AG - TENDER	378	194.54	73,536.12
SOLVAY SA	188	116.55	21,911.40
STORA ENSO OYJ-R SHS	985	12.96	12,765.60
SYMRISE AG	275	71.19	19,578.62
THYSSENKRUPP AG	618	22.81	14,100.28
UMICORE	352	39.38	13,861.76
UPM-KYMMENE OYJ	1,183	25.33	29,965.39
VOESTALPINE AG	187	48.13	9,000.31
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	363	32.41	11,766.64
AIRBUS SE	1,070	87.77	93,913.90
ALSTOM	344	34.26	11,785.44
ANDRITZ AG	216	48.00	10,369.08
BOSKALIS WESTMINSTER	71	30.88	2,192.48
BOUYGUES SA	352	44.42	15,635.84
BRENTAG AG	255	53.49	13,642.24
CNH INDUSTRIAL NV	2,356	11.10	26,151.60
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	971	47.72	46,336.12
DASSAULT AVIATION SA	2	1,358.00	2,716.00
EIFFAGE	126	92.75	11,686.50
FERROVIAL SA	885	18.63	16,491.97
GEA GROUP AG	434	39.94	17,336.13
HOCHTIEF AG	17	145.07	2,466.34
KION GROUP AG	150	67.60	10,140.00
KONE OYJ-B	637	44.15	28,123.55
LEGRAND SA	500	63.07	31,535.00
LEONARDO SPA	873	9.99	8,721.27
MAN SE	28	95.03	2,660.84
METSO OYJ	90	29.13	2,621.70
MTU AERO ENGINES AG	120	149.35	17,922.00
OSRAM LICHT AG	172	71.05	12,220.60
PRYSMIAN SPA	363	27.40	9,946.20
REXEL SA	790	15.26	12,055.40
SAFRAN SA	615	89.07	54,778.05
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,228	71.17	87,396.76

SIEMENS AG-REG	1,525	115.64	176,363.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	10.95	4,382.00
THALES SA	211	85.65	18,072.15
VINCI SA	930	87.76	81,616.80
WARTSILA OYJ ABP	245	52.70	12,911.50
ZODIAC AEROSPACE	194	24.83	4,817.99
BUREAU VERITAS SA	342	22.73	7,773.66
EDENRED	316	24.10	7,617.18
RANDSTAD HOLDING NV	211	51.94	10,959.34
RELX NV	1,667	19.21	32,031.40
SOCIETE BIC SA	23	93.00	2,139.00
TELEPERFORMANCE	135	119.10	16,078.50
WOLTERS KLUWER	604	43.74	26,418.96
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,263	18.90	23,870.70
ADP	25	164.50	4,112.50
AENA SME SA	162	168.70	27,329.40
ATLANTIA SPA	872	27.75	24,198.00
BOLLORE	740	4.44	3,290.04
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	526	30.23	15,902.03
DEUTSCHE POST AG-REG	2,015	40.49	81,597.42
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	35	86.87	3,040.45
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	1,078	10.98	11,836.44
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	824	7.25	5,974.82
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	655	85.60	56,073.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	44	73.38	3,228.76
CONTINENTAL AG	206	224.65	46,277.90
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,826	70.50	128,733.00
FAURECIA	200	64.06	12,812.00
FERRARI NV	204	90.20	18,400.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,963	14.89	29,229.07
MICHELIN (CGDE)	352	124.65	43,876.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	123	36.62	4,504.26
PEUGEOT SA	944	16.91	15,963.04
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	257	71.16	18,288.12
RENAULT SA	337	84.41	28,446.17

SCHAEFFLER AG	135	14.20	1,917.54
VALEO SA	449	59.71	26,809.79
VOLKSWAGEN AG	79	170.51	13,470.44
VOLKSWAGEN AG-PREF	378	172.47	65,197.06
ADIDAS AG	398	181.13	72,089.74
HERMES INTERNATIONAL	57	440.00	25,080.00
HUGO BOSS AG -ORD	184	72.03	13,254.44
KERING	154	385.75	59,405.50
LUXOTTICA GROUP SPA	284	51.45	14,611.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	535	247.40	132,359.00
SEB SA	21	151.80	3,187.80
ACCOR SA	277	43.08	11,933.16
PADDY POWER BETFAIR PLC	151	98.36	14,852.36
SODEXO	150	112.40	16,860.00
ALTICE NV - A	1,205	7.32	8,829.03
AXEL SPRINGER SE	35	68.05	2,382.06
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	19.13	7,824.17
JC DECAUX SA	60	34.16	2,049.60
LAGARDERE SCA	94	27.86	2,618.84
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	336	28.68	9,638.49
PUBLICIS GROUPE	359	56.91	20,430.69
RTL GROUP	32	68.30	2,185.69
SES	435	14.78	6,431.47
TELENET GROUP HOLDING NV	42	57.60	2,419.20
VIVENDI	2,216	22.19	49,184.12
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2,322	31.07	72,156.15
ZALANDO SE	220	45.39	9,987.12
CARREFOUR SA	1,308	17.71	23,164.68
CASINO GUICHARD PERRACHON	45	51.00	2,295.00
COLRUYT SA	54	45.08	2,434.59
JERONIMO MARTINS	703	16.31	11,469.44
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	2,370	18.56	43,999.05
METRO AG	170	17.53	2,980.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,424	94.43	134,468.32
DANONE	1,122	70.94	79,594.68

DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	1,400	6.61	9,254.00
HEINEKEN HOLDING NV	257	80.61	20,716.77
HEINEKEN NV	493	85.58	42,190.94
KERRY GROUP PLC-A	315	92.52	29,143.80
PERNOD RICARD SA	400	132.00	52,800.00
REMY COINTREAU	18	116.35	2,094.30
BEIERSDORF AG	107	101.28	10,837.92
HENKEL AG & CO KGAA	205	103.15	21,145.75
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	389	113.65	44,209.85
L'OREAL	525	188.40	98,910.00
UNILEVER NV-CVA	3,267	48.81	159,478.60
BIOMERIEUX	110	74.70	8,217.00
ESSILOR INTERNATIONAL	459	114.35	52,486.65
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	408	87.65	35,764.46
FRESENIUS SE & CO KGAA	777	66.36	51,563.27
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,699	32.59	55,378.90
BAYER AG-REG	1,605	104.77	168,155.85
EUROFINS SCIENTIFIC	19	508.70	9,665.30
GRIFOLS SA	422	24.08	10,161.76
IPSEN	65	99.74	6,483.10
MERCK KGAA	185	89.13	16,489.42
ORION OYJ-CLASS B	184	30.30	5,575.20
QIAGEN N.V.	173	26.64	4,609.75
RECORDATI SPA	180	38.68	6,962.40
SANOFI	2,253	73.18	164,874.54
UCB SA	212	64.08	13,584.96
ABN AMRO GROUP NV-CVA	956	26.55	25,381.80
ALLIED IRISH BANKS PLC	2,000	5.40	10,814.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	12,606	7.21	90,889.26
BANCO DE SABADELL SA	7,468	1.70	12,718.00
BANCO SANTANDER SA	31,978	5.63	180,036.14
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,600	6.93	11,088.00
BANKIA SA	1,600	4.15	6,640.00
BANKINTER SA	1,044	7.99	8,343.64
BNP PARIBAS	2,230	65.04	145,039.20

CAIXABANK S.A	7,705	4.03	31,120.49
COMMERZBANK AG	2,078	12.62	26,234.75
CREDIT AGRICOLE SA	1,969	14.67	28,885.23
ERSTE GROUP BANK AG	493	35.80	17,649.40
ING GROEP NV-CVA	7,417	15.65	116,076.05
INTESA SANPAOLO	25,003	2.88	72,008.64
INTESA SANPAOLO-RSP	804	2.74	2,207.78
KBC GROEP NV	405	72.00	29,160.00
MEDIOBANCA SPA	1,301	9.62	12,522.12
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	103	29.50	3,038.50
SOCIETE GENERALE SA	1,503	43.91	66,004.24
UNICREDIT SPA	3,986	17.96	71,588.56
AMUNDI SA	140	72.25	10,115.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3,727	16.47	61,402.32
DEUTSCHE BOERSE AG	340	98.95	33,643.68
EURAZEO	33	75.39	2,487.87
EXOR NV	188	51.25	9,635.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	137	90.81	12,440.97
NATIXIS	1,405	6.72	9,452.84
WENDEL	24	141.90	3,405.60
AEGON NV	4,056	5.24	21,281.83
AGEAS	466	42.01	19,576.66
ALLIANZ SE-REG	848	199.00	168,752.00
ASSICURAZIONI GENERALI	2,339	15.28	35,739.92
AXA SA	3,672	25.27	92,791.44
CNP ASSURANCES	139	18.68	2,596.52
HANNOVER RUECK SE	166	107.71	17,879.86
MAPFRE SA	942	2.71	2,561.29
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	308	185.86	57,245.49
NN GROUP NV	627	37.20	23,324.40
POSTE ITALIANE SPA	418	6.12	2,560.25
SAMPO OYJ-A SHS	829	44.90	37,222.10
SCOR SE	382	33.75	12,892.50
UNIPOLSAI SPA	887	1.92	1,711.02
DEUTSCHE WOHNEN SE	768	37.16	28,540.41

VONOVIA SE	1,053	41.08	43,261.45
AMADEUS IT GROUP SA	781	60.79	47,476.99
ATOS SE	214	125.20	26,792.80
CAPGEMINI SA	304	97.96	29,779.84
DASSAULT SYSTEMES SA	299	89.55	26,775.45
SAP SE	1,823	95.70	174,461.10
UBISOFT ENTERTAINMENT	145	66.49	9,641.05
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	260	57.80	15,028.00
WIRECARD AG	250	89.20	22,300.00
INGENICO GROUP	134	85.00	11,390.00
NOKIA OYJ	11,776	3.93	46,326.78
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	6,667	15.56	103,738.52
DRILLISCH AG	130	67.88	8,825.05
ELISA OYJ	300	34.59	10,377.00
ILIAD SA	33	205.75	6,789.75
KONINKLIJKE KPN NV	4,944	2.92	14,456.25
ORANGE	3,852	14.64	56,393.28
PROXIMUS	252	28.69	7,231.14
TELECOM ITALIA SPA	18,968	0.75	14,311.35
TELECOM ITALIA-RSP	9,717	0.62	6,097.41
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	4.19	2,600.90
TELEFONICA SA	8,832	8.62	76,184.83
E.ON SE	4,415	9.85	43,496.58
EDF	1,002	11.30	11,322.60
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	4,450	2.90	12,940.60
ENDESA SA	547	19.10	10,447.70
ENEL SPA	15,833	5.58	88,348.14
ENGIE	3,351	14.81	49,645.06
FORTUM OYJ	776	17.21	13,354.96
GAS NATURAL SDG SA	582	19.51	11,354.82
IBERDROLA SA	10,415	6.71	69,957.55
INNOGY SE	220	39.52	8,694.40
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,050	19.14	20,102.25
RWE AG	801	20.43	16,371.63
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	667	15.82	10,555.27

	TERNA SPA	2,725	5.28	14,388.00
	UNIPER SE	490	25.11	12,303.90
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	738	21.33	15,741.54
	ASML HOLDING NV	718	146.85	105,438.30
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,116	22.84	48,348.48
	STMICROELECTRONICS NV	1,355	18.30	24,796.50
	ユーロ 小計	361,988		7,735,199.97 (1,034,969,755)
英債券	BP PLC	39,267	4.92	193,488.14
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	8,250	23.57	194,493.75
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	7,807	23.85	186,196.95
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	1,050	6.82	7,161.00
	ANGLO AMERICAN PLC	2,413	13.64	32,913.32
	ANTOFAGASTA PLC	320	8.93	2,859.20
	BHP BILLITON PLC	3,901	13.41	52,331.91
	CRODA INTERNATIONAL PLC	296	42.53	12,588.88
	FRESNILLO PLC	180	13.06	2,350.80
	GLENCORE PLC	23,338	3.45	80,632.79
	JOHNSON MATTHEY PLC	482	30.12	14,517.84
	MONDI PLC	610	16.94	10,333.40
	RANDGOLD RESOURCES LTD	158	68.70	10,854.60
	RIO TINTO PLC	2,338	34.68	81,093.53
	ASHTED GROUP PLC	1,159	20.19	23,400.21
	BAE SYSTEMS PLC	5,893	5.57	32,824.01
	BUNZL PLC	503	20.85	10,487.55
	COBHAM PLC	1,372	1.22	1,673.84
	DCC PLC	182	69.50	12,649.00
	FERGUSON PLC	575	53.45	30,733.75
	IMI PLC	219	12.48	2,733.12
	MEGGITT PLC	623	4.91	3,062.66
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,973	8.38	24,928.60
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL	136,758	0.00	136.75
	SMITHS GROUP PLC	661	14.74	9,743.14
	TRAVIS PERKINS PLC	201	15.99	3,213.99
	WEIR GROUP PLC/THE	572	20.30	11,611.60

BABCOCK INTL GROUP PLC	204	6.61	1,349.46
CAPITA PLC	2,039	4.86	9,911.57
EXPERIAN PLC	1,773	15.73	27,889.29
G4S PLC	2,741	2.51	6,899.09
INTERTEK GROUP PLC	286	50.50	14,443.00
RELX PLC	1,978	17.12	33,863.36
EASYJET PLC	130	14.56	1,892.80
ROYAL MAIL PLC	732	4.38	3,209.08
GKN PLC	2,070	2.98	6,183.09
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,771	6.30	11,157.30
BERKELEY GROUP HOLDINGS	280	41.13	11,516.40
BURBERRY GROUP PLC	645	17.36	11,197.20
PERSIMMON PLC	752	26.71	20,085.92
TAYLOR WIMPEY PLC	4,869	2.02	9,879.20
CARNIVAL PLC	433	49.28	21,338.24
COMPASS GROUP PLC	2,870	14.91	42,791.70
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	424	44.46	18,851.04
MERLIN ENTERTAINMENT	2,373	3.59	8,521.44
TUI AG-DI	598	13.95	8,342.10
WHITBREAD PLC	263	39.94	10,504.22
ITV PLC	5,160	1.63	8,446.92
PEARSON PLC	1,090	7.40	8,071.45
SKY PLC	1,598	9.93	15,868.14
WPP PLC	2,851	13.41	38,231.91
KINGFISHER PLC	2,832	3.36	9,521.18
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,884	3.19	9,199.96
NEXT PLC	196	44.83	8,786.68
SAINSBURY (J) PLC	3,694	2.44	9,039.21
TESCO PLC	16,865	2.04	34,497.35
WM MORRISON SUPERMARKETS	3,127	2.21	6,938.81
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	565	28.83	16,288.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	4,510	49.39	222,748.90
COCA-COLA HBC AG-DI	149	23.19	3,455.31
DIAGEO PLC	5,105	26.35	134,542.27
IMPERIAL BRANDS PLC	1,707	30.83	52,635.34

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,255	67.16	84,285.80
UNILEVER PLC	2,396	41.81	100,188.74
CONVATEC GROUP PLC	2,000	2.10	4,204.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	301	5.95	1,790.95
SMITH & NEPHEW PLC	1,719	13.24	22,759.56
ASTRAZENECA PLC	2,370	47.84	113,380.80
GLAXOSMITHKLINE PLC	9,093	12.87	117,072.37
SHIRE PLC	1,741	36.48	63,511.68
BARCLAYS PLC	33,075	1.96	64,959.30
HSBC HOLDINGS PLC	39,307	7.33	288,198.92
LLOYDS BANKING GROUP PLC	135,358	0.66	90,419.14
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	5,828	2.81	16,376.68
STANDARD CHARTERED PLC	5,949	7.59	45,194.55
3I GROUP PLC	2,221	8.68	19,289.38
HARGREAVES LANSDOWN PLC	692	16.00	11,072.00
INVESTEC PLC	502	4.61	2,316.22
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	680	37.90	25,772.00
SCHRODERS PLC	320	34.25	10,960.00
ST JAMES'S PLACE PLC	749	11.57	8,665.93
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	5,860	4.18	24,518.24
ADMIRAL GROUP PLC	172	18.49	3,180.28
AVIVA PLC	8,862	5.10	45,196.20
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	3,088	3.59	11,089.00
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	12,519	2.63	33,025.12
OLD MUTUAL PLC	8,932	1.98	17,747.88
PRUDENTIAL PLC	5,371	18.35	98,557.85
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,912	6.00	11,481.56
AUTO TRADER GROUP PLC	805	3.42	2,757.93
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	860	24.25	20,855.00
SAGE GROUP PLC/THE	1,959	7.68	15,045.12
WORLDPAY GROUP PLC	4,738	4.24	20,122.28
BT GROUP PLC	15,603	2.68	41,816.04
VODAFONE GROUP PLC	50,050	2.29	114,814.70
CENTRICA PLC	10,312	1.44	14,859.59
NATIONAL GRID PLC	6,848	8.77	60,111.74

