

運用報告書 (全体版)

J-REITパッケージ

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/不動産投信/インデックス型	
信託期間	原則、無期限です。	
運用方針	東京証券取引所の「東証REIT指数」(配当込み)に連動する投資成果をめざした運用を行います。	
主要投資対象	J-REITパッケージ	新光J-REITマザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)に直接投資する場合があります。
	新光J-REITマザーファンド	わが国の取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券を主要投資対象とします。
運用方法	主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、「東証REIT指数」の採用銘柄(採用予定を含みます。)である不動産投資信託証券へ実質的に投資します。不動産投資信託証券への投資に当たっては、「東証REIT指数」における時価総額構成割合を基本とする個別銘柄への投資配分ならびに元本の変動に応じた売買を行います。	
組入制限	J-REITパッケージ	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。不動産投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。
	新光J-REITマザーファンド	不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)、不動産投信指数先物取引以外には投資をいたしません。同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。不動産投資信託証券の実質組入比率を調整するため、不動産投信指数先物取引を活用する場合があります。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。分配金額は、配当収益相当部分と判断される額を基礎として、安定した収益分配を行うことを目指し、基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

第238期	<決算日	2024年4月22日>
第239期	<決算日	2024年5月22日>
第240期	<決算日	2024年6月24日>
第241期	<決算日	2024年7月22日>
第242期	<決算日	2024年8月22日>
第243期	<決算日	2024年9月24日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「J-REITパッケージ」は、2024年9月24日に第243期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			東証REIT指数(配当込み)		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
		(分配落)	税込み 分配金	期騰 落率	(ベンチマーク)	期騰 落率			
第37作成期	214期(2022年4月22日)	円 3,881	円 20	% 1.0	ポイント 4,515.28	% 1.1	% 97.1	% 2.7	百万円 5,523
	215期(2022年5月23日)	3,856	20	△0.1	4,511.75	△0.1	97.1	2.8	5,467
	216期(2022年6月22日)	3,672	20	△4.3	4,322.67	△4.2	97.1	2.7	5,203
	217期(2022年7月22日)	3,850	20	5.4	4,558.90	5.5	97.1	2.8	5,325
	218期(2022年8月22日)	3,901	20	1.8	4,645.23	1.9	97.1	2.8	5,353
	219期(2022年9月22日)	3,878	20	△0.1	4,645.18	△0.0	97.0	2.8	5,312
第38作成期	220期(2022年10月24日)	3,550	20	△7.9	4,278.75	△7.9	97.0	2.8	4,849
	221期(2022年11月22日)	3,725	20	5.5	4,516.29	5.6	97.0	2.9	5,066
	222期(2022年12月22日)	3,610	20	△2.6	4,404.65	△2.5	97.0	2.9	4,886
	223期(2023年1月23日)	3,451	20	△3.9	4,237.39	△3.8	96.9	2.9	4,654
	224期(2023年2月22日)	3,461	20	0.9	4,276.75	0.9	96.9	3.0	4,667
	225期(2023年3月22日)	3,349	20	△2.7	4,165.50	△2.6	97.1	2.7	4,468
第39作成期	226期(2023年4月24日)	3,456	20	3.8	4,326.14	3.9	97.1	2.8	4,600
	227期(2023年5月22日)	3,512	20	2.2	4,424.44	2.3	97.2	2.7	4,620
	228期(2023年6月22日)	3,465	20	△0.8	4,393.19	△0.7	97.2	2.7	4,541
	229期(2023年7月24日)	3,519	20	2.1	4,489.39	2.2	97.1	2.7	4,554
	230期(2023年8月22日)	3,450	20	△1.4	4,429.41	△1.3	97.2	2.7	4,445
	231期(2023年9月22日)	3,460	20	0.9	4,471.22	0.9	97.1	2.7	4,366
第40作成期	232期(2023年10月23日)	3,343	20	△2.8	4,347.22	△2.8	97.0	2.8	4,157
	233期(2023年11月22日)	3,378	20	1.6	4,419.21	1.7	97.0	2.9	4,120
	234期(2023年12月22日)	3,282	20	△2.2	4,321.00	△2.2	96.9	2.9	3,748
	235期(2024年1月22日)	3,375	20	3.4	4,474.19	3.5	96.9	2.9	3,764
	236期(2024年2月22日)	3,102	20	△7.5	4,139.93	△7.5	96.8	3.0	3,384
	237期(2024年3月22日)	3,316	20	7.5	4,456.89	7.7	96.8	3.0	3,547
第41作成期	238期(2024年4月22日)	3,268	20	△0.8	4,421.43	△0.8	96.8	3.1	3,417
	239期(2024年5月22日)	3,206	20	△1.3	4,367.14	△1.2	96.8	3.1	3,322
	240期(2024年6月24日)	3,126	20	△1.9	4,287.59	△1.8	96.8	3.1	3,198
	241期(2024年7月22日)	3,097	20	△0.3	4,276.48	△0.3	96.7	3.1	3,105
	242期(2024年8月22日)	3,133	20	1.8	4,355.70	1.9	96.6	3.2	3,108
	243期(2024年9月24日)	3,125	20	0.4	4,376.43	0.5	96.7	3.2	3,069

