

第9期末 (2022年11月21日)

基準価額	20,153円
純資産総額	115億円
騰落率	△0.8%
分配金	0円

<購入・換金手数料なし> ニッセイグローバルリート インデックスファンド

追加型投信/海外/不動産投信/インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2021年11月23日~2022年11月21日

第9期(決算日 2022年11月21日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイグローバルリートインデックスファンド」は、このたび第9期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイグローバルリートマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。



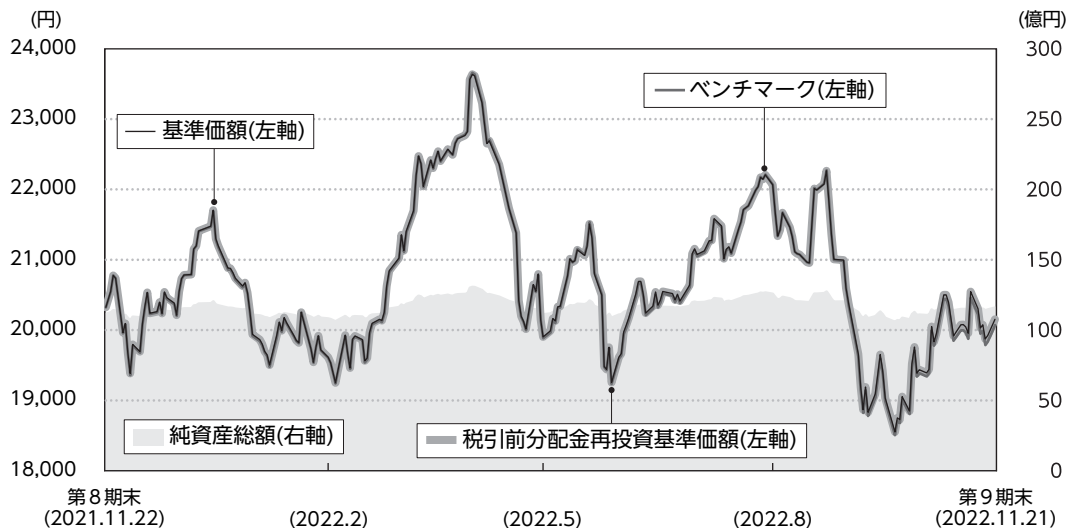
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年11月23日～2022年11月21日

基準価額等の推移



第9期首	20,322円	既払分配金	0円
第9期末	20,153円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△0.8%

- (注1) 税引前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あり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 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3) ベンチマークはS & Pグローバルリートインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS & Pグローバルリートインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は下落しました。詳しくは後掲の「グローバルリート市況」をご参照ください。

1万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	61円	0.296%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は20,665円です。
(投信会社)	(32)	(0.154)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(25)	(0.121)	購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
(受託会社)	(5)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	1	0.007	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.007)	
有価証券取引税	1	0.007	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(1)	(0.007)	
その他費用	10	0.047	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用 ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
(保管費用)	(7)	(0.032)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(3)	(0.013)	
合計	74	0.357	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み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。

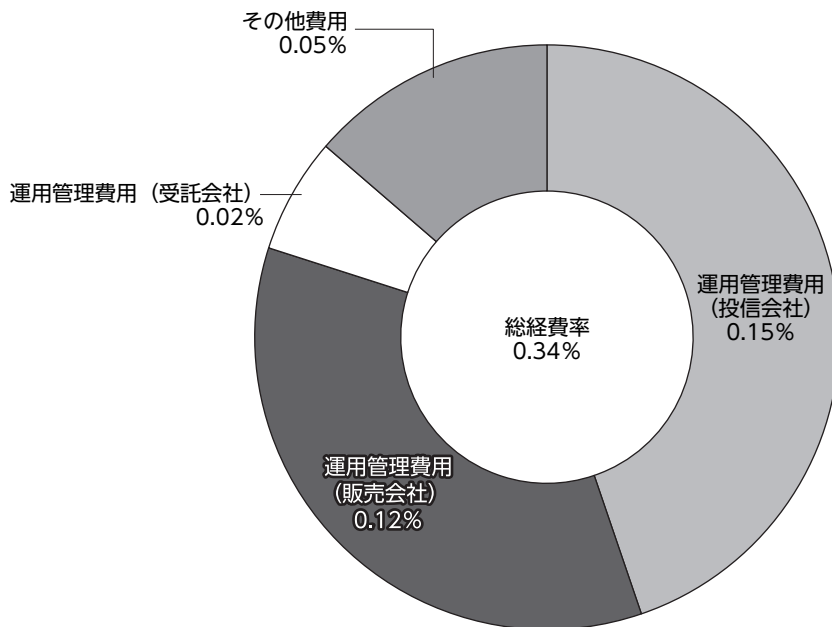
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く）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0.34%**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。

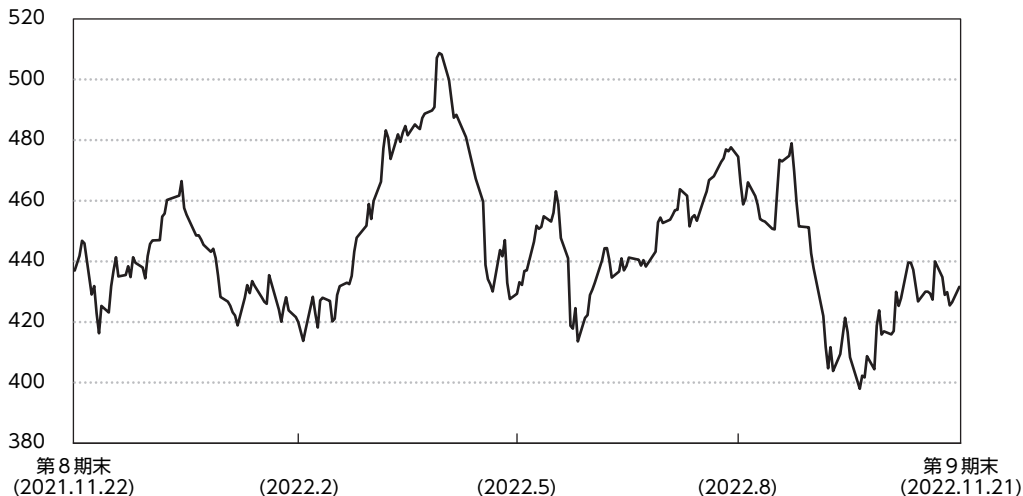
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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は異なります。

