

運用報告書 (全体版)

D I A M世界リートインデックスファンド(隔月分配型)

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／海外／不動産投信（インデックス型）
信託期間	2023年9月28日から2044年2月15日までです。
運用方針	S & P 先進国 R E I Tインデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	日本を含む世界各国のリート（不動産投資信託）*を主要投資対象とします。 ※国内、海外の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託証券とします。
運用方法	日本を含む世界各国のリートに投資し、S & P 先進国 R E I Tインデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を維持します。外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時（毎年2月、4月、6月、8月、10月、12月の各13日（休業日の場合は翌営業日））に、経費控除後の利子・配当等収益（繰越分を含みます。）および売買益（評価益を含みます。）等の中から、経費控除後の利子・配当等収益（繰越分を含みます。）および売買益（評価益を含みます。）等の水準および基準価額水準、市況動向等を勘案し、原則として経費控除後の利子・配当等収益（繰越分を含みます。）等を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 ※第1期（2023年12月13日）の決算は収益分配を行いません。

第2期 <決算日 2024年2月13日>
第3期 <決算日 2024年4月15日>
第4期 <決算日 2024年6月13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、「D I A M世界リートインデックスファンド（隔月分配型）」は、2024年6月13日に第4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/>

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			S&P先進国REITインデックス		投資信託 受益証券 投資組 比率	不動産 投信指 先物比 率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(円換算ベース、配当 込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期中 騰落率			
第1作成期	(設定日) 2023年9月28日	円	円	%	ポイント (9月27日)	%	%	%	百万円
		10,000	—	—	174,187.18	—	—	—	300
第2作成期	1期(2023年12月13日)	10,586	0	5.9	185,681.01	6.6	97.3	—	351
	2期(2024年2月13日)	10,976	45	4.1	194,500.65	4.7	95.1	—	748
	3期(2024年4月15日)	11,037	45	1.0	196,989.54	1.3	95.5	—	965
	4期(2024年6月13日)	11,518	45	4.8	207,267.06	5.2	96.2	3.8	952

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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) ベンチマークはS&P先進国REITインデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています(以下同じ)。

(注5) S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc. またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません(以下同じ)。

(注6) △(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

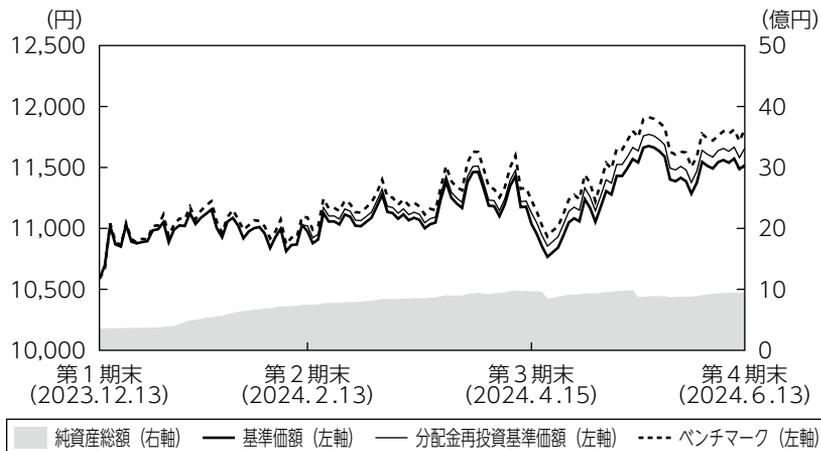
決算期	年 月 日	基 準 価 額		S&P 先進国 REITインデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (パンチマーク)		投資信託 受益証券 組 入 比 率	不動産 投 信 指 数 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率		
第 2 期	(期 首) 2023年12月13日	円 10,586	% -	ポイント 185,681.01	% -	% 97.3	% -
	12 月 末	11,051	4.4	194,912.78	5.0	99.8	-
	2024年1月 末	10,958	3.5	193,225.06	4.1	98.2	-
	(期 末) 2024年2月13日	11,021	4.1	194,500.65	4.7	95.1	-
第 3 期	(期 首) 2024年2月13日	10,976	-	194,500.65	-	95.1	-
	2 月 末	11,052	0.7	195,939.18	0.7	97.6	-
	3 月 末	11,461	4.4	203,977.37	4.9	96.7	-
	(期 末) 2024年4月15日	11,082	1.0	196,989.54	1.3	95.5	-
第 4 期	(期 首) 2024年4月15日	11,037	-	196,989.54	-	95.5	-
	4 月 末	11,240	1.8	200,652.65	1.9	95.8	-
	5 月 末	11,375	3.1	203,245.29	3.2	96.6	-
	(期 末) 2024年6月13日	11,563	4.8	207,267.06	5.2	96.2	3.8

(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) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

■第2期～第4期の運用経過（2023年12月14日から2024年6月13日まで）

基準価額等の推移



第2期首：10,586円
第4期末：11,518円
(既払分配金135円)
騰落率：10.1%
(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す。
- (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

米国等の物価上昇の鈍化傾向を受けた利下げ観測の浮上などを背景に米国やオーストラリアなどのリート市場が上昇したことや、為替市場で全ての指数構成通貨に対して円安になったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

米国リート市場は上昇しました。作成期初はF R B（米連邦準備理事会）による利下げ期待から上昇しましたが、2024年に入ると堅調な経済指標やC P I（消費者物価指数）の上振れなどを受けて、過度な利下げ観測が後退し、上昇幅を縮小して作成期末を迎えました。欧州リート市場はインフレの鎮静化や利下げ期待などから上昇しました。オーストラリアリート市場では利下げや減税政策に対する期待などを受けて上昇しました。

国内リート市場は下落しました。作成期前半は日銀の金融政策正常化への警戒感から下落しました。2024年3月の金融政策決定会合においてマイナス金利解除が決まると先行き不透明感が払拭されたことに加え、金融緩和的な環境が当面続くとの観測から反発しました。作成期末にかけては日銀が金融政策の正常化を早めるとの観測が強まり、下落しました。

為替市場は全ての指数構成通貨に対し円安となりました。米ドルは作成期初、早期利下げ観測が浮上したことから円高ドル安となりましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退し、改めて円安ドル高となりました。3月に日銀のマイナス金利解除観測から円高となる場面もありましたが、実際に決定されると、日米金利差は残るとの見方などから円安は進展しました。ユーロなどに対しても日欧金利差は残るとの見方などから円安となりました。

