

Smart-i 国内債券インデックス

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2018年6月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「Smart-i 国内債券インデックス」は、2018年6月25日に第1期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型
信託期間	2017年8月29日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI 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。
主要投資対象	RAM国内債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）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。 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。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、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。

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ：<http://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
(設定日)	円	円	%		%	%	百万円
2017年8月29日	10,000	—	—	380.422	—	—	0.1
1期(2018年6月25日)	10,033	0	0.3	382.659	0.6	99.0	1

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	券率
	騰落率	率	(ベンチマーク)	騰落率		
(設定日)	円	%		%		%
2017年8月29日	10,000	—	380.422	—	—	—
8月末	10,004	0.0	380.579	0.0	98.7	
9月末	9,964	△0.4	379.266	△0.3	98.7	
10月末	9,960	△0.4	379.268	△0.3	98.2	
11月末	9,983	△0.2	380.257	△0.0	98.8	
12月末	9,985	△0.2	380.513	0.0	99.2	
2018年1月末	9,967	△0.3	379.850	△0.2	98.9	
2月末	10,003	0.0	381.295	0.2	99.1	
3月末	10,017	0.2	381.911	0.4	99.2	
4月末	10,008	0.1	381.638	0.3	99.3	
5月末	10,030	0.3	382.498	0.5	98.6	
(期末)						
2018年6月25日	10,033	0.3	382.659	0.6	99.0	

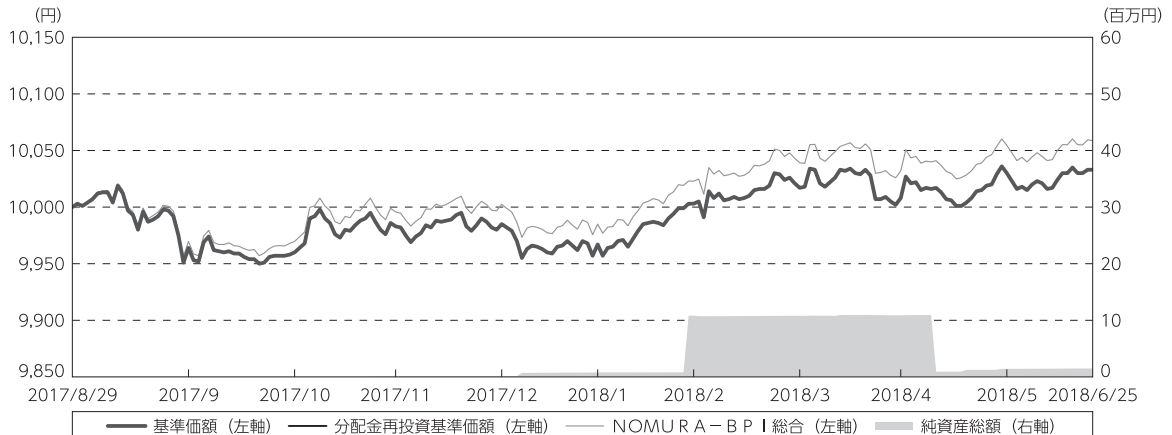
(注) 騰落率は設定日比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

(2017年8月29日～2018年6月25日)

期中の基準価額等の推移



設定時：10,000円

期末：10,033円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：0.3% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) NOMURA-BPI総合は、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) NOMURA-BPI総合は当ファンドのベンチマークです。
- (注) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、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。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は設定時10,000円から期末10,033円となり、33円の値上がりとなりました。

国内債券の市況(NOMURA-BPI総合)の上昇により、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、設定時と比較して小幅に上昇（債券価格は下落）しました。期の前半は、米国ではFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の利上げペースが加速するとの観測やトランプ政権の拡張的な財政政策を受けて長期金利が上昇し、欧州でもECB（欧州中央銀行）による量的緩和が縮小されるとの観測から金利上昇となる中、2018年の年明けにかけて、国内長期金利も上昇しました。その後、トランプ政権の保護貿易スタンスなどが懸念され、世界的にリスク回避の動きが強まると国内長期金利は低下し、期末にかけては横ばい圏での推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RAM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用を行いました。