グローバルリート市況

【S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の推移】



(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期のグローバルリート市場は、期初にワクチン接種が新型コロナウイルス変異型（オミクロン型）の感染予防に効果があることが報じられ、不動産市況の先行きに対する過度な懸念が後退したことから上昇して始まりましたが、その後に発表された米連邦公開市場委員会（FOMC）議事録の中で、金融引き締めに積極的な姿勢が示されると軟調となりました。2022年3月後半以降は、ロシアとウクライナの停戦交渉に進展期待が高まったことや原油価格の上昇に一服感が見られたことなどから一時センチメント（市場心理）は改善しました。しかし、4月下旬から10月中旬にかけては、米欧金融政策当局者から金融引き締めに積極的な発言が相次いだことや市場予想を上回る米消費者物価指数（CPI）、米連邦準備制度理事会（FRB）の大幅利上げなどが売り圧力となり下落する展開となりました。その後、当期末にかけては発表された経済指標等を背景にインフレ見通しが鈍化したことなどから上昇基調となりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

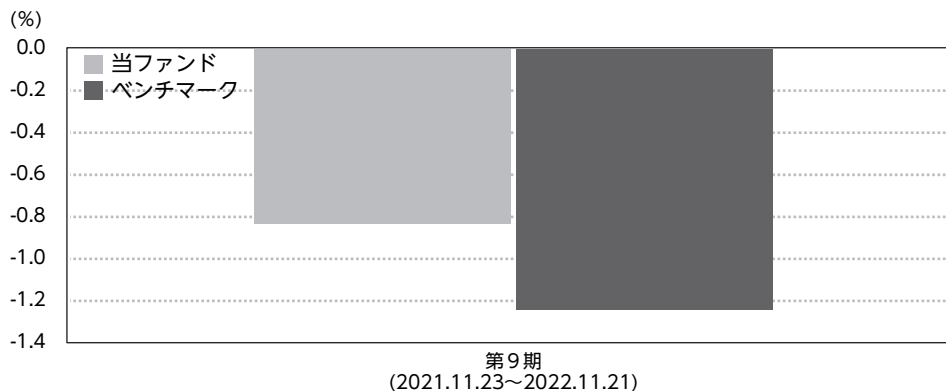
■マザーファンド

日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

当期も連動性を維持するため、適宜売買を行い調整しました。

*ベンチマークはS & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.8%となり、ベンチマーク騰落率（-1.2%）におおむね連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2021年11月23日～2022年11月21日
当期分配金(税引前)	—
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	10,551円

(注1) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り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。

(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。

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第9期末 2022年11月21日
ニッセイグローバルリート マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

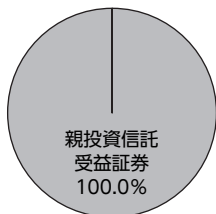
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

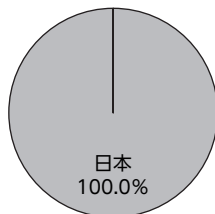
項目	第9期末 2022年11月21日
純資産総額	11,596,046,018円
受益権総口数	5,753,896,354口
1万口当たり基準価額	20,153円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,272,980,236円、同解約元本額は998,659,905円です。

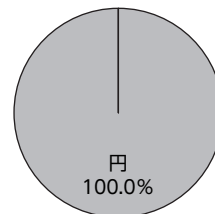
■資産別配分



■国別配分



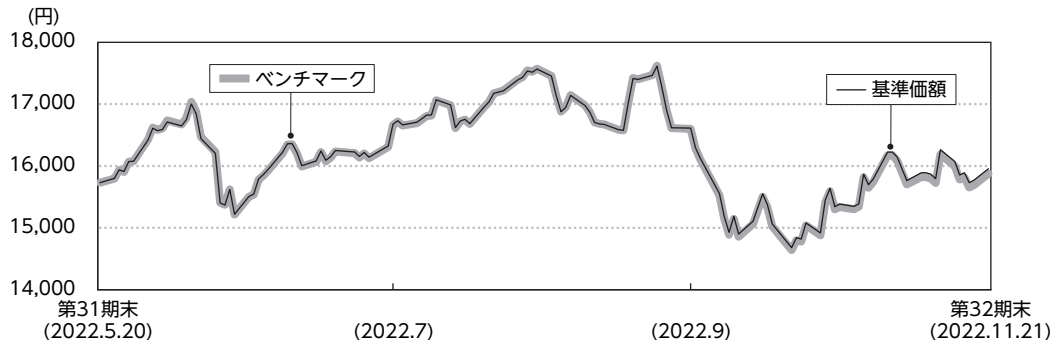
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年11月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイグローバルリートマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

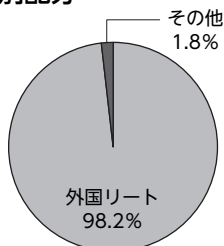
銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	米ドル	8.1%
EQUINIX INC	米ドル	4.5
PUBLIC STORAGE	米ドル	3.5
REALTY INCOME CORP	米ドル	3.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	3.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	米ドル	2.4
WELLTOWER INC	米ドル	2.4
VICI PROPERTIES INC	米ドル	2.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC	米ドル	1.8
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	米ドル	1.7
組入銘柄数		312

■ 1万口当たりの費用明細

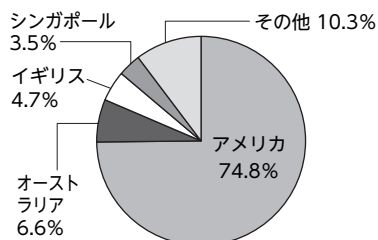
2022.5.21~2022.11.21

項目	金額
売買委託手数料	1円
(株式)	(0)
(投資信託証券)	(1)
有価証券取引税	1
(投資信託証券)	(1)
その他費用	3
(保管費用)	(3)
(その他)	(0)
合計	5