	SEVERN TRENT PLC	282	20.83	5,874.06
	SSE PLC	2,236	13.24	29,604.64
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	811	8.17	6,625.87
	英ポンド 小計	708,441		3,574,813.33 (544,408,322)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	27.15	15,747.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	23	652.50	15,007.50
	GIVAUDAN-REG	19	2,255.00	42,845.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	823	52.95	43,577.85
	SIKA AG-BR	5	7,530.00	37,650.00
	ABB LTD-REG	3,886	25.92	100,725.12
	GEBERIT AG-REG	71	427.50	30,352.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	52	216.70	11,268.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	57	222.60	12,688.20
	ADECCO SA-REG	237	74.10	17,561.70
	SGS SA-REG	12	2,476.00	29,712.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	75	173.20	12,990.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1,085	87.10	94,503.50
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	56	373.30	20,904.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	41	71.55	2,933.55
	DUFREY AG-REG	57	139.00	7,923.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	1,943.00	3,886.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	5	5,830.00	29,150.00
	NESTLE SA-REG	5,973	85.35	509,795.55
	SONOVA HOLDING AG-REG	89	157.30	13,999.70
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	16	719.00	11,504.00
	LONZA GROUP AG-REG	123	257.10	31,623.30
	NOVARTIS AG-REG	4,353	83.10	361,734.30
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,373	240.50	330,206.50
	VIFOR PHARMA AG	30	122.20	3,666.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	4,812	17.19	82,718.28
JULIUS BAER GROUP LTD	471	57.30	26,988.30	
PARGESA HOLDING SA-BR	29	84.70	2,456.30	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	28	669.50	18,746.00	
UBS GROUP AG-REG	7,008	17.35	121,588.80	

	BALOISE HOLDING AG - REG	58	151.60	8,792.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	53	329.90	17,484.70
	SWISS RE AG	538	90.65	48,769.70
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	314	297.60	93,446.40
	SWISS PRIME SITE-REG	195	86.70	16,906.50
	SWISSCOM AG-REG	47	524.00	24,628.00
	スイスフラン 小計	32,596		2,254,481.25 (258,183,192)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	151	188.90	28,523.90
	BOLIDEN AB	462	261.40	120,766.80
	ALFA LAVAL AB	659	192.50	126,857.50
	ASSA ABLOY AB-B	2,111	171.00	360,981.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,358	356.20	483,719.60
	ATLAS COPCO AB-B SHS	760	316.30	240,388.00
	SANDVIK AB	2,114	140.10	296,171.40
	SKANSKA AB-B SHS	566	182.70	103,408.20
	SKF AB-B SHARES	613	184.30	112,975.90
	VOLVO AB-B SHS	2,881	157.00	452,317.00
	SECURITAS AB-B SHS	933	145.80	136,031.40
	ELECTROLUX AB-SER B	412	269.80	111,157.60
	HUSQVARNA AB-B SHS	337	78.85	26,572.45
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,767	198.30	350,396.10
	ICA GRUPPEN AB	65	304.10	19,766.50
	SWEDISH MATCH AB	258	333.70	86,094.60
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	963	246.70	237,572.10
	GETINGE AB-B SHS	163	146.40	23,863.20
	NORDEA BANK AB	6,037	100.00	603,700.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	3,180	99.40	316,092.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,155	113.50	358,092.50
	SWEDBANK AB - A SHARES	1,557	201.90	314,358.30
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	133	200.10	26,613.30
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	481	270.60	130,158.60
	INVESTOR AB-B SHS	849	387.80	329,242.20
	LUNDBERGS AB-B SHS	45	613.00	27,585.00
	ERICSSON LM-B SHS	6,501	52.90	343,902.90

	HEXAGON AB-B SHS	471	412.20	194,146.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	55	558.50	30,717.50	
	TELE2 AB-B SHS	965	106.00	102,290.00	
	TELIA CO AB	5,963	37.42	223,135.46	
	スウェーデンクローナ 小計	45,965		6,317,597.21	(84,908,506)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	2,301	166.80	383,806.80	
	NORSK HYDRO ASA	2,329	53.70	125,067.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	339	366.10	124,107.90	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	71	216.00	15,336.00	
	MARINE HARVEST	996	137.70	137,149.20	
	ORKLA ASA	1,391	83.40	116,009.40	
	DNB ASA	1,804	152.30	274,749.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	162	149.80	24,267.60	
	TELENOR ASA	1,530	181.70	278,001.00	
	ノルウェークローネ 小計	10,923		1,478,494.40	(20,225,803)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	211	556.50	117,421.50	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	515	341.30	175,769.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	422	400.60	169,053.20	
	ISS A/S	284	233.00	66,172.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	10	10,140.00	101,400.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	14	10,630.00	148,820.00	
	DSV A/S	434	486.60	211,184.40	
	PANDORA A/S	167	636.50	106,295.50	
	CARLSBERG AS-B	198	732.00	144,936.00	
	COLOPLAST-B	177	486.30	86,075.10	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	100	176.20	17,620.00	
	GENMAB A/S	97	1,194.00	115,818.00	
	H LUNDBECK A/S	120	303.90	36,468.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	3,699	329.00	1,216,971.00	
	DANSKE BANK A/S	1,323	237.60	314,344.80	
	TRYG A/S	94	155.10	14,579.40	
TDC A/S	671	38.30	25,699.30		
	ORSTED A/S	431	350.90	151,237.90	

	デンマーククローネ 小計	8,967		3,219,865.60 (57,893,183)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	329	34.04	11,199.16
	OIL SEARCH LTD	3,517	7.26	25,533.42
	ORIGIN ENERGY LTD	4,126	9.13	37,670.38
	SANTOS LTD	2,893	5.00	14,465.00
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,931	31.56	60,942.36
	ALUMINA LTD	1,948	2.23	4,344.04
	AMCOR LIMITED	2,572	15.72	40,431.84
	BHP BILLITON LIMITED	6,107	27.17	165,927.19
	BLUESCOPE STEEL LTD	975	14.06	13,708.50
	BORAL LTD	1,791	7.85	14,059.35
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,154	4.56	14,382.24
	INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.83	20,459.86
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	801	21.94	17,573.94
	NEWCREST MINING LTD	1,487	22.76	33,844.12
	ORICA LTD	747	18.78	14,028.66
	RIO TINTO LTD	898	69.20	62,141.60
	SOUTH32 LTD	8,848	3.22	28,490.56
	CIMIC GROUP LTD	82	51.13	4,192.66
	BRAMBLES LTD	3,030	10.20	30,906.00
	SEEK LTD	909	18.65	16,952.85
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,129	5.34	27,388.86
	SYDNEY AIRPORT	2,292	7.33	16,800.36
	TRANSURBAN GROUP	4,306	12.35	53,179.10
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,336	23.02	30,754.72
	CROWN RESORTS LTD	773	12.39	9,577.47
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	49	46.85	2,295.65
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	45.59	2,005.96
	TABCORP HOLDINGS LTD	658	5.12	3,368.96
	TATTS GROUP LTD	1,709	4.52	7,724.68
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	4.20	1,856.40
WESFARMERS LTD	2,074	43.98	91,214.52	
WOOLWORTHS LTD	2,642	26.91	71,096.22	
COCA-COLA AMATIL LTD	469	8.45	3,963.05	

TREASURY WINE ESTATES LTD	1,522	16.22	24,686.84	
COCHLEAR LTD	117	180.91	21,166.47	
HEALTHSCOPE LTD	1,394	2.05	2,857.70	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	211	70.41	14,856.51	
SONIC HEALTHCARE LTD	681	22.85	15,560.85	
CSL LTD	892	142.03	126,690.76	
AUST AND NZ BANKING GROUP	5,942	28.51	169,406.42	
BANK OF QUEENSLAND LTD	304	12.68	3,854.72	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	368	11.49	4,228.32	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,227	79.62	256,933.74	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	5,447	29.84	162,538.48	
WESTPAC BANKING CORP	6,315	31.57	199,364.55	
AMP LTD	5,656	5.23	29,580.88	
ASX LTD	342	56.25	19,237.50	
CHALLENGER LTD	596	14.03	8,361.88	
MACQUARIE GROUP LTD	603	98.65	59,485.95	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	5,369	7.16	38,442.04	
MEDIBANK PRIVATE LTD	5,841	3.27	19,100.07	
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,977	10.70	21,153.90	
SUNCORP GROUP LTD	2,548	14.35	36,563.80	
LENDLEASE GROUP	1,068	16.10	17,194.80	
COMPUTERSHARE LTD	1,073	16.37	17,565.01	
REA GROUP LTD	43	77.20	3,319.60	
TELSTRA CORP LTD	9,588	3.69	35,379.72	
TPG TELECOM LTD	287	6.36	1,825.32	
AGL ENERGY LTD	1,335	25.82	34,469.70	
APA GROUP	1,768	8.86	15,664.48	
AUSNET SERVICES	1,437	1.92	2,766.22	
オーストラリアドル 小計	139,361		2,314,735.91 (197,701,594)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	914	7.16	6,544.24
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,787	6.52	11,660.17
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,400	13.40	18,760.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	10.39	16,592.83
	SPARK NEW ZEALAND LTD	3,528	3.69	13,018.32

	MERCURY NZ LTD	567	3.36	1,905.12	
	MERIDIAN ENERGY LTD	1,074	2.97	3,189.78	
	ニュージーランドドル 小計	10,867		71,670.46 (5,580,978)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	5,000	96.70	483,500.00	
	NWS HOLDINGS LTD	1,000	13.72	13,720.00	
	MTR CORP	2,500	45.40	113,500.00	
	MINTH GROUP LTD	2,000	46.25	92,500.00	
	LI & FUNG LTD	4,000	3.85	15,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	3,500	45.90	160,650.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	28.85	14,425.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,000	57.50	345,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	800	21.95	17,560.00	
	SANDS CHINA LTD	5,400	38.45	207,630.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	2,000	16.86	33,720.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	6.23	12,460.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	23.00	119,600.00	
	WH GROUP LTD	18,000	8.68	156,240.00	
	BANK OF EAST ASIA	1,000	32.80	32,800.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	8,000	38.35	306,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	1,600	185.90	297,440.00	
	FIRST PACIFIC CO	2,000	5.60	11,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,300	227.40	523,020.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	10,000	8.36	83,600.00	
	AIA GROUP LTD	22,600	61.80	1,396,680.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,500	65.80	361,900.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	1,200	27.90	33,480.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	18.28	54,840.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,650	48.25	79,612.50	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	300	42.20	12,660.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	33.15	16,575.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	10,000	11.06	110,600.00	
	SINO LAND CO	6,000	13.46	80,760.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,700	121.50	328,050.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	700	73.10	51,170.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	1,000	25.65	25,650.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	26.50	53,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	49.50	99,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	1,400	53.70	75,180.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	6,000	9.70	58,200.00	
	PCCW LTD	4,000	4.49	17,960.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	1,400	67.30	94,220.00	
	CLP HOLDINGS LTD	3,000	78.35	235,050.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.14	3,570.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	16,000	15.40	246,400.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	2,500	66.20	165,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	200	106.20	21,240.00	
	香港ドル 小計	176,950		6,662,062.50 (96,999,630)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	2,300	7.65	17,595.00	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	800	3.02	2,416.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	3.21	9,630.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	1.55	2,325.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	6,700	1.91	12,797.00	
	SATS LTD	1,200	5.26	6,312.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	800	10.56	8,448.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	10,800	1.32	14,256.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,600	2.65	4,240.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	40.81	4,081.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,700	0.37	2,109.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,600	3.10	11,160.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	3,600	24.84	89,424.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	6,100	12.39	75,579.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,300	25.88	59,524.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,300	7.58	9,854.00	
	CAPITALAND LTD	5,200	3.46	17,992.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	400	12.31	4,924.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	5,600	3.35	18,760.00	
	UOL GROUP LTD	400	8.65	3,460.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	15,400	3.78	58,212.00		

	STARHUB LTD	600	2.92	1,752.00	
	シンガポールドル 小計	79,000		434,850.00	(36,514,354)
イスラエルシ ケル	FRUTAROM	40	300.80	12,032.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	407	14.13	5,750.91	
	ELBIT SYSTEMS LTD	52	461.20	23,982.40	
	BANK HAPOALIM BM	2,520	24.56	61,891.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,596	19.81	31,616.76	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	110	62.17	6,838.70	
	AZRIELI GROUP	34	181.50	6,171.00	
	NICE SYSTEMS LTD	153	306.80	46,940.40	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,770	5.29	9,373.92	
	イスラエルシケル 小計	6,682		204,597.29	(6,600,308)
	合 計	2,235,013		7,648,672,583	(7,648,672,583)

(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	654	13,321.98	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	229	29,770.00	
		AMERICAN TOWER CORP	884	125,943.48	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,762	20,985.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	259	47,194.98	
		BOSTON PROPERTIES INC	248	30,915.68	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	521	9,341.53	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	192	17,694.72	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	820	9,987.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	801	87,709.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	388	44,546.28	
		DUKE REALTY CORP	601	16,773.91	
		EQUINIX INC	144	65,144.16	

	EQUITY RESIDENTIAL	687	45,211.47	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	126	30,783.06	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	216	18,636.48	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	126	16,416.54	
	GGP INC	897	21,016.71	
	HCP INC	716	19,174.48	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1,245	24,700.80	
	INVITATION HOMES INC	800	18,920.00	
	IRON MOUNTAIN INC	625	25,075.00	
	KIMCO REALTY CORP	547	10,004.63	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	348	15,583.44	
	MACERICH CO/THE	178	11,703.50	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	179	18,460.27	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	210	8,836.80	
	PROLOGIS INC	1,148	75,951.68	
	PUBLIC STORAGE	342	72,107.28	
	REALTY INCOME CORP	535	29,735.30	
	REGENCY CENTERS CORP	259	17,503.22	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	267	44,105.73	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	612	99,297.00	
	SL GREEN REALTY CORP	174	17,852.40	
	UDR INC	643	25,096.29	
	VENTAS INC	603	38,175.93	
	VEREIT INC	1,599	12,680.07	
	VORNADO REALTY TRUST	283	21,788.17	
	WELLTOWER INC	678	44,964.96	
	WEYERHAEUSER CO	1,409	49,920.87	
	米ドル 小計	22,955	1,353,031.32	(153,772,009)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,416.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	130	3,230.50	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,559.79	
	カナダドル 小計	297	7,207.09	(636,962)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	27	2,508.30	

	GECINA SA	93	13,610.55
	ICADE	30	2,450.10
	KLEPIERRE	383	13,634.80
	UNIBAIL-RODAMCO SE	206	46,247.00
	ユーロ 小計	739	78,450.75 (10,496,710)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	1,444	9,458.20
	HAMMERSON PLC	1,987	10,461.55
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,095	10,495.57
	SEGRO PLC	1,601	8,981.61
	英ポンド 小計	6,127	39,396.93 (5,999,758)
オーストラリアドル	DEXUS	1,537	15,923.32
	GOODMAN GROUP	3,498	30,082.80
	GPT GROUP	3,440	18,472.80
	MIRVAC GROUP	7,208	17,803.76
	SCENTRE GROUP	11,497	48,517.34
	STOCKLAND	3,647	16,922.08
	VICINITY CENTRES	8,539	23,823.81
	WESTFIELD CORP	3,925	33,323.25
	オーストラリアドル 小計	43,291	204,869.16 (17,497,874)
香港ドル	LINK REIT	4,500	314,100.00
	香港ドル 小計	4,500	314,100.00 (4,573,296)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	3,800	10,146.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,600	14,288.00
	CAPITALAND MALL TRUST	8,100	16,848.00
	SUNTEC REIT	8,500	17,340.00
	シンガポールドル 小計	28,000	58,622.00 (4,922,489)
合計			197,899,098 (197,899,098)

(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 603銘柄	97.0%		63.7%
	投資証券 40銘柄		3.0%	2.0%
カナダドル	株式 89銘柄	99.8%		3.8%
	投資証券 3銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%		13.2%
	投資証券 5銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 100銘柄	98.9%		6.9%
	投資証券 4銘柄		1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%		3.3%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.7%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	91.9%		2.5%
	投資証券 8銘柄		8.1%	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 43銘柄	95.5%		1.2%
	投資証券 1銘柄		4.5%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	88.1%		0.5%
	投資証券 4銘柄		11.9%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%		0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	122,563,173
コール・ローン	5,506,311
株式	2,675,564,165
投資証券	11,108,314
派生商品評価勘定	174,960
未収入金	2,253,266
未収配当金	595,775
差入委託証拠金	66,576,966
流動資産合計	2,884,342,930
資産合計	2,884,342,930
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,250,864
未払利息	14
流動負債合計	2,250,878
負債合計	2,250,878
純資産の部	
元本等	
元本	2,084,707,441
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	797,384,611
元本等合計	2,882,092,052
純資産合計	2,882,092,052
負債純資産合計	2,884,342,930

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

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	1,454,211,119円
期中追加設定元本額	1,449,823,393円
期中一部解約元本額	819,327,071円
期末元本額	2,084,707,441円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	304,343,298円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	926,656,221円
りそなラップ型ファンド(成長型)	220,896,929円
DCりそな グローバルバランス	1,241,716円
つみたてバランスファンド	16,195円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	631,315,983円
Smart-i 新興国株式インデックス	121,348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)	115,751円
2. 計算日における受益権の総数	2,084,707,441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	1.3825円
(10,000口当たり純資産額)	(13,825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