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 東証REIT指数(配当込み)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません(以下同じ)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
第238期	(期 首) 2024年 3月 22日	円 3,316	% -	ポイント 4,456.89	% -	% 96.8	% 3.0
	3 月 末	3,281	△1.1	4,410.17	△1.0	96.8	3.0
	(期 末) 2024年 4月 22日	3,288	△0.8	4,421.43	△0.8	96.8	3.1
第239期	(期 首) 2024年 4月 22日	3,268	-	4,421.43	-	96.8	3.1
	4 月 末	3,293	0.8	4,455.74	0.8	96.8	3.1
	(期 末) 2024年 5月 22日	3,226	△1.3	4,367.14	△1.2	96.8	3.1
第240期	(期 首) 2024年 5月 22日	3,206	-	4,367.14	-	96.8	3.1
	5 月 末	3,158	△1.5	4,302.09	△1.5	96.7	3.1
	(期 末) 2024年 6月 24日	3,146	△1.9	4,287.59	△1.8	96.8	3.1
第241期	(期 首) 2024年 6月 24日	3,126	-	4,287.59	-	96.8	3.1
	6 月 末	3,118	△0.3	4,277.59	△0.2	96.7	3.1
	(期 末) 2024年 7月 22日	3,117	△0.3	4,276.48	△0.3	96.7	3.1
第242期	(期 首) 2024年 7月 22日	3,097	-	4,276.48	-	96.7	3.1
	7 月 末	3,106	0.3	4,290.75	0.3	96.7	3.1
	(期 末) 2024年 8月 22日	3,153	1.8	4,355.70	1.9	96.6	3.2
第243期	(期 首) 2024年 8月 22日	3,133	-	4,355.70	-	96.6	3.2
	8 月 末	3,172	1.2	4,411.38	1.3	96.7	3.1
	(期 末) 2024年 9月 24日	3,145	0.4	4,376.43	0.5	96.7	3.2

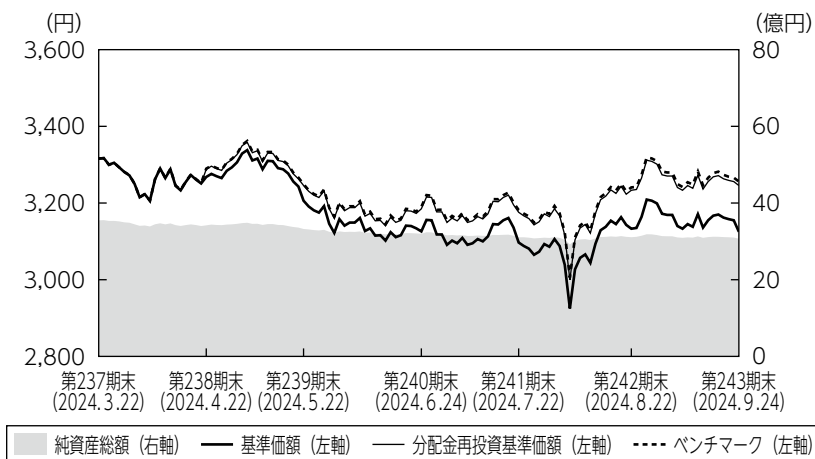
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第238期～第243期の運用経過（2024年3月23日から2024年9月24日まで）

基準価額等の推移



第238期首： 3,316円
第243期末： 3,125円
(既払分配金120円)
騰落率： △2.1%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀の金融政策を巡る思惑などから方向感に欠ける展開となり、東証REIT指数（配当込み）が下落したことから、当ファンドの基準価額も下落しました。

投資環境

作成期間においてリート市場は下落しました。3月の日銀の金融政策決定会合においてマイナス金利政策が終了し、加えて今後も金融緩和的な環境が継続するとの見方が広がると上昇傾向となりましたが、その後、日銀が国債買入れの減額に踏み切ると下落しました。8月には急速な円高と米国の景気後退懸念を背景に株式市場が急落し、リスク回避的な動きからリート市場も下落する局面がありましたが、作成期末にかけては米国の利下げ観測などを背景に反発しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

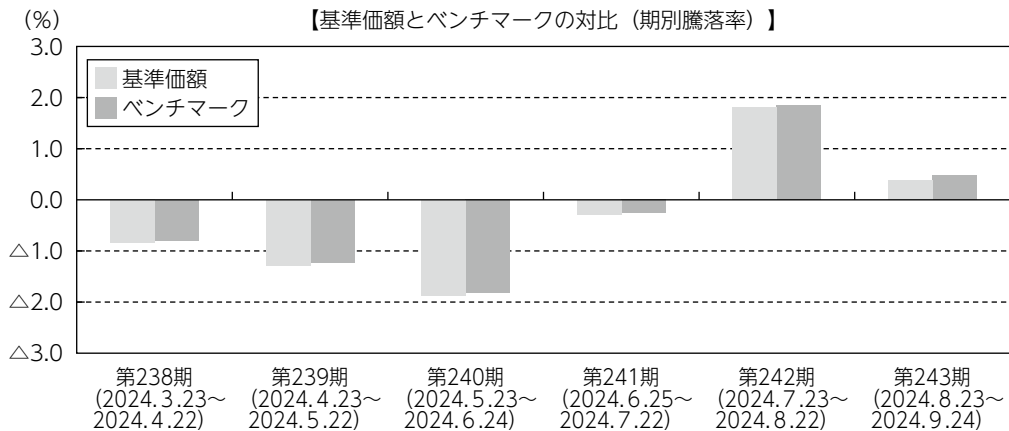
新光J-REITマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