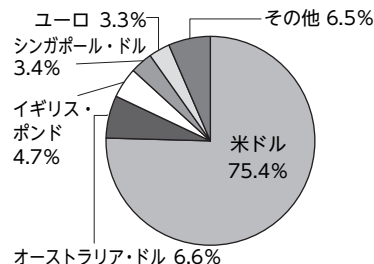
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2022年11月21日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	百万円
5期(2018年11月20日)	14,893	0	0.4	14,893	14,979	0.3	—	98.6	5,546
6期(2019年11月20日)	16,608	0	11.5	16,608	16,716	11.6	—	97.4	7,056
7期(2020年11月20日)	14,123	0	△15.0	14,123	14,130	△15.5	—	98.4	7,006
8期(2021年11月22日)	20,322	0	43.9	20,322	20,320	43.8	—	98.9	11,135
9期(2022年11月21日)	20,153	0	△ 0.8	20,153	20,068	△ 1.2	—	98.2	11,596

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%
(期首)2021年11月22日	20,322	—	20,320	—	—	98.9
11月末	20,092	△ 1.1	20,080	△ 1.2	—	98.2
12月末	21,408	5.3	21,402	5.3	—	98.5
2022年1月末	19,925	△ 2.0	19,901	△ 2.1	—	99.1
2月末	19,926	△ 1.9	19,915	△ 2.0	—	99.2
3月末	22,369	10.1	22,358	10.0	—	98.3
4月末	22,692	11.7	22,708	11.8	—	98.2
5月末	21,013	3.4	21,007	3.4	—	97.8
6月末	20,508	0.9	20,476	0.8	0.6	97.3
7月末	21,584	6.2	21,565	6.1	0.6	97.7
8月末	21,112	3.9	21,110	3.9	—	98.9
9月末	18,829	△ 7.3	18,776	△ 7.6	—	98.6
10月末	20,499	0.9	20,441	0.6	—	98.9
(期末)2022年11月21日	20,153	△ 0.8	20,068	△ 1.2	—	98.2

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年11月23日～2022年11月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイグローバルリートマザーファンド	1,610,695	2,633,630	1,284,764	2,098,712

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	ニッセイグローバルリートマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.95

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2021年11月23日～2022年11月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2022年11月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイグローバルリートマザーファンド	6,943,124	7,269,055	11,596,324

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイグローバルリートマザーファンド全体の口数は7,269,055千口です。

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイグローバルリートマザーファンド	11,596,324	99.8
コール・ローン等、その他	22,799	0.2
投資信託財産総額	11,619,124	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内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11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1香港ドル17.95円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シケル40.408円、1メキシコ・ペソ7.213円、1南アフリカ・ランド8.12円、1ユーロ144.81円です。

(注2) ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（11,448,823千円）の投資信託財産総額（11,602,300千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	11,619,124,550円
コール・ローン等	17,082,586
ニッセイグローバルリートマザーファンド(評価額)	11,596,324,626
未収入金	5,717,338
(B) 負債	23,078,532
未払解約金	5,436,328
未払信託報酬	17,577,182
その他未払費用	65,022
(C) 純資産総額(A-B)	11,596,046,018
元本	5,753,896,354
次期繰越損益金	5,842,149,664
(D) 受益権総口数	5,753,896,354口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,153円

(注) 期首元本額 5,479,576,023円
 期中追加設定元本額 1,272,980,236円
 期中一部解約元本額 998,659,905円

損益の状況

当期(2021年11月23日～2022年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 3,620円
受取利息	319
支払利息	△ 3,939
(B) 有価証券売買損益	△ 105,351,905
売却益	95,715,889
売却損	△ 201,067,794
(C) 信託報酬等	△ 34,518,389
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 139,873,914
(E) 前期繰越損益金(分配準備積立金)	2,422,348,605 (2,422,348,605)
(F) 追加信託差損益金*	3,559,674,973
(配当等相当額)	(3,264,736,610)
(売買損益相当額)	(294,938,363)
(G) 合計(D+E+F)	5,842,149,664
次期繰越損益金(G)	5,842,149,664
追加信託差損益金	3,559,674,973
(配当等相当額)	(3,271,959,300)
(売買損益相当額)	(287,715,673)
分配準備積立金	2,799,008,044
繰越欠損金	△ 516,533,353

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	376,659,439円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	3,271,959,300円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	2,422,348,605円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	6,070,967,344円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	10,551.05円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

運用部門については、CO-CIO（取締役執行役員、統括部長）の2名体制からCIO（取締役執行役員）1名とCO-CIO（統括部長）1名の体制に変更しました。

新たにCIOが就任し、従来のCO-CIOのうちの1名（統括部長）が、引き続きCO-CIOを務めています。
(2022年3月25日)

当ファンドの概要

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	無期限	
運 用 方 針	ニッセイグローバルリートマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイグローバルリート インデックスファンド	ニッセイグローバルリートマザーファンド受益証券
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリート
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイグローバルリート インデックスファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイグローバルリート マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるリートがある場合には、当該リートを同インデックスにおける構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の金額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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もあります。	

ニッセイグローバルリート マザーファンド

運用報告書

第 32 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

運用方針	主に日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、S & P グローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリート
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none">・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S & P グローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるリートがある場合には、当該リートを同インデックスにおける構成割合の範囲で投資することができるものとします。・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

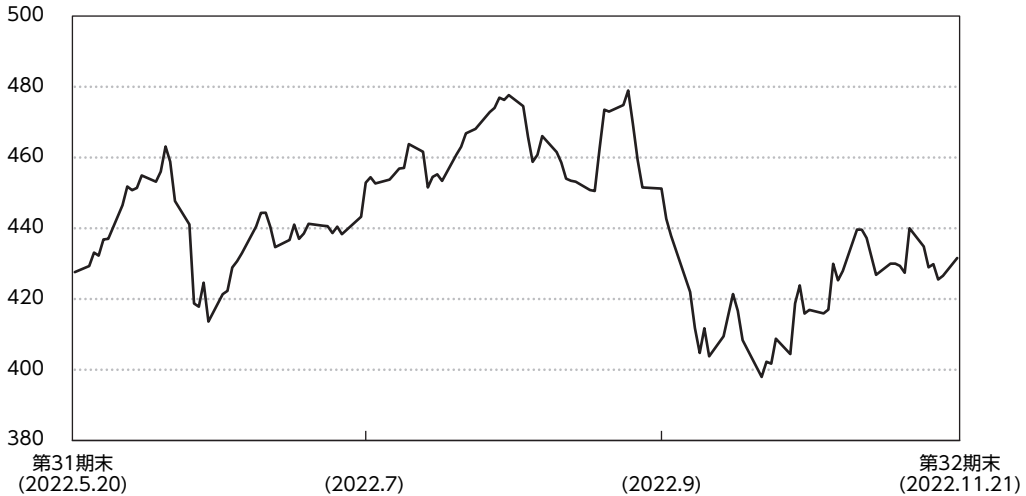
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