平成29年12月11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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11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>株式、投資証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引</p> <p>（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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る場合、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）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		129,288,921
投資証券		516,349
合計		128,772,572

(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)

（平成29年12月11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	204,785,367	-	202,697,048	2,088,319
合計		204,785,367	-	202,697,048	2,088,319

(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)

（平成29年12月11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	4,533,160	-	4,545,600	12,440
	米ドル	4,533,160	-	4,545,600	12,440
	売建	15,467	-	15,492	25
	マレーシアリン ギット	15,467	-	15,492	25
合計		4,548,627	-	4,561,092	12,415

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	25,200	4.45	112,140.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,970	57.20	112,684.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	400	115.00	46,000.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	5,800	4.95	28,756.40	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	7,000	4.60	32,249.00	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	1,300	50.60	65,780.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	800	13.16	10,528.00	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	1,150	9.65	11,097.50	

	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3,180	17.19	54,680.10	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	450	23.55	10,597.50	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	600	15.05	9,030.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	330	39.37	12,992.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	1,250	14.82	18,525.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	360	41.99	15,116.40	
	DP WORLD LTD	950	24.13	22,923.50	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	650	90.01	58,506.50	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,200	29.04	34,848.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,650	40.81	67,336.50	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	1,820	42.98	78,223.60	
	JD.COM INC-ADR	3,020	38.01	114,790.20	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1,500	8.46	12,690.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,850	26.69	49,376.50	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	5,000	4.10	20,500.00	
	CREDICORP LTD	325	209.07	67,947.75	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	11,500	16.13	185,495.00	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	14,500	1.81	26,303.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	4,000	1.44	5,772.00	
	58.COM INC-ADR	360	69.48	25,012.80	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	5,230	177.62	928,952.60	
	AUTOHOME INC-ADR	220	56.60	12,452.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,252	234.59	293,706.68	
	MOMO INC-SPON ADR	350	24.44	8,554.00	
	NETEASE INC-ADR	356	321.51	114,457.56	
	SINA CORP	230	97.02	22,314.60	
	WEIBO CORP-SPON ADR	230	100.24	23,055.20	
	YY INC-ADR	220	105.85	23,287.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	2,600	8.73	22,698.00	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	11,700	1.30	15,210.00	
	米ドル 小計	120,503		2,774,588.99	(315,332,038)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	71,000	14.19	1,007,490.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	18,000	58.94	1,060,920.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	590	381.54	225,108.60	

	MEXICHEM SAB DE CV-*	4,500	48.19	216,855.00	
	ALFA S.A.B.-A	15,400	20.76	319,704.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,000	61.14	122,280.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,300	194.85	253,305.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,150	336.33	386,779.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	800	193.80	155,040.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	12,100	70.87	857,527.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	800	118.41	94,728.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	25,400	45.46	1,154,684.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	133.10	239,580.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	1,800	129.10	232,380.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	8,700	176.70	1,537,290.00	
	GRUMA S.A.B.-B	860	243.94	209,788.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	6,400	42.65	272,960.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	2,600	28.38	73,788.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	6,600	33.81	223,146.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	7,300	29.45	214,985.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	11,200	105.84	1,185,408.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	9,000	32.42	291,780.00	
	GENTERA SAB DE CV	4,200	16.64	69,888.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	157,500	16.31	2,568,825.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	2,300	99.42	228,666.00	
	メキシコペソ 小計	373,300		13,202,905.50	(79,217,433)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	700	34.75	24,325.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	30,900	15.35	474,315.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,800	70.49	126,882.00	
	BRASKEM SA-PREF A	800	43.15	34,520.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	1,100	47.09	51,799.00	
	GERDAU SA-PREF	4,000	11.70	46,800.00	
	KLABIN SA - UNIT	2,600	17.48	45,448.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,800	18.78	33,804.00	
	VALE SA	13,600	35.48	482,528.00	
	EMBRAER SA	2,400	16.42	39,408.00	
	WEG SA	2,500	23.15	57,875.00	

CCR SA	5,800	15.97	92,626.00
LOCALIZA RENT A CAR	1,800	21.15	38,070.00
RUMO SA	5,600	12.48	69,888.00
KROTON EDUCACIONAL SA	6,000	16.99	101,940.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	3,500	15.35	53,725.00
LOJAS RENNER S.A.	3,300	34.50	113,850.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	2,300	15.51	35,673.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	700	74.91	52,437.00
RAIA DROGASIL SA	1,200	88.00	105,600.00
AMBEV SA	21,900	21.02	460,338.00
BRF SA	2,300	36.71	84,433.00
JBS SA	4,200	8.78	36,876.00
M DIAS BRANCO SA	500	49.55	24,775.00
NATURA COSMETICOS SA	800	30.70	24,560.00
ODONTOPREV S.A.	1,600	15.16	24,256.00
QUALICORP SA	900	29.76	26,784.00
HYPERMARCAS SA	1,400	34.11	47,754.00
BANCO BRADESCO SA-PREF	17,400	32.96	573,504.00
BANCO DO BRASIL S.A.	4,300	30.95	133,085.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,700	32.00	54,400.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	15,000	42.25	633,750.00
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	17,800	10.52	187,256.00
BM&FBOVESPA SA	9,400	21.73	204,262.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	3,400	27.81	94,554.00
PORTO SEGURO SA	700	35.45	24,815.00
SUL AMERICA SA - UNITS	1,300	18.06	23,478.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	3,500	12.45	43,575.00
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	400	69.32	27,728.00
CIELO SA	6,000	23.33	139,980.00
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	2,100	50.05	105,105.00
TIM PARTICIPACOES SA	3,400	11.99	40,766.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	1,700	21.47	36,499.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,200	6.71	21,472.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	1,200	32.98	39,576.00
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	1,300	13.60	17,680.00

	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	700	34.85	24,395.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,000	64.82	64,820.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	800	20.79	16,632.00	
	ブラジルリアル 小計	222,300		5,318,621.00 (183,492,424)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,350	8,205.40	19,282,690.00	
	EMPRESAS CMPC SA	4,500	1,796.30	8,083,350.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	470	34,308.00	16,124,760.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	1,580	7,924.00	12,519,920.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	3,700	5,457.50	20,192,750.00	
	CENCOSUD SA	5,200	1,568.60	8,156,720.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	650	8,264.00	5,371,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,250	2,731.00	3,413,750.00	
	BANCO DE CHILE	108,000	87.82	9,484,560.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	167	35,463.00	5,922,321.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	350,000	43.63	15,270,500.00	
	ITAU CORPBANCA	680,000	4.96	3,376,200.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	680	6,159.50	4,188,460.00	
	AES GENER SA	14,000	177.76	2,488,640.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	12,000	366.66	4,399,920.00	
	COLBUN SA	35,000	128.01	4,480,350.00	
	ENEL AMERICAS SA	144,000	124.99	17,998,560.00	
	ENEL CHILE SA	87,000	67.30	5,855,100.00	
	ENEL GENERACION CHILE SA	11,500	531.21	6,108,915.00	
	チリペソ 小計	1,462,047		172,719,066.00 (29,932,214)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	28,000	1,780.00	49,840,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	2,000	10,680.00	21,360,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	1,300	20,400.00	26,520,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	950	29,140.00	27,683,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	2,250	29,380.00	66,105,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	15,000	1,255.00	18,825,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	850	38,780.00	32,963,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	480	37,500.00	18,000,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,700	13,680.00	23,256,000.00	

コロンビアペソ 小計		52,530		284,552,000.00 (10,727,610)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	280	20.44	5,723.20
	OPAP SA	1,100	10.10	11,110.00
	FF GROUP	250	17.18	4,295.00
	JUMBO SA	560	13.38	7,492.80
	ALPHA BANK AE	6,800	1.63	11,084.00
	EUROBANK ERGASIAS SA	10,000	0.72	7,200.00
	NATIONAL BANK OF GREECE	28,000	0.27	7,616.00
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,150	10.50	12,075.00
ユーロ 小計		48,140		66,596.00 (8,910,544)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	650	118.00	76,700.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	5,000	8.94	44,700.00
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	3,100	6.90	21,390.00
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	900	33.52	30,168.00
	KOC HOLDING AS	3,960	17.58	69,616.80
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	3,500	4.34	15,190.00
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	800	21.10	16,880.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	2,500	13.59	33,975.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	60.50	27,225.00
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	600	32.50	19,500.00
	ARCELIK AS	1,000	20.50	20,500.00
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,100	73.70	81,070.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	920	23.50	21,620.00
	COCA-COLA ICECEK AS	500	34.32	17,160.00
	ULKER BISKUVI SANAYI	950	18.30	17,385.00
	AKBANK T.A.S.	9,900	9.14	90,486.00
	TURKIYE GARANTI BANKASI	10,200	10.05	102,510.00
	TURKIYE HALK BANKASI	2,600	9.92	25,792.00
	TURKIYE IS BANKASI-C	6,000	6.71	40,260.00
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	3,300	6.05	19,965.00
YAPI VE KREDI BANKASI	4,000	4.22	16,880.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	3,300	10.56	34,848.00	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	3,200	6.12	19,584.00	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	5,700	15.02	85,614.00	
トルコリラ 小計		74,130		949,018.80	(28,128,917)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	400	898.90	359,560.00	
	MONETA MONEY BANK AS	2,400	78.00	187,200.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	420	276.90	116,298.00	
	CEZ AS	850	490.40	416,840.00	
チェココルナ 小計		4,070		1,079,898.00	(5,647,866)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,880	3,051.00	5,735,880.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	710	6,489.00	4,607,190.00	
	OTP BANK PLC	1,050	10,075.00	10,578,750.00	
ハンガリーフォリント 小計		3,640		20,921,820.00	(8,916,879)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	420	60.35	25,347.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,320	111.05	146,586.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	6,200	5.93	36,766.00	
	GRUPA AZOTY SA	320	69.60	22,272.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	250	90.02	22,505.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	730	102.40	74,752.00	
	CCC SA	120	260.00	31,200.00	
	LPP SA	5	8,345.90	41,729.50	
	CYFROWY POLSAT SA	1,000	24.00	24,000.00	
	DINO POLSKA SA	350	73.00	25,550.00	
	ALIOR BANK SA	420	74.00	31,080.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	250	74.00	18,500.00	
	BANK MILLENNIUM SA	2,800	8.40	23,520.00	
	BANK PEKAO SA	810	126.55	102,505.50	
	BANK ZACHODNI WBK SA	185	366.90	67,876.50	
	MBANK SA	65	463.00	30,095.00	
	PKO BANK POLSKI SA	4,100	41.97	172,077.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,800	43.40	121,520.00	
	CD PROJEKT SA	380	94.00	35,720.00	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	5.45	22,890.00	
PLAY COMMUNICATIONS SA	750	34.00	25,500.00		

	PGE SA	3,000	12.66	37,980.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	5,000	3.28	16,400.00	
	ポーランドズロチ 小計	35,475		1,156,371.50	(36,865,123)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	8,000	7.05	56,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	112,000	5.45	610,400.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	15,500	19.02	294,810.00	
	CNOOC LTD	78,000	10.48	817,440.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	12,000	7.21	86,520.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	96,000	5.13	492,480.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	8,000	7.25	58,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	18,000	4.90	88,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,500	36.40	163,800.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	21,000	4.53	95,130.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	12,000	6.53	78,360.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	6,000	11.24	67,440.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	8,000	9.33	74,640.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	7,000	12.60	88,200.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	14,000	4.50	63,000.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	24,000	2.53	60,720.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	10,000	3.98	39,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	2,000	44.80	89,600.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	22,000	8.55	188,100.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	7,000	17.98	125,860.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	8,500	8.98	76,330.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	21,000	5.70	119,700.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	8,000	10.18	81,440.00	
	CITIC LTD	26,000	11.02	286,520.00	
	CRRG CORP LTD - H	21,000	7.19	150,990.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	13,000	16.48	214,240.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	3,000	22.50	67,500.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	14,000	3.07	42,980.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	21.65	43,300.00	
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	9,000	7.99	71,910.00	
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	2,400	43.65	104,760.00	

CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	13,000	10.50	136,500.00
AIR CHINA LTD-H	8,000	8.10	64,800.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	6,000	11.70	70,200.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	6,000	19.78	118,680.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	7.21	57,680.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	8,000	7.91	63,280.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	6,000	11.50	69,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	6,000	8.85	53,100.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	14,000	19.48	272,720.00
BYD CO LTD-H	3,000	64.70	194,100.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	12,000	9.32	111,840.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,000	30.50	61,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	23,000	25.70	591,100.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	11,500	8.80	101,200.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	10,000	18.38	183,800.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	5,000	17.66	88,300.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	5,000	33.25	166,250.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	21.20	106,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,000	73.30	219,900.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	60,000	0.91	54,600.00
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	43,000	0.86	36,980.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	10,000	8.25	82,500.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	13,000	20.35	264,550.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	8,000	23.90	191,200.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	8,000	12.86	102,880.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	33.55	67,100.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	26,000	6.09	158,340.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	3,500	79.80	279,300.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	14,000	3.71	51,940.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	5.27	42,160.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,800	19.36	54,208.00
SINOPHARM GROUP CO-H	6,000	30.10	180,600.00
3SBIO INC	4,500	14.48	65,160.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	6,000	16.84	101,040.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	9,500	9.61	91,295.00

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	20,000	15.42	308,400.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2,500	40.50	101,250.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	17,000	2.64	44,880.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	22,000	11.20	246,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	121,000	3.59	434,390.00
BANK OF CHINA LTD-H	369,000	3.76	1,387,440.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	41,000	5.68	232,880.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	46,000	4.89	224,940.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	386,000	6.65	2,566,900.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	11,000	3.57	39,270.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	18,000	30.45	548,100.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	28,500	7.68	218,880.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	10,000	5.40	54,000.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	339,000	5.90	2,000,100.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	32,000	2.76	88,320.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	4,000	17.08	68,320.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	14,000	5.84	81,760.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	50,000	3.48	174,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	11,500	16.28	187,220.00
FAR EAST HORIZON LTD	8,000	6.78	54,240.00
GF SECURITIES CO LTD-H	5,200	15.58	81,016.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	16,000	11.26	180,160.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6,200	15.46	95,852.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	33,000	24.65	813,450.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	11,800	38.20	450,760.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	8,400	28.55	239,820.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	3,000	52.30	156,900.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	27,000	3.84	103,680.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	22,000	14.94	328,680.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	24,000	78.40	1,881,600.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	8,000	11.48	91,840.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	17,000	25.70	436,900.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	16,000	3.39	54,240.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	18,000	24.20	435,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	14,000	21.90	306,600.00

CHINA VANKE CO LTD-H	5,100	28.30	144,330.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	25,000	12.98	324,500.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	30,000	3.13	93,900.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	4,400	16.58	72,952.00	
LONGFOR PROPERTIES	5,500	18.44	101,420.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	5,000	15.64	78,200.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	13,000	5.07	65,910.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	4.37	52,440.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	10,000	33.80	338,000.00	
KINGSOFT CORP LTD	3,000	22.10	66,300.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	25,900	394.00	10,204,600.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	4,000	21.65	86,600.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	148.90	521,150.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,500	18.42	64,470.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	3,000	40.80	122,400.00	
LENOVO GROUP LTD	26,000	4.30	111,800.00	
MEITU INC	7,000	10.76	75,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	3,000	116.00	348,000.00	
ZTE CORP-H	3,200	27.35	87,520.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	4.94	59,280.00	
CHINA MOBILE LTD	28,000	76.00	2,128,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	58,000	3.75	217,500.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	28,000	10.62	297,360.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	18,000	5.98	107,640.00	
CGN POWER CO LTD-H	45,000	2.06	92,700.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	10,000	24.00	240,000.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	14,000	5.25	73,500.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	4,000	29.00	116,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	8,000	14.02	112,160.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,000	56.10	168,300.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	16,000	10.68	170,880.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	16,000	4.86	77,760.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	22,000	2.40	52,800.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	52,000	1.26	65,520.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	11,000	10.72	117,920.00	

	香港ドル 小計	3,308,900		41,227,793.00 (600,276,666)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	13,500	2.40	32,400.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,100	24.50	26,950.00	
	SAPURA ENERGY BHD	17,000	0.83	14,110.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	12,600	7.42	93,492.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	7,500	5.07	38,025.00	
	GAMUDA BHD	7,400	4.75	35,150.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,800	9.50	26,600.00	
	IJM CORP BHD	12,600	2.86	36,036.00	
	SIME DARBY BERHAD	11,900	2.18	25,942.00	
	AIRASIA BHD	7,500	3.22	24,150.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	3,700	8.30	30,710.00	
	MISC BHD	5,000	7.12	35,600.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.55	24,140.00	
	GENTING BHD	12,200	8.79	107,238.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	10,600	5.25	55,650.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	10,000	2.72	27,200.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	700	38.08	26,656.00	
	IOI CORP BHD	8,500	4.49	38,165.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,800	24.46	44,028.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	300	99.46	29,838.00	
	PPB GROUP BERHAD	2,100	16.80	35,280.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	11,900	5.29	62,951.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	3,100	9.19	28,489.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	7,500	5.62	42,150.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	6,500	3.90	25,350.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	7,500	4.13	30,975.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	20,700	5.96	123,372.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	2,900	16.00	46,400.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,500	16.76	25,140.00	
	MALAYAN BANKING BHD	20,900	9.27	193,743.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	12,500	20.02	250,250.00	
RHB BANK BHD	5,500	4.85	26,675.00		
(Right)SP SETIA BHD-RIGHTS	2,800	0.00	14.00		

