

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	無期限（2016年1月29日設定）	
運用方針	米国・リート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の不動産投資信託証券に投資を行い、S&P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーフンド	米国・リート・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、米国の不動産投資信託証券に直接投資することがあります。
	マザーファンド	米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）



イーマックス

eMAXIS 米国リートインデックス

第7期（決算日：2023年1月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 米国リートインデックス」は、去る1月26日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
 フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配)	基準価額			S&P米国REITインデックス (配当込み、円換算ベース)		投資信託 証券 組入比率	不動産 投信 先物 指数 比率	純資産 総額
		税 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
3期(2019年1月28日)	10,526	0	5.7	43,094	5.8	99.4	—	604	
4期(2020年1月27日)	12,229	0	16.2	50,378	16.9	98.7	—	475	
5期(2021年1月26日)	10,501	0	△14.1	43,243	△14.2	99.2	—	637	
6期(2022年1月26日)	14,751	0	40.5	60,898	40.8	99.4	—	1,536	
7期(2023年1月26日)	14,649	0	△0.7	60,427	△0.8	96.9	3.1	1,944	

(注) S & P米国REITインデックス(配当込み)とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している指数で、米国の不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄を対象に浮動株修正時価総額に基づいて算出されています。S & P米国REITインデックス(配当込み、円換算ベース)は、S & P米国REITインデックス(配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S & P米国REITインデックス(配当込み)はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、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、S & P米国REITインデックス(配当込み)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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」、「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) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P米国REITインデックス (配当込み、 円換算ベース)		投 資 信 託 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月26日	円	%		%	%	%
	14,751	—	60,898	—	99.4	—
1 月末	14,976	1.5	61,820	1.5	98.4	—
2 月末	14,917	1.1	61,610	1.2	99.4	—
3 月末	16,773	13.7	69,253	13.7	98.9	—
4 月末	17,173	16.4	70,891	16.4	99.3	—
5 月末	15,688	6.4	64,730	6.3	99.5	—
6 月末	15,417	4.5	63,516	4.3	99.1	—
7 月末	16,353	10.9	67,431	10.7	99.5	—
8 月末	16,014	8.6	66,074	8.5	97.8	2.4
9 月末	14,394	△ 2.4	59,341	△ 2.6	98.9	0.7
10 月末	15,692	6.4	64,734	6.3	96.2	3.7
11 月末	15,154	2.7	62,519	2.7	94.9	5.1
12 月末	14,108	△ 4.4	58,164	△ 4.5	97.7	2.0
(期 末) 2023年 1 月26日	14,649	△ 0.7	60,427	△ 0.8	96.9	3.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」、「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) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第7期：2022年1月27日～2023年1月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第7期首	14,751円
第7期末	14,649円
既払分配金	0円
騰落率	-0.7%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.7%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.8%）を0.1%上回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第7期：2022年1月27日～2023年1月26日

投資環境について

▶ 米国REIT市況

米国REIT市況は下落しました。

米国REIT市況は、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて下落しました。

▶ 為替市況

米ドルは円に対して上昇しました。

為替市況は、期間の初めに比べて13.6%の円安・米ドル高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 米国リートインデックス

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 米国・リート・マザーファンド

S & P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている

不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、各銘柄の組入比率が原則ベンチマークに準じた比率となるようにポートフォリオを構築しました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS 米国リートインデックス

ベンチマークとの乖離は0.1%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.7%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.8%程度でした。

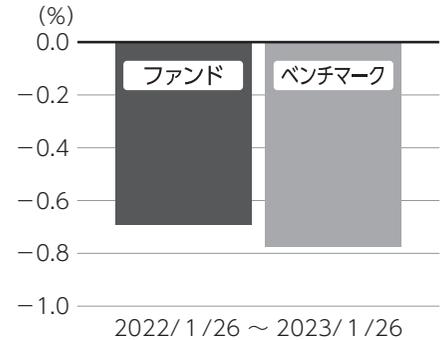
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）と ベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第7期
	2022年1月27日～2023年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	4,649