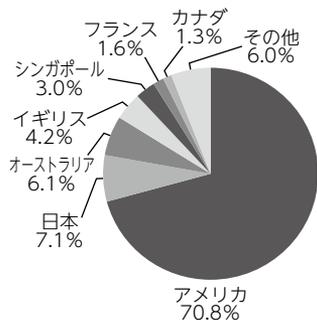
ポートフォリオについて

ベンチマークの構成比率を基本配分比率とし、この割合に合致するよう、各リーートの組入れを行いました。

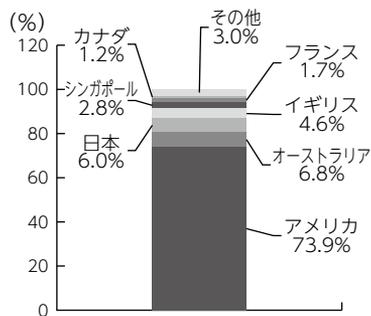
【運用状況】

- (注1) 比率は純資産総額に対する割合です。
 (注2) 現金等はその他として表示しています。
 (注3) 国別配分は発行国（地域）を表示しています。
 (注4) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

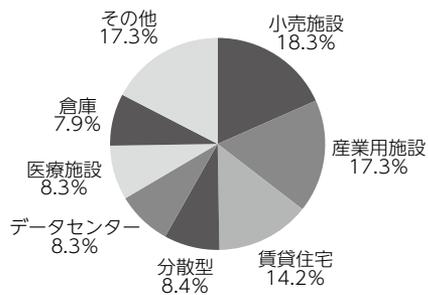
○国別配分 前作成期末



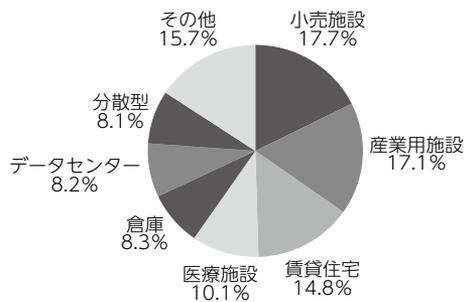
当作成期末



○業種別配分 前作成期末



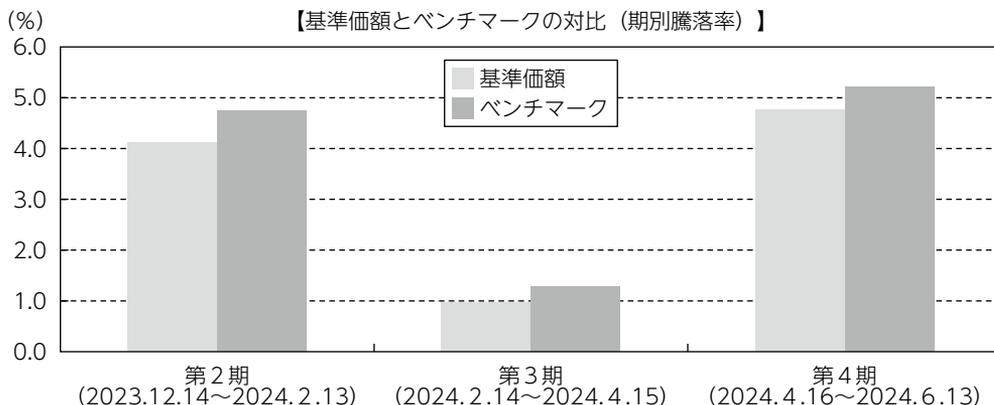
当作成期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前作成期末比で11.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.5%下回りました。設定当初のポートフォリオ構築のための取引コストが当作成期に計上されたことや、信託報酬、配当課税などの影響を除くとベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、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2期	第3期	第4期
	2023年12月14日 ～2024年2月13日	2024年2月14日 ～2024年4月15日	2024年4月16日 ～2024年6月13日
当期分配金（税引前）	45円	45円	45円
対基準価額比率	0.41%	0.41%	0.39%
当期の収益	45円	45円	45円
当期の収益以外	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	976円	1,036円	1,517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。

今後の運用方針

引き続き、日本を含む世界各国のリートに投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざします。また、原則としてリートの組入比率を高位に維持します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期～第4期 (2023年12月14日 ～2024年6月13日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	52円	
(投信会社)	(21)	(0.190)	
(販売会社)	(26)	(0.234)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	3	0.027	(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)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.004)	
(投資証券)	(2)	(0.022)	
(c) 有価証券取引税	4	0.033	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0.002)	
(投資証券)	(4)	(0.031)	
(d) その他費用	48	0.429	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(47)	(0.424)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.003)	
合計	107	0.956	

(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。

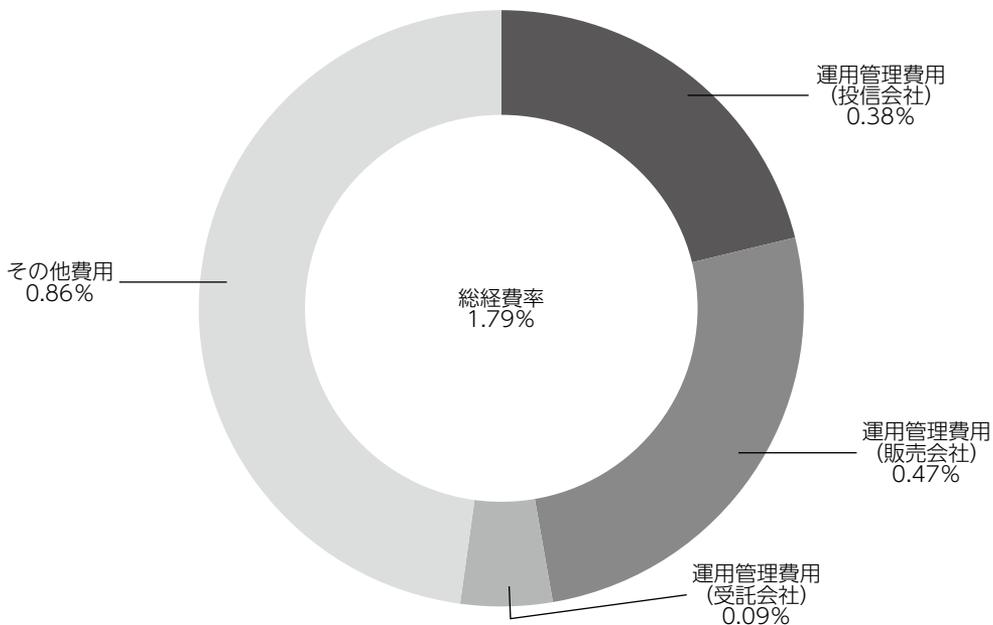
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.79%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。