●新光J-REITマザーファンド

リーートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

ベンチマークとの差異について

この期間におけるベンチマークの騰落率は $\Delta 1.8\%$ である一方、当ファンドの騰落率は $\Delta 2.1\%$ （税引前分配金再投資騰落率）となりました。なお、信託報酬等の影響を除くと概ねベンチマークに連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第238期	第239期	第240期	第241期	第242期	第243期
	2024年3月23日 ～2024年4月22日	2024年4月23日 ～2024年5月22日	2024年5月23日 ～2024年6月24日	2024年6月25日 ～2024年7月22日	2024年7月23日 ～2024年8月22日	2024年8月23日 ～2024年9月24日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.61%	0.62%	0.64%	0.64%	0.63%	0.64%
当期の収益	3円	6円	7円	10円	11円	20円
当期の収益以外	16円	13円	12円	9円	8円	-円
翌期繰越分配対象額	5,504円	5,490円	5,478円	5,469円	5,460円	5,461円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、新光J-REITマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●新光J-REITマザーファンド

引き続き、リートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果を目指したパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第238期～第243期 (2024年3月23日 ～2024年9月24日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	11円	
(投信会社)	(5)	(0.167)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(5)	(0.167)	販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価
(受託会社)	(1)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) 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)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	12	0.362	

(注1) 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・解約によって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。
なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

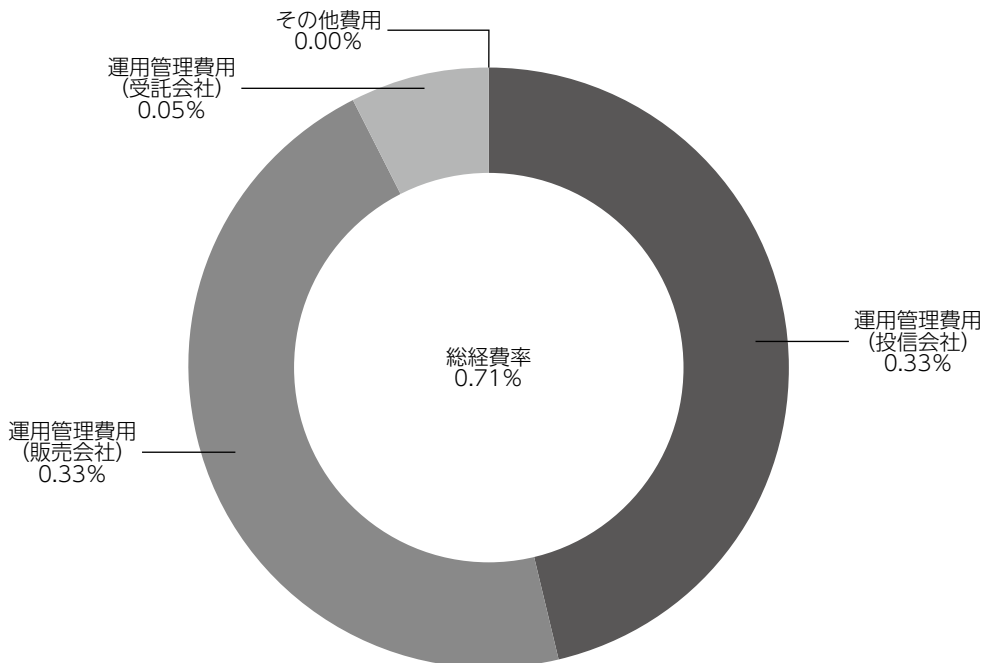
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.71%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年3月23日から2024年9月24日まで）

	第 238 期 ~ 第 243 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
新光J-REITマザーファンド	千□ 24,218	千円 52,387	千□ 214,525	千円 463,072

■利害関係人との取引状況等（2024年3月23日から2024年9月24日まで）

【J-REITパッケージにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 238 期 ~ 第 243 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	24千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	18千円
(B) / (A)	74.7%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

【新光J-REITマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 238 期 ~ 第 243 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
不動産投信指数先物取引	百万円 4,198	百万円 4,198	100.0 %	百万円 4,240	百万円 2,134	50.3 %
投 資 証 券	2,794	1,773	63.4	5,958	3,532	59.3

平均保有割合 4.7%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 238 期 ~ 第 243 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 680

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あり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第40作成期末	第 41 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
新 光 J - R E I T マ ザ ー フ ァ ン ド	1,601,817	1,411,510	3,069,611

■投資信託財産の構成

2024年9月24日現在

項 目	第 41 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新 光 J - R E I T マ ザ ー フ ァ ン ド	3,069,611	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,411	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	3,097,022	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月22日)、(2024年5月22日)、(2024年6月24日)、(2024年7月22日)、(2024年8月22日)、(2024年9月24日)現在