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

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

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ eMAXIS 米国リートインデックス
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 米国・リート・マザーファンド
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。

2022年1月27日～2023年1月26日

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	102	0.660	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(46)	(0.297)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(46)	(0.297)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0.066)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.015	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(投資信託証券)	(2)	(0.013)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	13	0.082	(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)	(10)	(0.066)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(2)	(0.013)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	117	0.757	

期中の平均基準価額は、15,431円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

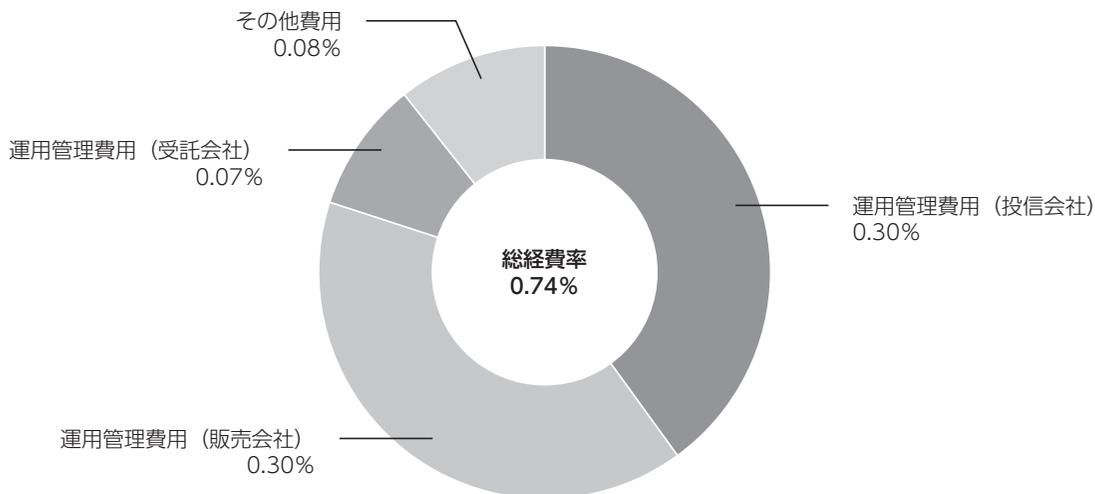
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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0.74%**です。



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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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。

○売買及び取引の状況

(2022年1月27日～2023年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
米国・リート・マザーファンド	千口 682,106	千円 1,147,041	千口 418,228	千円 669,685

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS 米国リートインデックス>
該当事項はございません。

<米国・リート・マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
			%			%
為替直物取引	百万円 1,011	百万円 1,011	100.0	百万円 1,005	百万円 1,005	100.0

平均保有割合 67.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米国・リート・マザーファンド	千口 993,389	千口 1,257,268	千円 1,943,611

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国・リート・マザーファンド	千円 1,943,611	% 99.5
コール・ローン等、その他	9,814	0.5
投資信託財産総額	1,953,425	100.0

(注) 米国・リート・マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(2,743,002千円)の投資信託財産総額(2,744,661千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=129.27円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,953,425,573
コール・ローン等	8,768,419
米国・リート・マザーファンド(評価額)	1,943,611,361
未収入金	1,045,793
(B) 負債	9,223,407
未払解約金	2,574,267
未払信託報酬	6,615,021
未払利息	3
その他未払費用	34,116
(C) 純資産総額(A-B)	1,944,202,166
元本	1,327,170,054
次期繰越損益金	617,032,112
(D) 受益権総口数	1,327,170,054口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,649円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,041,321,579円
 期中追加設定元本額 1,229,237,231円
 期中一部解約元本額 943,388,756円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,649円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年1月27日～ 2023年1月26日
費用控除後の配当等収益額	57,004,693円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	508,467,012円
分配準備積立金額	51,560,407円
当ファンドの分配対象収益額	617,032,112円
1万口当たり収益分配対象額	4,649円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,300
受取利息	22
支払利息	△ 2,322
(B) 有価証券売買損益	△ 90,045,053
売買益	32,868,617
売買損	△122,913,670
(C) 信託報酬等	△ 12,786,039
(D) 当期損益金(A+B+C)	△102,833,392
(E) 前期繰越損益金	51,560,407
(F) 追加信託差損益金	668,305,097
(配当等相当額)	(412,054,630)
(売買損益相当額)	(256,250,467)
(G) 計(D+E+F)	617,032,112
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	617,032,112
追加信託差損益金	668,305,097
(配当等相当額)	(417,122,345)
(売買損益相当額)	(251,182,752)
分配準備積立金	108,565,100
繰越損益金	△159,838,085