■売買及び取引の状況（2023年12月14日から2024年6月13日まで）

(1) 投資信託受益証券、投資証券

決 算 期	第 2 期		第 4 期	
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内	千□	千円	千□	千円
S O S I L A 物流リート投資法人	0.012 (-)	1,496 (-)	0.007 (-)	856 (-)
日本アコモデーションファンド投資法人	0.001 (-)	604 (-)	- (-)	- (-)
森ヒルズリート投資法人	0.004 (-)	558 (-)	- (-)	- (-)
産業ファンド投資法人	0.01 (-)	1,311 (-)	- (-)	- (-)
アドバンス・レジデンス投資法人	0.005 (-)	1,638 (-)	0.003 (-)	1,021 (-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.002 (-)	785 (-)	- (-)	- (-)
G L P 投資法人	0.024 (-)	3,149 (-)	0.008 (-)	1,059 (-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.006 (-)	1,968 (-)	0.003 (-)	1,010 (-)
日本プロロジスリート投資法人	0.006 (-)	1,613 (-)	- (-)	- (-)
イオンリート投資法人	0.003 (-)	426 (-)	- (-)	- (-)
ヒューリックリート投資法人	0.003 (-)	465 (-)	- (-)	- (-)
日本リート投資法人	0.002 (-)	656 (-)	- (-)	- (-)
積水ハウス・リート投資法人	0.012 (-)	944 (-)	- (-)	- (-)
野村不動産マスターファンド投資法人	0.028 (-)	4,200 (-)	0.013 (-)	1,987 (-)
ラサールロジポート投資法人	0.006 (-)	931 (-)	- (-)	- (-)
スターアジア不動産投資法人	0.01 (-)	578 (-)	- (-)	- (-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.001 (-)	467 (-)	- (-)	- (-)
三菱地所物流リート投資法人	0.001 (-)	375 (-)	- (-)	- (-)
日本ビルファンド投資法人	0.004 (-)	2,415 (-)	- (-)	- (-)
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.004 (-)	2,273 (-)	- (-)	- (-)
日本都市ファンド投資法人	0.042 (-)	4,002 (-)	0.024 (-)	2,251 (-)
オリックス不動産投資法人	0.007 (-)	1,165 (-)	- (-)	- (-)
日本プライムリアルティ投資法人	0.002 (-)	685 (-)	- (-)	- (-)
N T T 都市開発リート投資法人	0.003 (-)	375 (-)	- (-)	- (-)

決 算 期	第 2 期		第 4 期	
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内	千□	千円	千□	千円
東急リアル・エステート投資法人	0.004 (-)	656 (-)	- (-)	- (-)
グローバル・ワン不動産投資法人	0.006 (-)	651 (-)	- (-)	- (-)
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.007 (-)	1,039 (-)	- (-)	- (-)
森トラストリート投資法人	0.005 (-)	369 (-)	- (-)	- (-)
インヴィンシブル投資法人	0.021 (-)	1,290 (-)	- (-)	- (-)
フロンティア不動産投資法人	0.001 (-)	439 (-)	- (-)	- (-)
平和不動産リート投資法人	0.005 (-)	661 (-)	- (-)	- (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.002 (-)	576 (-)	- (-)	- (-)
福岡リート投資法人	0.003 (-)	517 (-)	- (-)	- (-)
KDX不動産投資法人	0.023 (-)	3,668 (-)	0.01636 (-)	2,575 (-)
大和証券オフィス投資法人	- (0.001)	- (-)	- (-)	- (-)
阪急阪神リート投資法人	0.011 (-)	1,517 (-)	0.011 (-)	1,528 (-)
大和ハウスリート投資法人	0.01 (-)	2,551 (-)	0.004 (-)	1,045 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.014 (-)	1,018 (-)	- (-)	- (-)
大和証券リビング投資法人	0.004 (-)	424 (-)	- (-)	- (-)
ジャパンエクセレント投資法人	0.004 (-)	496 (-)	- (-)	- (-)
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.506 (-)	62 (-)	0.1 (-)	12 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	0.36 (-)	24 (-)	- (-)	- (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	0.737 (-)	22 (-)	0.272 (-)	8 (-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	0.694 (-)	5 (-)	- (-)	- (-)
AGREE REALTY CORP	0.25 (-)	15 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN	0.181 (-)	7 (-)	- (-)	- (-)
EPR PROPERTIES	0.201 (-)	8 (-)	- (-)	- (-)
PROLOGIS INC	3.203 (-)	400 (-)	0.942 (-)	104 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.477 (-)	86 (-)	0.149 (-)	28 (-)