RAM国内債券マザーファンド

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+0.3%となり、ベンチマークの+0.6%を0.3%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

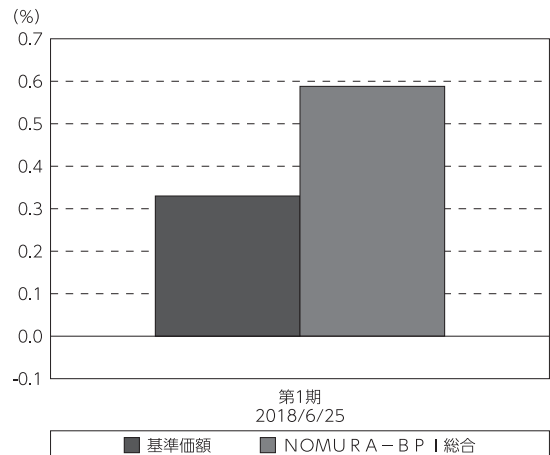
(マイナス要因)

- ・信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・コスト負担（取引費用などのコスト）が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 1 期
	2017年8月29日～ 2018年6月25日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	64

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RAM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RAM国内債券マザーファンド

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2017年8月29日～2018年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 12	% 0.125	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(5)	(0.053)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.053)	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)	(2)	(0.018)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.013	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.013)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	13	0.138	
期中の平均基準価額は、9,992円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2017年8月29日～2018年6月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
RAM国内債券マザーファンド	千口 11,263	千円 11,677	千口 9,836	千円 10,218

○利害関係人との取引状況等

(2017年8月29日～2018年6月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2017年8月29日～2018年6月25日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年8月29日～2018年6月25日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取 引 理 由
百万円 0.1	百万円 -	百万円 0.1	百万円 -	当初設定時における取得およびその処分

○組入資産の明細

(2018年6月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
RAM国内債券マザーファンド		千円 1,427	千円 1,486

○投資信託財産の構成

(2018年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RAM国内債券マザーファンド	千円 1,486	% 99.2
コール・ローン等、その他	12	0.8
投資信託財産総額	1,498	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2017年8月29日～2018年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,498,683
コール・ローン等	8,472
RAM国内債券マザーファンド(評価額)	1,486,211
未収入金	4,000
(B) 負債	11,514
未払解約金	7,818
未払信託報酬	3,435
その他未払費用	261
(C) 純資産総額(A-B)	1,487,169
元本	1,482,225
次期繰越損益金	4,944
(D) 受益権総口数	1,482,225口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,033円

(注) 当ファンドの設定時元本額は100,000円、期中追加設定元本額は11,680,142円、期中一部解約元本額は10,297,917円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0033円です。

○損益の状況 (2017年8月29日～2018年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	8,458
売買益	27,216
売買損	△18,758
(B) 信託報酬等	△ 4,091
(C) 当期損益金(A+B)	4,367
(D) 追加信託差損益金	577
(売買損益相当額)	(577)
(E) 計(C+D)	4,944
(F) 収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	4,944
追加信託差損益金	577
(配当等相当額)	(2,935)
(売買損益相当額)	(△ 2,358)
分配準備積立金	6,633
繰越損益金	△ 2,266

(注) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(D)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,633円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、および信託約款に規定する収益調整金(2,935円)より分配対象収益は9,568円(1万口当たり64円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

・デリバティブ取引にかかる利用目的をより明確にするため、約款に所要の変更を行いました。(2017年9月22日)

<当ファンドが投資対象とするRAM国内債券マザーファンドは以下の約款変更を行いました。>

・デリバティブ取引にかかる利用目的をより明確にするため、約款に所要の変更を行いました。(2017年9月22日)