項 目	第 238 期 末	第 239 期 末	第 240 期 末	第 241 期 末	第 242 期 末	第 243 期 末
(A) 資 産	3,460,906,421円	3,350,845,935円	3,225,901,787円	3,134,841,438円	3,132,152,740円	3,097,022,312円
コール・ローン等	8,211,802	5,939,100	5,962,493	4,395,931	4,640,648	2,665,135
新光J-REITマザーファンド(評価額)	3,417,369,619	3,322,049,835	3,198,077,294	3,104,726,507	3,107,827,092	3,069,611,177
未 収 入 金	35,325,000	22,857,000	21,862,000	25,719,000	19,685,000	24,746,000
(B) 負 債	43,003,171	28,206,746	27,262,008	29,563,952	23,657,561	27,138,684
未 払 収 益 分 配 金	20,917,275	20,726,457	20,463,214	20,052,877	19,842,816	19,644,944
未 払 解 約 金	19,981,703	5,456,204	4,700,621	7,769,589	1,941,745	5,472,158
未 払 信 託 報 酬	2,099,620	2,019,688	2,093,615	1,737,706	1,868,932	2,017,191
そ の 他 未 払 費 用	4,573	4,397	4,558	3,780	4,068	4,391
(C) 純資産総額(A-B)	3,417,903,250	3,322,639,189	3,198,639,779	3,105,277,486	3,108,495,179	3,069,883,628
元 本	10,458,637,960	10,363,228,529	10,231,607,235	10,026,438,763	9,921,408,302	9,822,472,445
次 期 繰 越 損 益 金	△7,040,734,710	△7,040,589,340	△7,032,967,456	△6,921,161,277	△6,812,913,123	△6,752,588,817
(D) 受 益 権 総 口 数	10,458,637,960□	10,363,228,529□	10,231,607,235□	10,026,438,763□	9,921,408,302□	9,822,472,445□
1万口当たり基準価額(C/D)	3,268円	3,206円	3,126円	3,097円	3,133円	3,125円

(注) 第237期末における元本額は10,697,192,087円、当作成期間(第238期~第243期)中における追加設定元本額は291,903,841円、同解約元本額は1,166,623,483円です。

■損益の状況

〔自 2024年 3月23日 至 2024年 4月22日〕〔自 2024年 4月23日 至 2024年 5月22日〕〔自 2024年 5月23日 至 2024年 6月24日〕〔自 2024年 6月25日 至 2024年 7月22日〕〔自 2024年 7月23日 至 2024年 8月22日〕〔自 2024年 8月23日 至 2024年 9月24日〕

項 目	第 238 期	第 239 期	第 240 期	第 241 期	第 242 期	第 243 期
(A) 配 当 等 収 益	403円	287円	322円	281円	494円	690円
受 取 利 息	403	287	322	281	494	690
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△27,473,556	△41,369,606	△59,015,065	△7,413,253	57,415,583	14,045,025
売 買 益	1,384,839	339,899	1,063,686	768,010	58,154,331	14,511,109
売 買 損	△28,858,395	△41,709,505	△60,078,751	△8,181,263	△738,748	△466,084
(C) 信 託 報 酬 等	△2,104,193	△2,024,085	△2,098,173	△1,741,486	△1,873,000	△2,021,582
(D) 当 期 繰 上 益 金 (A+B+C)	△29,577,346	△43,393,404	△61,112,916	△9,154,458	55,543,077	12,024,133
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△729,880,497	△475,899,445	△790,209,888	△838,962,086	△845,492,830	△790,712,129
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△6,260,359,592	△6,221,570,034	△6,161,181,438	△6,052,991,856	△6,003,120,554	△5,954,255,877
(配当等相当額)	(5,771,047,768)	(5,704,280,218)	(5,617,959,038)	(5,492,745,488)	(5,426,220,307)	(5,363,806,704)
(売買損益相当額)	(△12,031,407,360)	(△11,925,850,252)	(△11,779,140,476)	(△11,545,737,344)	(△11,429,340,861)	(△11,318,062,581)
(G) 合 計 (D+E+F)	△7,019,817,435	△7,019,862,883	△7,012,504,242	△6,901,108,400	△6,793,070,307	△6,732,943,873
(H) 収 益 分 配 金	△20,917,275	△20,726,457	△20,463,214	△20,052,877	△19,842,816	△19,644,944
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△7,040,734,710	△7,040,589,340	△7,032,967,456	△6,921,161,277	△6,812,913,123	△6,752,588,817
追 加 信 託 差 損 益 金	△6,274,625,175	△6,235,652,481	△6,174,032,385	△6,062,102,551	△6,011,546,776	△5,954,255,877
(配当等相当額)	(5,756,800,815)	(5,690,229,807)	(5,605,139,330)	(5,483,667,812)	(5,417,835,381)	(5,363,865,842)
(売買損益相当額)	(△12,031,425,990)	(△11,925,882,288)	(△11,779,171,715)	(△11,545,770,363)	(△11,429,382,157)	(△11,318,121,719)
分 配 準 備 積 立 金	-	-	-	-	-	464,705
繰 越 損 益 金	△766,109,535	△804,936,859	△858,935,071	△859,058,726	△801,366,347	△798,797,645