決 算 期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LXP INDUSTRIAL TRUST	0.914	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.482	48	0.2	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	0.329	5	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	0.331	265	0.1	77
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	0.513	21	0.195	8
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	0.543	12	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	0.533	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.271	67	0.105	26
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	1.216	75	0.409	26
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.212	21	0.081	8
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	0.319	16	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1.921	36	0.429	8
	(0.624)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	0.204	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.373	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	0.345	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	1.937	178	0.573	54
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	0.145	25	0.057	9
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	1.623	32	0.219	4
	(0.081)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	0.214	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	0.128	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	0.968	69	0.287	22
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	0.795	12	0.467	6
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.839	55	0.335	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	0.239	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	2.371	46	0.53	9
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
MID AMERICA	0.369	49	0.068	9
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	0.153	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	0.136	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	-	-	-	-
	(△0.134)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	2.761	151	0.888	47
	(0.236)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	0.785	48	0.345	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	1.379	52	0.583	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
COPT DEFENCE PROPERTIES	0.343	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	1.147	166	0.344	50
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	0.501	143	0.14	38
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	0.532	67	0.209	24
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER INC	0.3	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	0.34	5	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	1.61	75	0.584	26
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	0.477	13	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	0.271	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	0.569	12	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.699	102	0.211	30
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	0.662	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	1.005	44	0.472	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.085	151	0.313	43
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	0.417	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	1.937	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	0.671	9	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	0.262	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
TERRENO REALTY CORP	0.24	15	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.231	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	0.321	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	0.758	21	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0.246	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.616	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	0.569	21	0.221	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	0.964	58	0.381	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	0.224	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1.235	19	0.297	4
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.17	19	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.071	3	-	-
	(△0.311)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.556	7	-	-
	(△0.926)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	0.509	27	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	1.454	52	0.612	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	0.83	13	0.275	4
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	0.092	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	0.243	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	2.153	73	0.8	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	4.8	1	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	0.401	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	0.344	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1.233	56	0.505	22
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.731	16	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	0.144	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
NETSTREIT CORP	0.217	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	0.503	11	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	0.367	13	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	0.415	13	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	0.409	6	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	-	-	-	-
	(-)	(△0.01256)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	0.228	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	0.228	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	0.284	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	0.736	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	0.224	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	0.524	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	0.409	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	-	-	-	-
	(0.001)	(0.00749)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.533	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	3.468	104	1.042	29
	(-)	(-)	(-)	(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	0.382	9	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	0.153	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	0.352	16	0.155	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	0.469	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.271	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.415	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	0.146	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.052	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	0.394	5	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
DREAM INDUSTRIAL REIT	0.248	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.09	6	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	0.587	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.099	1	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.978	13	1.072	14
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.256	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	1.44	5	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	10.219	21	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	0.931	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	4.516	20	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	3.841	6	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	8.266	37	2.652	12
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	1.292	5	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	3.339	25	1.008	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	6.249	176	1.934	63
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	23.956	47	12.562	23
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	3.08	37	1.853	22
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGION RE LTD	4.869	11	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	1.287	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	1.378	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	1.176	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	4.755	10	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	13.539	41	2.054	6
	(-)	(-)	(-)	(-)
HMC CAPITAL LTD	0.617	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	3.335	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期		第 4 期	
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
WAYPOINT REIT LTD	2.376	5	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	7.6	295	2	64
	(—)	(—)	(—)	(—)
CHAMPION REIT	13	20	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4	19	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	24.8	48	11.3	21
	(—)	(△0.0328)	(—)	(—)
CAPLAND ASCENDAS REIT	18.1	50	7.9	20
	(—)	(△0.14549)	(—)	(—)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	8.8	10	—	—
	(—)	(△0.01287)	(—)	(—)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	9.1	14	—	—
	(—)	(△0.20268)	(—)	(—)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	7.8	7	—	—
	(—)	(△0.05255)	(—)	(—)
KEPPEL REIT	9.5	8	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	2	4	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
ESR LOGOS REIT	12.4	4	—	—
	(—)	(△0.03448)	(—)	(—)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	—	—
	(—)	(△0.00912)	(—)	(—)
CAPITALAND CHINA TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△0.0254)	(—)	(—)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	—	—	—	—
	(—)	(△0.01297)	(—)	(—)
PARKWAY LIFE REIT	1.3	4	—	—
	(—)	(△0.03724)	(—)	(—)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	6	14	—	—
	(—)	(△0.01165)	(—)	(—)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	6.1	8	—	—
	(—)	(△0.07663)	(—)	(—)
PARAGON REIT	5.8	5	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△0.00001)	(—)	(—)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	7	4	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
KEPPEL DC REIT	2.2	4	—	—
	(—)	(△0.02946)	(—)	(—)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	11.8	12	8.5	8
	(—)	(△0.07987)	(—)	(—)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	3.11	3	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)

決算期	第 2 期 ~ 第 4 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
GOODMAN PROPERTY TRUST	3.648	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	5.001	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	1.327	1	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	3.98	16	1.603	6
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	0.374	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	0.634	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	8.266	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	4.21	28	2.011	13
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	0.521	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	0.846	8	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	2.107	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	4.995	43	1.61	14
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1.181	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	4.616	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	5.358	3	-	-
	(△6.859)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	0.585	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	7.154	14	5.889	11
	(3.808)	(-)	(-)	(-)
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	2.754	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	5.346	7	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	3.307	2	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	5.303	8	-	-
	(3.045)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	3.461	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC-RTS	-	-	0.955	1
	(0.955)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	4.219	4	-	-
	(△6.924)	(-)	(-)	(-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	2.531	3	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期		第 4 期	
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イスラエル	千□	千イスラエル・シケル	千□	千イスラエル・シケル
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	4.284	7	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
JR REIT XXVII	1.729	7,021	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	1.604	7,338	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ガーンジ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
SHURGARD SELF STORAGE LTD	0.064	2	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	-	-	(-)	(-)
	(-)	(△0.00809)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
NSI NV	0.074	1	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	0.098	2	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COFINIMMO SA	0.115	7	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	0.137	8	0.115	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	-	-	0.04	0.83192
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	0.685	18	0.218	5
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	0.071	5	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	0.089	5	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.088	2	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	0.131	13	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	0.067	2	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	0.553	13	0.144	3
	(-)	(-)	(-)	(-)
COVIVIO	0.129	5	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	0.216	2	(-)	(-)
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	0.097	1	(-)	(-)
	(-)	(△0.15252)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.476	34	0.197	15
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	-	-	(-)	(-)
	(-)	(△0.02859)	(-)	(-)

決 算 期	第 2 期		第 4 期	
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	0.68	4	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	-	-	-	-
	(-)	(△0.00315)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1.029	9	0.322	3
	(-)	(△0.30296)	(-)	(-)

(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

銘 柄 別		第 2 期		第 4 期	
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 62	百万円 26	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（2023年12月14日から2024年6月13日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 2 期 ~ 第 4 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
投資信託受益証券、投資証券	百万円 720	百万円 8	% 1.2	百万円 197	百万円 -	% -

(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 2 期 ~ 第 4 期	
	買	付 額
投資信託受益証券、投資証券		百万円 0.8

(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	第 2 期 ~ 第 4 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	198千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1千円
(B)/(A)	0.7%

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。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 300	百万円 -	百万円 200	百万円 100	当初設定時又は当初運用時における取得の処分