- (注) (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) (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) (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。

米国・リート・マザーファンド

《第7期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26日]

「米国・リート・マザーファンド」は、1月26日に第7期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第7期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として米国の不動産投資信託証券に投資を行い、S & P米国REITインデックス(配当込み、円換算ベース)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高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P米国REITインデックス (配当込み、円換算ベース)		投資信託証券 組入比率	不動産 投信指 先物比	純総 資産 率	純総 資産 額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%		百万円
3期(2019年1月28日)	10,763	6.5	43,094	5.8	99.4	—		604
4期(2020年1月27日)	12,632	17.4	50,378	16.9	98.8	—		680
5期(2021年1月26日)	10,924	△13.5	43,243	△14.2	99.2	—		1,464
6期(2022年1月26日)	15,458	41.5	60,898	40.8	99.4	—		2,741
7期(2023年1月26日)	15,459	0.0	60,427	△0.8	96.9	3.1		2,743

(注) S & P米国REITインデックス(配当込み)とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している指数で、米国の不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄を対象に浮動株修正時価総額に基づいて算出されています。S & P米国REITインデックス(配当込み、円換算ベース)は、S & P米国REITインデックス(配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S & P米国REITインデックス(配当込み)はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信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SPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、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、S & P米国REITインデックス(配当込み)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。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P米国REITインデックス (配当込み、 円換算ベース)		投 資 信 託 証 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年1月26日	円	%		%	%	%
	15,458	—	60,898	—	99.4	—
1月末	15,695	1.5	61,820	1.5	98.4	—
2月末	15,643	1.2	61,610	1.2	99.4	—
3月末	17,600	13.9	69,253	13.7	98.9	—
4月末	18,028	16.6	70,891	16.4	99.3	—
5月末	16,480	6.6	64,730	6.3	99.5	—
6月末	16,205	4.8	63,516	4.3	99.1	—
7月末	17,198	11.3	67,431	10.7	99.5	—
8月末	16,852	9.0	66,074	8.5	97.8	2.4
9月末	15,156	△ 2.0	59,341	△ 2.6	98.9	0.7
10月末	16,533	7.0	64,734	6.3	96.2	3.7
11月末	15,975	3.3	62,519	2.7	94.9	5.1
12月末	14,881	△ 3.7	58,164	△ 4.5	97.7	2.0
(期 末) 2023年1月26日	15,459	0.0	60,427	△ 0.8	96.9	3.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

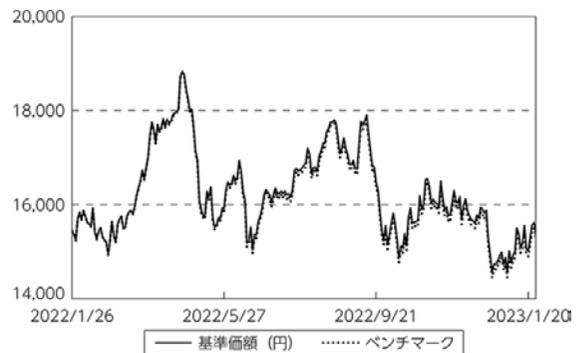
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べほぼ横ばいとなりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.8%)を0.8%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 米国REIT市況