(注1) (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2) (C)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3) (F)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4) 分配金の計算過程

項 目	第 238 期	第 239 期	第 240 期	第 241 期	第 242 期	第 243 期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,878,126円	6,644,010円	7,612,267円	10,942,182円	11,416,594円	20,109,649円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	5,771,066,398	5,704,312,254	5,617,990,277	5,492,778,507	5,426,261,603	5,363,865,842
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,773,566	0	0	0	0	0
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	5,777,718,090	5,710,956,264	5,625,602,544	5,503,720,689	5,437,678,197	5,383,975,491
(f) 1万口当たり当期分配対象額	5,524.35	5,510.79	5,498.26	5,489.21	5,480.75	5,481.28
(g) 分 配 金	20,917,275	20,726,457	20,463,214	20,052,877	19,842,816	19,644,944
(h) 1万口当たり分配金	20	20	20	20	20	20

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 238 期	第 239 期	第 240 期	第 241 期	第 242 期	第 243 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、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）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

新光 J-R E I T マザーファンド

運用報告書

第17期 (決算日 2023年10月20日)

(計算期間 2022年10月21日～2023年10月20日)

新光 J-R E I T マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	主として東証 R E I T 指数の採用銘柄 (採用予定を含みます。) に投資を行うことにより、東証 R E I T 指数 (配当込み) に連動する投資成果を目指した運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所上場 (上場予定を含みます。) の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券 (以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。) を主要投資対象とします。
主な組入制限	不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品 (短期運用の有価証券を含みます。)、不動産投信指数先物取引以外には投資を行いません。不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証 R E I T 指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先物 指数比率	純総 資産額
	期 騰 落	中 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期 (2019年10月21日)	22,878	32.2	4,636.09	32.8	98.5	—	2,655
14期 (2020年10月20日)	17,870	△21.9	3,596.26	△22.4	98.7	—	1,480
15期 (2021年10月20日)	23,148	29.5	4,660.27	29.6	98.1	1.8	116,308
16期 (2022年10月20日)	21,429	△7.4	4,314.99	△7.4	97.0	2.8	90,442
17期 (2023年10月20日)	21,747	1.5	4,379.49	1.5	97.0	2.8	78,479

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証 R E I T 指数 (配当込み) の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 10 月 20 日	円	%	ポ イ ン ト	%	%	%
10 月 末	21,429	—	4,314.99	—	97.0	2.8
11 月 末	22,667	5.8	4,564.72	5.8	97.0	2.9
12 月 末	22,670	5.8	4,565.38	5.8	97.0	2.9
2023 年 1 月 末	21,868	2.0	4,403.82	2.1	97.0	2.9
2 月 末	21,173	△1.2	4,263.06	△1.2	96.9	2.9
3 月 末	21,504	0.3	4,331.37	0.4	96.4	3.0
4 月 末	20,879	△2.6	4,204.73	△2.6	97.1	2.7
5 月 末	21,949	2.4	4,420.34	2.4	97.2	2.6
6 月 末	22,091	3.1	4,448.91	3.1	97.2	2.7
7 月 末	21,954	2.4	4,421.28	2.5	97.2	2.7
8 月 末	22,211	3.6	4,472.88	3.7	97.2	2.7
9 月 末	22,539	5.2	4,539.20	5.2	97.2	2.7
(期 末) 2023 年 10 月 20 日	22,187	3.5	4,468.30	3.6	97.1	2.8
	21,747	1.5	4,379.49	1.5	97.0	2.8

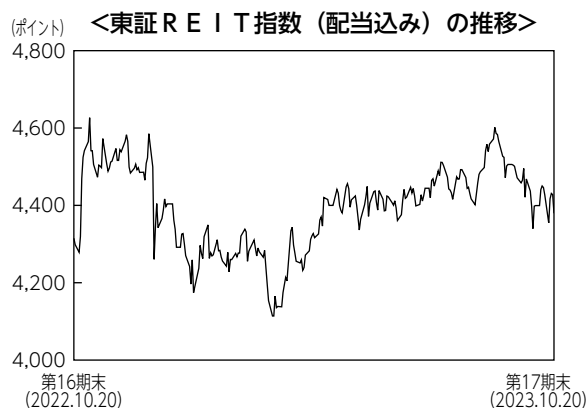
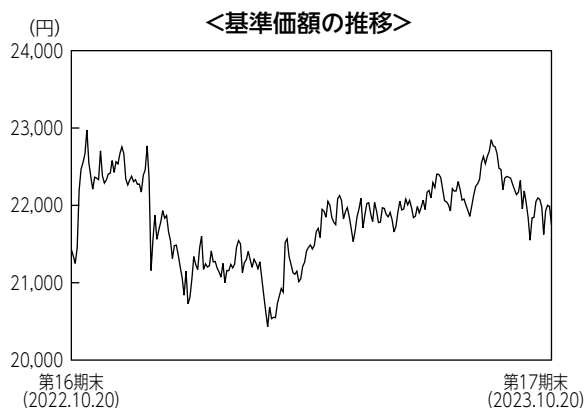
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年10月21日から2023年10月20日まで）