RAM国内債券マザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2018年1月25日）
（2017年1月26日～2018年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②債券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・ NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券
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す。）の行使等により取得したものに限りま す。 ・ 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合			債組入比率	純資産額
	期騰落	中率	(ベンチマーク)	期騰落	中率		
(設定日)	円	%			%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	—	367.259		—	—	195
1期(2017年1月25日)	10,300	3.0	378.473		3.1	99.5	15,275
2期(2018年1月25日)	10,328	0.3	379.684		0.3	99.3	46,026

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村証券株式会社が公表する、日本の公券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証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合			債組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落	率	
(期首)	円	%			%	%
2017年1月25日	10,300	—	378.473		—	99.5
1月末	10,281	△0.2	377.739		△0.2	99.5
2月末	10,312	0.1	378.896		0.1	98.2
3月末	10,298	△0.0	378.492		0.0	98.7
4月末	10,349	0.5	380.333		0.5	99.2
5月末	10,328	0.3	379.549		0.3	98.8
6月末	10,298	△0.0	378.570		0.0	98.8
7月末	10,300	0.0	378.545		0.0	99.1
8月末	10,355	0.5	380.579		0.6	99.0
9月末	10,317	0.2	379.266		0.2	99.1
10月末	10,317	0.2	379.268		0.2	98.7
11月末	10,344	0.4	380.257		0.5	99.2
12月末	10,350	0.5	380.513		0.5	99.4
(期末)						
2018年1月25日	10,328	0.3	379.684		0.3	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2017年1月26日～2018年1月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の変動要因

基準価額は前期末10,300円から当期末10,328円となり、28円の値上がりとなりました。

国内債券の市況（NOMURA-BPI総合）の上昇により、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、前期末と比較してほぼ横ばいとなりました。北朝鮮情勢の緊迫化や仏大統領選挙に向けた地政学リスクの高まりを背景に期の半ばにかけては国内長期金利は低下（債券価格は上昇）基調で推移しました。期末にかけては、北朝鮮情勢の緊迫化により、国内長期金利は一時マイナス圏にまで低下する場面も見られましたが、その後は世界的な株高や日銀の政策に対する不透明感の台頭から国内長期金利は前期末の水準まで戻しました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+0.3%となり、ベンチマークの+0.3%と同等のリターンとなりました。主な差異要因は以下の通りです。

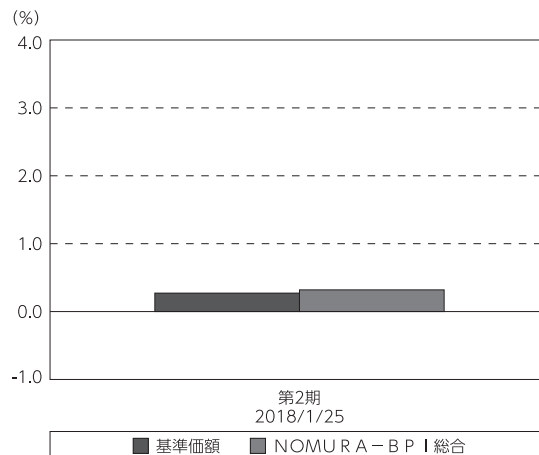
(マイナス要因)

- ・コスト負担(債券等に係る取引費用)が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



○今後の運用方針

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2017年1月26日～2018年1月25日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2017年1月26日～2018年1月25日)

公社債	
-----	--

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	34,483,273	8,713,927
	地方債証券	1,954,664	—
	特殊債証券	1,885,967	100,149 (2,478)
	社債証券(投資法人債券を含む)	1,412,565	200,643