- ・ 米国REIT市況は下落しました。
- ・ 米国REIT市況は、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドルは円に対して上昇しました。
- ・ 為替市況は、期間の初めに比べて13.6%の円安・米ドル高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ S&P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、各銘柄の組入比率が原則ベンチマークに準じた比率となるようにポートフォリオを構築しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは0.8%の下落になったため、乖離は0.8%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ その他の要因[※]によるものです。
- ※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ 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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 3 (2) (0)	% 0.016 (0.013) (0.002)	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) 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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (11) (2)	0.078 (0.065) (0.012)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	16	0.094	
期中の平均基準価額は、16,227円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2022年1月27日～2023年1月26日)

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	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	SITE CENTERS CORP	0.303	3	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	94	3	98
	ACADIA REALTY TRUST	0.287	4	—	—
	AGREE REALTY CORP	0.605	41	0.148	10
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.983	178	0.832	146
	PROLOGIS INC	4 (3)	614 (426)	4	597
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	0.324	17	0.396 (2)	25 (138)
	BRANDYWINE REALTY TRUST	1	14	0.73	9
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.829	126	0.769	119
	CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.666	29	(0.23)	(5)
	COUSINS PROPERTIES INC	0.383	14	0.294	11
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	221	1	227
	EASTGROUP PROPERTIES INC	0.122	22	0.04	8
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.956	72	0.939	72
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.411	127	0.428	133
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.859	164	0.941	175
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.211	24	0.096	11
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	0.441	25	0.325	18
	GETTY REALTY CORP	0.243	7	0.288	9
	WELLTOWER INC	3	272	2	228
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.546	22	0.433	15
	SERVICE PROPERTIES TRUST	0.527	3	—	—
	EQUITY COMMONWEALTH	0.159	4	0.268	7
	KILROY REALTY CORP	0.346	22	0.291	18
	KITE REALTY GROUP TRUST	1	26	1	20
	LXP INDUSTRIAL TRUST	—	—	0.476	6
	BOSTON PROPERTIES INC	0.885	102	0.79	92
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	100	4	91
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.745	143	0.818	155
	NATL HEALTH INVESTORS INC	0.071	3	0.114	7
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.748	23	0.683	19
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	— (△ 1)	— (—)	0.08	0.34797
	RPT REALTY	0.37	3	—	—
	REALTY INCOME CORP	4	282	3	218
	REGENCY CENTERS CORP	0.711	46	0.641	40

外

国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
SAUL CENTERS INC	0.097	3	—	—
LIFE STORAGE INC	0.36	47	0.344	47
SUN COMMUNITIES INC	0.749	126	0.678	118
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	0.395	3	0.628	6
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	0.213	3	—	—
CUBESMART	0.949	42	0.91	41
UDR INC	1	106	1	95
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.077	3	—	—
URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.218	4	—	—
VENTAS INC	2	125	2	135
ELME COMMUNITIES	0.562	14	0.387	9
PS BUSINESS PARKS INC/MD	0.14	23	0.166 (0.42)	28 (69)
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	—	—	— (1)	— (37)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.569	15	0.359 (3)	10 (94)
DOUGLAS EMMETT INC	0.797	22	0.614	15
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0.615	14	0.423	10
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	31	1	26
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	—	—	0.525	6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	0.261	3	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	0.584	23	0.653	24
SABRA HEALTH CARE REIT INC	2	34	2	27
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.769 (3)	21 (94)	0.857	20
WP CAREY INC	1	107	0.915	75
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.234	21	0.198	18
TERRENO REALTY CORP	0.316	22	0.441	28
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.655	29	0.223	10
GEO GROUP INC/THE	—	—	2	17
DUKE REALTY CORP	1 (△ 7)	105 (△ 426)	2	117
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	74	0.536	42
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.269	4	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1	64	1	53
CYRUSONE INC	—	—	— (2)	— (223)
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	3	32	3	26
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.939	23	0.772	18
CARETRUST REIT INC	0.2	3	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	—	—	— (1)	— (21)
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	61	0.542	26
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4	97	1	35