基準価額の推移

当ファンドの基準価額は21,747円となり、前期末比で1.5%上昇しました。



基準価額の主な変動要因

相対的に高い分配金利回りに着目した資金流入や米国の追加利上げ観測後退などにより東証REIT指数（配当込み）が上昇し、当ファンドの基準価額も上昇しました。

投資環境

リート市場は上昇しました。2022年12月の日銀による長期金利の許容変動幅拡大や2023年3月の米銀破綻による金融システム不安などを受けて急落する局面もありましたが、一方で相対的に高い分配金利回りに着目した資金流入が相場の支えとなりました。期を通じて米国の金融引き締めペースや日銀による政策修正を巡る思惑などから方向感に乏しい展開が続きました。期末にかけては中東情勢の緊迫化などにより値を下げました。

ポートフォリオについて

リーートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

ベンチマークとの差異について

当期におけるベンチマークの騰落率は1.5%となりました。当ファンドの騰落率は1.5%となり、ベンチマークにほぼ連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、リートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果を目指したパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(投資証券)	(0)	(0.001)	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は21,822円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2022年10月21日から2023年10月20日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
	千口	千円	千円	千円	千口	千円	千円	千円
国内								
エスコンジャパンリート投資法人	0.067	(-)	7,766	(-)	0.286	(-)	33,024	(-)
サンケイリアルエステート投資法人	0.109	(-)	9,792	(-)	0.454	(-)	40,486	(-)
S O S I L A 物流リート投資法人	0.424	(-)	57,178	(-)	0.697	(-)	92,016	(-)
東海道リート投資法人	0.411	(-)	50,187	(-)	0.34	(-)	40,827	(-)
日本アコモデーションファンド投資法人	0.117	(-)	74,058	(-)	0.49	(-)	306,248	(-)
森ヒルズリート投資法人	0.403	(-)	61,132	(-)	1.672	(-)	251,348	(-)
産業ファンド投資法人	0.744	(-)	109,968	(-)	2.126	(-)	316,742	(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	0.523	(-)	176,689	(-)	1.739	(-)	590,201	(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.384	(-)	81,312	(-)	1.033	(-)	218,568	(-)
アクティブア・プロパティーズ投資法人	0.169	(-)	68,615	(-)	0.763	(-)	308,431	(-)
G L P 投資法人	3.39	(-)	492,644	(-)	4.522	(-)	657,526	(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.36	(-)	113,334	(-)	0.667	(-)	214,113	(-)
日本プロロジスリート投資法人	1.357	(-)	417,859	(-)	2.366	(-)	704,128	(-)
星野リゾート・リート投資法人	0.132	(-)	86,626	(-)	0.25	(-)	170,948	(-)
Oneリート投資法人	0.057	(-)	14,032	(-)	0.245	(-)	60,123	(-)
イオンリート投資法人	1.302	(-)	194,233	(-)	1.617	(-)	244,166	(-)
ヒューリックリート投資法人	0.317	(-)	50,824	(-)	1.327	(-)	212,212	(-)
日本リート投資法人	0.11	(-)	37,538	(-)	0.461	(-)	156,731	(-)
積水ハウス・リート投資法人	0.942	(-)	73,340	(-)	4.472	(-)	350,638	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数 千□	金 額 千円	□ 数 千□	金 額 千円
トーセイ・リート投資法人	0.068 (-)	9,109 (-)	0.39 (-)	52,389 (-)
ケネディクス商業リート投資法人	0.147 (-)	38,756 (-)	0.616 (-)	160,083 (-)
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.085 (-)	14,283 (-)	0.352 (-)	58,300 (-)
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.186 (-)	21,598 (-)	0.374 (-)	42,967 (-)
野村不動産マスターファンド投資法人	1.103 (-)	177,886 (-)	4.592 (-)	742,749 (-)
いちごホテルリート投資法人	0.06 (-)	6,640 (-)	0.239 (-)	25,761 (-)
ラサールロジポート投資法人	0.83 (-)	129,251 (-)	1.754 (-)	272,975 (-)
スターアジア不動産投資法人	2.617 (-)	143,133 (-)	1.815 (-)	101,683 (-)
マリモ地方創生リート投資法人	0.283 (-)	37,077 (-)	0.203 (-)	26,149 (-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.289 (-)	141,324 (-)	0.562 (-)	271,647 (-)
大江戸温泉リート投資法人	0.047 (-)	3,046 (-)	0.284 (-)	18,384 (-)
投資法人みらい	0.903 (-)	41,565 (-)	1.744 (-)	80,127 (-)
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.023 (△1.872)	3,121 (-)	0.128 (-)	17,143 (-)
三菱地所物流リート投資法人	0.419 (-)	173,317 (-)	0.482 (-)	197,445 (-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人	0.48 (-)	85,873 (-)	0.58 (-)	105,378 (-)
ザイマックス・リート投資法人	0.055 (-)	6,393 (-)	0.23 (-)	26,479 (-)
タカラレーベン不動産投資法人	0.442 (-)	40,715 (-)	0.648 (-)	61,967 (-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.167 (-)	22,826 (-)	0.621 (-)	84,662 (-)
日本ビルファンド投資法人	0.394 (-)	233,652 (-)	1.653 (-)	969,506 (-)
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.544 (-)	305,396 (-)	1.423 (-)	805,984 (-)
日本都市ファンド投資法人	1.518 (-)	154,145 (-)	8.816 (-)	874,567 (-)
オリックス不動産投資法人	0.676 (-)	123,234 (-)	2.827 (-)	508,825 (-)
日本プライムリアルティ投資法人	0.234 (-)	85,269 (-)	0.972 (-)	350,823 (-)
N T T 都市開発リート投資法人	0.326 (-)	44,823 (-)	1.363 (-)	185,122 (-)
東急リアル・エステート投資法人	0.229 (-)	44,660 (-)	0.953 (-)	182,934 (-)
グローバル・ワン不動産投資法人	0.685 (-)	74,903 (-)	1.033 (-)	113,534 (-)
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.703 (-)	106,996 (-)	3.237 (-)	487,298 (-)
森トラストリート投資法人	1.032 (9.13848)	80,529 (-)	2.03048 (-)	174,069 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
インヴェンシブル投資法人	4.71 (-)	271,882 (-)	6.224 (-)	341,708 (-)
フロンティア不動産投資法人	0.126 (-)	62,364 (-)	0.526 (-)	256,983 (-)
平和不動産リート投資法人	0.72 (-)	107,741 (-)	0.99 (-)	149,466 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.205 (-)	62,914 (-)	1.181 (-)	361,031 (-)
福岡リート投資法人	0.178 (-)	29,617 (-)	0.736 (-)	121,224 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	0.193 (2.463)	63,136 (-)	0.857 (-)	281,323 (-)
いちごオフィスリート投資法人	0.281 (-)	24,806 (-)	1.166 (-)	102,651 (-)
大和証券オフィス投資法人	0.067 (-)	42,527 (-)	0.306 (-)	192,993 (-)
阪急阪神リート投資法人	0.343 (-)	49,573 (-)	0.646 (-)	93,554 (-)
スターツプロシード投資法人	0.206 (-)	48,547 (-)	0.244 (-)	55,448 (-)
大和ハウスリート投資法人	0.508 (-)	145,127 (-)	2.135 (-)	603,675 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1.985 (-)	151,644 (-)	4.564 (-)	347,309 (-)
大和証券リビング投資法人	1.052 (-)	117,084 (-)	1.909 (-)	215,490 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	0.275 (-)	34,927 (-)	1.62 (-)	208,318 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 9,574	百万円 9,961	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2022年10月21日から2023年10月20日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
不動産投信指数先物取引	百万円 9,574	百万円 5,027	% 52.5	百万円 9,961	百万円 4,975	% 49.9
投 資 証 券	5,738	1,074	18.7	15,298	2,730	17.9

