

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（2019年10月31日設定） | |
| 運用方針 | MUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券に投資を行います。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。S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）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 | MUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）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 | S&P先進国REITインデックス（除く日本、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。投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。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 | 株式への直接投資は行いません。投資信託証券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 | <p>経費等控除後の配当等収益および売益（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。</p> <p>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。）</p> | |

運用報告書（全体版）



イーマックス

eMAXIS Slim

先進国リートインデックス



第5期（決算日：2024年4月25日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「eMAXIS Slim 先進国リートインデックス」は、去る4月25日に第5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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9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.am.mufg.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。

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | S & P 先進国 REITインデックス | | 投資信託 証券組 入比率 | 不動産 投信物 比率 | 純 資 産 額 |
|----------------|--------|-------------|------------------|-------------------------|--------|--------------------|------------------|------------------|
| | (分配落) | 税 分 配 | み 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 2019年10月31日 | 10,000 | — | — | 48,143.18 | — | — | — | 1 |
| 1期(2020年4月27日) | 7,140 | 0 | △28.6 | 34,061.00 | △29.3 | 98.9 | — | 1,131 |
| 2期(2021年4月26日) | 10,202 | 0 | 42.9 | 48,712.70 | 43.0 | 99.2 | — | 7,059 |
| 3期(2022年4月25日) | 14,036 | 0 | 37.6 | 66,956.99 | 37.5 | 99.1 | 0.8 | 19,440 |
| 4期(2023年4月25日) | 11,569 | 0 | △17.6 | 54,994.69 | △17.9 | 98.3 | 1.6 | 21,036 |
| 5期(2024年4月25日) | 13,806 | 0 | 19.3 | 65,382.13 | 18.9 | 97.6 | 2.5 | 27,026 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) S & P先進国REITインデックスとは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S & P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S & P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S & P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJII」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ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SPDJII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、SPDJII、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先進国REIT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。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、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) 2023年4月25日 | 円 11,569 | % — | 54,994.69 | % — | % 98.3 | % 1.6 |
| 4月末 | 11,572 | 0.0 | 54,997.08 | 0.0 | 98.2 | 1.8 |
| 5月末 | 11,741 | 1.5 | 55,825.75 | 1.5 | 97.6 | 2.5 |
| 6月末 | 12,599 | 8.9 | 59,850.31 | 8.8 | 97.5 | 2.1 |
| 7月末 | 12,662 | 9.4 | 60,158.04 | 9.4 | 97.1 | 3.0 |
| 8月末 | 12,850 | 11.1 | 61,059.23 | 11.0 | 97.2 | 2.8 |
| 9月末 | 12,123 | 4.8 | 57,524.16 | 4.6 | 96.4 | 3.8 |
| 10月末 | 11,420 | △ 1.3 | 54,188.45 | △ 1.5 | 97.9 | 2.2 |
| 11月末 | 12,612 | 9.0 | 59,805.74 | 8.7 | 97.9 | 1.9 |
| 12月末 | 13,628 | 17.8 | 64,636.41 | 17.5 | 98.1 | 1.4 |
| 2024年1月末 | 13,505 | 16.7 | 64,012.38 | 16.4 | 97.8 | 2.2 |
| 2月末 | 13,746 | 18.8 | 65,140.19 | 18.4 | 96.6 | 3.4 |
| 3月末 | 14,278 | 23.4 | 67,617.65 | 23.0 | 96.1 | 4.0 |
| (期 末) 2024年4月25日 | 13,806 | 19.3 | 65,382.13 | 18.9 | 97.6 | 2.5 |

(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5期：2023年4月26日～2024年4月25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5期首 | 11,569円 |
| 第5期末 | 13,806円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | 19.3% |

※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19.3%の上昇となりました。

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（18.9%）を0.4%上回りました。

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。

第5期：2023年4月26日～2024年4月25日

投資環境について

▶ 外国REIT市況

外国REIT市況は上昇しました。

主要国の長期金利の上昇などを受けて外国REIT市況は下落する場面がみられたものの、主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて上昇して期間を終えました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロ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円安・米ドル高、円安・ユーロ高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS Slim 先進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。

▶ MUAMG-REITマザーファンド

ベンチマークであるS & P先進国REITインデックス（除く日本、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（REIT）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。

REITの組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様に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 Slim 先進国リートインデックス
ベンチマークとの乖離は0.4%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△0.3%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0.7%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。

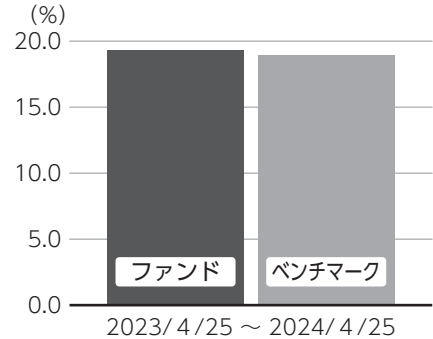
主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*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：組入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5期 |
|----------------|-----------------------|
| | 2023年4月26日～2024年4月25日 |
| 当期分配金（対基準価額比率） | －（－％） |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 5,115 |