外

国

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
IRON MOUNTAIN INC	1	90	1	90
STORE CAPITAL CORP	0.757	22	0.546	16
URBAN EDGE PROPERTIES	2	43	2	37
EQUINIX INC	0.548	389	0.503	354
PARAMOUNT GROUP INC	2	20	1	16
XENIA HOTELS & RESORTS INC	0.971	15	0.646	10
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.287	18	0.149	9
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.165	15	0.111	9
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	—	0.265 (0.453)	7 (12)
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	0.719	5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.151	3	—	—
FARMLAND PARTNERS INC	0.621	8	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.333	4	0.497	6
EQUITY RESIDENTIAL	2	176	2	188
DIGITALBRIDGE GROUP INC	2	14	12	74
INVITATION HOMES INC	3	141	4	170
JBG SMITH PROPERTIES	—	—	0.329	7
VICI PROPERTIES INC	9	291	3	111
AMERICOLD REALTY TRUST INC	0.862	23	0.65	18
RETAIL VALUE INC	—	—	0.166	0.48133
BRT APARTMENTS CORP	0.314	6	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.102	20	—	—
SAFEHOLD INC	0.193 (0.128)	6 (—)	—	—
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	1	12	1	9
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	1	36	0.973	23
COREPOINT LODGING INC	—	—	— (0.539)	— (8)
NETSTREIT CORP	0.361	7	—	—
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	—	—	0.14	0.94736
BROADSTONE NET LEASE INC	0.842	16	0.448	9
APARTMENT INCOME REIT CO	0.364	19	0.419	19
CTO REALTY GROWTH INC	0.209 (0.142)	3 (—)	—	—
INDUS REALTY TRUST INC	0.063	4	0.118	7
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2	74	0.295	10
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	0.5	14	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1	38	—	—
BLUEROCK HOMES TRUST INC	— (0.056)	— (1)	—	—
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	0.7	8	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	6	121	5	113
ISTAR INC	1	21	—	—
PUBLIC STORAGE	0.94	340	0.862	311

外

国

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1	246	2	256
	VORNADO REALTY TRUST	0.4	18	0.237	9
	KIMCO REALTY CORP	3	95	3	83
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.852	197	0.922	206
小計		125 (△ 1)	6,779 (95)	111 (12)	5,915 (610)

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 512	百万円 416	百万円 -	百万円 -

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

区分	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
為替直物取引	百万円 1,011	百万円 1,011	% 100.0	百万円 1,005	百万円 1,005	% 100.0

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			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	%
SITE CENTERS CORP	3	3	50	6,493	0.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11	10	293	37,995	1.4
MACERICH CO/THE	4	4	55	7,238	0.3
ACADIA REALTY TRUST	1	1	28	3,714	0.1
AGREE REALTY CORP	1	1	132	17,115	0.6
ALEXANDER'S INC	0.056	0.056	13	1,730	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	460	59,556	2.2
PROLOGIS INC	14	18	2,311	298,750	10.9
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2	—	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	0.693	0.693	4	563	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	3	3	21	2,813	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	256	33,164	1.2
CEDAR REALTY TRUST INC	0.23	—	—	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	3	170	22,011	0.8
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2	2	64	8,366	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	2	3	79	10,337	0.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4	4	41	5,378	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	5	608	78,718	2.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	0.798	0.88	144	18,680	0.7
EPR PROPERTIES	1	1	63	8,144	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3	3	240	31,051	1.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	283	36,630	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	2	399	51,624	1.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	164	21,294	0.8
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2	2	139	18,010	0.7
GETTY REALTY CORP	0.704	0.659	23	3,042	0.1
WELLTOWER INC	8	9	689	89,186	3.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2	2	61	8,014	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	2	3	29	3,780	0.1
EQUITY COMMONWEALTH	2	2	56	7,307	0.3
KILROY REALTY CORP	2	2	82	10,724	0.4
KITE REALTY GROUP TRUST	4	4	92	11,911	0.4
LXP INDUSTRIAL TRUST	6	5	64	8,350	0.3
LTC PROPERTIES INC	0.87	0.87	31	4,103	0.1
VERIS RESIDENTIAL INC	1	1	26	3,390	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	2	2	204	26,466	1.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	11	12	149	19,339	0.7
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	2	368	47,591	1.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.936	0.893	50	6,507	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4	4	135	17,477	0.6