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 1,753

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,148千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	595千円
(B) / (A)	51.8%

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当 期		末	
		□ 数	□ 数	評 価	額	比	率
不動産ファンド		千□	千□	千円			%
エスコンジャパンリート投資法人		1,713	1,494	174,349			0.2
サンケイリアルエステート投資法人		2,699	2,354	216,803			0.3
S O S I L A物流リート投資法人		3,939	3,666	443,586			0.6
東海道リート投資法人		1,022	1,093	137,718			0.2
日本アコモデーションファンド投資法人		2,91	2,537	1,550,107			2.0
森ヒルズリート投資法人		9,909	8,64	1,208,736			1.5
産業ファンド投資法人		12,592	11,21	1,532,407			2.0
アドバンス・レジデンス投資法人		8,425	7,209	2,386,179			3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6,043	5,394	1,185,601			1.5
アクティビア・プロパティーズ投資法人		4,449	3,855	1,578,622			2.0
G L P投資法人		25,95	24,818	3,275,976			4.2
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		3,92	3,613	1,105,578			1.4
日本プロロジスリート投資法人		13,808	12,799	3,486,447			4.4
星野リゾート・リート投資法人		1,474	1,356	824,448			1.1
Oneリート投資法人		1,47	1,282	325,115			0.4
イオンリート投資法人		9,328	9,013	1,309,588			1.7
ヒューリックリート投資法人		7,884	6,874	1,063,407			1.4
日本リート投資法人		2,737	2,386	833,907			1.1
積水ハウス・リート投資法人		25,608	22,078	1,788,318			2.3
トーセイ・リート投資法人		1,869	1,547	218,281			0.3
ケネディクス商業リート投資法人		3,663	3,194	898,791			1.1
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,078	1,811	254,264			0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		2,19	2,002	226,025			0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		27,249	23,76	3,989,304			5.1
いちごホテルリート投資法人		1,396	1,217	128,880			0.2
ラサールロジポート投資法人		10,316	9,392	1,389,076			1.8
スターアジア不動産投資法人		10,521	11,323	668,057			0.9
マリモ地方創生リート投資法人		1,052	1,132	143,764			0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		3,329	3,056	1,428,680			1.8
大江戸温泉リート投資法人		1,36	1,123	72,545			0.1
投資法人みらい		10,237	9,396	444,430			0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人		1,977	-	-			-
三菱地所物流リート投資法人		2,6	2,537	961,523			1.2
C R Eロジスティクスファンド投資法人		3,263	3,163	508,294			0.6
ザイマックス・リート投資法人		1,367	1,192	137,437			0.2
タカラレーベン不動産投資法人		3,69	3,484	340,735			0.4