グローバルリート市況

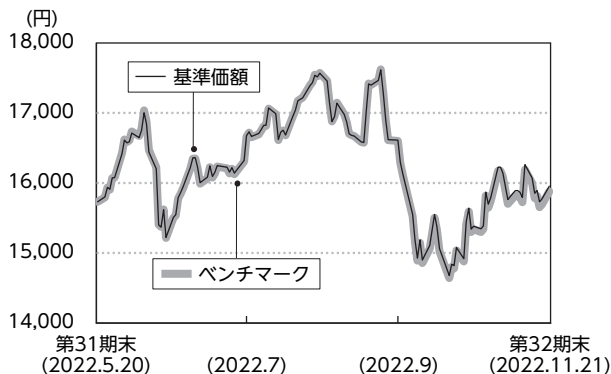
【S & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の推移】



(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期のグローバルリート市場は、期初より公開された米連邦公開市場委員会（F O M C）議事録要旨を受けて金融引き締め加速への警戒感が後退したことなどから上昇して始まりましたが、6月下旬にかけては、米消費者物価指数（C P I）の上昇率が上振れする一方、米ミシガン大学が発表した消費者マインド指数が大きく悪化したため、スタグフレーション（景気後退下でのインフレ進行）シナリオが懸念され、株式市場とともに下落しました。その後は景気のスローダウンを示す経済指標発表が続く中、米連邦準備制度理事会（F R B）による積極的な利上げ観測が後退したことなどが買い材料となり、8月下旬にかけて上昇基調で推移しましたが、9月に入ると景気減速への警戒感の高まりやイギリスのトラス政権の大規模減税、国債増発計画の発表等が嫌気され再び調整しました。その後、当期末にかけては発表された経済指標等を背景にインフレへの過度な懸念が後退し、上昇基調となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「グローバルリート市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

当期も連動性を維持するため、適宜売買を行い調整しました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+1.4%となり、ベンチマーク騰落率（+0.9%）を上回りました。キャッシュフローに伴う売買タイミング効果等がプラスの影響を与えました。

今後の運用方針

日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率	投資信託証券 組入比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率			
28期(2020年11月20日)	11,113	17.8	10,471	17.7	—	98.4	7,006
29期(2021年5月20日)	13,510	21.6	12,699	21.3	—	98.2	9,222
30期(2021年11月22日)	16,039	18.7	15,058	18.6	—	98.9	11,136
31期(2022年5月20日)	15,730	△ 1.9	14,734	△ 2.2	0.0	98.3	11,118
32期(2022年11月21日)	15,953	1.4	14,871	0.9	—	98.2	11,596

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率	投資信託証券 組入比率
	円	騰落率		騰落率		
(期首)2022年5月20日	15,730	—	14,734	—	0.0	98.3
5月末	16,610	5.6	15,567	5.7	—	97.8
6月末	16,215	3.1	15,174	3.0	0.6	97.3
7月末	17,069	8.5	15,981	8.5	0.6	97.7
8月末	16,701	6.2	15,644	6.2	—	98.9
9月末	14,898	△ 5.3	13,914	△ 5.6	—	98.6
10月末	16,224	3.1	15,148	2.8	—	98.9
(期末)2022年11月21日	15,953	1.4	14,871	0.9	—	98.2

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (投資信託証券)	1円 (0) (1)	0.005% (0.000) (0.004)	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：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 (投資信託証券)	1 (1)	0.005 (0.005)	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：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用)	3 (3)	0.019 (0.019)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	5	0.028	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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（16,248円）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います。

売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		158	467	—	—
		(△158)	(△467)		
	南アフリカ	—	千南アフリカ・ランド	93	千南アフリカ・ランド
			—	70	

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。

(注4) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

ニッセイグローバルリートマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.732	62	-	-
AGREE REALTY CORP	0.892	66	-	-
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.754	119	0.147	22
PROLOGIS INC	2	298	0.471	53
	(11)			
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	17	-	-
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.397	78	-	-
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.484	61	-	-
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.305	13	-	-
SITE CENTERS CORP	1	22	-	-
DUKE REALTY CORP	1	75	-	0.083
	(△ 24)			
EASTGROUP PROPERTIES	0.188	30	-	-
EPR PROPERTIES	0.264	11	-	-
EQUITY RESIDENTIAL	0.937	67	0.447	32
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.216	57	-	-
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.487	49	-	-
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	0.220	10	-	-
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	56	-	-
WELLTOWER INC	2	218	-	-
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.835	23	-	-
	(△ 9)			
HOST HOTELS AND RESORTS INC	1	21	-	-
EQUITY COMMONWEALTH	3	108	8	226
ISTAR FINANCIAL INC	6	83	-	-
KILROY REALTY CORP	0.091	4	-	-
KIMCO REALTY CORP	2	43	-	-
MACERICH CO/THE	0.664	6	-	-
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.301	50	-	-
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.430	13	-	-
PENN REAL ESTATE INVEST TST	4	1	0.737	3
	(△ 10)			
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.066	12	1	212
PUBLIC STORAGE	0.772	245	-	-
RPT REALTY	2	21	-	-
REGENCY CENTERS CORP	0.696	39	-	-

外国

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5	10	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	148	0.607	58
LIFE STORAGE INC	0.701	79	—	—
SUN COMMUNITIES INC	0.767	121	—	—
UDR INC	0.937	41	—	—
VENTAS INC	1	50	—	—
VORNADO REALTY TRUST	0.868	23	—	—
WP CAREY INC	1	128	—	—
REALTY INCOME CORP	4	299	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.303	20	—	—
KITE REALTY GROUP TRUST	1	24	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.457	85	—	—
CUBESMART	1	56	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.951	115	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	—	—	8	566
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1	14	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	64	—	—
外国 TERRENO REALTY CORP	0.551	33	0.805	47
STAG INDUSTRIAL INC	1	45	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	24	—	—
EQUINIX INC	0.340	216	0.032	19
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	0.644	14	—	—
	(9)			
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1	40	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	20	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	72	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1	47	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	2	105	—	—
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2	41	—	—
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	0.765	16	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	—	—	4	115
STORE CAPITAL CORP	1	45	—	—
PARAMOUNT GROUP INC	3	22	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	1	17	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	23	2	46
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.606	31	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.417	30	—	—