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債証券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2017年1月26日～2018年1月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2017年1月26日～2018年1月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2018年1月25日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	35,571,000 (440,000)	38,580,836 (408,400)	83.8 (0.9)	— (—)	52.4 (0.5)	21.7 (—)	9.7 (0.4)
地方債証券	2,710,000 (2,710,000)	2,778,956 (2,778,956)	6.0 (6.0)	— (—)	3.6 (3.6)	1.3 (1.3)	1.1 (1.1)
特殊債券 (除く金融債)	2,266,522 (2,266,522)	2,339,371 (2,339,371)	5.1 (5.1)	— (—)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.2 (0.2)
金融債券	300,000 (300,000)	300,430 (300,430)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,700,000 (1,700,000)	1,719,668 (1,719,668)	3.7 (3.7)	— (—)	2.2 (2.2)	1.3 (1.3)	0.2 (0.2)
合 計	42,547,522 (7,416,522)	45,719,262 (7,546,826)	99.3 (16.4)	— (—)	61.8 (9.9)	26.1 (4.4)	11.5 (2.1)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第373回利付国債(2年)		0.1	260,000	260,639
第374回利付国債(2年)		0.1	370,000	370,976
第375回利付国債(2年)		0.1	220,000	220,624
第376回利付国債(2年)		0.1	170,000	170,515
第377回利付国債(2年)		0.1	150,000	150,484
第378回利付国債(2年)		0.1	250,000	250,857
第379回利付国債(2年)		0.1	170,000	170,617
第380回利付国債(2年)		0.1	250,000	250,957
第381回利付国債(2年)		0.1	170,000	170,683
第382回利付国債(2年)		0.1	80,000	80,337
第383回利付国債(2年)		0.1	400,000	401,768
第117回利付国債(5年)		0.2	127,000	127,469
第118回利付国債(5年)		0.2	206,000	206,916
第119回利付国債(5年)		0.1	100,000	100,306
第120回利付国債(5年)		0.2	179,000	179,941
第121回利付国債(5年)		0.1	190,000	190,685
第122回利付国債(5年)		0.1	410,000	411,627
第123回利付国債(5年)		0.1	395,000	396,773
第124回利付国債(5年)		0.1	305,000	306,457
第125回利付国債(5年)		0.1	371,000	372,914
第126回利付国債(5年)		0.1	380,000	382,147
第127回利付国債(5年)		0.1	350,000	352,089
第128回利付国債(5年)		0.1	400,000	402,512
第129回利付国債(5年)		0.1	310,000	312,036
第130回利付国債(5年)		0.1	350,000	352,457
第131回利付国債(5年)		0.1	540,000	544,033
第132回利付国債(5年)		0.1	550,000	554,482
第133回利付国債(5年)		0.1	480,000	484,137
第134回利付国債(5年)		0.1	130,000	131,147
第1回利付国債(40年)		2.4	40,000	56,852
第2回利付国債(40年)		2.2	50,000	68,647
第3回利付国債(40年)		2.2	60,000	82,635
第4回利付国債(40年)		2.2	90,000	124,305
第5回利付国債(40年)		2.0	90,000	119,439
第6回利付国債(40年)		1.9	90,000	116,991
第7回利付国債(40年)		1.7	90,000	111,610
第8回利付国債(40年)		1.4	120,000	137,464
第9回利付国債(40年)		0.4	170,000	139,908
第10回利付国債(40年)		0.9	100,000	97,875
第299回利付国債(10年)		1.3	100,000	101,622
第300回利付国債(10年)		1.5	50,000	50,925
第301回利付国債(10年)		1.5	70,000	71,577
第302回利付国債(10年)		1.4	20,000	20,422
第303回利付国債(10年)		1.4	80,000	81,992