銘	柄	期首(前期末)				当 期				末			
		□ 数		□ 数		評 価 額		比 率					
		千□		千□		千円		%					
アドバンス・ロジスティクス投資法人		3,673		3,219		403,984		0.5					
日本ビルファンド投資法人		9.83		8,571		5,031,177		6.4					
ジャパンリアルエステイト投資法人		8,426		7,547		4,256,508		5.4					
日本都市ファンド投資法人		42,516		35,218		3,497,147		4.5					
オリックス不動産投資法人		16.79		14,639		2,613,061		3.3					
日本プライムリアルティ投資法人		5,763		5,025		1,781,362		2.3					
NTT都市開発リート投資法人		8.1		7,063		950,679		1.2					
東急リアル・エステート投資法人		5.65		4,926		876,828		1.1					
グローバル・ワン不動産投資法人		5,773		5,425		616,822		0.8					
ユナイテッド・アーバン投資法人		18,969		16,435		2,478,398		3.2					
森トラストリート投資法人		6,022		14,162		1,028,161		1.3					
インヴィンシブル投資法人		37,088		35,574		2,041,947		2.6					
フロンティア不動産投資法人		3,126		2,726		1,211,707		1.5					
平和不動産リート投資法人		5,759		5,489		784,378		1.0					
日本ロジスティクスファンド投資法人		5,682		4,706		1,344,974		1.7					
福岡リート投資法人		4,358		3.8		608,380		0.8					
ケネディクス・オフィス投資法人		2,476		4,275		1,427,850		1.8					
いちごオフィスリート投資法人		6,905		6.02		524,944		0.7					
大和証券オフィス投資法人		1,761		1,522		992,344		1.3					
阪急阪神リート投資法人		3,806		3,503		491,120		0.6					
スターツプロシード投資法人		1,312		1,274		269,578		0.3					
大和ハウスリート投資法人		12,702		11,075		2,941,520		3.7					
ジャパン・ホテル・リート投資法人		27,174		24,595		1,704,433		2.2					
大和証券リビング投資法人		11,677		10.82		1,186,954		1.5					
ジャパンエクセレント投資法人		7.73		6,385		842,820		1.1					
合 計		497,105		454,994		76,144,070		-					
		□ 数 ・ 金 額		□ 数 ・ 金 額		□ 数 ・ 金 額		□ 数 ・ 金 額					
		銘 柄 数 < 比 率 >		銘 柄 数 < 比 率 >		銘 柄 数 < 比 率 >		銘 柄 数 < 比 率 >					
		61銘柄<97.0%>		60銘柄<97.0%>		-		97.0					

(注1) < >内は、期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) サンケイリアルエステート投資法人、東海道リート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、いちごホテルリート投資法人、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本都市ファンド投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラストリート投資法人、インヴィンシブル投資法人、平和不動産リート投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、スターツプロシード投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書等より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 2,216		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年10月20日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 76,144,070		% 96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,528,768		3.2
投 資 信 託 財 産 総 額	78,672,839		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年10月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	78,672,839,180円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,465,629,999
投 資 証 券(評価額)	76,144,070,900
未 収 入 金	64,784,753
未 収 配 当 金	778,088,248
差 入 委 託 証 拠 金	220,265,280
(B) 負 債	192,847,700
未 払 金	109,197,700
未 払 解 約 金	83,650,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	78,479,991,480
元 本	36,087,319,626
次 期 繰 越 損 益 金	42,392,671,854
(D) 受 益 権 総 口 数	36,087,319,626口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,747円

■損益の状況

当期 自2022年10月21日 至2023年10月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,361,570,777円
受 取 配 当 金	3,362,257,012
そ の 他 収 益 金	4
支 払 利 息	△686,239
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,018,654,498
売 買 損 益	1,441,407,722
売 買 損	△3,460,062,220
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	30,034,090
取 引 益	278,950,100
取 引 損	△248,916,010
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,372,950,369
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	48,236,971,008
(F) 解 約 差 損 益 金	△8,280,975,669
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,063,726,146
(H) 合 計(D+E+F+G)	42,392,671,854
次 期 繰 越 損 益 金(H)	42,392,671,854

- (注1) 期首元本額 42,205,375,103円
追加設定元本額 903,876,854円
一部解約元本額 7,021,932,331円
- (注2) 期末における元本の内訳
J-R E I Tパッケージ 1,925,871,959円
新光J-R E I Tオープン 31,646,671,380円
One DC 国内リートインデックスファンド 1,476,828,680円
新光7資産バランスファンド 277,479,957円
新光J-R E I Tオープン (年2回決算型) 760,467,650円
期末元本合計 36,087,319,626円

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) (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。
- (注3) (G)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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■新N I S A制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。

(2023年7月15日)