	IOI PROPERTIES GROUP BHD	11,000	1.95	21,450.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	11,900	1.28	15,232.00	
	SP SETIA BHD	7,000	3.41	23,870.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	9,800	5.36	52,528.00	
	DIGI.COM BHD	16,500	4.67	77,055.00	
	MAXIS BHD	8,000	5.94	47,520.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	5,000	6.04	30,200.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,500	16.00	40,000.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	14,600	15.52	226,592.00	
	YTL CORP BHD	19,380	1.18	22,868.40	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	15,300	1.21	18,513.00	
	マレーシアリングット 小計	379,880		2,238,697.40	(62,258,174)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	13,000	17.00	221,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	5,000	49.00	245,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	42,500	6.45	274,125.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	5,000	93.50	467,500.00	
	PTT PCL-NVDR	4,500	422.00	1,899,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	6,000	99.25	595,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	6,200	52.50	325,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	11,500	82.25	945,875.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	1,900	480.00	912,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	5,400	58.50	315,900.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	20,500	62.50	1,281,250.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	33,000	7.70	254,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	26,000	8.30	215,800.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	11,500	42.25	485,875.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	18,000	12.30	221,400.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	72.75	240,075.00	
	CP ALL PCL-NVDR	21,000	74.50	1,564,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	12,000	23.90	286,800.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	9,000	19.50	175,500.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	14,300	21.30	304,590.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	1,600	202.00	323,200.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	1,100	219.00	240,900.00	

	KASIKORNBANK PCL-NVDR	9,000	228.00	2,052,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	15,200	19.40	294,880.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,100	151.00	1,374,100.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	85,000	2.94	249,900.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	4,800	79.75	382,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	2,200	82.00	180,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	4,600	177.50	816,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	43,000	5.75	247,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	900	219.00	197,100.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	2,300	85.75	197,225.00	
	タイパーツ 小計	448,400		17,787,545.00	(61,900,656)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	7,000	70.90	496,300.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	18,000	15.72	282,960.00	
	DMCI HOLDINGS INC	18,000	14.32	257,760.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	14,700	69.00	1,014,300.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,240	980.50	1,215,820.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	2,500	104.50	261,250.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,900	248.80	472,720.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	3,200	144.00	460,800.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	3,200	103.50	331,200.00	
	BDO UNIBANK INC	9,800	148.00	1,450,400.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	2,700	96.15	259,605.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	250.00	350,000.00	
	AYALA CORPORATION	1,250	1,030.00	1,287,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	380	1,175.00	446,500.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	60,000	6.40	384,000.00	
	AYALA LAND INC	35,500	43.00	1,526,500.00	
	MEGAWORLD CORP	68,000	5.20	353,600.00	
	ROBINSONS LAND CO	12,000	22.20	266,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	42,000	36.50	1,533,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	150	1,760.00	264,000.00	
	PLDT INC	320	1,515.00	484,800.00	
	ABOITIZ POWER CORP	6,500	38.60	250,900.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,400	323.40	452,760.00	

	フィリピンペソ 小計	311,140		14,103,075.00 (31,731,918)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	62,000	1,725.00	106,950,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	8,700	32,900.00	286,230,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	7,900	19,400.00	153,260,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	13,000	9,150.00	118,950,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	9,500	6,225.00	59,137,500.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	34,000	1,950.00	66,300,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	11,500	6,425.00	73,887,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	87,000	8,250.00	717,750,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	36,000	2,450.00	88,200,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	9,500	10,000.00	95,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	32,000	3,000.00	96,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	2,100	80,575.00	169,207,500.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	34,000	4,340.00	147,560,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	10,000	8,775.00	87,750,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	16,000	7,375.00	118,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,800	50,900.00	397,020,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	90,000	1,675.00	150,750,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	47,500	21,125.00	1,003,437,500.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	15,000	5,500.00	82,500,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	80,000	7,475.00	598,000,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	39,500	8,850.00	349,575,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	240,000	3,370.00	808,800,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	3,540.00	92,040,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	36,000	1,630.00	58,680,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	640.00	62,080,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	239,000	4,140.00	989,460,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	13,000	6,175.00	80,275,000.00	
XL AXIATA TBK PT	22,000	2,940.00	64,680,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	40,000	1,675.00	67,000,000.00		
	インドネシアルピア 小計	1,366,000		7,188,480,000.00 (60,383,232)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	200	60,200.00	12,040,000.00	
	S-OIL CORP	180	119,000.00	21,420,000.00	

SK INNOVATION CO LTD	311	203,000.00	63,133,000.00
HANWHA CHEMICAL CORP	470	29,900.00	14,053,000.00
HYOSUNG CORPORATION	90	134,000.00	12,060,000.00
HYUNDAI STEEL CO	430	58,900.00	25,327,000.00
KOREA ZINC CO LTD	31	464,000.00	14,384,000.00
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	110	86,200.00	9,482,000.00
LG CHEM LTD	238	398,500.00	94,843,000.00
LOTTE CHEMICAL CORP	81	357,000.00	28,917,000.00
OCI CO LTD	80	120,500.00	9,640,000.00
POSCO	330	330,500.00	109,065,000.00
CJ CORP	65	190,000.00	12,350,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	125	81,800.00	10,225,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	220	34,150.00	7,513,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	220	26,900.00	5,918,000.00
HANWHA TECHWIN CO LTD	160	33,550.00	5,368,000.00
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	260	39,350.00	10,231,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	280	34,650.00	9,702,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	170	126,500.00	21,505,000.00
KCC CORP	26	382,000.00	9,932,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	242	46,150.00	11,168,300.00
LG CORP	465	87,500.00	40,687,500.00
LOTTE CORP	112	58,900.00	6,596,800.00
SAMSUNG C&T CORP	330	132,000.00	43,560,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1,450	7,640.00	11,078,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	157	295,500.00	46,393,500.00
SK NETWORKS CO LTD	900	6,420.00	5,778,000.00
S-1 CORPORATION	85	100,000.00	8,500,000.00
CJ LOGISTICS	36	151,000.00	5,436,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	68	143,000.00	9,724,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	200	31,550.00	6,310,000.00
PAN OCEAN CO LTD	950	5,690.00	5,405,500.00
HANKOOK TIRE CO LTD	270	53,200.00	14,364,000.00
HANON SYSTEMS	800	13,250.00	10,600,000.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	305	262,000.00	79,910,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	710	158,500.00	112,535,000.00

HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	105,000.00	25,200,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	100	65,100.00	6,510,000.00	
KIA MOTORS CORP	1,320	33,000.00	43,560,000.00	
COWAY CO LTD	265	103,000.00	27,295,000.00	
HANSSEM CO LTD	45	173,000.00	7,785,000.00	
LG ELECTRONICS INC	495	94,500.00	46,777,500.00	
KANGWON LAND INC	520	36,650.00	19,058,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	320	20,400.00	6,528,000.00	
CJ E&M CORP	85	89,100.00	7,573,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	130	86,100.00	11,193,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	60	101,500.00	6,090,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	41	204,500.00	8,384,500.00	
SHINSEGAE INC	33	281,500.00	9,289,500.00	
BGF CO LTD	62	28,550.00	1,770,100.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	33	194,000.00	6,402,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	230	28,550.00	6,566,500.00	
E-MART INC	90	257,500.00	23,175,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	35	390,000.00	13,650,000.00	
KT&G CORP	570	116,000.00	66,120,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	105	114,000.00	11,970,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	160	319,000.00	51,040,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	125	150,000.00	18,750,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	48	1,188,000.00	57,024,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	180	77,900.00	14,022,000.00	
CELLTRION INC	380	196,100.00	74,518,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	27	535,000.00	14,445,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	75	105,000.00	7,875,000.00	
MEDY-TOX INC	19	446,000.00	8,474,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	85	337,000.00	28,645,000.00	
SILLAJEN INC	270	91,200.00	24,624,000.00	
YUHAN CORP	40	210,000.00	8,400,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	1,100	9,280.00	10,208,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	750	10,300.00	7,725,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	1,450	46,950.00	68,077,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,100	15,550.00	17,105,000.00	

	KB FINANCIAL GROUP INC	1,790	59,500.00	106,505,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,900	48,200.00	91,580,000.00	
	WOORI BANK	1,800	15,700.00	28,260,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	170	68,800.00	11,696,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,050	10,550.00	21,627,500.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	620	13,700.00	8,494,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	180	39,100.00	7,038,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	280	36,050.00	10,094,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	215	68,700.00	14,770,500.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	910	7,130.00	6,488,300.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	270	44,850.00	12,109,500.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	200	53,900.00	10,780,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	130	263,000.00	34,190,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	305	124,000.00	37,820,000.00	
	KAKAO CORP	145	138,500.00	20,082,500.00	
	NAVER CORP	124	830,000.00	102,920,000.00	
	NCSOFT CORP	83	465,500.00	38,636,500.00	
	NETMARBLE GAMES CORP	75	185,500.00	13,912,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	180	200,500.00	36,090,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	1,120	29,650.00	33,208,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	63	154,000.00	9,702,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	220	99,600.00	21,912,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	443	2,600,000.00	1,151,800,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	81	2,075,000.00	168,075,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	237	209,500.00	49,651,500.00	
	SK TELECOM	88	271,500.00	23,892,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,110	38,000.00	42,180,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	125	41,850.00	5,231,250.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	49	382,500.00	18,742,500.00	
	SK HYNIX INC	2,690	78,700.00	211,703,000.00	
	韓国ウォン 小計	39,398		4,040,176,250.00 (420,986,365)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	5,000	108.00	540,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	10,000	26.45	264,500.00	
	CHINA STEEL CORP	60,000	24.40	1,464,000.00	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	14,000	94.40	1,321,600.00
FORMOSA PLASTICS CORP	18,000	93.00	1,674,000.00
NAN YA PLASTICS CORP	20,000	74.50	1,490,000.00
TAIWAN CEMENT	12,000	33.80	405,600.00
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	493.00	493,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	12,000	24.95	299,400.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,020	315.00	321,300.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	9,000	28.70	258,300.00
CHINA AIRLINES LTD	17,000	11.80	200,600.00
EVA AIRWAYS CORP	9,270	15.25	141,367.50
EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,000	16.30	179,300.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	8,000	23.25	186,000.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	7,000	51.10	357,700.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,020	292.00	297,840.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,000	131.00	262,000.00
GIANT MANUFACTURING	2,000	150.50	301,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	283.00	283,000.00
POU CHEN	8,000	37.15	297,200.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	4,000	47.05	188,200.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	341.50	341,500.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	3,000	275.50	826,500.00
STANDARD FOODS CORP	3,120	73.00	227,760.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	21,000	65.10	1,367,100.00
TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	172.50	172,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,950	16.40	327,180.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	56,000	9.49	531,440.00
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	74,000	20.20	1,494,800.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	47,222	18.70	883,051.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	38,760	19.15	742,254.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	30,450	16.50	502,425.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	45,000	23.35	1,050,750.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	44,505	9.36	416,566.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	39,632	13.55	537,013.60
TAIWAN BUSINESS BANK	16,480	8.29	136,619.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	41,810	16.45	687,774.50

CHAILEASE HOLDING CO LTD	6,000	82.60	495,600.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	29,000	50.20	1,455,800.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	51,000	13.85	706,350.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	39,000	53.50	2,086,500.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,170	29.55	418,723.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	34,000	10.10	343,400.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	4,000	39.60	158,400.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	7,200	29.95	215,640.00
ACER INC	14,000	20.00	280,000.00
ADVANTECH CO LTD	2,000	199.50	399,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	3,000	270.00	810,000.00
AU OPTRONICS CORP	32,000	12.50	400,000.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	3,000	313.00	939,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	3,000	75.50	226,500.00
COMPAL ELECTRONICS	17,000	20.95	356,150.00
DELTA ELECTRONICS INC	10,000	137.00	1,370,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	4,000	85.40	341,600.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	1,000	212.50	212,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	71,000	93.60	6,645,600.00
HTC CORP	3,000	65.00	195,000.00
INNOLUX CORP	32,000	12.30	393,600.00
INVENTEC CORP	11,000	22.15	243,650.00
LARGAN PRECISION CO LTD	500	4,370.00	2,185,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	10,000	37.25	372,500.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	3,000	72.20	216,600.00
PEGATRON CORP	10,000	68.60	686,000.00
QUANTA COMPUTER INC	14,000	59.80	837,200.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	6,000	40.30	241,800.00
WISTRON CORP	11,325	22.10	250,282.50
WPG HOLDINGS LTD	7,000	39.95	279,650.00
YAGEO CORPORATION	1,000	310.00	310,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	2,000	68.90	137,800.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	16,000	104.50	1,672,000.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	7,000	70.90	496,300.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	8,000	106.50	852,000.00

	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	27,000	38.00	1,026,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	396.50	396,500.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	9,000	39.85	358,650.00	
	MEDIATEK INC	7,000	296.00	2,072,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	3,000	77.30	231,900.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3,000	113.00	339,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	310.00	310,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	3,000	87.90	263,700.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	104.50	209,000.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	7,000	50.10	350,700.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	112,000	227.00	25,424,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	52,000	14.65	761,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	4,000	63.00	252,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	286.00	572,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	14,000	24.75	346,500.00	
	新台湾ドル 小計	1,448,434		81,615,038.00 (309,320,994)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,600	514.45	1,852,020.00	
	COAL INDIA LTD	2,900	264.85	768,065.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	2,600	428.45	1,113,970.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	2,300	404.85	931,155.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	5,500	180.25	991,375.00	
	PETRONET LNG LTD	2,300	251.30	577,990.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	11,870	921.00	10,932,270.00	
	ACC LTD	200	1,746.95	349,390.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,600	268.10	697,060.00	
	ASIAN PAINTS LTD	1,460	1,135.50	1,657,830.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	1,400	1,134.05	1,587,670.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	6,100	239.70	1,462,170.00	
	JSW STEEL LTD	3,600	252.45	908,820.00	
	SHREE CEMENT LTD	36	17,238.20	620,575.20	
	TATA STEEL LTD	1,300	697.80	907,140.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	415	4,165.55	1,728,703.25	
	UPL LTD	1,770	728.05	1,288,648.50	
	VEDANTA LTD	6,900	291.20	2,009,280.00	

ASHOK LEYLAND LTD	4,900	118.55	580,895.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	3,900	92.10	359,190.00
EICHER MOTORS LTD	64	28,999.95	1,855,996.80
HAVELLS INDIA LTD	1,100	537.10	590,810.00
LARSEN & TOUBRO LTD	2,250	1,220.35	2,745,787.50
SIEMENS LTD	300	1,175.30	352,590.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,650	393.40	1,435,910.00
BAJAJ AUTO LTD	360	3,212.65	1,156,554.00
BHARAT FORGE LTD	900	706.90	636,210.00
BOSCH LTD	31	19,550.25	606,057.75
HERO MOTOCORP LTD	220	3,519.55	774,301.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,600	1,388.15	2,221,040.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	480	9,042.25	4,340,280.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,700	372.30	1,005,210.00
TATA MOTORS LTD	7,300	411.15	3,001,395.00
TATA MOTORS LTD-A-DVR	1,600	233.50	373,600.00
TITAN CO LTD	1,100	810.95	892,045.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	2,600	563.00	1,463,800.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	155	4,855.85	752,656.75
ITC LTD	15,300	262.20	4,011,660.00
NESTLE INDIA LTD	85	7,921.05	673,289.25
UNITED SPIRITS LTD	250	3,420.90	855,225.00
DABUR INDIA LTD	2,300	351.15	807,645.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	1,040	1,007.65	1,047,956.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,800	1,326.65	3,714,620.00
MARICO LTD	2,000	311.95	623,900.00
AUROBINDO PHARMA LTD	1,150	672.50	773,375.00
CADILA HEALTHCARE LTD	870	416.95	362,746.50
CIPLA LTD	1,500	603.10	904,650.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	580	2,185.45	1,267,561.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	600	536.20	321,720.00
LUPIN LTD	780	822.85	641,823.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	280	2,879.95	806,386.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	4,400	521.85	2,296,140.00
AXIS BANK LTD	7,550	542.50	4,095,875.00