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第304回利付国債	(10年)	1.3	40,000	40,930	2019/9/20
第305回利付国債	(10年)	1.3	370,000	379,882	2019/12/20
第306回利付国債	(10年)	1.4	280,000	289,055	2020/3/20
第307回利付国債	(10年)	1.3	250,000	257,550	2020/3/20
第308回利付国債	(10年)	1.3	310,000	320,431	2020/6/20
第309回利付国債	(10年)	1.1	120,000	123,463	2020/6/20
第310回利付国債	(10年)	1.0	350,000	360,192	2020/9/20
第311回利付国債	(10年)	0.8	40,000	40,953	2020/9/20
第312回利付国債	(10年)	1.2	440,000	456,579	2020/12/20
第313回利付国債	(10年)	1.3	330,000	344,483	2021/3/20
第314回利付国債	(10年)	1.1	60,000	62,255	2021/3/20
第315回利付国債	(10年)	1.2	355,000	370,627	2021/6/20
第316回利付国債	(10年)	1.1	100,000	104,062	2021/6/20
第317回利付国債	(10年)	1.1	170,000	177,389	2021/9/20
第318回利付国債	(10年)	1.0	236,000	245,395	2021/9/20
第319回利付国債	(10年)	1.1	250,000	261,562	2021/12/20
第320回利付国債	(10年)	1.0	242,000	252,248	2021/12/20
第321回利付国債	(10年)	1.0	141,000	147,350	2022/3/20
第322回利付国債	(10年)	0.9	120,000	124,906	2022/3/20
第323回利付国債	(10年)	0.9	90,000	93,884	2022/6/20
第324回利付国債	(10年)	0.8	133,000	138,153	2022/6/20
第325回利付国債	(10年)	0.8	370,000	384,985	2022/9/20
第326回利付国債	(10年)	0.7	280,000	290,651	2022/12/20
第327回利付国債	(10年)	0.8	207,000	215,888	2022/12/20
第328回利付国債	(10年)	0.6	461,000	476,922	2023/3/20
第329回利付国債	(10年)	0.8	387,000	405,099	2023/6/20
第330回利付国債	(10年)	0.8	297,000	311,368	2023/9/20
第331回利付国債	(10年)	0.6	90,000	93,335	2023/9/20
第332回利付国債	(10年)	0.6	402,000	417,436	2023/12/20
第333回利付国債	(10年)	0.6	325,000	337,795	2024/3/20
第334回利付国債	(10年)	0.6	311,000	323,645	2024/6/20
第335回利付国債	(10年)	0.5	85,000	87,968	2024/9/20
第336回利付国債	(10年)	0.5	210,000	217,532	2024/12/20
第337回利付国債	(10年)	0.3	50,000	51,103	2024/12/20
第338回利付国債	(10年)	0.4	561,000	577,426	2025/3/20
第339回利付国債	(10年)	0.4	325,000	334,603	2025/6/20
第340回利付国債	(10年)	0.4	444,000	457,217	2025/9/20
第341回利付国債	(10年)	0.3	210,000	214,800	2025/12/20
第342回利付国債	(10年)	0.1	160,000	161,038	2026/3/20
第343回利付国債	(10年)	0.1	260,000	261,521	2026/6/20
第344回利付国債	(10年)	0.1	460,000	462,373	2026/9/20
第345回利付国債	(10年)	0.1	260,000	261,149	2026/12/20
第346回利付国債	(10年)	0.1	460,000	461,669	2027/3/20
第347回利付国債	(10年)	0.1	340,000	341,268	2027/6/20
第348回利付国債	(10年)	0.1	190,000	190,636	2027/9/20
第349回利付国債	(10年)	0.1	160,000	160,313	2027/12/20