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第 1 作 成 期 末	第 2 作 成 期 末		
		□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
不動産ファンド		千□	千□	千円	%
サンケイリアルエステート投資法人		0.001	0.001	83	0.0
S O S I L A 物流リート投資法人		0.001	0.006	688	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		0.001	0.002	1,264	0.1
森ヒルズリート投資法人		0.003	0.007	903	0.1
産業ファンド投資法人		0.003	0.013	1,593	0.2
アドバンス・レジデンス投資法人		0.002	0.004	1,276	0.1
アクティビア・プロパティーズ投資法人		0.001	0.003	1,093	0.1
G L P 投資法人		0.008	0.024	3,182	0.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		0.001	0.004	1,256	0.1
日本プロロジスリート投資法人		0.004	0.01	2,498	0.3
星野リゾート・リート投資法人		0.001	0.001	513	0.1
One リート投資法人		0.001	0.001	252	0.0
イオンリート投資法人		0.003	0.006	784	0.1
ヒューリックリート投資法人		0.002	0.005	723	0.1
日本リート投資法人		0.001	0.003	994	0.1
積水ハウス・リート投資法人		0.007	0.019	1,480	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.001	0.001	103	0.0
野村不動産マスターファンド投資法人		0.008	0.023	3,174	0.3
ラサールロジポート投資法人		0.003	0.009	1,323	0.1
スターアジア不動産投資法人		0.004	0.014	823	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.001	0.002	859	0.1
投資法人みらい		0.003	0.003	133	0.0
三菱地所物流リート投資法人		0.001	0.002	758	0.1
C R E ロジスティクスファンド投資法人		0.001	0.001	142	0.0
タカラレーベン不動産投資法人		0.001	0.001	98	0.0
アドバンス・ロジスティクス投資法人		0.001	0.001	118	0.0
日本ビルファンド投資法人		0.003	0.007	3,990	0.4
ジャパンリアルエステイト投資法人		0.002	0.006	3,012	0.3
日本都市ファンド投資法人		0.011	0.029	2,601	0.3
オリックス不動産投資法人		0.005	0.012	1,882	0.2
日本プライムリアルティ投資法人		0.002	0.004	1,306	0.1
N T T 都市開発リート投資法人		0.002	0.005	579	0.1

銘	柄	第 2 作 成 期 末			
		第 1 作 成 期 末	第 2 作 成 期 末	評 価 額	比 率
		□ 数	□ 数	千円	%
		千□	千□		
東急リアル・エステート投資法人		0.002	0.006	930	0.1
グローバル・ワン不動産投資法人		0.002	0.008	792	0.1
ユナイテッド・アーバン投資法人		0.005	0.012	1,689	0.2
森トラストリート投資法人		0.004	0.009	618	0.1
インヴィンシブル投資法人		0.01	0.031	2,108	0.2
フロンティア不動産投資法人		0.001	0.002	899	0.1
平和不動産リート投資法人		0.002	0.007	912	0.1
日本ロジスティクスファンド投資法人		0.002	0.004	1,065	0.1
福岡リート投資法人		0.001	0.004	627	0.1
KDX不動産投資法人		0.00636	0.013	1,948	0.2
いちごオフィスリート投資法人		0.002	0.002	161	0.0
大和証券オフィス投資法人		0.001	0.002	556	0.1
阪急阪神リート投資法人		0.001	0.001	130	0.0
大和ハウスリート投資法人		0.004	0.01	2,470	0.3
ジャパン・ホテル・リート投資法人		0.007	0.021	1,665	0.2
大和証券リビング投資法人		0.004	0.008	813	0.1
ジャパンエクセレント投資法人		0.002	0.006	720	0.1
合 計	□ 数 ・ 金 額	0.14536	0.375	57,599	—
	銘 柄 数 ・ 比 率	49銘柄<7.1%>	49銘柄<6.0%>	—	6.0

(注1) 比率は作成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) ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、KDX不動産投資法人、インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、福岡リート投資法人、SOSIL A物流リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、Oneリート投資法人、ジャパンリアルエステイ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より記載）

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

銘柄	第1作成期末		第2作成期末		比率
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド (アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	4.8	0.6624	103	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE	0.8	0.8	0.436	68	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.267	0.673	77	12,219	1.3
ALEXANDER'S INC.	0.004	0.004	0.8626	135	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	0.237	0.597	35	5,616	0.6
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	0.426	0.891	28	4,443	0.5
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	0.226	0.92	7	1,163	0.1
AGREE REALTY CORP	0.163	0.413	24	3,901	0.4
SL GREEN	0.101	0.282	15	2,458	0.3
EPR PROPERTIES	0.135	0.336	13	2,117	0.2
PROLOGIS INC	1.571	3.832	432	67,821	7.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.243	0.571	113	17,805	1.9
LXP INDUSTRIAL TRUST	0.455	1.369	12	1,887	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.185	0.467	50	7,868	0.8
VERIS RESIDENTIAL INC	0.129	0.458	6	1,077	0.1
EQUINIX INC	0.159	0.39	296	46,590	4.9
NNN REIT INC	0.307	0.625	26	4,106	0.4
CTO REALTY GROUTH INC	0.041	0.041	0.72898	114	0.0
COUSINS PROPERTIES INC	0.235	0.778	17	2,781	0.3
SITE CENTERS CORP	0.282	0.815	11	1,868	0.2
SAFEHOLD INC	0.076	0.076	1	225	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.11	0.276	74	11,753	1.2
EQUITY RESIDENTIAL	0.591	1.398	91	14,429	1.5
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.12	0.251	25	3,971	0.4
FIRST INDUSTRIAL RT	0.224	0.543	25	4,047	0.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.948	3.064	59	9,325	1.0
EQUITY COMMONWEALTH	0.172	0.376	7	1,132	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.166	0.539	13	2,148	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	0.268	0.613	3	484	0.1
WELLTOWER INC	0.943	2.307	237	37,233	3.9
EAST GROUP	0.075	0.163	27	4,280	0.4
KIMCO REALTY	1.07	2.555	47	7,427	0.8
KILROY REALTY CORP	0.192	0.406	12	2,030	0.2
LTC PROPERTIES INC	0.067	0.195	6	1,033	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	0.416	0.416	1	191	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	0.292	0.292	1	207	0.0
IRON MOUNTAIN INC	0.5	1.181	103	16,175	1.7
THE MACERICH COMPANY	0.336	0.664	9	1,542	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.31	0.814	49	7,827	0.8
ACADIA REALTY TRUST	0.153	0.392	6	1,050	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	1.227	3.068	56	8,822	0.9