(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 Slim 先進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。

▶ **MUAMG-REIT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。

2023年4月26日～2024年4月25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 | 28 | 0.220 | (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) | (13) | (0.099) | 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) | (13) | (0.099) | 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) | (3) | (0.022) | 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 | 1 | 0.006 | (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 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (投 資 信 託 証 券) | (0) | (0.001) | |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (1) | (0.005) | |
| (c) 有価証券取引税 | 1 | 0.007 | (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 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (投 資 信 託 証 券) | (1) | (0.006) | |
| (d) その他費用 | 5 | 0.040 | (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) | (2) | (0.017) | 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) | (0) | (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) | (3) | (0.020) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 35 | 0.273 | |

期中の平均基準価額は、12,810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。

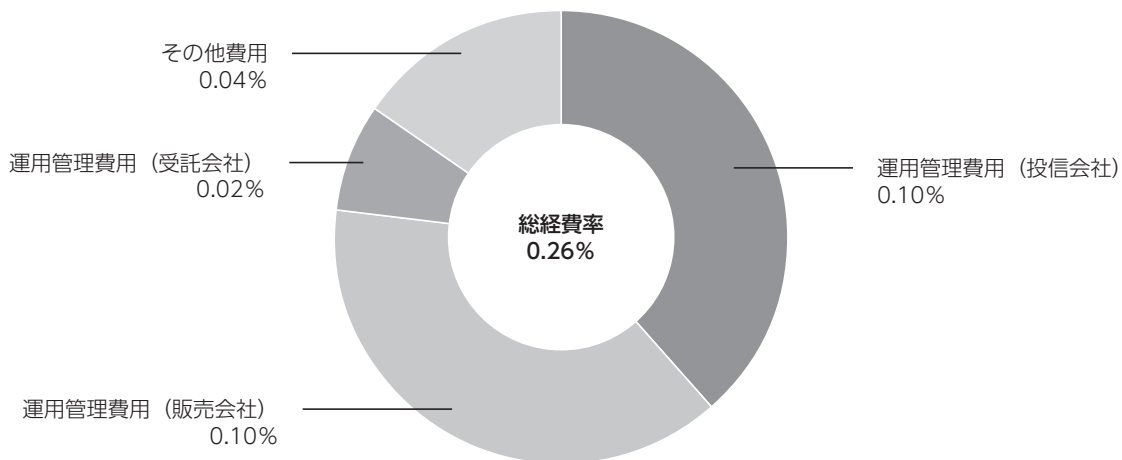
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.26%**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

(2023年4月26日～2024年4月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|--------------------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| MUAM G-REITマザーファンド | 千口 1,285,752 | 千円 3,095,069 | 千口 572,544 | 千円 1,386,166 |

○株式売買比率

(2023年4月26日～2024年4月25日)

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 |
|---------------------|--------------------|
| | MUAM G-REITマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 31,045千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | —千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | — |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年4月26日～2024年4月25日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS Slim 先進国リートインデックス>

該当事項はございません。

<MUAM G-REIT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 22,388 | 百万円 356 | % 1.6 | 百万円 11,440 | 百万円 30 | % 0.3 |

平均保有割合 21.7%

※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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年4月25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 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 千口 9,626,053 | 千口 10,339,261 | 千円 27,023,728 |

○投資信託財産の構成

(2024年4月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | 比 率 |
|-----------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 千円 27,023,728 | % 99.8 |
| コール・ローン等、その他 | 57,444 | 0.2 |
| 投資信託財産総額 | 27,081,172 | 100.0 |

(注) MUAM G-R E I Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(125,505,409千円)の投資信託財産総額(125,722,126千円)に対する比率は99.8%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=155.53円 | 1カナダドル=113.56円 | 1ユーロ=166.49円 | 1イギリスポンド=193.87円 |
| 1オーストラリアドル=101.11円 | 1ニュージーランドドル=92.37円 | 1香港ドル=19.86円 | 1シンガポールドル=114.23円 |
| 100韓国ウォン=11.31円 | 1イスラエルシェケル=41.0947円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年4月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 27,081,172,546 |
| コール・ローン等 | 57,443,813 |
| MUAM G-REITマザーファンド(評価額) | 27,023,728,632 |
| 未収利息 | 101 |
| (B) 負債 | 54,266,166 |
| 未払解約金 | 25,700,623 |
| 未払信託報酬 | 28,129,593 |
| その他未払費用 | 435,950 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 27,026,906,380 |
| 元本 | 19,575,994,741 |
| 次期繰越損益金 | 7,450,911,639 |
| (D) 受益権総口数 | 19,575,994,741口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,806円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 18,183,250,656円
 期中追加設定元本額 7,645,993,690円
 期中一部解約元本額 6,253,249,605円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,806円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2023年4月26日～ 2024年4月25日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 947,510,857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 | 6,352,703,856円 |
| 分配準備積立金額 | 2,713,226,999円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 10,013,441,712円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 5,115円 |
| 1万口当たり分配金額 | -円 |
| 収益分配金金額 | -円 |