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.830	22	2	56
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	–	–	2	22
MANULIFE US REAL ESTATE INV	–	–	–	–
		(△0.341)		
DIGITALBRIDGE GROUP INC	–	–	31	188
INVITATION HOMES INC	2	98	2	83
JBG SMITH PROPERTIES	1	38	1	27
VICI PROPERTIES INC	23	695	0.939	31
AMERICOLD REALTY TRUST	1	39	16	445
	(15)	(467)		
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.067	7	–	–
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	0.739	17	–	–
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1	21	–	–
PRIME US REIT	–	–	–	–
		(△0.602)		
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	–	–	–	–
		(△0.528)		
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	–	–	2	20
APARTMENT INCOME REIT CO	0.275	11	–	–
CTO REALTY GROWTH INC	–	–	–	–
	(0.998)			
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	0.869	5	–	–
CEDAR REALTY TRUST INC	–	–	1	11
POSTAL REALTY TRUST INC- A	2	33	–	–
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	0.714	22	–	–
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	–	–	1	44
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1	31	–	–
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	40	35	–	–
		(△0.342)		
BLUEROCK HOMES TRUST INC	–	–	–	–
	(0.291)			
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.500	23	–	–
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	43	–	–
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2	33	–	–
CHOICE PROPERTIES REIT	3	47	4	58
PLAZA RETAIL REIT	–	–	2	11
SLATE GROCERY REIT	3	48	–	–

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(オーストラリア)	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
GPT GROUP	10	46	—	—
GOODMAN GROUP	10	217	5	93
STOCKLAND	4	14	—	—
MIRVAC GROUP	7	14	—	—
VICINITY CENTRES	17	30	—	—
CHARTER HALL GROUP	1	18	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	17	44	—	—
SCENTRE GROUP	20	54	—	—
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	10	37	—	—
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	15	45	—	—
IRONGATE GROUP	—	—	39	75
DEXUS/AU	1	15	—	—
HOME CONSORTIUM LTD	3	14	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
CHAMPION REIT	16	56	—	—
LINK REIT	18	1,191	13	840
PROSPERITY REIT	187	454	366	830
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	224	679	292	754
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	39	146	47	168
FORTUNE REIT	65	423	91	574
CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	197	511	292	681
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	21	59	—	—
		(△ 3)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	8	17	—	—
		(△0.093)		
SUNTEC REIT	—	—	—	—
		(△0.578)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	57	96	28	46
		(△ 3)		
CAPITALAND ASCOTT TRUST	—	—	—	—
		(△ 2)		
ESR-LOGOS REIT	125	50	—	—
		(△0.303)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	—	—
		(△0.081)		
CAPITALAND CHINA TRUST	38	42	—	—
		(△ 1)		

外国

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
AIMS APAC REIT	27	37 (△0.390)	—	—
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	—	— (△0.489)	—	—
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	34	168 (△0.617)	52	247
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	8	21 (△0.155)	21	54
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	—	— (△0.142)	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	—	— (△0.088)	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	—	—	133	159
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	—	— (△0.092)	—	—
SPH REIT	34	32	43	39
KEPPEL DC REIT	6	12 (△0.718)	23	45
外国 FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	—	— (△ 2)	—	—
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	8	6	—	—
IREIT GLOBAL	—	— (△0.548)	42	21
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	72	47	—	—
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル		千ニュージーランド・ドル
GOODMAN PROPERTY TRUST	73	148	73	149
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	6	25	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.672	4	—	—
SEGRO PLC	4	45	—	—
WORKSPACE GROUP PLC	1	9	—	—
CAPITAL & COUNTIES PRO-W/I	4	6	—	—
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	—	—	37	18
TRITAX BIG BOX REIT PLC	11	19	—	—
ASSURA PLC	30	21	—	—
NEWRIVER REIT PLC	6	5	—	—
UNITE GROUP PLC	2	21	—	—

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
LXI REIT PLC	63	93	—	—
AEW UK REIT PLC	—	—	18	18
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	33	39	15	18
HOME REIT PLC	4	4	—	—
URBAN LOGISTICS REIT PLC	34	58	—	—
WAREHOUSE REIT PLC	28	41	—	—
(イスラエル)		千イスラエル・シケル		千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	5	102	—	—
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	12	115	—	—
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	66	136	—	—
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	—	—	—	—
		(△ 35)		
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	16	875	—	—
(南アフリカ)		千南アフリカ・ランド		千南アフリカ・ランド
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	6	217	—	—
REDEFINE PROPERTIES LTD	68	257	—	—
(ユーロ/アイルランド)		千ユーロ		千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC-W/I	—	—	43	69
(ユーロ/オランダ)				
WERELDHAVE NV	1	24	—	—
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	—	—	—	0.022
	(0.047)			
(ユーロ/ベルギー)				
COFINIMMO	0.126	13	0.432	49
BEFIMMO S.C.A.	0.204	9	2	107
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.675	23	—	—
CARE PROPERTY INVEST	3	85	4	85
(ユーロ/フランス)				
ICADE	—	—	—	—
		(△ 1)		
ALTAREA	—	—	—	—
		(△ 2)		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.210	9	—	—
CARMILA	1	23	—	—
		(△ 2)		

外国

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(ユーロ/ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	-	-	-	-
HAMBORNER REIT AG	-	(△ 3)	2	20
(ユーロ/スペイン)				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	-	-	-	-
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	-	(△0.000)	-	-
(ユーロ/イタリア)				
COIMA RES SPA	2	24	2	24

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

(注4) 口数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
LIGHTHOUSE PROPERTIES PLC	93	—	—	—	不動産
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	93 1	— —	— —	<—>