銘柄	第 1 作成期末		第 2 作成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額		比 率
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
MID AMERICA	0.201	0.502	68	10,816	1.1
NATIONAL HEALTH INVS INC	0.068	0.221	14	2,265	0.2
CENTERSPACE	0.025	0.025	1	262	0.0
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.033	0.033	0.78243	122	0.0
GETTY REALTY CORP	0.074	0.21	5	876	0.1
RPT REALTY	0.134	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	1.209	3.318	174	27,428	2.9
REGENCY CENTERS CORP	0.284	0.724	43	6,884	0.7
UDR INC	0.524	1.32	52	8,192	0.9
COPT DEFENCE PROPERTIES	0.175	0.518	12	1,973	0.2
SAUL CENTERS INC	0.024	0.024	0.88008	138	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.558	1.361	208	32,703	3.4
PUBLIC STORAGE	0.27	0.631	173	27,297	2.9
SUN COMMUNITIES INC	0.214	0.537	62	9,810	1.0
TANGER INC	0.164	0.464	12	2,028	0.2
UMH PROPERTIES INC	0.1	0.44	6	1,052	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.075	0.075	1	165	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.024	0.024	0.93024	145	0.0
VENTAS INC	0.69	1.716	84	13,331	1.4
VORNADO REALTY TRUST	0.287	0.764	18	2,957	0.3
ELME COMMUNITIES	0.143	0.414	6	1,006	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	0.374	0.943	20	3,262	0.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.361	0.849	131	20,615	2.2
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	0.326	0.988	10	1,571	0.2
CUBESMART	0.39	0.923	40	6,313	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.516	1.288	192	30,228	3.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	0.333	0.75	6	984	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	0.926	2.863	13	2,174	0.2
DOUGLAS EMMETT INC	0.262	0.933	12	1,951	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	0.201	0.463	5	904	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	0.219	0.219	1	239	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	0.193	0.193	1	179	0.0
TERRENO REALTY CORP	0.143	0.383	22	3,504	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.081	0.312	6	1,039	0.1
RLJ LODGING TRUST	0.251	0.572	5	877	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	0.418	1.176	30	4,719	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0.192	0.438	6	960	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	0.092	0.092	0.7774	121	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.416	1.032	14	2,292	0.2
WHITESTONE REIT	0.107	0.107	1	219	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	0.213	0.213	1	160	0.0
STAG INDUSTRIAL INC	0.303	0.651	22	3,598	0.4
WP CAREY INC	0.369	0.952	53	8,316	0.9

銘柄	第 1 作成期末		第 2 作成期末		比率
	□ 数	□ 数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
ALEXANDER & BALDWIN INC	0.118	0.342	5	888	0.1
GLADSTONE LAND CORP	0.063	0.063	0.84987	133	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.644	1.582	26	4,105	0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.101	0.271	27	4,287	0.5
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	0.093	0.093	1	161	0.0
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.24	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.37	—	—	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	0.357	0.866	39	6,122	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT	0.549	1.391	49	7,699	0.8
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	0.347	0.902	16	2,516	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	0.044	0.136	14	2,273	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	0.152	0.395	5	899	0.1
INVITATION HOMES INC	0.986	2.339	81	12,862	1.4
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	0.214	0.615	5	909	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	0.061	0.061	1	202	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	0.279	0.623	17	2,693	0.3
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	0.437	1.165	50	7,998	0.8
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.507	1.238	27	4,325	0.5
POSTAL REALTY TRUST INC	0.053	0.053	0.69271	108	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	0.107	0.251	6	967	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	0.084	0.084	0.91728	143	0.0
ORION OFFICE REIT INC	0.118	0.118	0.40474	63	0.0
NETSTREIT CORP	0.11	0.327	5	869	0.1
CARETRUST REIT INC	0.156	0.659	16	2,610	0.3
PEAKSTONE REALTY TRUST	0.065	0.065	0.75985	119	0.0
PHILLIPS EDISON & CO INC	0.201	0.568	18	2,842	0.3
APARTMENT INCOME REIT CORP	0.255	0.67	26	4,081	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC	0.291	0.7	10	1,682	0.2
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	0.046	0.046	1	161	0.0
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	0.023	0.023	0.5589	87	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	0.281	0.281	1	202	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	0.113	0.113	1	161	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	0.186	0.414	7	1,152	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	0.153	0.381	4	714	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	0.174	0.458	6	1,044	0.1
COMMUNICATIONS SALES & LEASING I	0.392	1.128	3	555	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	0.039	0.039	1	227	0.0
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	0.129	0.353	14	2,228	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	0.042	0.042	0.99078	155	0.0
APPLE HOSPITALITY REIT INC	0.381	0.905	13	2,085	0.2
GLOBAL NET LEASE INC	0.307	0.716	5	820	0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE	0.068	0.069	0.33948	53	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.335	0.868	13	2,050	0.2

銘柄	第1作成期末		第2作成期末		比率	
	□数	□数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
VICI PROPERTIES INC	1,731	4,157	117	18,502	1.9	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	0.142	0.524	12	1,996	0.2	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	37,728	94,406	4,251	666,963	-
		128銘柄<70.8%>	126銘柄<70.0%>	-	-	70.0
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
SMARTCENTRES REIT	0.115	0.268	5	678	0.1	
CANADIAN APT PPTYS REIT	0.127	0.324	14	1,604	0.2	
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	0.215	0.684	6	705	0.1	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	0.171	0.442	6	748	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.231	0.646	10	1,240	0.1	
ALLIED PROPERTIES REIT	0.105	0.251	3	455	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.037	0.089	6	714	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	0.115	0.115	0.74175	84	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INV	0.094	0.094	1	135	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	0.121	0.515	6	697	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	0.217	0.217	1	123	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	0.061	0.061	0.94245	107	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REIT	0.209	0.457	5	662	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	0.05	0.14	9	1,094	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	0.257	0.844	10	1,234	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	-	0.099	1	171	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.094	-	-	-	-	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.055	0.055	0.85415	97	0.0	
SLATE GROCERY REIT	0.05	0.05	0.5545	63	0.0	
PRIMARIS REIT	0.087	0.087	1	134	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	0.098	0.354	6	700	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	2,509	5,792	100	11,455	-
		20銘柄<1.3%>	20銘柄<1.2%>	-	-	1.2
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%	
BWP TRUST	0.79	2.23	8	840	0.1	
MIRVAC GROUP	6.707	16,926	32	3,349	0.4	
CROMWELL PROPERTY GROUP	2.127	2,127	0.8827	92	0.0	
CHARTER HALL RETAIL REIT	0.849	1.78	5	605	0.1	
GPT GROUP	3.377	7,893	32	3,387	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	1.365	5,206	8	921	0.1	
ABACUS GROUP	1.129	1,129	1	133	0.0	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	0.597	0.597	1	150	0.0	
STOCKLAND	4.038	9,652	43	4,495	0.5	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	0.618	1.91	9	953	0.1	
DEXUS	1.832	4,163	27	2,877	0.3	
GOODMAN GROUP	2.931	7,246	251	26,272	2.8	
VICINITY CENTRES	6.851	18,245	34	3,562	0.4	
CHARTER HALL GROUP	0.733	1.96	24	2,511	0.3	