銘	柄	当期			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
国債証券		%	千円	千円	
第1回利付国債 (30年)		2.8	10,000	13,039	2029/9/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	10,000	12,006	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	10,000	12,623	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	20,000	24,967	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	20,000	26,242	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	20,000	26,603	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	20,000	26,657	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	50,000	65,978	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	60,000	78,219	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	50,000	65,286	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	20,000	26,832	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	50,000	65,423	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	50,000	67,243	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	60,000	80,821	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	40,000	53,963	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	20,000	26,304	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	45,000	60,037	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	105,000	142,303	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	100,000	135,844	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	110,000	147,996	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	130,000	172,914	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	120,000	157,681	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	135,000	180,729	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	170,000	217,657	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	145,000	192,329	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	146,000	187,735	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	185,000	238,348	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	180,000	228,272	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	120,000	149,654	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	110,000	139,812	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	85,000	106,133	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	85,000	104,200	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	110,000	134,899	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	100,000	122,684	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	90,000	110,456	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	120,000	141,564	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	130,000	153,366	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	130,000	156,708	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	143,000	165,225	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	120,000	138,630	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	140,000	140,483	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	140,000	122,529	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	140,000	129,458	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	130,000	123,319	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	150,000	149,821	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	20,000	19,952	2047/6/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第56回利付国債 (30年)		0.8	130,000	129,533	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)		0.8	10,000	9,951	2047/12/20
第46回利付国債 (20年)		2.2	10,000	10,554	2020/6/22
第47回利付国債 (20年)		2.2	10,000	10,612	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)		2.5	20,000	21,515	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)		2.1	30,000	32,085	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)		1.9	10,000	10,632	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)		2.0	20,000	21,425	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)		2.1	40,000	43,202	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)		2.1	20,000	21,705	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	10,000	10,891	2021/12/20
第56回利付国債 (20年)		2.0	10,000	10,916	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	10,000	10,872	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	50,000	54,611	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	40,000	43,495	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	30,000	32,179	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	50,000	52,771	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	80,000	83,764	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	10,000	11,011	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	20,000	22,218	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	140,000	156,128	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	20,000	22,393	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	20,000	22,640	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	40,000	46,236	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	20,000	22,862	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	80,000	91,308	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	30,000	34,169	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	20,000	23,005	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	20,000	22,720	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	20,000	22,862	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)		1.9	50,000	57,019	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	20,000	22,955	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	130,000	150,170	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)		2.0	30,000	34,558	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	40,000	46,382	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	10,000	11,643	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	20,000	23,128	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	50,000	58,448	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	20,000	23,704	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	10,000	11,770	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	45,000	53,547	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	20,000	23,631	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	50,000	59,300	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	10,000	11,946	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	105,000	124,051	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)		2.0	20,000	23,536	2027/3/20

銘柄	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第94回利付国債 (20年)		2.1	50,000	59,295
第95回利付国債 (20年)		2.3	35,000	42,319
第96回利付国債 (20年)		2.1	20,000	23,809
第97回利付国債 (20年)		2.2	80,000	96,364
第98回利付国債 (20年)		2.1	70,000	83,647
第99回利付国債 (20年)		2.1	125,000	149,850
第100回利付国債 (20年)		2.2	151,000	183,096
第101回利付国債 (20年)		2.4	20,000	24,653
第102回利付国債 (20年)		2.4	145,000	179,382
第103回利付国債 (20年)		2.3	20,000	24,536
第104回利付国債 (20年)		2.1	10,000	12,062
第105回利付国債 (20年)		2.1	162,000	196,010
第106回利付国債 (20年)		2.2	40,000	48,818
第108回利付国債 (20年)		1.9	190,000	226,476
第109回利付国債 (20年)		1.9	130,000	155,344
第110回利付国債 (20年)		2.1	65,000	79,100
第111回利付国債 (20年)		2.2	130,000	160,110
第112回利付国債 (20年)		2.1	55,000	67,122
第113回利付国債 (20年)		2.1	185,000	226,403
第114回利付国債 (20年)		2.1	140,000	171,791
第115回利付国債 (20年)		2.2	60,000	74,325
第116回利付国債 (20年)		2.2	120,000	148,968
第117回利付国債 (20年)		2.1	105,000	129,097
第118回利付国債 (20年)		2.0	111,000	135,482
第119回利付国債 (20年)		1.8	60,000	71,779
第120回利付国債 (20年)		1.6	50,000	58,604
第121回利付国債 (20年)		1.9	185,000	224,051
第122回利付国債 (20年)		1.8	20,000	23,974
第123回利付国債 (20年)		2.1	185,000	229,170
第124回利付国債 (20年)		2.0	50,000	61,309
第125回利付国債 (20年)		2.2	100,000	125,440
第126回利付国債 (20年)		2.0	50,000	61,441
第128回利付国債 (20年)		1.9	205,000	249,628
第129回利付国債 (20年)		1.8	20,000	24,094
第130回利付国債 (20年)		1.8	160,000	192,968
第131回利付国債 (20年)		1.7	30,000	35,785
第132回利付国債 (20年)		1.7	150,000	179,197
第133回利付国債 (20年)		1.8	95,000	114,766
第134回利付国債 (20年)		1.8	95,000	114,949
第135回利付国債 (20年)		1.7	40,000	47,821
第136回利付国債 (20年)		1.6	80,000	94,552
第137回利付国債 (20年)		1.7	170,000	203,529
第138回利付国債 (20年)		1.5	50,000	58,437
第139回利付国債 (20年)		1.6	30,000	35,501
第140回利付国債 (20年)		1.7	220,000	263,751
第141回利付国債 (20年)		1.7	105,000	125,952