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価を国内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) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(注4) 業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	8	9	655	92,058
ACADIA REALTY TRUST	6	6	92	13,031
AGREE REALTY CORP	3	4	339	47,618
ALEXANDER'S INC	0.079	0.079	19	2,704
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8	9	1,414	198,574
PROLOGIS INC	44	58	6,651	933,551
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	8	11	94	13,296
AVALONBAY COMMUNITIES INC	8	8	1,484	208,336
BRANDYWINE REALTY TRUST	11	11	74	10,516
CAMDEN PROPERTY TRUST	6	6	752	105,641
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10	10	496	69,661
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6	6	182	25,628
COUSINS PROPERTIES INC	9	9	235	33,043
SITE CENTERS CORP	11	13	172	24,252
DUKE REALTY CORP	22	—	—	—
EASTGROUP PROPERTIES	2	2	418	58,775
EPR PROPERTIES	4	4	189	26,581
EQUITY RESIDENTIAL	20	21	1,324	185,852
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	4	870	122,180
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	4	513	72,034
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	7	7	387	54,343
GETTY REALTY CORP	2	2	76	10,746

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2	2	39	5,580
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	32	34	848	119,164
WELLTOWER INC	26	29	1,978	277,759
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8	—	—	—
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4	4	44	6,282
HIGHWOODS PROPERTIES INC	6	6	191	26,833
HOST HOTELS AND RESORTS INC	44	45	841	118,137
EQUITY COMMONWEALTH	9	5	141	19,928
CENTERSPACE	0.985	0.985	65	9,235
ISTAR FINANCIAL INC	—	6	69	9,783
KILROY REALTY CORP	6	6	273	38,375
KIMCO REALTY CORP	37	39	883	124,044
LXP INDUSTRIAL TRUST	16	16	171	24,116
LTC PROPERTIES INC	2	2	89	12,508
MACERICH CO/THE	13	14	187	26,314
VERIS RESIDENTIAL INC	5	5	83	11,743
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	7	1,145	160,747
NATL HEALTH INVESTORS INC	2	2	157	22,057
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	14	15	466	65,473
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	1	37	5,244
PENN REAL ESTATE INVEST TST	6	—	—	—
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1	—	—	—
PUBLIC STORAGE	9	9	2,909	408,386
RPT REALTY	5	7	80	11,358
REGENCY CENTERS CORP	9	9	643	90,340
SAUL CENTERS INC	0.812	0.812	35	4,957
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	16	21	22	3,191
SIMON PROPERTY GROUP INC	20	20	2,461	345,498
SL GREEN REALTY CORP	4	4	167	23,567
LIFE STORAGE INC	4	5	594	83,455
SUN COMMUNITIES INC	6	7	1,108	155,654
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	6	6	134	18,903
UDR INC	18	19	768	107,867
UMH PROPERTIES INC	3	3	53	7,543
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.345	0.345	17	2,465
VENTAS INC	24	25	1,121	157,474
VORNADO REALTY TRUST	10	11	266	37,377

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
WP CAREY INC	11	12	1,011	142,017
ELME COMMUNITIES	5	5	98	13,783
REALTY INCOME CORP	33	38	2,496	350,447
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10	10	708	99,384
KITE REALTY GROUP TRUST	13	14	319	44,797
EXTRA SPACE STORAGE INC	8	8	1,348	189,269
CUBESMART	12	13	567	79,657
DIGITAL REALTY TRUST INC	17	18	1,994	279,989
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	8	—	—	—
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	15	15	144	20,274
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36	37	469	65,856
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	14	14	152	21,342
URSTADT BIDDLE - CL A	2	2	46	6,555
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5	5	16	2,290
DOUGLAS EMMETT INC	11	11	185	26,016
IRON MOUNTAIN INC	17	18	972	136,524
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	8	8	87	12,280
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9	9	102	14,425
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9	9	144	20,213
TERRENO REALTY CORP	4	4	242	34,077
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3	3	103	14,477
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	7	7	117	16,438
CHATHAM LODGING TRUST	3	3	45	6,429
STAG INDUSTRIAL INC	10	11	386	54,226
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	7	11	94	13,231
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	3	3	46	6,505
EQUINIX INC	5	5	3,716	521,687
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	13	23	447	62,820
SABRA HEALTH CARE REIT INC	15	15	188	26,481
WHITESTONE REIT	2	2	22	3,145
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	17	19	610	85,680
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	4	60	8,524
PHYSICIANS REALTY TRUST	12	12	187	26,277
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	9	10	595	83,616
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7	9	376	52,909
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	12	12	94	13,234
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	14	16	821	115,354

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	5	5	18	2,606
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	18	20	461	64,841
CARETRUST REIT INC	7	7	131	18,427
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	13	14	249	35,054
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4	—	—	—
STORE CAPITAL CORP	15	16	537	75,435
PARAMOUNT GROUP INC	11	14	91	12,853
URBAN EDGE PROPERTIES	6	7	119	16,814
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5	3	61	8,620
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4	5	218	30,652
NEXPOINT RESIDENTIAL	1	1	77	10,902
APPLE HOSPITALITY REIT INC	14	14	234	32,854
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1	—	—	—
CITY OFFICE REIT INC	4	4	38	5,428
GLOBAL NET LEASE INC	8	8	116	16,379
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5	5	137	19,262
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2	—	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	1	43	6,056
FARMLAND PARTNERS INC	2	2	31	4,485
MANULIFE US REAL ESTATE INV	85	85	31	4,424
DIGITALBRIDGE GROUP INC	31	—	—	—
INVITATION HOMES INC	36	36	1,152	161,763
JBG SMITH PROPERTIES	6	7	137	19,253
ALEXANDER & BALDWIN INC	5	5	99	14,004
CLIPPER REALTY INC	0.713	0.713	5	750
GLADSTONE LAND CORP	2	2	42	6,005
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4	4	41	5,872
VICI PROPERTIES INC	39	61	1,976	277,399
AMERICOLD REALTY TRUST	16	17	501	70,329
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	4	4	14	2,100
BRT APARTMENTS CORP	1	1	33	4,695
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1	1	206	29,039
SAFEHOLD INC	1	1	44	6,307
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	8	8	55	7,804
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	8	8	204	28,638
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2	3	63	8,933
EAGLE HOSPITALITY TRUST	71	71	0.071	9