銘柄	第1作成期末		第2作成期末		比率	
	□数	□数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	0.257	0.257	0.59881	62	0.0	
REGION RE LTD	1.836	6.705	14	1,512	0.2	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	0.875	2.162	6	706	0.1	
ARENA REIT	0.596	1.974	7	756	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	1.067	2.243	7	796	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	0.423	0.423	1	128	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	1.987	6.742	15	1,570	0.2	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	0.39	0.39	1	131	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	0.707	0.707	1	148	0.0	
SCENTRE GROUP	8.502	19.987	61	6,470	0.7	
HMC CAPITAL LTD	0.415	1.032	7	794	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	2.871	6.206	7	780	0.1	
HEALTHCO REIT	0.869	0.869	0.97328	101	0.0	
ABACUS STORAGE KING	1.061	1.061	1	129	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	1.088	1.088	1	134	0.0	
WAYPOINT REIT LTD	1.106	3.482	8	843	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	57.994 30銘柄<6.1%>	136.392 30銘柄<6.8%>	624 -	65,223 -	- 6.8
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT	4.4	10	322	6,479	0.7	
PROSPERITY REIT	3	3	4	81	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	4	4	4	81	0.0	
CHAMPION REIT	3	16	25	504	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	1	1	1	34	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	2	6	23	473	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	17.4 6銘柄<1.0%>	40 6銘柄<0.8%>	381 -	7,655 -	- 0.8
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	8.3	21.8	42	4,894	0.5	
CAPLAND ASCENDAS REIT	5.9	16.1	41	4,794	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	3.5	12.3	12	1,502	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	5.7	14.8	19	2,272	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	2.5	2.5	1	141	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	3.6	11.4	10	1,180	0.1	
KEPPEL REIT	3.2	12.7	10	1,241	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	1.7	3.7	7	925	0.1	
ESR LOGOS REIT	9.7	22.1	6	719	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	1.2	1.2	1	135	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	2	2	1	153	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	1.2	1.2	1	175	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	0.6	1.9	6	802	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3.7	9.7	20	2,437	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	3.6	9.7	11	1,376	0.1	

銘柄	第1作成期末		第2作成期末			
	□数	□数	評価額		比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	2	2	1	143	0.0	
PARAGON REIT	2.1	7.9	6	776	0.1	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	1.5	1.5	0.9975	116	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	3	10	5	633	0.1	
KEPPEL DC REIT	2.1	4.3	7	895	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	4.5	7.8	7	871	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	71.6 21銘柄<3.0%>	176.6 21銘柄<2.7%>	225 -	26,189 -	- 2.7
(ニュージーランド)	千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES	2.243	5.353	6	602	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	1.697	5.345	11	1,093	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	2.671	7.672	6	606	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	0.566	1.893	2	196	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	7.177 4銘柄<0.2%>	20.263 4銘柄<0.3%>	25 -	2,498 -	- 0.3
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	1.669	4.046	17	3,550	0.4	
DERWENT LONDON PLC	0.175	0.549	13	2,622	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	0.275	0.909	10	2,186	0.2	
HAMMERSON PLC	6.29	14.556	4	829	0.1	
LAND SECURITIES GROUP PLC	1.246	3.445	22	4,443	0.5	
WORKSPACE GROUP PLC	0.229	0.75	4	873	0.1	
UNITE GROUP PLC	0.678	1.524	13	2,765	0.3	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	2.134	4.241	3	782	0.1	
SEGRO PLC	2.111	5.496	50	10,083	1.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	0.411	1.592	5	1,107	0.1	
ASSURA PLC	4.729	9.345	3	744	0.1	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	1.164	1.164	0.61459	123	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	1.366	1.366	0.62699	125	0.0	
HELICAL PLC	0.226	0.226	0.49607	99	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	1.005	1.005	0.66531	133	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	1.501	-	-	-	-	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	0.343	0.928	7	1,478	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1.544	6.617	13	2,685	0.3	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU	1.238	3.992	3	609	0.1	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	3.034	8.38	11	2,395	0.3	
WAREHOUSE REIT PLC	0.626	0.626	0.51269	102	0.0	
NEWRIVER REIT PLC	0.646	0.646	0.46382	93	0.0	
PRS REIT PLC/THE	0.958	0.958	0.75298	151	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	0.998	0.998	0.56486	113	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	2.025	5.332	3	780	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	3.403	11.751	18	3,696	0.4	
CUSTODIAN REIT PLC	0.812	0.812	0.58788	118	0.0	

銘柄	第1作成期末	第2作成期末				
		□数	□数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	1.098	1.098	0.86632	173	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	1.042	4.503	4	848	0.1	
LIFE SCIENCE REIT PLC	0.728	0.728	0.26353	52	0.0	
LXI REIT PLC	2.705	-	-	-	-	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	0.821	3.352	4	818	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	0.797	0.797	0.68701	137	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	48.027 33銘柄<4.4%>	101.732 31銘柄<4.7%>	222 -	44,727 -	- 4.7
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シケル	千円	%	
REIT 1 LTD	0.327	0.327	4	198	0.0	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	0.401	0.401	2	113	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	-	4.284	6	292	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.728 2銘柄<0.1%>	5.012 3銘柄<0.1%>	14 -	604 -	- 0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
JR REIT XXVII	-	1.729	7,158	821	0.1	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	-	1.604	7,627	875	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	- 一銘柄<-%>	3.333 2銘柄<0.2%>	14,785 -	1,697 -	- 0.2
(ユーロ…ガーンジー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
SHURGARD SELF STORAGE LTD	0.052	0.116	4	756	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.052 1銘柄<0.1%>	0.116 1銘柄<0.1%>	4 -	756 -	- 0.1
(ユーロ…シンガポール)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	0.6	0.6	0.852	144	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.6 1銘柄<0.0%>	0.6 1銘柄<0.0%>	0.852 -	144 -	- 0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	0.642	0.642	0.60733	103	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.642 1銘柄<0.0%>	0.642 1銘柄<0.0%>	0.60733 -	103 -	- 0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	0.035	0.035	0.83475	141	0.0	
WERELDHAVE NV	0.07	0.07	0.9506	161	0.0	
NSI NV	-	0.074	1	249	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	0.072	0.17	4	680	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.177 3銘柄<0.1%>	0.349 4銘柄<0.1%>	7 -	1,233 -	- 0.1
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	0.053	0.168	9	1,672	0.2	
RETAIL ESTATES	0.021	0.043	2	465	0.0	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	0.04	-	-	-	-	
WAREHOUSES DE PAUW	0.286	0.753	19	3,333	0.4	