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第142回利付国債 (20年)		1.8	80,000	97,104	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	255,000	302,340	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	205,000	246,131	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	210,000	252,413	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	225,000	267,135	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	235,000	275,436	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	260,000	304,925	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	240,000	277,660	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	195,000	219,160	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	190,000	213,349	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	180,000	205,003	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	258,000	289,388	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	190,000	206,617	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	190,000	186,684	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	210,000	198,387	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	200,000	198,982	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	220,000	222,261	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	250,000	256,492	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	180,000	180,941	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	140,000	140,492	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	80,000	80,142	2037/12/20
小	計		35,571,000	38,580,836	
地方債証券					
第678回東京都公募公債		1.38	100,000	102,557	2019/12/20
第680回東京都公募公債		1.39	100,000	102,906	2020/3/19
第705回東京都公募公債		1.06	100,000	104,197	2022/3/18
第729回東京都公募公債		0.69	100,000	103,668	2024/3/19
平成28年度第8回北海道公募公債		0.06	100,000	98,709	2026/10/28
平成29年度第6回北海道公募公債		0.01	100,000	99,752	2022/7/28
第211回神奈川県公募公債		0.438	100,000	102,177	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債		0.08	100,000	99,236	2026/3/19
第376回大阪府公募公債		0.82	110,000	114,499	2023/9/27
平成27年度第4回静岡県公募公債		0.157	100,000	100,292	2020/6/19
平成20年度第10回愛知県公募公債		1.48	100,000	101,685	2019/3/27
平成24年度第5回愛知県公募公債		0.886	100,000	103,666	2022/6/28
平成29年度第11回愛知県公募公債		0.225	100,000	99,904	2027/10/27
平成21年度第1回広島県公募公債		1.57	100,000	102,051	2019/5/28
平成29年度第3回広島県公募公債		0.15	100,000	99,336	2027/9/27
平成21年度第4回埼玉県公募公債		1.46	100,000	102,146	2019/7/29
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	100,000	102,905	2024/9/26
平成27年度第1回福岡県公募公債		0.578	100,000	103,222	2025/6/26
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	104,282	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	100,000	103,669	2024/4/25
第169回共同発行市場公募地方債		0.205	100,000	99,954	2027/4/23
平成27年度第1回静岡市公募公債		0.476	100,000	102,484	2025/11/25
平成21年度第4回大阪市公募公債		1.62	100,000	102,482	2019/8/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第26回横浜市公募公債		1.776	100,000	118,144	2033/1/28
平成26年度第5回福岡市公募公債		0.539	100,000	102,808	2024/10/28
平成27年度第2回広島市公募公債		0.464	100,000	102,416	2025/12/25
平成29年度第1回鹿児島県公募公債		0.02	100,000	99,809	2022/10/31
小 計			2,710,000	2,778,956	
特殊債券(除く金融債)					
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.699	127,000	131,809	2023/10/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	100,000	102,178	2025/11/18
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	101,796	2019/4/30
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	101,000	105,349	2021/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	114,000	118,332	2024/6/28
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	127,000	131,046	2024/9/30
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	100,000	102,728	2024/12/27
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.115	100,000	99,732	2027/1/29
第57回政府保証関西国際空港債券		1.2	100,000	103,536	2020/12/14
第208回政府保証預金保険機構債		0.1	100,000	100,337	2020/10/6
第31回国際協力機構債券		0.53	100,000	102,563	2025/9/19
第27回道路債券		2.42	100,000	113,936	2024/3/20
F82回地方公共団体金融機構債券		1.381	100,000	108,275	2024/11/20
第2回一般担保住宅金融公庫債券		2.54	100,000	119,279	2026/6/19
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	98,538	98,811	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	99,157	99,088	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	99,827	99,628	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	100,000	99,880	2053/1/10
第36回東日本高速道路株式会社債		0.06	100,000	100,016	2021/6/18
第39回東日本高速道路株式会社債		0.03	100,000	99,902	2021/12/20
第61回中日本高速道路株式会社債		0.262	100,000	100,556	2020/6/2
第29回西日本高速道路株式会社債		0.31	100,000	100,592	2026/2/12
小 計			2,266,522	2,339,371	
金融債券					
い第772号商工債		0.25	100,000	100,242	2019/9/27
第310回信金中金債		0.225	100,000	100,412	2020/9/25
第327回信金中金債		0.06	100,000	99,776	2022/2/25
小 計			300,000	300,430	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第484回関西電力株式会社社債		0.976	100,000	102,536	2020/10/23
第289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	98,888	2026/11/25
第15回旭硝子株式会社無担保社債		0.31	100,000	99,547	2027/5/28
第26回株式会社豊田自動織機無担保社債		0.361	100,000	100,746	2021/9/17
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債		0.304	100,000	100,069	2021/8/2
第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債		1.51	100,000	104,528	2021/4/16
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債		0.89	100,000	103,834	2023/7/24
第37回株式会社みずほ銀行無担保社債		0.26	100,000	100,319	2019/7/25
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		0.25	100,000	99,362	2024/9/13
第49回野村ホールディングス株式会社無担保社債		0.437	100,000	100,683	2020/6/10
第120回三菱地所株式会社無担保社債		0.24	100,000	99,153	2027/6/18