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			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	%
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.365	0.365	8	1,099	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1	—	—	—	—
RPT REALTY	1	1	19	2,457	0.1
REALTY INCOME CORP	11	12	836	108,146	3.9
REGENCY CENTERS CORP	3	3	205	26,509	1.0
SAUL CENTERS INC	0.205	0.302	12	1,619	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5	5	4	521	0.0
SL GREEN REALTY CORP	1	1	49	6,430	0.2
LIFE STORAGE INC	1	1	177	22,959	0.8
SUN COMMUNITIES INC	2	2	359	46,528	1.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4	4	45	5,860	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	2	41	5,340	0.2
CUBESMART	4	4	196	25,448	0.9
UDR INC	5	6	250	32,429	1.2
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.198	0.275	14	1,896	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.49	0.708	13	1,701	0.1
VENTAS INC	8	7	398	51,501	1.9
ELME COMMUNITIES	1	1	32	4,238	0.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	0.727	0.727	6	861	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/MD	0.446	—	—	—	—
UMH PROPERTIES INC	1	1	16	2,191	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.839	0.839	13	1,799	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	1	—	—	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2	—	—	—	—
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	1	4	589	0.0
CENTERSPACE	0.289	0.289	18	2,414	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	3	3	55	7,157	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2	2	41	5,383	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	2	26	3,484	0.1
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3	2	25	3,328	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	1	27	3,540	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2	2	20	2,602	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	1	1	17	2,226	0.1
RLJ LODGING TRUST	3	3	41	5,329	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	2	2	40	5,293	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	3	3	126	16,416	0.6
SABRA HEALTH CARE REIT INC	4	4	62	8,047	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	4	7	153	19,811	0.7
WP CAREY INC	3	4	344	44,586	1.6
WHITESTONE REIT	0.74	0.74	7	969	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	1	98	12,757	0.5
CHATHAM LODGING TRUST	1	1	15	2,009	0.1
TERRENO REALTY CORP	1	1	84	10,930	0.4
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2	2	118	15,285	0.6
GEO GROUP INC/THE	2	—	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			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	%
DUKE REALTY CORP	7	—	—	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	1	16	2,099	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	3	226	29,321	1.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	4	4	72	9,360	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	5	6	204	26,472	1.0
CYRUSONE INC	2	—	—	—	—
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1	1	8	1,121	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	2	2	21	2,748	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	6	137	17,763	0.6
CARETRUST REIT INC	1	2	39	5,048	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	1	—	—	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	4	5	272	35,243	1.3
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2	4	82	10,604	0.4
IRON MOUNTAIN INC	5	5	308	39,868	1.5
STORE CAPITAL CORP	5	5	172	22,308	0.8
URBAN EDGE PROPERTIES	1	2	34	4,519	0.2
EQUINIX INC	1	1	1,323	171,109	6.2
PARAMOUNT GROUP INC	2	3	19	2,497	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	1	28	3,671	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	2	2	34	4,410	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1	1	66	8,620	0.3
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.415	0.469	22	2,845	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	4	4	74	9,569	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.718	—	—	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	2	2	31	4,098	0.1
CITY OFFICE REIT INC	0.751	0.751	7	910	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.719	—	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1	1	49	6,411	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.534	0.534	22	2,857	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	0.325	0.946	12	1,587	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	4	4	62	8,117	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	6	6	415	53,731	2.0
DIGITALBRIDGE GROUP INC	9	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	12	11	365	47,238	1.7
JBG SMITH PROPERTIES	2	1	37	4,807	0.2
ALEXANDER & BALDWIN INC	1	1	29	3,836	0.1
CLIPPER REALTY INC	0.04	0.04	0.272	35	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.603	0.603	11	1,518	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1	1	14	1,919	0.1
VICI PROPERTIES INC	12	19	642	83,058	3.0
AMERICOLD REALTY TRUST INC	5	5	168	21,800	0.8
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	1	1	4	620	0.0
RETAIL VALUE INC	0.166	—	—	—	—
BRT APARTMENTS CORP	0.055	0.369	7	955	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.474	0.576	49	6,437	0.2