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千□	千米ドル	千円
PRIME US REIT		39	39	19	2,779
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		51	51	30	4,212
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST		2	—	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO		9	9	356	49,973
NETSTREIT CORP		2	2	44	6,289
CTO REALTY GROWTH INC		0.499	1	30	4,284
BROADSTONE NET LEASE INC-A		9	9	164	23,083
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST		1	1	25	3,561
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		2	2	19	2,724
CEDAR REALTY TRUST INC		1	—	—	—
INDUS REALTY TRUST INC		0.449	0.449	25	3,563
POSTAL REALTY TRUST INC- A		—	2	33	4,667
ORION OFFICE REIT INC		3	3	30	4,240
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN		6	7	229	32,204
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES		1	—	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP		3	4	122	17,143
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT		—	40	23	3,300
BLUEROCK HOMES TRUST INC		—	0.291	7	1,004
小計		1,608	1,679	61,919	8,691,089
□数・金額 銘柄数<比率>		147	139	—	<74.9%>
(カナダ)		千カナダ・ドル			
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		2	2	106	11,193
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		4	4	118	12,411
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		4	5	230	24,163
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM		2	2	32	3,383
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		8	8	104	10,905
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	11	239	25,129
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		4	4	116	12,230
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		6	6	55	5,830
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		3	6	96	10,150
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		7	7	71	7,528
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		3	3	42	4,453
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		1	1	148	15,544
CHOICE PROPERTIES REIT		9	8	125	13,154
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		1	1	15	1,673
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		3	3	57	5,984
PLAZA RETAIL REIT		2	—	—	—

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		6	6	79	8,343
SLATE GROCERY REIT		0.900	4	66	6,981
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		3	3	60	6,391
SLATE OFFICE REIT		4	4	18	1,964
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		5	5	127	13,383
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		2	2	17	1,857
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		1	1	21	2,290
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		6	6	111	11,700
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		0.500	0.500	6	642
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES		9	9	27	2,890
NEXUS INDUSTRIAL REIT		2	2	30	3,158
PRIMARIS REIT		2	2	31	3,345
小計	□数・金額	122	126	2,162	226,686
	銘柄数<比率>	28	27	-	<2.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP		115	125	538	50,338
GOODMAN GROUP		103	109	2,007	187,532
STOCKLAND		148	153	561	52,492
BWP TRUST		28	28	113	10,646
MIRVAC GROUP		251	258	547	51,168
CHARTER HALL RETAIL REIT		30	30	124	11,589
ABACUS PROPERTY GROUP		25	25	68	6,377
VICINITY CENTRES		238	255	490	45,781
CHARTER HALL GROUP		28	30	414	38,737
CROMWELL PROPERTY GROUP		97	97	69	6,525
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		64	81	215	20,131
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		21	21	70	6,574
INGENIA COMMUNITIES GROUP		29	29	121	11,383
GDI PROPERTY GROUP		26	26	19	1,842
DEXUS INDUSTRIA REIT		13	13	38	3,640
NATIONAL STORAGE REIT		77	77	187	17,477
SCENTRE GROUP		320	341	975	91,153
ARENA REIT		17	17	67	6,325
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU		16	27	92	8,672
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		8	8	27	2,599
WAYPOINT REIT LTD		44	44	120	11,231

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□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
CHARTER HALL LONG WALE REIT		37	37	164	15,323
RURAL FUNDS GROUP		26	26	66	6,216
CENTURIA OFFICE REIT		36	36	58	5,446
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		33	48	153	14,323
CENTURIA CAPITAL GROUP		44	44	82	7,728
IRONGATE GROUP		39	—	—	—
HOMECO DAILY NEEDS REIT		109	109	139	13,065
DEXUS/AU		66	68	516	48,255
HOME CONSORTIUM LTD		14	17	87	8,135
HEALTHCO REIT		36	36	57	5,382
小計	□数・金額	2,152	2,230	8,201	766,099
	銘柄数<比率>	31	30	—	<6.6%>
(香港)				千香港ドル	
CHAMPION REIT		175	191	502	9,016
LINK REIT		125	131	7,218	129,564
PROSPERITY REIT		220	41	73	1,317
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		216	148	265	4,768
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		70	62	189	3,394
FORTUNE REIT		107	81	435	7,822
CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R		105	10	18	323
小計	□数・金額	1,019	664	8,702	156,206
	銘柄数<比率>	7	7	—	<1.3%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		191	212	583	59,591
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		308	317	645	65,862
KEPPEL REIT		122	122	111	11,352
SUNTEC REIT		144	144	202	20,663
MAPLE TREE LOGISTICS TRUST		172	201	333	34,003
STARHILL GLOBAL REIT		101	101	55	5,616
CAPITALAND ASCOTT TRUST		164	164	156	16,001
FRASERS CENTREPOINT TRUST		73	73	149	15,229
ESR-LOGOS REIT		339	465	162	16,614
CDL HOSPITALITY TRUSTS		80	80	101	10,404
CAPITALAND CHINA TRUST		62	101	108	11,052
AIMS APAC REIT		13	40	51	5,262

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		75	75	19	1,959
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		30	12	51	5,304
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		124	110	254	26,011
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		129	129	226	23,113
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		88	88	52	5,407
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		133	—	—	—
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		184	184	63	6,482
SPH REIT		69	61	55	5,684
KEPPEL DC REIT		81	64	119	12,217
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T		179	179	205	20,936
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		25	33	26	2,681
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		127	127	90	9,210
IREIT GLOBAL		42	—	—	—
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		—	72	45	4,668
小計	□数・金額	3,068	3,167	3,873	395,332
	銘柄数<比率>	25	24	—	<3.4%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル	
GOODMAN PROPERTY TRUST		84	83	171	14,778
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		41	41	98	8,504
小計	□数・金額	125	124	270	23,283
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.2%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		56	62	254	42,404
HAMMERSON PLC		258	258	64	10,665
LAND SECURITIES GROUP PLC		48	49	307	51,267
SEGRO PLC		71	76	636	106,082
WORKSPACE GROUP PLC		8	9	44	7,424
INTU PROPERTIES PLC		52	52	0.052	8
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		75	75	88	14,698
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		16	16	91	15,264
SHAFTESBURY PLC		17	17	68	11,477
BIG YELLOW GROUP PLC		10	10	118	19,755
DERWENT LONDON PLC		6	6	161	26,975
CAPITAL & COUNTIES PRO-W/I		51	56	62	10,476
INVISTA FOUNDATION PROPERTY		54	16	7	1,254
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		57	57	109	18,302