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.757	100,000	103,542	2024/1/30
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.41	100,000	101,455	2026/1/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.133	100,000	102,214	2047/7/26
第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.02	100,000	99,914	2020/11/27
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券		0.69	100,000	102,444	2023/3/20
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債		0.384	100,000	100,434	2024/10/11
小 計			1,700,000	1,719,668	
合 計			42,547,522	45,719,262	

○投資信託財産の構成

(2018年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 45,719,262	% 99.0
コール・ローン等、その他	467,149	1.0
投資信託財産総額	46,186,411	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2017年1月26日～2018年1月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	46,186,411,471	
コール・ローン等	372,566,238	
公社債(評価額)	45,719,262,120	
未収利息	85,548,018	
前払費用	9,035,095	
(B) 負債	160,062,209	
未払金	160,061,200	
未払利息	1,009	
(C) 純資産総額(A-B)	46,026,349,262	
元本	44,564,485,799	
次期繰越損益金	1,461,863,463	
(D) 受益権総口数	44,564,485,799口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,328円	

(注) 当ファンドの期首元本額は14,831,307,760円、期中追加設定元本額は37,371,390,762円、期中一部解約元本額は7,638,212,723円です。

(注) 2018年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内債券インデックスファンド	31,337,398,898円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	12,810,654,867円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	242,942,919円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	101,088,182円
・DCりそな グローバルバランス	66,208,661円
・つみたてバランスファンド	4,467,972円
・グローバル資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	980,207円
・Smart-i 国内債券インデックス	744,093円

(注) 1口当たり純資産額は1.0328円です。

○損益の状況 (2017年1月26日～2018年1月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	276,641,756	
受取利息	277,158,701	
支払利息	△ 516,945	
(B) 有価証券売買損益	△ 192,419,250	
売買益	33,899,575	
売買損	△ 226,318,825	
(C) 当期損益金(A+B)	84,222,506	
(D) 前期繰越損益金	444,241,196	
(E) 追加信託差損益金	1,177,784,838	
(F) 解約差損益金	△ 244,385,077	
(G) 計(C+D+E+F)	1,461,863,463	
次期繰越損益金(G)	1,461,863,463	

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

デリバティブ取引にかかる利用目的をより明確にするため、約款に所要の変更を行いました。(2017年9月22日)