銘柄	第1作成期末		第2作成期末		比率	
	□数	□数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
MONTEA SCA	0.025	0.096	7	1,327	0.1	
AEDIFICA	0.074	0.163	9	1,604	0.2	
CARE PROPERTY INVEST NV	0.085	0.085	1	205	0.0	
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.048	0.136	4	682	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.632 8銘柄<1.0%>	1.444 7銘柄<1.0%>	54 -	9,291 -	- 1.0
(ユーロ…フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	0.085	0.216	20	3,540	0.4	
ICADE	0.051	0.118	3	537	0.1	
ALTAREA	0.009	0.009	0.7983	135	0.0	
KLEPIERRE	0.344	0.753	20	3,397	0.4	
COVIVIO	0.076	0.205	9	1,655	0.2	
MERCIALYS	0.158	0.374	4	721	0.1	
CARMILA SA	0.067	0.164	2	463	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.172	0.451	34	5,848	0.6	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.962 8銘柄<1.6%>	2.29 8銘柄<1.7%>	96 -	16,300 -	- 1.7
(ユーロ…ドイツ)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
HAMBORNER REIT AG	0.106	0.106	0.70066	118	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	0.106 1銘柄<0.0%>	0.106 1銘柄<0.0%>	0.70066 -	118 -	- 0.0
(ユーロ…スペイン)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	0.456	1.136	7	1,201	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	0.06	0.06	0.4164	70	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	0.601	1.308	14	2,433	0.3	
小計	□数・金額 銘柄数・比率	1.117 3銘柄<0.4%>	2.504 3銘柄<0.4%>	21 -	3,705 -	- 0.4
合計	□数・金額 銘柄数・比率	247.451 270銘柄<90.2%>	591.581 269銘柄<90.2%>	- -	858,668 -	- 90.2

(注1) 邦貨換算金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率は、作成期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは投資国別）投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	第2作成期末	
	買建額	売建額
外国 DJ US REAL ESTATE	百万円 36	百万円 -

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を作成期末の仲値により、邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成

2024年6月13日現在

項 目	第 2 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	916,267	95.7
コール・ローン等、その他	41,590	4.3
投資信託財産総額	957,858	100.0

(注1) 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。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、878,230千円、91.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年6月13日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=156.89円、1カナダ・ドル=114.28円、1オーストラリア・ドル=104.43円、1香港・ドル=20.09円、1シンガポール・ドル=116.33円、1ニュージーランド・ドル=96.97円、1イギリス・ポンド=200.74円、1イスラエル・シケル=42.385円、100韓国・ウォン=11.48円、1ユーロ=169.61円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月13日)、 (2024年4月15日)、 (2024年6月13日)現在

項 目	第 2 期 末	第 3 期 末	第 4 期 末
(A) 資 産	772,516,271円	971,011,506円	957,853,934円
コール・ローン等	39,671,169	45,377,436	32,120,368
投資信託受益証券(評価額)	69,810,377	93,810,588	92,203,155
投資証券(評価額)	642,405,320	828,561,676	824,064,730
未 収 入 金	19,470,556	—	157,416
未 収 配 当 金	1,158,849	3,261,806	2,133,685
差 入 委 託 証 拠 金	—	—	7,174,580
(B) 負 債	23,646,890	5,510,169	5,492,547
未 払 金	19,415,500	—	—
未 払 収 益 分 配 金	3,070,158	3,936,601	3,720,840
未 払 解 約 金	339,707	202,848	382,840
未 払 信 託 報 酬	818,472	1,365,614	1,383,693
そ の 他 未 払 費 用	3,053	5,106	5,174
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	748,869,381	965,501,337	952,361,387
元 本	682,257,416	874,800,253	826,853,425
次 期 繰 越 損 益 金	66,611,965	90,701,084	125,507,962
(D) 受 益 権 総 口 数	682,257,416口	874,800,253口	826,853,425口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,976円	11,037円	11,518円

(注) 第1期末における元本額は332,083,638円、当作成期間(第2期~第4期)中における追加設定元本額は742,794,652円、同解約元本額は248,024,865円です。

■損益の状況

〔自 2023年12月14日〕〔自 2024年 2月14日〕〔自 2024年 4月16日〕
 〔至 2024年 2月13日〕〔至 2024年 4月15日〕〔至 2024年 6月13日〕

項 目	第 2 期	第 3 期	第 4 期
(A) 配 当 等 収 益	2,878,701円	7,061,671円	3,700,997円
受 取 配 当 金	2,851,220	6,968,607	3,656,448
受 取 利 息	27,659	93,132	44,549
支 払 利 息	△178	△68	－
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,414,972	1,121,926	37,972,125
売 買 益	28,790,158	33,222,534	58,365,730
売 買 損	△15,375,186	△32,100,608	△20,393,605
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	－	－	249,305
取 引 益	－	－	254,077
取 引 損	－	－	△4,772
(D) 信 託 報 酬 等	△1,915,980	△2,648,002	△2,095,136
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	14,377,693	5,535,595	39,827,291
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	19,086,974	29,448,340	23,920,742
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,217,456	59,653,750	65,480,769
(配 当 等 相 当 額)	(22,373,642)	(39,109,302)	(42,677,466)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,843,814)	(20,544,448)	(22,803,303)
(H) 合 計(E + F + G)	69,682,123	94,637,685	129,228,802
(I) 収 益 分 配 金	△3,070,158	△3,936,601	△3,720,840
次 期 繰 越 損 益 金(H + I)	66,611,965	90,701,084	125,507,962
追 加 信 託 差 損 益 金	36,217,456	59,653,750	65,480,769
(配 当 等 相 当 額)	(22,373,642)	(39,109,302)	(42,677,466)
(売 買 損 益 相 当 額)	(13,843,814)	(20,544,448)	(22,803,303)
分 配 準 備 積 立 金	30,394,509	31,047,334	60,027,193

(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) (D)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) (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。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 2 期	第 3 期	第 4 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,540,147円	4,776,710円	3,515,996円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,837,546	758,885	36,311,295
(c) 収 益 調 整 金	36,217,456	59,653,750	65,480,769
(d) 分 配 準 備 積 立 金	19,086,974	29,448,340	23,920,742
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	69,682,123	94,637,685	129,228,802
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,021.35	1,081.82	1,562.90
(g) 分 配 金	3,070,158	3,936,601	3,720,840
(h) 1万口当たり分配金	45	45	45

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期
1 万口当たり分配金	45円	45円	45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。

《お知らせ》

- 2024年6月14日付で、投資形態を、世界のリート市場へ直接投資する方式から、「世界リートインデックスマザーファンド」を通じて投資を行う「ファミリーファンド方式」への変更を予定しています。なお、この変更に伴い運用方針が変更されるものではありません。