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			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	%
SAFEHOLD INC	0.225	0.546	18	2,376	0.1
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	2	2	16	2,082	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	2	2	68	8,907	0.3
COREPOINT LODGING INC	0.539	—	—	—	—
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	0.704	0.704	14	1,920	0.1
NETSTREIT CORP	0.798	1	22	2,921	0.1
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	0.14	—	—	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC	3	3	61	7,997	0.3
APARTMENT INCOME REIT CO	3	3	111	14,462	0.5
CTO REALTY GROWTH INC	0.071	0.422	8	1,035	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	0.2	0.2	3	515	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	0.16	0.105	6	868	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	0.24	0.24	3	473	0.0
ORION OFFICE REIT INC	1	1	9	1,220	0.0
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	0.38	2	76	9,869	0.4
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	0.5	13	1,701	0.1
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	1	32	4,180	0.2
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	0.056	1	157	0.0
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	—	0.7	8	1,139	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	13	14	263	34,061	1.2
ISTAR INC	—	1	14	1,915	0.1
PUBLIC STORAGE	3	3	916	118,491	4.3
SIMON PROPERTY GROUP INC	6	6	810	104,819	3.8
VORNADO REALTY TRUST	3	3	73	9,484	0.3
KIMCO REALTY CORP	12	12	275	35,660	1.3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	2	477	61,762	2.3
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	3	3	23	3,075	0.1
合 計	口 数	口 数	金 額	金 額	
	152	141	20,565	2,658,536	
	銘柄 数 < 比 率 >		—	< 96.9% >	

(注) 邦貨換算金額は、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。

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資信託証券の内容

●PROLOGIS INC (期末組入比率10.9%)

① 信託の概要

S & P米国REITインデックスにおいて約11%を占めます。

米国を中心に世界各地の産業用不動産に対して、投資・開発を行います。

② 1口当たりの資産運用報酬額等

投資信託の資産運用報酬額等に相当する詳細な開示がないため、1口当たりの資産運用報酬額等に関する開示は出来ません。

ホームページアドレス <https://www.prologis.com/>

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外国	不動産投信指数先物取引	DJREIT2303	百万円 86	百万円 —

(注) 邦貨換算金額は、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。

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 2,658,536	% 96.9
コール・ローン等、その他	86,125	3.1
投資信託財産総額	2,744,661	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(2,743,002千円)の投資信託財産総額(2,744,661千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=129.27円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,745,566,140
コール・ローン等	66,811,967
投資証券(評価額)	2,658,536,151
未収入金	3,381,221
未収配当金	1,556,618
差入委託証拠金	15,280,183
(B) 負債	1,950,263
未払金	904,470
未払解約金	1,045,793
(C) 純資産総額(A-B)	2,743,615,877
元本	1,774,712,757
次期繰越損益金	968,903,120
(D) 受益権総口数	1,774,712,757口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,459円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,773,244,173円
 期中追加設定元本額 687,066,552円
 期中一部解約元本額 685,597,968円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5459円です。

- ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)
- | | |
|-----------------------------------|----------------|
| e MAX I S 米国リートインデックス | 1,257,268,492円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 110,621,691円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 107,795,162円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 107,282,143円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定) | 95,977,903円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 95,767,366円 |
| 合計 | 1,774,712,757円 |

○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	99,565,470
受取配当金	98,638,210
受取利息	682,334
その他収益金	247,627
支払利息	△ 2,701
(B) 有価証券売買損益	△ 99,871,620
売買益	441,834,919
売買損	△541,706,539
(C) 先物取引等取引損益	1,152,687
取引益	10,971,235
取引損	△ 9,818,548
(D) 保管費用等	△ 2,216,227
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 1,369,690
(F) 前期繰越損益金	967,784,476
(G) 追加信託差損益金	467,733,345
(H) 解約差損益金	△465,245,011
(I) 計(E+F+G+H)	968,903,120
次期繰越損益金(I)	968,903,120

- (注) (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) (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) (H) 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。