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	7,040	1,682.95	11,847,968.00	
	ICICI BANK LTD	10,800	310.75	3,356,100.00	
	IDFC BANK LTD	6,000	53.55	321,300.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,700	1,205.55	2,049,435.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	1,300	566.40	736,320.00	
	STATE BANK OF INDIA	8,800	313.10	2,755,280.00	
	YES BANK LTD	8,050	312.70	2,517,235.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	850	1,702.25	1,446,912.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	1,200	452.40	542,880.00	
	POWER FINANCE CORPORATION	2,800	120.95	338,660.00	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	3,000	153.00	459,000.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	630	1,375.45	866,533.50	
	BAJAJ FINSERV LTD	165	5,125.10	845,641.50	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	2,680	870.45	2,332,806.00	
	INFOSYS LTD	8,040	1,001.85	8,054,874.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	2,060	2,601.50	5,359,090.00	
	TECH MAHINDRA LTD	2,000	496.10	992,200.00	
	VAKRANGEE LTD	1,100	759.00	834,900.00	
	WIPRO LTD	6,100	282.90	1,725,690.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	5,200	525.15	2,730,780.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	373.70	896,880.00	
	IDEA CELLULAR LTD	6,000	96.20	577,200.00	
	GAIL INDIA LTD	2,600	482.50	1,254,500.00	
	NTPC LTD	8,300	180.40	1,497,320.00	
	TATA POWER CO LTD	4,900	91.60	448,840.00	
	インドルピー 小計	237,261		133,521,378.00 (237,668,052)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	850	149.71	127,253.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	320	349.43	111,817.60	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	2,150	124.35	267,352.50	
	GOLD FIELDS LTD	3,500	51.16	179,060.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	400	350.00	140,000.00	
	MONDI LTD	500	307.54	153,770.00	
	SAPPI LIMITED	2,900	98.28	285,012.00	
	SASOL LTD	2,620	418.52	1,096,522.40	

SIBANYE-STILLWATER	8,000	16.80	134,400.00	
BIDVEST GROUP LTD	1,690	197.37	333,555.30	
NASPERS LTD-N SHS	1,992	3,619.20	7,209,446.40	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	620	230.00	142,600.00	
MR PRICE GROUP LTD	1,000	211.50	211,500.00	
THE FOSCHINI GROUP LTD	850	158.86	135,031.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	1,800	83.90	151,020.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	5,200	57.80	300,560.00	
BID CORP LTD	1,450	306.27	444,091.50	
PICK N PAY STORES LTD	1,600	66.25	106,000.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	1,930	216.34	417,536.20	
SPAR GROUP LIMITED/THE	850	191.86	163,081.00	
PIONEER FOODS GROUP LTD	550	126.91	69,800.50	
TIGER BRANDS LTD	850	425.83	361,955.50	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	4,800	26.57	127,536.00	
NETCARE LTD	4,400	22.53	99,132.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	1,700	287.62	488,954.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	3,500	156.99	549,465.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	165	933.03	153,949.95	
NEDBANK GROUP LTD	900	227.13	204,417.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	5,900	176.42	1,040,878.00	
BRAIT SE	1,550	39.10	60,605.00	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	1,000	68.82	68,820.00	
FIRSTRAND LTD	16,400	55.65	912,660.00	
INVESTEC LTD	1,100	85.00	93,500.00	
PSG GROUP LTD	380	249.00	94,620.00	
REMGRO LTD	2,550	212.07	540,778.50	
RMB HOLDINGS LTD	3,700	65.42	242,054.00	
DISCOVERY LTD	1,500	155.51	233,265.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	800	113.45	90,760.00	
MMI HOLDINGS LTD	3,900	19.49	76,011.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	2,800	41.50	116,200.00	
SANLAM LTD	6,700	78.08	523,136.00	
NEPI ROCKCASTLE PLC	1,950	210.94	411,333.00	
MTN GROUP LTD	7,550	128.38	969,269.00	

	TELKOM SA SOC LTD	1,200	48.50	58,200.00	
	VODACOM GROUP LTD	3,050	140.59	428,799.50	
	南アフリカランド 小計	119,117		20,125,708.35	(167,445,893)
アラブディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	22,000	0.64	14,278.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	10,500	6.84	71,820.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	5,500	6.01	33,055.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	5,700	10.10	57,570.00	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	11,000	2.30	25,300.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	13,700	2.20	30,140.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	8,000	3.40	27,200.00	
	EMAAR MALLS PJSC	9,000	2.14	19,260.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	16,700	7.69	128,423.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	7,400	16.60	122,840.00	
	アラブディルハム 小計	109,500		529,886.00	(16,421,167)
	合 計	10,164,165		2,675,564,165	(2,675,564,165)

(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	15,700	453,573.00		
		メキシコペソ 小計	15,700	453,573.00	(2,721,438)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	8,200	21,402.00		
		トルコリラ 小計	8,200	21,402.00	(634,355)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A		4,500	78,210.00	
		FORTRESS REIT LTD-B		3,400	137,360.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		11,150	284,325.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD		1,050	110,638.50	
		REDEFINE PROPERTIES LTD		18,000	181,260.00	

	RESILIENT REIT LTD	1,000	140,000.00	
	南アフリカランド 小計	39,100	931,793.50 (7,752,521)	
	合計		11,108,314 (11,108,314)	

(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 38銘柄	100.0%		11.8%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.7%		2.9%
	投資証券 1銘柄		3.3%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	100.0%		6.8%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%		1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%		0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%		0.3%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.8%		1.0%
	投資証券 1銘柄		2.2%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%		0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	100.0%		1.4%
香港ドル	株式 136銘柄	100.0%		22.4%
マレーシアリングット	株式 44銘柄	100.0%		2.3%
タイバーツ	株式 32銘柄	100.0%		2.3%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%		1.2%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.0%		2.2%
韓国ウォン	株式 102銘柄	100.0%		15.8%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		11.6%
インドルピー	株式 78銘柄	100.0%		8.8%
南アフリカランド	株式 45銘柄	95.6%		6.2%
	投資証券 6銘柄		4.4%	0.3%
アラブディルハム	株式 10銘柄	100.0%		0.6%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
平成29年12月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	358,076,574
投資証券	9,078,855,800
派生商品評価勘定	1,640,924
未収配当金	64,530,763
前払金	678,900
差入委託証拠金	6,298,500
流動資産合計	9,510,081,461
資産合計	9,510,081,461
負債の部	
流動負債	
未払金	28,881,384
未払解約金	10,584,500
未払利息	971
流動負債合計	39,466,855
負債合計	39,466,855
純資産の部	
元本等	
元本	9,094,856,412
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	375,758,194
元本等合計	9,470,614,606
純資産合計	9,470,614,606
負債純資産合計	9,510,081,461

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)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	4,018,718,276円
期中追加設定元本額	14,892,977,999円
期中一部解約元本額	9,816,839,863円
期末元本額	9,094,856,412円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	402,848,721円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,133,794,281円
りそなラップ型ファンド(成長型)	883,204,605円
DCりそな グローバルバランス	1,649,432円
つみたてバランスファンド	43,481円
FWりそな国内リートインデックスオープン	2,123,774,001円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,121,064,937円
Smart-i リートインデックス	2,071,665円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,426,072,129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)	333,160円
2. 計算日における受益権の総数	9,094,856,412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	1.0413円
(10,000口当たり純資産額)	(10,413円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

平成29年12月11日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11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）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		104,398,553
合計		104,398,553

（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）

（平成29年12月11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	404,550,576	-	406,191,500	1,640,924
合計		404,550,576	-	406,191,500	1,640,924

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	398	181,090,000	
	MCUBS MidCity投資法人	242	93,412,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,286	173,481,400	
	産業ファンド投資法人	325	156,975,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,108	301,930,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	271	88,346,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	521	242,265,000	
	GLP投資法人	2,095	258,732,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	436	105,424,800	
	日本プロロジスリート投資法人	1,505	361,200,000	
	星野リゾート・リート投資法人	182	100,464,000	
	Oneリート投資法人	131	32,527,300	
	イオンリート投資法人	1,136	132,571,200	
	ヒューリックリート投資法人	813	132,762,900	
	日本リート投資法人	321	107,374,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	663	73,261,500	
	日本ヘルスケア投資法人	58	9,448,200	
	積水ハウス・リート投資法人	751	100,558,900	
	トーセイ・リート投資法人	192	20,467,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	435	99,223,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	147	15,802,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	208	18,553,600	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	66	10,632,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,432	488,030,400	
	いちごホテルリート投資法人	189	22,887,900	
	ラサールロジポート投資法人	903	103,574,100	
	スターアジア不動産投資法人	249	27,414,900	
	マリモ地方創生リート投資法人	67	7,658,100	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	194	68,773,000	
	大江戸温泉リート投資法人	201	17,366,400	
さくら総合リート投資法人	287	26,490,100		
投資法人みらい	152	26,706,400		
森トラスト・ホテルリ-ト投資法人	259	37,011,100		

三菱地所物流リート投資法人	111	30,380,700	
日本ビルファンド投資法人	1,159	651,358,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,131	617,526,000	
日本リートファンド投資法人	2,302	470,759,000	
オリックス不動産投資法人	2,309	361,358,500	
日本プライムリアルティ投資法人	756	278,208,000	
プレミア投資法人	1,081	114,910,300	
東急リアル・エステート投資法人	802	111,397,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	192	75,360,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,637	428,248,800	
森トラスト総合リート投資法人	855	137,227,500	
インヴィンシブル投資法人	3,282	158,684,700	
フロンティア不動産投資法人	407	181,929,000	
平和不動産リート投資法人	744	69,415,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	797	164,022,600	
福岡リート投資法人	581	97,724,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	349	221,266,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	906	100,113,000	
いちごオフィスリート投資法人	927	72,676,800	
大和証券オフィス投資法人	258	144,996,000	
阪急リート投資法人	490	64,092,000	
スタートアップリート投資法人	189	30,863,700	
大和ハウスリート投資法人	1,230	329,025,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,452	272,708,000	
日本賃貸住宅投資法人	1,346	108,218,400	
ジャパンエクセレント投資法人	1,072	143,969,600	
合計	48,588	9,078,855,800	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国リ - トマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	12,641,693
コール・ローン	5,284,168
投資証券	6,662,391,923
派生商品評価勘定	2,177
未収入金	38,947
未収配当金	12,116,406
流動資産合計	6,692,475,314
資産合計	6,692,475,314
負債の部	
流動負債	
未払金	11,596,645
未払解約金	4,000,000
未払利息	14
流動負債合計	15,596,659
負債合計	15,596,659
純資産の部	
元本等	
元本	6,251,996,628
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	424,882,027
元本等合計	6,676,878,655
純資産合計	6,676,878,655
負債純資産合計	6,692,475,314

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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>原則として、約定日基準で計上しております。</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)

平成29年12月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月 5日
期首元本額	970,212,955円
期中追加設定元本額	6,083,112,825円
期中一部解約元本額	801,329,152円
期末元本額	6,251,996,628円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	398,736,342円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	230,758,519円
りそなラップ型ファンド（成長型）	524,065,915円
DCりそな グローバルバランス	1,669,535円
つみたてバランスファンド	21,143円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	3,674,726,770円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	1,420,476,138円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,234,118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）	308,148円
2. 計算日における受益権の総数	
	6,251,996,628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	1.0680円
(10,000口当たり純資産額)	(10,680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

平成29年12月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	
<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月11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）

平成29年12月11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	平成29年12月11日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		101,087,811
合計		101,087,811

(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)

(平成29年12月11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	793,303	-	795,480	2,177
	米ドル	793,303	-	795,480	2,177
	合計	793,303	-	795,480	2,177

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	4,109	112,792.05	
		AGREE REALTY CORP	1,500	74,535.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,350	68,220.50	
		ALEXANDER'S INC	177	69,561.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,676	607,880.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,914	73,669.86	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,127	308,456.56	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,062	284,359.74	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	8,087	356,879.31	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,736	211,928.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,820	28,228.20	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1,110	10,256.40	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,070	33,969.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,906	1,258,411.32	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	920	10,110.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,912	986,309.92	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	9,092	162,110.36	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,863	284,423.59	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,784	440,893.44	
		CARETRUST REIT INC	3,505	62,038.50	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,565	42,515.30	
		CEDAR REALTY TRUST INC	4,920	29,913.60	
		CHATHAM LODGING TRUST	2,195	49,233.85	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,938	82,293.38	
		CITY OFFICE REIT INC	1,200	15,576.00	
		CLIPPER REALTY INC	650	6,526.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	28,077	341,977.86	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,905	130,264.30	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	900	24,201.00			

CORECIVIC INC	6,246	140,847.30	
CORESITE REALTY CORP	1,621	187,160.66	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	5,028	151,946.16	
COUSINS PROPERTIES INC	21,962	205,125.08	
CUBESMART	8,905	255,128.25	
CYRUSONE INC	4,643	280,669.35	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4,743	283,157.10	
DDR CORP	14,862	113,545.68	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,591	119,254.66	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,215	1,172,784.15	
DOUGLAS EMMETT INC	7,845	318,742.35	
DUKE REALTY CORP	17,720	494,565.20	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	2,525	54,540.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,581	144,392.73	
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,511	126,396.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,549	133,403.13	
EPR PROPERTIES	3,168	212,192.64	
EQUITY COMMONWEALTH	6,522	196,768.74	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,458	406,837.08	
EQUITY RESIDENTIAL	18,398	1,210,772.38	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,363	821,614.53	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,291	542,787.48	
FARMLAND PARTNERS INC	1,320	11,708.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,642	474,516.18	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	6,211	201,050.07	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	13,872	334,453.92	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,420	86,731.20	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,980	63,866.40	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	10,259	371,478.39	
GEO GROUP INC/THE	6,604	161,665.92	
GETTY REALTY CORP	1,345	37,686.90	
GGP INC	31,123	729,211.89	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,520	32,786.40	
GLADSTONE LAND CORP	420	5,665.80	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	800	7,000.00	
GLOBAL NET LEASE INC	3,234	68,463.78	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	4,492	82,158.68	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	8,287	229,798.51	
HCP INC	23,395	626,518.10	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,174	201,457.62	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	10,247	312,943.38	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,258	39,334.36	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,050	260,024.50	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,374	252,141.14	
HOST HOTELS & RESORTS INC	37,078	735,627.52	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	7,550	262,287.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	4,150	41,915.00	
INFREIT INC	2,160	43,437.60	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,000	35,160.00	
INVITATION HOMES INC	14,587	344,982.55	
IRON MOUNTAIN INC	13,313	534,117.56	
ISTAR INC	3,340	37,808.80	
JBG SMITH PROPERTIES	4,952	168,615.60	
KILROY REALTY CORP	4,942	371,984.34	
KIMCO REALTY CORP	22,189	405,836.81	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,576	86,623.68	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,953	166,981.65	
LEXINGTON REALTY TRUST	10,955	112,288.75	
LIBERTY PROPERTY TRUST	7,647	342,432.66	
LIFE STORAGE INC	2,401	216,522.18	
LTC PROPERTIES INC	1,878	85,129.74	
MACERICH CO/THE	5,542	364,386.50	
MACK-CALI REALTY CORP	4,107	88,752.27	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	50,000	45,250.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,300	14,183.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	19,018	258,264.44	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,690	586,809.70	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	4,150	74,824.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,698	323,931.84	

NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,150	56,050.50	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,980	154,915.20	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,930	30,614.70	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,200	33,348.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,240	31,875.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,005	276,037.95	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,050	27,510.00	
PARAMOUNT GROUP INC	9,750	153,465.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	8,040	228,416.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,389	127,426.40	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,712	40,200.96	
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,307	167,712.14	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,996	139,640.16	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,640	34,407.20	
PROLOGIS INC	26,917	1,780,828.72	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,068	138,679.80	
PUBLIC STORAGE	7,575	1,597,113.00	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,446	133,624.98	
QUALITY CARE PROPERTIES	4,621	67,836.28	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,748	54,308.52	
REALTY INCOME CORP	13,919	773,618.02	
REGENCY CENTERS CORP	7,589	512,864.62	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,596	109,010.08	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	10,920	140,540.40	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4,215	130,412.10	
RLJ LODGING TRUST	8,439	181,016.55	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,738	186,868.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,181	175,632.53	
SAUL CENTERS INC	500	30,890.00	
SELECT INCOME REIT	3,499	88,349.75	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	12,347	235,333.82	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,147	46,453.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	15,715	2,549,758.75	
SL GREEN REALTY CORP	5,007	513,718.20	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,219	187,750.55	

	STAG INDUSTRIAL INC	4,374	122,472.00	
	STORE CAPITAL CORP	8,235	212,545.35	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,610	68,965.60	
	SUN COMMUNITIES INC	4,062	388,327.20	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,109	185,631.39	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,539	113,838.12	
	TAUBMAN CENTERS INC	3,185	189,189.00	
	TERRENO REALTY CORP	2,624	96,563.20	
	TIER REIT INC	2,400	47,640.00	
	UDR INC	13,561	529,285.83	
	UMH PROPERTIES INC	1,030	15,480.90	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	650	47,645.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	5,154	128,850.00	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,525	34,282.00	
	VENTAS INC	18,140	1,148,443.40	
	VEREIT INC	49,334	391,218.62	
	VORNADO REALTY TRUST	8,605	662,498.95	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,096	63,762.96	
	WASHINGTON REIT	3,770	119,923.70	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	6,364	207,339.12	
	WELLTOWER INC	18,419	1,221,548.08	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	150	1,744.50	
	WHITESTONE REIT	2,400	34,800.00	
	WP CAREY INC	5,487	389,083.17	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,727	122,901.42	
	米ドル 小計	1,174,365	41,759,189.35 (4,745,931,869)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	220	2,626.80	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,284	95,699.60	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,709	52,445.26	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,370	57,553.70	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,239	119,843.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,679	77,636.96	
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,430	32,246.10	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4,530	64,054.20	