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		□数	□数	評価額	
				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
TRITAX BIG BOX REIT PLC		109	121	186	31,068
SAFESTORE HOLDINGS PLC		12	12	122	20,390
ASSURA PLC		163	194	108	18,092
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		32	32	30	5,035
REGIONAL REIT LTD		27	27	16	2,779
NEWRIVER REIT PLC		17	23	16	2,802
UNITE GROUP PLC		23	25	245	40,904
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		29	29	18	3,062
LXI REIT PLC		46	109	137	22,880
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		16	16	17	2,861
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		64	64	39	6,513
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		24	24	16	2,762
PICTON PROPERTY INCOME LTD		37	37	31	5,296
AEW UK REIT PLC		18	—	—	—
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU		50	50	43	7,187
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		57	76	79	13,302
CUSTODIAN REIT PLC		19	19	18	3,035
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIM		25	25	13	2,225
HOME REIT PLC		27	31	23	3,937
PRS REIT PLC/THE		34	34	29	4,959
URBAN LOGISTICS REIT PLC		—	34	49	8,316
WAREHOUSE REIT PLC		—	28	33	5,609
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,624 34	1,786 35	3,296 —	549,080 <4.7%>
(イスラエル)				千イスラエル・シケル	
REIT 1 LTD		9	15	285	11,528
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		—	12	115	4,664
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		—	66	130	5,259
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	9 1	94 3	530 —	21,452 <0.2%>
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		188	188	4,430	31,955
FIBRA MACQUARIE MEXICO		51	51	1,424	10,272
PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIAL		47	47	1,316	9,494
CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S		60	60	1,430	10,318
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA		26	43	2,518	18,168
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	375 5	392 5	11,119 —	80,209 <0.7%>

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	257	257	3,560	28,911	
EMIRA PROPERTY FUND LTD	27	27	283	2,304	
SA CORPORATE REAL ESTATE FUND	137	137	310	2,517	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	15	22	771	6,267	
VUKILE PROPERTY FUND LTD	73	73	1,046	8,497	
RESILIENT REIT LTD	19	19	1,048	8,513	
REDEFINE PROPERTIES LTD	341	410	1,757	14,267	
FORTRESS REIT LTD-A	78	78	818	6,644	
FORTRESS REIT LTD-B	54	54	242	1,967	
EQUITES PROPERTY FUND LTD	46	46	756	6,145	
STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	32	32	450	3,657	
ATTACQ LTD	76	76	551	4,480	
FAIRVEST LTD-B	44	44	149	1,216	
INVESTEC PROPERTY FUND LTD	40	40	407	3,309	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,246 14	1,321 14	12,155 -	98,700 <0.9%>
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ		
HIBERNIA REIT PLC-W/I	43	-	-	-	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	21	21	23	3,443	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	64 2	21 1	23 -	3,443 <0.0%>
(ユーロ/オランダ)					
WERELDHAVE NV	2	4	63	9,185	
VASTNED RETAIL NV	1	1	27	3,954	
NSI NV	0.372	0.372	9	1,352	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3	3	84	12,196	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	8 4	9 4	184 -	26,688 <0.2%>
(ユーロ/ベルギー)					
COFINIMMO	1	1	127	18,506	
RETAIL ESTATES	0.756	0.756	46	6,743	
BEFIMMO S.C.A.	2	-	-	-	
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	1	1	24	3,518	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	7	8	228	33,097	
AEDIFICA	2	2	169	24,490	
XIOR STUDENT HOUSING NV	1	1	41	5,979	
MONTEA NV	0.741	0.741	50	7,243	

ニッセイグローバルリートマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□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
CARE PROPERTY INVEST		0.481	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	18 9	16 7	687 -	99,579 <0.9%>
(ユーロ/フランス)					
KLEPIERRE		11	11	263	38,137
GECINA SA		3	3	317	45,981
COVIVIO		3	3	176	25,534
MERCIALYS		5	5	49	7,204
ICADE		1	1	75	10,938
ALTAREA		0.371	0.371	49	7,188
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		7	7	385	55,873
CARMILA		2	4	63	9,161
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36 8	37 8	1,381 -	200,020 <1.7%>
(ユーロ/ドイツ)					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		0.885	0.885	6	1,010
HAMBORNER REIT AG		3	0.961	7	1,049
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	4 2	1 2	14 -	2,059 <0.0%>
(ユーロ/スペイン)					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		5	5	26	3,768
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		21	21	193	28,007
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		17	17	101	14,709
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	45 3	45 3	321 -	46,485 <0.4%>
(ユーロ/イタリア)					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		4	4	13	1,972
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	4 1	4 1	13 -	1,972 <0.0%>
ユーロ計	□数・金額 銘柄数<比率>	181 29	136 26	2,625 -	380,248 <3.3%>
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	11,534 323	11,723 312	- -	11,388,390 <98.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価を国内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) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率です。

(注3) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	11,388,390	98.2
コール・ローン等、その他	213,909	1.8
投資信託財産総額	11,602,300	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内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11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1香港ドル17.95円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シケル40.408円、1メキシコ・ペソ7.213円、1南アフリカ・ランド8.12円、1ユーロ144.81円です。

(注2) 外貨建純資産（11,448,823千円）の投資信託財産総額（11,602,300千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	11,602,300,678円
コール・ローン等	199,839,280
投資信託証券(評価額)	11,388,390,868
未収入金	607,189
未収配当金	13,463,341
(B)負債	5,717,435
未払解約金	5,717,338
その他未払費用	97
(C)純資産総額(A-B)	11,596,583,243
元本	7,269,055,743
次期繰越損益金	4,327,527,500
(D)受益権総口数	7,269,055,743口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,953円

(注1) 期首元本額 7,068,059,635円
 期中追加設定元本額 727,346,187円
 期中一部解約元本額 526,350,079円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
 <購入・換金手数料なし>ニッセイグローバルリート
 インデックスファンド 7,269,055,743円

損益の状況

当期 (2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	239,893,977円
受取配当金	239,542,523
受取利息	385,037
支払利息	△ 33,583
(B)有価証券売買損益	△ 86,863,966
売買益	1,147,713,658
売買損	△ 1,234,577,624
(C)信託報酬等	△ 2,193,637
(D)当期損益金(A+B+C)	150,836,374
(E)前期繰越損益金	4,049,948,116
(F)追加信託差損益金	447,751,243
(G)解約差損益金	△ 321,008,233
(H)合計(D+E+F+G)	4,327,527,500
次期繰越損益金(H)	4,327,527,500

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ S & P グローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S & P グローバルリートインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがS P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、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、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。