	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2,160	30,045.60
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,020	14,932.80
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	5,180	62,574.40
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,300	11,505.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,242	49,974.18
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,243	61,839.25
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7,137	151,304.40
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,480	13,438.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,600	23,072.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	720	10,569.60
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	650	8,970.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,475	37,406.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1,795	20,265.55
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	6,800	44,676.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,366	207,895.10
	SLATE OFFICE REIT	1,500	12,120.00
	SLATE RETAIL REIT - U	720	9,403.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,605	106,095.15
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,100	7,942.00
	カナダドル 小計	69,554	1,386,134.25 (122,506,545)
ユーロ	AEDIFICA	892	72,073.60
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,153	80,142.82
	ALTAREA	222	42,857.10
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	3,582	65,514.78
	BEFIMMO	1,281	71,210.79
	BENI STABILI SPA	46,870	35,949.29
	COFINIMMO	959	106,401.05
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	2,399	86,268.04
	FONCIERE DES REGIONS	2,608	242,283.20
	GECINA SA	2,350	343,922.50
	GREEN REIT PLC	33,573	51,433.83
	HAMBORNER REIT AG	4,100	40,298.90
	HIBERNIA REIT PLC	30,321	45,178.29
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,940	91,683.90

	ICADE	2,289	186,942.63
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	23,300	25,863.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	15,200	126,220.80
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	934	20,683.43
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	17,700	26,461.50
	KLEPIERRE	10,603	377,466.80
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,820	42,738.94
	MERCIALYS	2,708	48,933.56
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	16,940	190,320.90
	NSI NV	1,111	39,440.50
	RETAIL ESTATES	241	17,920.76
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,071	1,138,439.50
	VASTNED RETAIL NV	759	31,346.70
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	906	83,614.74
	WERELDHAVE NV	1,962	77,185.08
	ユーロ 小計	245,794	3,808,796.93 (509,617,029)
英bond	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	3,400	3,446.75
	ASSURA PLC	98,213	58,927.80
	BIG YELLOW GROUP PLC	8,213	69,933.69
	BRITISH LAND CO PLC	52,738	345,433.90
	CAPITAL & REGIONAL PLC	19,200	9,936.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	6,200	6,928.50
	DERWENT LONDON PLC	5,920	171,324.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	27,400	22,810.50
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	17,568	116,036.64
	HAMMERSON PLC	40,780	214,706.70
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	19,999	26,638.66
	INTU PROPERTIES PLC	41,682	98,369.52
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,626	360,645.21
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	33,022	58,614.05
	LXI REIT PLC	6,200	6,417.00
	NEWRIVER REIT PLC	15,600	49,327.20
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	29,954	33,773.13
	RDI REIT PLC	47,871	16,529.85
	REGIONAL REIT LTD	8,900	9,078.00

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	11,905	56,715.42
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	19,200	11,232.00
	SEGRO PLC	51,247	287,495.67
	SHAFTESBURY PLC	11,463	114,630.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	66,857	96,274.08
	UNITE GROUP PLC	11,900	90,023.50
	WORKSPACE GROUP PLC	5,735	55,142.02
	英債券 小計	698,793	2,390,390.59 (364,032,582)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	15,800	66,360.00
	ARENA REIT	13,900	33,360.00
	BWP TRUST	24,255	78,101.10
	CHARTER HALL GROUP	24,903	156,390.84
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	7,100	30,885.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	15,992	68,925.52
	CROMWELL PROPERTY GROUP	66,923	68,930.69
	DEXUS	50,990	528,256.40
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	9,100	25,935.00
	GDI PROPERTY GROUP	29,000	37,555.00
	GOODMAN GROUP	80,485	692,171.00
	GPT GROUP	90,656	486,822.72
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	10,300	36,771.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6,020	20,046.60
	INDUSTRIA REIT	5,250	13,597.50
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,400	32,490.00
	INVESTA OFFICE FUND	26,321	127,130.43
	MIRVAC GROUP	189,977	469,243.19
	NATIONAL STORAGE REIT	25,500	40,290.00
	PROPERTYLINK GROUP	22,600	23,278.00
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	23,800.00
	SCENTRE GROUP	263,682	1,112,738.04
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	36,627	88,637.34
	STOCKLAND	121,280	562,739.20
	VICINITY CENTRES	170,703	476,261.37
	VIVA ENERGY REIT	19,900	43,581.00

	WESTFIELD CORP	96,418	818,588.82
	オーストラリアドル 小計	1,445,082	6,162,885.76 (526,372,072)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	33,000	34,650.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	49,948	68,678.50
	INVESTORE PROPERTY LTD	8,477	12,291.65
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	61,937	83,305.26
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	57,373	76,306.09
	STRIDE STAPLED GROUP	22,111	39,136.47
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	20,200	44,238.00
	ニュージーランドドル 小計	253,046	358,605.97 (27,924,646)
香港ドル	CHAMPION REIT	94,000	534,860.00
	FORTUNE REIT	72,000	681,840.00
	LINK REIT	112,500	7,852,500.00
	PROSPERITY REIT	53,000	173,840.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56,000	193,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	40,000	209,600.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	47,000	240,640.00
	香港ドル 小計	474,500	9,886,480.00 (143,947,148)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	22,700	30,872.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	34,000	28,900.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	119,600	319,332.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	70,900	84,371.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	55,400	46,813.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	136,800	257,184.00
	CAPITALAND MALL TRUST	141,600	294,528.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	22,900	36,411.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	32,600	54,442.00
	ESR REIT	72,000	40,680.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	53,200	37,772.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	31,000	43,090.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	27,200	60,112.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	24,700	35,815.00

	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	50,000	55,000.00	
	KEPPEL DC REIT	38,400	54,528.00	
	KEPPEL REIT	96,900	121,125.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	77,000	31,955.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	101,500	160,370.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	92,500	109,150.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	59,000	117,410.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	97,500	123,825.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	70,300	57,294.50	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	19,500	55,965.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	38,400	15,744.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	25,900	16,835.00	
	SPH REIT	32,500	33,800.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	62,600	47,576.00	
	SUNTEC REIT	108,800	221,952.00	
	シンガポールドル 小計	1,815,400	2,592,851.50 (217,721,740)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,900	134,479.00	
	イスラエルシュケル 小計	8,900	134,479.00 (4,338,292)	
合計			6,662,391,923 (6,662,391,923)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 158銘柄	100.0%	71.2%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 29銘柄	100.0%	7.6%
英ポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	7.9%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.4%

香港ドル	投資証券	7銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	投資証券	29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

【中間財務諸表】

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

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2017年12月12日から2018年6月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【FWりそな国内債券インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,358,019	139,746,617
親投資信託受益証券	28,941,038,662	42,614,730,674
流動資産合計	29,054,396,681	42,754,477,291
資産合計	29,054,396,681	42,754,477,291
負債の部		
流動負債		
未払解約金	68,271,601	62,579,261
未払受託者報酬	3,163,314	5,732,733
未払委託者報酬	23,197,585	42,039,937
未払利息	307	379
その他未払費用	1,054,358	1,911,126
流動負債合計	95,687,165	112,263,436
負債合計	95,687,165	112,263,436
純資産の部		
元本等		
元本	28,966,582,797	42,508,187,573
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,873,281	134,026,282
（分配準備積立金）	80,681,100	74,678,215
元本等合計	28,958,709,516	42,642,213,855
純資産合計	28,958,709,516	42,642,213,855
負債純資産合計	29,054,396,681	42,754,477,291

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	137,551	173,192,012
営業収益合計	137,551	173,192,012
営業費用		
支払利息	14,914	47,506
受託者報酬	1,171,353	5,732,733
委託者報酬	8,589,899	42,039,937
その他費用	390,419	1,911,999
営業費用合計	10,166,585	49,732,175
営業利益又は営業損失()	10,304,136	123,459,837
経常利益又は経常損失()	10,304,136	123,459,837
中間純利益又は中間純損失()	10,304,136	123,459,837
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	682,099	4,332,516
期首剰余金又は期首欠損金()	-	7,873,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,099,711	22,772,242
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,099,711	506,955
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	22,265,287
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,122,125	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,122,125	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	51,008,649	134,026,282

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 28,966,582,797円
期中追加設定元本額 30,909,545,686円	期中追加設定元本額 16,261,174,206円
期中一部解約元本額 1,943,062,889円	期中一部解約元本額 2,719,569,430円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 28,966,582,797口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 42,508,187,573口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 7,873,281円	
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9997円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0032円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,997円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,032円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

<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 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>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>
--	---

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな国内株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,241,320	48,327,155
親投資信託受益証券	8,181,157,860	14,083,251,601
流動資産合計	8,214,399,180	14,131,578,756
資産合計	8,214,399,180	14,131,578,756
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,314,568	20,572,926
未払受託者報酬	861,317	1,657,807
未払委託者報酬	7,751,781	14,920,211
未払利息	90	131
その他未払費用	287,033	552,617
流動負債合計	28,214,789	37,703,692
負債合計	28,214,789	37,703,692
純資産の部		
元本等		
元本	6,908,921,204	11,956,144,246
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,277,263,187	2,137,730,818
（分配準備積立金）	968,388,243	864,114,416
元本等合計	8,186,184,391	14,093,875,064
純資産合計	8,186,184,391	14,093,875,064
負債純資産合計	8,214,399,180	14,131,578,756

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	223,838,071	106,863,741
営業収益合計	223,838,071	106,863,741
営業費用		
支払利息	6,835	14,558
受託者報酬	396,655	1,657,807
委託者報酬	3,569,810	14,920,211
その他費用	132,187	552,860
営業費用合計	4,105,487	17,145,436
営業利益又は営業損失（ ）	219,732,584	89,718,305
経常利益又は経常損失（ ）	219,732,584	89,718,305
中間純利益又は中間純損失（ ）	219,732,584	89,718,305
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	44,324,054	8,393,863
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	1,277,263,187
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,903,467	943,183,910
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	517,975	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,385,492	943,183,910
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	164,040,721
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	164,040,721
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	177,311,997	2,137,730,818

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 6,908,921,204円
期中追加設定元本額 8,464,338,150円	期中追加設定元本額 5,947,878,876円
期中一部解約元本額 1,555,516,946円	期中一部解約元本額 900,655,834円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 6,908,921,204口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 11,956,144,246口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1849円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1788円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,849円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,788円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,056,561	32,175,682
親投資信託受益証券	8,782,505,894	9,494,423,274
流動資産合計	8,815,562,455	9,526,598,956
資産合計	8,815,562,455	9,526,598,956
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,609,154	7,672,186
未払受託者報酬	956,092	1,525,283
未払委託者報酬	10,198,297	16,269,644
未払利息	89	87
その他未払費用	318,615	508,418
流動負債合計	27,082,247	25,975,618
負債合計	27,082,247	25,975,618
純資産の部		
元本等		
元本	8,363,296,428	9,559,432,142
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	425,183,780	58,808,804
(分配準備積立金)	406,052,664	293,122,559
元本等合計	8,788,480,208	9,500,623,338
純資産合計	8,788,480,208	9,500,623,338
負債純資産合計	8,815,562,455	9,526,598,956

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	219,372,541	503,082,620
営業収益合計	219,372,541	503,082,620
営業費用		
支払利息	7,043	13,759
受託者報酬	432,487	1,525,283
委託者報酬	4,613,234	16,269,644
その他費用	144,143	508,715
営業費用合計	5,196,907	18,317,401
営業利益又は営業損失（ ）	214,175,634	521,400,021
経常利益又は経常損失（ ）	214,175,634	521,400,021
中間純利益又は中間純損失（ ）	214,175,634	521,400,021
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,214,784	114,005,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	425,183,780
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,958,667	55,509,284
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,958,667	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	55,509,284
剰余金減少額又は欠損金増加額	124,484,730	132,107,243
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	132,107,243
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	124,484,730	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	90,434,787	58,808,804

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 8,363,296,428円
期中追加設定元本額 9,815,951,299円	期中追加設定元本額 4,287,233,931円
期中一部解約元本額 1,452,754,871円	期中一部解約元本額 3,091,098,217円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 8,363,296,428口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 9,559,432,142口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0508円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,508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 58,808,804円
	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9938円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,938円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【 F Wりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）】

（ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	109,473,132	127,652,898
親投資信託受益証券	28,968,298,282	41,742,150,086
流動資産合計	29,077,771,414	41,869,802,984
資産合計	29,077,771,414	41,869,802,984
負債の部		
流動負債		
未払解約金	53,397,603	29,663,022
未払受託者報酬	3,145,353	5,669,924
未払委託者報酬	33,550,403	60,479,057
未払利息	296	346
その他未払費用	1,048,368	1,890,222
流動負債合計	91,142,023	97,702,571
負債合計	91,142,023	97,702,571
純資産の部		
元本等		
元本	28,727,931,088	42,428,363,349
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	258,698,303	656,262,936
（分配準備積立金）	242,919,590	225,988,457
元本等合計	28,986,629,391	41,772,100,413
純資産合計	28,986,629,391	41,772,100,413
負債純資産合計	29,077,771,414	41,869,802,984

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	34,104,203	768,148,196
営業収益合計	34,104,203	768,148,196
営業費用		
支払利息	16,447	48,878
受託者報酬	1,154,163	5,669,924
委託者報酬	12,311,056	60,479,057
その他費用	384,691	1,891,209
営業費用合計	13,866,357	68,089,068
営業利益又は営業損失（ ）	20,237,846	836,237,264
経常利益又は経常損失（ ）	20,237,846	836,237,264
中間純利益又は中間純損失（ ）	20,237,846	836,237,264
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,289,174	28,827,156
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	258,698,303
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,122,948	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,122,948	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,246,941	107,551,131
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	16,276,637
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,246,941	91,274,494
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,175,321	656,262,936

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 28,727,931,088円
期中追加設定元本額 30,662,348,431円	期中追加設定元本額 16,244,825,432円
期中一部解約元本額 1,934,517,343円	期中一部解約元本額 2,544,393,171円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 28,727,931,088口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 42,428,363,349口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0090円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,090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 656,262,936円 4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9845円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,845円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな新興国債券インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,784,089	4,567,978
親投資信託受益証券	741,996,402	1,069,674,266
流動資産合計	744,780,491	1,074,242,244
資産合計	744,780,491	1,074,242,244
負債の部		
流動負債		
未払解約金	646,497	1,233,567
未払受託者報酬	78,607	149,384
未払委託者報酬	1,362,456	2,589,243
未払利息	7	12
その他未払費用	26,122	49,723
流動負債合計	2,113,689	4,021,929
負債合計	2,113,689	4,021,929
純資産の部		
元本等		
元本	688,292,151	1,074,063,709
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	54,374,651	3,843,394
(分配準備積立金)	22,828,921	21,568,435
元本等合計	742,666,802	1,070,220,315
純資産合計	742,666,802	1,070,220,315
負債純資産合計	744,780,491	1,074,242,244

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	12,589,964	78,622,136
営業収益合計	12,589,964	78,622,136
営業費用		
支払利息	535	1,524
受託者報酬	29,158	149,384
委託者報酬	505,329	2,589,243
その他費用	9,684	49,750
営業費用合計	544,706	2,789,901
営業利益又は営業損失()	12,045,258	81,412,037
経常利益又は経常損失()	12,045,258	81,412,037
中間純利益又は中間純損失()	12,045,258	81,412,037
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	68,966	622,768
期首剰余金又は期首欠損金()	-	54,374,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,571,833	26,394,942
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,571,833	26,394,942
剰余金減少額又は欠損金増加額	106,924	3,823,718
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	106,924	3,823,718
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	19,441,201	3,843,394

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 688,292,151円
期中追加設定元本額 735,195,511円	期中追加設定元本額 434,127,469円
期中一部解約元本額 47,003,360円	期中一部解約元本額 48,355,911円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 688,292,151口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,074,063,709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 3,843,394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 1.0790円	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9964円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,790円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,964円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

<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 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>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>
--	---

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな先進国株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,871,972	30,339,198
親投資信託受益証券	5,908,106,045	9,684,763,595
流動資産合計	5,932,978,017	9,715,102,793
資産合計	5,932,978,017	9,715,102,793
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,545,338	7,387,438
未払受託者報酬	624,640	1,185,762
未払委託者報酬	7,703,853	14,624,340
未払利息	67	82
その他未払費用	208,135	395,237
流動負債合計	20,082,033	23,592,859
負債合計	20,082,033	23,592,859
純資産の部		
元本等		
元本	5,138,361,469	8,405,246,746
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	774,534,515	1,286,263,188
(分配準備積立金)	519,346,148	466,658,143
元本等合計	5,912,895,984	9,691,509,934
純資産合計	5,912,895,984	9,691,509,934
負債純資産合計	5,932,978,017	9,715,102,793

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	173,258,747	139,657,550
営業収益合計	173,258,747	139,657,550
営業費用		
支払利息	4,805	10,618
受託者報酬	294,724	1,185,762
委託者報酬	3,634,941	14,624,340
その他費用	98,220	395,435
営業費用合計	4,032,690	16,216,155
営業利益又は営業損失()	169,226,057	123,441,395
経常利益又は経常損失()	169,226,057	123,441,395
中間純利益又は中間純損失()	169,226,057	123,441,395
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,997,890	6,794,708
期首剰余金又は期首欠損金()	-	774,534,515
剰余金増加額又は欠損金減少額	45,627,673	477,110,485
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	45,627,673	477,110,485
剰余金減少額又は欠損金増加額	815,625	95,617,915
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	815,625	95,617,915
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	212,040,215	1,286,263,188

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 5,138,361,469円
期中追加設定元本額 6,405,595,993円	期中追加設定元本額 3,914,801,760円
期中一部解約元本額 1,267,334,524円	期中一部解約元本額 647,916,483円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 5,138,361,469口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 8,405,246,746口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1507円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1530円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,507円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,530円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

(参考)

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

【F Wりそな新興国株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,750,950	6,329,879
親投資信託受益証券	872,794,346	1,349,790,751
流動資産合計	876,545,296	1,356,120,630
資産合計	876,545,296	1,356,120,630
負債の部		
流動負債		
未払解約金	910,879	1,597,784
未払受託者報酬	92,539	176,981
未払委託者報酬	1,758,146	3,362,466
未払利息	10	17
その他未払費用	30,773	58,921
流動負債合計	2,792,347	5,196,169
負債合計	2,792,347	5,196,169
純資産の部		
元本等		
元本	701,866,069	1,099,072,026
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	171,886,880	251,852,435
（分配準備積立金）	79,216,581	71,123,945
元本等合計	873,752,949	1,350,924,461
純資産合計	873,752,949	1,350,924,461
負債純資産合計	876,545,296	1,356,120,630

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	30,879,117	17,123,595
営業収益合計	30,879,117	17,123,595
営業費用		
支払利息	681	1,935
受託者報酬	36,631	176,981
委託者報酬	695,987	3,362,466
その他費用	12,185	58,951
営業費用合計	745,484	3,600,333
営業利益又は営業損失（ ）	30,133,633	20,723,928
経常利益又は経常損失（ ）	30,133,633	20,723,928
中間純利益又は中間純損失（ ）	30,133,633	20,723,928
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	175,765	3,315,074
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	171,886,880
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,354,337	125,470,217
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,354,337	125,470,217
剰余金減少額又は欠損金増加額	485,232	21,465,660
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	485,232	21,465,660
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	55,826,973	251,852,435

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 701,866,069円
期中追加設定元本額 814,558,599円	期中追加設定元本額 482,976,967円
期中一部解約元本額 112,792,530円	期中一部解約元本額 85,771,010円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 701,866,069口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,099,072,026口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.2449円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.2292円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,449円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (12,292円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【FWりそな国内リートインデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,797,430	5,870,582
親投資信託受益証券	1,167,364,918	1,721,423,400
流動資産合計	1,172,162,348	1,727,293,982
資産合計	1,172,162,348	1,727,293,982
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,402,648	2,258,533
未払受託者報酬	134,123	230,609
未払委託者報酬	1,207,082	2,075,451
未払利息	13	15
その他未払費用	44,623	76,790
流動負債合計	3,788,489	4,641,398
負債合計	3,788,489	4,641,398
純資産の部		
元本等		
元本	1,259,761,806	1,750,471,939
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	91,387,947	27,819,355
（分配準備積立金）	20,117,809	17,897,472
元本等合計	1,168,373,859	1,722,652,584
純資産合計	1,168,373,859	1,722,652,584
負債純資産合計	1,172,162,348	1,727,293,982

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	35,918,971	86,208,482
営業収益合計	35,918,971	86,208,482
営業費用		
支払利息	939	2,120
受託者報酬	58,737	230,609
委託者報酬	528,611	2,075,451
その他費用	19,552	76,820
営業費用合計	607,839	2,385,000
営業利益又は営業損失（ ）	36,526,810	83,823,482
経常利益又は経常損失（ ）	36,526,810	83,823,482
中間純利益又は中間純損失（ ）	36,526,810	83,823,482
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,213,325	3,994,547
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	91,387,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,122,770	11,882,471
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,122,770	11,882,471
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,940,632	28,142,814
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,940,632	28,142,814
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	60,131,347	27,819,355

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 1,259,761,806円
期中追加設定元本額 1,436,631,064円	期中追加設定元本額 663,732,094円
期中一部解約元本額 176,969,258円	期中一部解約元本額 173,021,961円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,259,761,806口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,750,471,939口
3. 元本の欠損	3. 元本の欠損
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 91,387,947円	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 27,819,355円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9275円	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9841円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,275円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,841円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

【F Wりそな先進国リートインデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,127,600	6,261,253
親投資信託受益証券	1,517,068,515	1,804,098,283
流動資産合計	1,523,196,115	1,810,359,536
資産合計	1,523,196,115	1,810,359,536
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,032,374	1,347,409
未払受託者報酬	164,908	261,890
未払委託者報酬	2,033,803	3,229,937
未払利息	16	16
その他未払費用	54,888	87,220
流動負債合計	4,285,989	4,926,472
負債合計	4,285,989	4,926,472
純資産の部		
元本等		
元本	1,479,548,942	1,839,540,425
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	39,361,184	34,107,361
（分配準備積立金）	71,146,872	52,943,503
元本等合計	1,518,910,126	1,805,433,064
純資産合計	1,518,910,126	1,805,433,064
負債純資産合計	1,523,196,115	1,810,359,536

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 1月 5日 至 2017年 7月 4日	第2期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	29,440,824	55,470,232
営業収益合計	29,440,824	55,470,232
営業費用		
支払利息	1,171	2,355
受託者報酬	69,262	261,890
委託者報酬	854,322	3,229,937
その他費用	23,055	87,259
営業費用合計	947,810	3,581,441
営業利益又は営業損失（ ）	28,493,014	59,051,673
経常利益又は経常損失（ ）	28,493,014	59,051,673
中間純利益又は中間純損失（ ）	28,493,014	59,051,673
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	140,273	44,964,954
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	39,361,184
剰余金増加額又は欠損金減少額	483,438	385,596
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	483,438	385,596
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,758,339	59,767,422
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,758,339	59,767,422
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,922,160	34,107,361

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 1,479,548,942円
期中追加設定元本額 1,618,231,745円	期中追加設定元本額 890,162,425円
期中一部解約元本額 138,782,803円	期中一部解約元本額 530,170,942円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,479,548,942口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,839,540,425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 34,107,361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 1.0266円	4. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 0.9815円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,266円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,815円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年12月11日現在	第2期中間計算期間末 2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

<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 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>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>
--	---

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	874,957
コール・ローン	573,937,391
国債証券	49,772,377,380
地方債証券	3,183,669,900

2018年 6月11日現在	
特殊債券	3,069,835,302
社債券	2,023,302,000
未収利息	142,913,737
前払費用	20,429,846
流動資産合計	58,787,340,513
資産合計	58,787,340,513
負債の部	
流動負債	
未払金	325,662,200
未払利息	1,556
その他未払費用	2,698
流動負債合計	325,666,454
負債合計	325,666,454
純資産の部	
元本等	
元本	56,242,776,408
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,218,897,651
元本等合計	58,461,674,059
純資産合計	58,461,674,059
負債純資産合計	58,787,340,513

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	42,755,412,735円
期中追加設定元本額	18,088,770,351円
期中一部解約元本額	4,601,406,678円
期末元本額	56,242,776,408円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	14,661,368,381円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	258,369,190円
りそなラップ型ファンド(成長型)	126,972,591円
DCりそな グローバルバランス	129,403,761円
つみたてバランスファンド	66,946,894円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	18,761円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	10,969円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	4,907円

FWりそな国内債券インデックスファンド	40,995,411,904円
Smart-i 国内債券インデックス	1,391,557円
Smart-i 8資産バランス 安定型	27,708円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	15,394円
Smart-i 8資産バランス 成長型	7,025円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,827,366円
2. 計算日における受益権の総数	56,242,776,408口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0395円
(10,000口当たり純資産額)	(10,395円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

RAM国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	373,329,715
株式	19,242,059,540
派生商品評価勘定	2,991,700
未収配当金	113,072,306
差入委託証拠金	8,775,000
流動資産合計	19,740,228,261
資産合計	
19,740,228,261	
負債の部	
流動負債	
前受金	1,637,500
未払金	135,873,942
未払解約金	11,000
未払利息	1,012
その他未払費用	1,291
流動負債合計	137,524,745
負債合計	
137,524,745	
純資産の部	
元本等	
元本	16,249,335,017
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,353,368,499
元本等合計	19,602,703,516
純資産合計	
19,602,703,516	
負債純資産合計	
19,740,228,261	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	10,646,785,404円
期中追加設定元本額	10,584,910,999円
期中一部解約元本額	4,982,361,386円
期末元本額	16,249,335,017円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,795,157,535円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	799,268,925円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,605,167,021円
DCりそな グローバルバランス	15,769,367円
つみたてバランスファンド	87,071,306円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	13,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	18,675円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	22,677円
FWりそな国内株式インデックスファンド	11,673,782,826円
Smart-i TOPIXインデックス	13,586,163円
Smart-i 8資産バランス 安定型	6,556円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	15,980円
Smart-i 8資産バランス 成長型	22,242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）	1,454,787円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	257,977,945円
2. 計算日における受益権の総数	16,249,335,017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	1.2064円
(10,000口当たり純資産額)	(12,064円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2018年 6月11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	345,180,800	-	348,172,500	2,991,700
	合計	345,180,800	-	348,172,500	2,991,700

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2018年 6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	92,178,583
コール・ローン	98,456,926
国債証券	21,097,122,083
派生商品評価勘定	1,934
未収利息	129,646,351
前払費用	24,051,224
流動資産合計	21,441,457,101

2018年 6月11日現在

資産合計	21,441,457,101
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	342,185
未払金	143,954,178
未払解約金	10,000,000
未払利息	267
その他未払費用	340
流動負債合計	154,296,970
負債合計	154,296,970
純資産の部	
元本等	
元本	22,394,852,413
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,107,692,282
元本等合計	21,287,160,131
純資産合計	21,287,160,131
負債純資産合計	21,441,457,101

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	19,107,771,611円
期中追加設定元本額	8,054,604,235円
期中一部解約元本額	4,767,523,433円
期末元本額	22,394,852,413円

期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,263,003,231円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	8,959,791,976円
りそなラップ型ファンド(成長型)	135,583,674円
DCりそな グローバルバランス	28,822,310円
つみたてバランスファンド	17,939,070円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	11,108円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	6,392円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	2,620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)	9,988,872,461円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	428,372円
Smart-i 8資産バランス 安定型	16,768円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	8,592円
Smart-i 8資産バランス 成長型	4,296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)	361,543円
2. 計算日における受益権の総数	22,394,852,413口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,107,692,282円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9505円
(10,000口当たり純資産額)	(9,505円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2018年 6月11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	74,801,104	-	74,458,919	342,185
	米ドル	34,822,986	-	34,688,363	134,623
	ユーロ	25,485,063	-	25,386,102	98,961
	ポーランドズロチ	6,471,823	-	6,444,312	27,511
	オーストラリアドル	8,021,232	-	7,940,142	81,090
	売建	876,735	-	874,801	1,934
	マレーシアリングット	876,735	-	874,801	1,934
合計		75,677,839	-	75,333,720	340,251

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	248,391,882
コール・ローン	463,934,688
国債証券	52,253,122,832
派生商品評価勘定	22,255,404
未収入金	346,459
未収利息	317,280,684
前払費用	61,736,210
流動資産合計	53,367,068,159
資産合計	53,367,068,159
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	648,467,725
未払金	640,241,072
未払利息	1,258
その他未払費用	1,704
流動負債合計	1,288,711,759
負債合計	1,288,711,759
純資産の部	
元本等	
元本	54,448,793,814
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,370,437,414
元本等合計	52,078,356,400
純資産合計	52,078,356,400
負債純資産合計	53,367,068,159

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

（貸借対照表に関する注記）

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	40,017,360,273円
期中追加設定元本額	14,434,863,555円
期中一部解約元本額	3,430,014円
期末元本額	54,448,793,814円
期末元本の内訳	
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	20,369円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	11,996円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	5,483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）	43,640,512,375円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	8,378,195円
Smart-i 8資産バランス 安定型	30,187円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	16,647円
Smart-i 8資産バランス 成長型	7,550円
先進国債券インデックスファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	10,796,781,153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）	3,029,859円
2. 計算日における受益権の総数	54,448,793,814口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,370,437,414円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9565円
(10,000口当たり純資産額)	(9,565円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2018年 6月11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	437,419,669	-	435,499,145	1,920,524
	米ドル	174,530,544	-	173,817,049	713,495
	カナダドル	20,507,497	-	20,471,850	35,647
	ユーロ	165,231,121	-	164,590,218	640,903
	英ポンド	27,200,394	-	27,042,339	158,055
	ポーランドズロチ	22,624,113	-	22,527,939	96,174
	オーストラリアドル	27,326,000	-	27,049,750	276,250
	売建	52,478,242,773	-	53,102,534,570	624,291,797
	米ドル	23,140,715,929	-	23,301,154,810	160,438,881
	カナダドル	1,127,363,214	-	1,128,623,200	1,259,986
	メキシコペソ	424,208,336	-	417,027,150	7,181,186
	ユーロ	21,116,149,779	-	21,502,428,480	386,278,701
	英ポンド	3,724,077,861	-	3,781,956,850	57,878,989
	スウェーデンクローナ	210,097,588	-	214,331,070	4,233,482
	ノルウェークローネ	134,728,388	-	138,122,160	3,393,772
	デンマーククローネ	320,966,443	-	326,672,520	5,706,077

	ポーランドズロチ	341,987,408	-	350,532,420	8,545,012
	オーストラリアドル	1,136,804,832	-	1,150,242,600	13,437,768
	シンガポールドル	221,527,234	-	224,023,850	2,496,616
	マレーシアリンギット	247,031,443	-	245,681,540	1,349,903
	南アフリカランド	332,584,318	-	321,737,920	10,846,398
	合計	52,915,662,442	-	53,538,033,715	626,212,321

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

RAM新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	15,334,635
コール・ローン	4,992,700
投資信託受益証券	1,919,840,734
流動資産合計	1,940,168,069
資産合計	1,940,168,069
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,718
未払金	9,538,416
未払利息	13
その他未払費用	59
流動負債合計	9,554,206
負債合計	9,554,206
純資産の部	
元本等	
元本	1,803,300,367
剰余金	

2018年 6月11日現在

剰余金又は欠損金（ ）	127,313,496
元本等合計	1,930,613,863
純資産合計	1,930,613,863
負債純資産合計	1,940,168,069

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	1,314,276,430円
期中追加設定元本額	509,436,257円
期中一部解約元本額	20,412,320円
期末元本額	1,803,300,367円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	419,703,472円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	244,983,172円
りそなラップ型ファンド(成長型)	119,798,234円
DCりそな グローバルバランス	3,639,241円
つみたてバランスファンド	15,795,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,736円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	4,146円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	5,026円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	999,135,313円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,764円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	3,706円
Smart-i 8資産バランス 成長型	4,678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）	223,480円
2. 計算日における受益権の総数	1,803,300,367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	1.0706円
(10,000口当たり純資産額)	(10,706円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2018年 6月11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	4,413,598	-	4,397,880	15,718
	米ドル	4,413,598	-	4,397,880	15,718
合計		4,413,598	-	4,397,880	15,718

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R A M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	347,406,370
コール・ローン	78,136,849
株式	13,169,053,205
投資証券	293,548,385
派生商品評価勘定	9,662,409
未収入金	10,736
未収配当金	25,497,673
差入委託証拠金	294,234,524
流動資産合計	14,217,550,151
資産合計	
14,217,550,151	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,248,511
未払解約金	10,000,000
未払利息	211
その他未払費用	285
流動負債合計	12,249,007
負債合計	
12,249,007	
純資産の部	

2018年 6月11日現在

元本等	
元本	11,683,269,893
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,522,031,251
元本等合計	14,205,301,144
純資産合計	14,205,301,144
負債純資産合計	14,217,550,151

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日

期首元本額	7,099,520,268円
期中追加設定元本額	6,663,726,951円
期中一部解約元本額	2,079,977,326円
期末元本額	11,683,269,893円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	896,341,848円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	762,478,768円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,916,701,159円
DCりそな グローバルバランス	7,956,075円
つみたてバランスファンド	57,495,899円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	15,156円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	21,369円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	26,251円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	7,965,098,771円
Smart-i 先進国株式インデックス	75,103,811円
Smart-i 8資産バランス 安定型	8,302円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	17,819円
Smart-i 8資産バランス 成長型	24,032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)	1,980,633円
2. 計算日における受益権の総数	11,683,269,893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	1.2159円
(10,000口当たり純資産額)	(12,159円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2018年 6月11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	658,953,106	-	666,590,624	7,637,518
合計		658,953,106	-	666,590,624	7,637,518

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

（通貨関連）

（2018年 6月11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	65,273,870	-	65,033,250	240,620
	米ドル	46,112,220	-	45,948,000	164,220
	カナダドル	2,959,950	-	2,954,700	5,250
	ユーロ	7,771,800	-	7,743,600	28,200
	英ポンド	3,682,750	-	3,668,250	14,500
	スイスフラン	2,239,000	-	2,221,800	17,200
	オーストラリアドル	2,508,150	-	2,496,900	11,250

	売建	37,209,600	-	37,192,600	17,000
	米ドル	37,209,600	-	37,192,600	17,000
	合計	102,483,470	-	102,225,850	223,620

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

RAM新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	213,098,051
コール・ローン	16,133,823
株式	3,893,905,164
投資証券	14,441,470
派生商品評価勘定	917,225
未収入金	83,595
未収配当金	7,988,378
差入委託証拠金	78,096,311
流動資産合計	4,224,664,017
資産合計	4,224,664,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,155,694
未払解約金	10,000,000
未払利息	43
その他未払費用	34
流動負債合計	11,155,771
負債合計	11,155,771
純資産の部	
元本等	
元本	3,076,691,556
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,136,816,690
元本等合計	4,213,508,246

2018年 6月11日現在

純資産合計	4,213,508,246
負債純資産合計	4,224,664,017

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	2,084,707,441円
期中追加設定元本額	1,288,844,068円
期中一部解約元本額	296,859,953円
期末元本額	3,076,691,556円

期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	326,902,794円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,317,009,624円
りそなラップ型ファンド（成長型）	390,591,591円
DCりそな グローバルバランス	2,892,022円
つみたてバランスファンド	12,543,210円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	4,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	6,639円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	8,315円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	985,608,435円
Smart-i 新興国株式インデックス	40,760,710円
Smart-i 8資産バランス 安定型	2,116円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	5,108円
Smart-i 8資産バランス 成長型	7,442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）	348,807円
2. 計算日における受益権の総数	3,076,691,556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	1.3695円
(10,000口当たり純資産額)	(13,695円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2018年 6月11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	286,366,451	-	286,143,255	223,196
合計		286,366,451	-	286,143,255	223,196

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

（通貨関連）

（2018年 6月11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	5,160,177	-	5,141,800	18,377
	米ドル	5,160,177	-	5,141,800	18,377
	売建	5,745,439	-	5,742,335	3,104
	米ドル	5,472,000	-	5,469,500	2,500
	マレーシアリン ギット	273,439	-	272,835	604
合計		10,905,616	-	10,884,135	15,273

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,142,803,659
投資証券	10,298,288,840
未収入金	505,412,160
未収配当金	85,202,467
前払金	2,465,800
差入委託証拠金	11,534,500
流動資産合計	12,045,707,426
資産合計	12,045,707,426
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,726,028
未払金	43,496,736
未払解約金	516,400,000
未払利息	3,099
その他未払費用	1,872
流動負債合計	561,627,735
負債合計	561,627,735
純資産の部	
元本等	
元本	10,375,923,540
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,108,156,151
元本等合計	11,484,079,691
純資産合計	11,484,079,691
負債純資産合計	12,045,707,426

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券
--------------------	------

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	9,094,856,412円
期中追加設定元本額	11,471,459,058円
期中一部解約元本額	10,190,391,930円
期末元本額	10,375,923,540円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	411,873,246円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	252,107,503円
りそなラップ型ファンド(成長型)	571,937,161円
DCりそな グローバルバランス	3,586,039円
つみたてバランスファンド	31,159,663円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,683円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	5,099円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	6,043円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,120,031,961円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,555,315,685円
Smart-i Jリートインデックス	188,100,780円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,794円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	4,627円
Smart-i 8資産バランス 成長型	5,662円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	4,241,261,489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)	523,105円
2. 計算日における受益権の総数	10,375,923,540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	1.1068円
(10,000口当たり純資産額)	(11,068円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
投資証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2018年 6月11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	672,877,528	-	671,151,500	1,726,028
	合計	672,877,528	-	671,151,500	1,726,028

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国リ - トマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2018年 6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	47,084,982
コール・ローン	32,368,527
株式	151,957,124
投資証券	7,615,778,837
派生商品評価勘定	14,112
未収入金	91,605
未収配当金	5,814,390
流動資産合計	7,853,109,577
資産合計	7,853,109,577
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,470
未払金	19,525,303
未払解約金	16,000,000
未払利息	87
その他未払費用	117
流動負債合計	35,582,977
負債合計	35,582,977
純資産の部	
元本等	
元本	7,640,366,171
剰余金	
剰余金又は欠損金()	177,160,429
元本等合計	7,817,526,600
純資産合計	7,817,526,600
負債純資産合計	7,853,109,577

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6月11日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	6,251,996,628円
期中追加設定元本額	4,151,599,624円
期中一部解約元本額	2,763,230,081円
期末元本額	7,640,366,171円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	440,512,334円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	939,255,807円
りそなラップ型ファンド(成長型)	943,674,186円
DCりそな グローバルバランス	3,914,465円
つみたてバランスファンド	16,881,163円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	4,618円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	6,261円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	8,216円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	3,410,138,506円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	1,763,192,224円
Smart-i 先進国リートインデックス	121,841,002円
Smart-i 8資産バランス 安定型	1,981円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	5,166円
Smart-i 8資産バランス 成長型	7,357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)	922,885円
2. 計算日における受益権の総数	7,640,366,171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	1.0232円
(10,000口当たり純資産額)	(10,232円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2018年 6月11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	15,290,370	-	15,232,900	57,470
	米ドル	8,783,280	-	8,752,000	31,280
	ユーロ	3,497,310	-	3,484,620	12,690
	オーストラリアド ル	3,009,780	-	2,996,280	13,500
	売建	24,618,712	-	24,604,600	14,112
	米ドル	16,416,000	-	16,408,500	7,500
	ユーロ	2,583,000	-	2,581,200	1,800

	英ポンド	1,468,630	-	1,467,300	1,330
	香港ドル	2,510,100	-	2,507,400	2,700
	シンガポールドル	1,640,982	-	1,640,200	782
	合計	39,909,082	-	39,837,500	43,358

(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ではありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 6月29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	43,984,111,673円
負債総額	53,236,037円
純資産総額（ - ）	43,930,875,636円
発行済口数	43,744,176,819口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0043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	14,116,726,118円
負債総額	17,713,942円
純資産総額（ - ）	14,099,012,176円
発行済口数	12,334,322,997口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1431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	9,856,773,367円
負債総額	9,563,380円
純資産総額（ - ）	9,847,209,987円
発行済口数	9,831,502,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0016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	43,496,448,006円
負債総額	38,231,262円

純資産総額（ - ）	43,458,216,744円
発行済口数	43,760,778,712口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9931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	1,081,369,339円
負債総額	1,160,368円
純資産総額（ - ）	1,080,208,971円
発行済口数	1,104,726,314口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9778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	9,902,243,463円
負債総額	9,750,287円
純資産総額（ - ）	9,892,493,176円
発行済口数	8,720,456,190口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1344円

【FWりそな新興国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

資産総額	1,295,199,199円
負債総額	1,520,585円
純資産総額（ - ）	1,293,678,614円
発行済口数	1,129,214,413口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1456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	1,791,977,076円
------	----------------

負債総額	2,144,913円
純資産総額（ - ）	1,789,832,163円
発行済口数	1,785,824,821口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0022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	1,880,077,074円
負債総額	1,664,444円
純資産総額（ - ）	1,878,412,630円
発行済口数	1,877,820,074口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0003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	60,090,854,665円
負債総額	324,078,540円
純資産総額（ - ）	59,766,776,125円
発行済口数	57,421,864,672口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0408円

RAM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	19,814,938,144円
負債総額	244,976,173円
純資産総額（ - ）	19,569,961,971円
発行済口数	16,726,252,137口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1700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	22,155,921,557円
負債総額	59,909,616円
純資産総額（ - ）	22,096,011,941円
発行済口数	23,062,151,449口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9581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	54,735,558,859円
負債総額	867,330,827円
純資産総額（ - ）	53,868,228,032円
発行済口数	55,823,813,864口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9650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	1,964,723,320円
負債総額	2,879,071円
純資産総額（ - ）	1,961,844,249円
発行済口数	1,866,843,622口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0509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	14,415,069,693円
負債総額	24,882,186円
純資産総額（ - ）	14,390,187,507円
発行済口数	12,027,300,952口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1965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	4,469,686,103円
負債総額	317,446,561円
純資産総額（ - ）	4,152,239,542円
発行済口数	3,252,140,482口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2768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	9,978,870,106円
負債総額	37,217,862円
純資産総額（ - ）	9,941,652,244円
発行済口数	8,818,164,595口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1274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	8,128,799,464円
負債総額	17,206,385円
純資産総額（ - ）	8,111,593,079円
発行済口数	7,776,234,199口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0431円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとしします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律

の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2018年6月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 委託会社の機構（2018年6月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会において選任され、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。また、取締役会は、取締役社長1名を選定し、必要に応じ、取締役副社長、専務取締役および常務取締役を各若干名定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。

社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

取締役会は、法令、定款等に定められた業務執行の重要事項を決定します。

取締役会の決議は、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

・運用部は、運用基本方針や運用ガイドラインなどを策定し、運用委員会がその承認を行います。

DO：実行

- ・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、運用部長が承認します。
- ・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。
- ・運用部長は、ファンドが運用計画に沿って行われていることを確認します。
- ・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離された運用部トレーディンググループが、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

CHECK：検証 ACTION：改善

- ・法令等や運用ガイドラインの遵守状況等については、運用部門から独立した業務部がモニタリングを行います。その結果は、コンプライアンス・リスク管理委員会に報告するとともにすみやかに運用部にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
- ・運用実績等については運用委員会が統括し、運用部に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「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である委託会社は、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。

2018年6月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	57	456,651

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- (2) 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期事業年度（自2017年4月1日至2018年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		（単位：千円）	
		前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）
資産の部			
流動資産			
預金		334,657	1,159,736
前払費用		36,555	45,871
未収入金	2	95,899	19,258
未収委託者報酬		67,272	213,404
未収還付消費税等		11,066	-
繰延税金資産		8,236	22,764
流動資産計		553,688	1,461,036
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	3,992	3,519
器具備品	1	3,866	5,451
有形固定資産計		7,858	8,970
無形固定資産			
ソフトウェア		36,708	30,292
無形固定資産計		36,708	30,292
投資その他の資産			
投資有価証券		2,796	1,716
差入敷金保証金		10,200	15,266
長期前払費用		3,416	2,416
繰延税金資産		873	18,917
投資その他の資産計		17,286	38,317
固定資産計		61,853	77,580
資産合計		615,542	1,538,616

		（単位：千円）	
		前事業年度 （2017年3月31日）	当事業年度 （2018年3月31日）

負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	27,694	52,802
その他未払金	55,592	94,427
未払費用	17,511	21,235
未払法人税等	4,868	8,252
未払消費税等	-	12,000
預り金	32	106
賞与引当金	26,272	31,097
流動負債計	131,972	219,921
負債合計	131,972	219,921
純資産の部		
株主資本		
資本金	490,000	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	496,843	171,316
利益剰余金計	496,843	171,316
株主資本計	483,156	1,318,683
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	413	11
評価・換算差額等計	413	11
純資産合計	483,569	1,318,695
負債・純資産合計	615,542	1,538,616

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2016年4月1日	(自	2017年4月1日
	至	2017年3月31日)	至	2018年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		332,491		854,946
営業収益計		332,491		854,946
営業費用				
支払手数料		150,399		213,554
広告宣伝費		20,758		24,143
調査費				
調査費		110,241		155,859
委託調査費		65,285		111,085
委託計算費		52,522		92,905
営業雑経費				
印刷費		12,940		26,910
協会費		1,482		2,097
販売促進費		1,560		1,592
その他		15,978		41,568
営業費用計		431,169		669,717

一般管理費		
給料		
役員報酬	46,399	61,599
給料・手当	150,916	195,821
賞与	10,843	20,138
賞与引当金繰入額	23,811	31,097
旅費交通費	2,575	4,892
租税公課	5,778	7,802
不動産賃借料	16,113	16,648
固定資産減価償却費	8,420	11,306
諸経費	37,244	48,459
一般管理費計	302,103	397,765
営業損失	400,782	212,537
営業外収益		
投資有価証券売却益	419	1,616
雑収入	16	14
営業外収益計	436	1,630
営業外費用		
為替差損	26	-
株式交付費	-	3,630
営業外費用計	26	3,630
経常損失	400,372	214,536
税引前当期純損失	400,372	214,536
法人税、住民税及び事業税	95,241	17,669
法人税等調整額	2,141	32,394
法人税等計	97,383	50,063
当期純損失	302,989	164,472

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	490,000	490,000	490,000	193,854	193,854	786,145
当期変動額						
当期純損失（ ）				302,989	302,989	302,989
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	302,989	302,989	302,989
当期末残高	490,000	490,000	490,000	496,843	496,843	483,156

	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	-	-	786,145
当期変動額			

当期純損失（ ）			302,989
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	413	413	413
当期変動額合計	413	413	302,575
当期末残高	413	413	483,569

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	490,000	490,000	490,000	496,843	496,843	483,156
当期変動額						
欠損填補		490,000	490,000	490,000	490,000	
新株の発行	510,000	490,000	490,000			1,000,000
当期純損失（ ）				164,472	164,472	164,472
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	510,000	0	0	325,527	325,527	835,527
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683

	評価・換算差額等		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	413	413	483,569
当期変動額			
欠損填補			
新株の発行			1,000,000
当期純損失（ ）			164,472
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	401	401	401
当期変動額合計	401	401	835,125
当期末残高	11	11	1,318,695

（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 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。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し、認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
建物	800千円	1,273千円
器具備品	1,607千円	3,324千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
流動資産		
未収入金	95,685千円	18,947千円

(注) 当該金額は、連結納税親会社から収受する金額であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式（株）	1,960,000	-	-	1,960,000

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	増加	減少	当期末
普通株式（株）	1,960,000	2,000,000	-	3,960,000

2．配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

当社の未収入金は、主に連結納税親会社から収受する金額であります。

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。

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（2017年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	334,657	334,657	-
未収入金	95,899	95,899	-
未収委託者報酬	67,272	67,272	-
資産計	497,828	497,828	-

当事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

負債計	94,427	94,427	-
-----	--------	--------	---

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収入金、未収委託者報酬

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

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 (2017年3月31日)	当事業年度 (2018年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	8,102千円	9,518千円
未払事業所税	222千円	281千円
未払事業税	1,190千円	1,954千円
未確定債務	1,280千円	1,190千円
減価償却超過額	1,372千円	2,966千円
繰越欠損金	37,126千円	75,767千円
繰延税金資産小計	49,294千円	91,677千円
評価性引当額	40,000千円	49,990千円
繰延税金資産合計	9,294千円	41,687千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	182千円	5千円
繰延税金負債合計	182千円	5千円
繰延税金資産の純額	9,110千円	41,682千円

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

前事業年度及び当事業年度ともに税引前当期純損失のため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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

顧客情報については、制度上知り得ないため、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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

顧客情報については、制度上知り得ないため、記載を省略しております。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
該当事項はありません。
4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
該当事項はありません。
5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017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	連結法人税還付請求	95,685	未収入金	95,685

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	--------	-----	-------------------	-------	------------------------	-----------	-------	--------------	----	--------------

親会社 の子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言	支払手数料	121,659	未払手数料	23,073
							委託調査費	62,746	その他 未払金	38,267

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主(会社等に限る)等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社 りそなホール ディングス	東京都 江東区	50,472	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税 資金の調達	連結法人税 還付請求	18,947	未収入金	18,947
							増資の割当	1,000,000	-	-

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社 の子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言	支払手数料	177,380	未払手数料	45,605
							委託調査費	63,426	その他 未払金	21,550

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1株当たり純資産額	246円71銭	333円
1株当たり当期純損失金額	154円58銭	47円97銭

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失であり、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純損失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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
当期純損失(千円)	302,989	164,472

普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純損失（千円）	302,989	164,472
普通株式の期中平均株式数（株）	1,960,000	3,428,493

（重要な後発事象）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

- 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
 資本金の額：51,000百万円（2018年3月末現在）
 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
 再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
株式会社近畿大阪銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
 ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
 ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2018年6月8日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 太田 健司 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第3期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2018年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内債券インデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内債券インデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内株式インデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内株式インデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな新興国債券インデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな新興国債券インデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国株式インデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国株式インデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな新興国株式インデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな新興国株式インデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな国内リートインデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな国内リートインデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月1日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国リートインデックスファンドの平成29年1月5日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWりそな先進国リートインデックスファンドの平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1.上記は、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いません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内債券インデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな国内債券インデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな国内株式インデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）の2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）の2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな新興国債券インデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな新興国債券インデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな先進国株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな先進国株式インデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな新興国株式インデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな新興国株式インデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWRりそな国内リートインデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWRりそな国内リートインデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月7日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWりそな先進国リートインデックスファンドの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWりそな先進国リートインデックスファンドの2018年6月11日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。