○損益の状況 (2023年4月26日～2024年4月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 12,475 |
| 受取利息 | 5,137 |
| 支払利息 | △ 17,612 |
| (B) 有価証券売買損益 | 3,539,496,388 |
| 売買益 | 4,287,250,312 |
| 売買損 | △ 747,753,924 |
| (C) 信託報酬等 | △ 53,952,509 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,485,531,404 |
| (E) 前期繰越損益金 | 89,623,629 |
| (F) 追加信託差損益金 | 3,875,756,606 |
| (配当等相当額) | (6,335,505,386) |
| (売買損益相当額) | (△2,459,748,780) |
| (G) 計(D+E+F) | 7,450,911,639 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 7,450,911,639 |
| 追加信託差損益金 | 3,875,756,606 |
| (配当等相当額) | (6,352,703,856) |
| (売買損益相当額) | (△2,476,947,250) |
| 分配準備積立金 | 3,660,737,856 |
| 繰越損益金 | △ 85,582,823 |

- (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。

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに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。

【お 知 ら せ】

- ①新NISA（成長投資枠）の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年7月25日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)

MUAM G-REITマザーファンド

【第18期】決算日2024年1月5日

〔計算期間：2023年1月6日～2024年1月5日〕

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第18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18期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 主としてS&P先進国REITインデックス（除く日本、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に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投資指数先物取引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は行いません。 |
| 主要運用対象 | S&P先進国REITインデックス（除く日本、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ます。 |
| 主な組入制限 | 株式への直接投資は行いません。投資信託証券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 先進国 REIT インデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) | | 投資信託証券組入比率 | 不動産指数先物投信物比率 | 純総資産額 |
|----------------|--------|-------|--|-------|------------|--------------|---------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 14期(2020年1月6日) | 18,377 | 22.4 | 47,161.24 | 22.2 | 99.0 | — | 30,217 |
| 15期(2021年1月5日) | 15,806 | △14.0 | 40,236.52 | △14.7 | 99.0 | — | 40,409 |
| 16期(2022年1月5日) | 24,645 | 55.9 | 62,554.10 | 55.5 | 99.3 | — | 78,315 |
| 17期(2023年1月5日) | 21,519 | △12.7 | 54,258.04 | △13.3 | 95.3 | 5.3 | 87,184 |
| 18期(2024年1月5日) | 25,604 | 19.0 | 64,147.13 | 18.2 | 98.2 | 2.0 | 116,457 |

(注) S & P 先進国 REIT インデックスとは、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC が有する S & P グローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託 (REIT) 及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) は、S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。S & P 先進国 REIT インデックスは 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 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 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 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、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 先進国 REIT 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。

(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) 「不動産投資指数先物比率」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 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込 み、円換算ベース) | | 投 資 信 託 券 率 組 入 比 | 不 動 産 指 数 投 信 物 比 | 産 数 率 |
|--------------------|---------|-------|--|-------|----------------------|----------------------|-------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2023年1月5日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| | 21,519 | — | 54,258.04 | — | 95.3 | | 5.3 |
| 1月末 | 22,702 | 5.5 | 57,299.84 | 5.6 | 97.3 | | 2.6 |
| 2月末 | 22,938 | 6.6 | 57,855.97 | 6.6 | 97.3 | | 2.9 |
| 3月末 | 21,356 | △ 0.8 | 53,766.84 | △ 0.9 | 96.2 | | 3.8 |
| 4月末 | 21,857 | 1.6 | 54,997.08 | 1.4 | 98.2 | | 1.8 |
| 5月末 | 22,180 | 3.1 | 55,825.75 | 2.9 | 97.6 | | 2.5 |
| 6月末 | 23,807 | 10.6 | 59,850.31 | 10.3 | 97.5 | | 2.1 |
| 7月末 | 23,931 | 11.2 | 60,158.04 | 10.9 | 97.1 | | 3.0 |
| 8月末 | 24,290 | 12.9 | 61,059.23 | 12.5 | 97.2 | | 2.8 |
| 9月末 | 22,919 | 6.5 | 57,524.16 | 6.0 | 96.4 | | 3.8 |
| 10月末 | 21,595 | 0.4 | 54,188.45 | △ 0.1 | 97.9 | | 2.2 |
| 11月末 | 23,854 | 10.9 | 59,805.74 | 10.2 | 97.9 | | 1.9 |
| 12月末 | 25,781 | 19.8 | 64,636.41 | 19.1 | 98.1 | | 1.4 |
| (期 末) 2024年1月5日 | 25,604 | 19.0 | 64,147.13 | 18.2 | 98.2 | | 2.0 |

(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

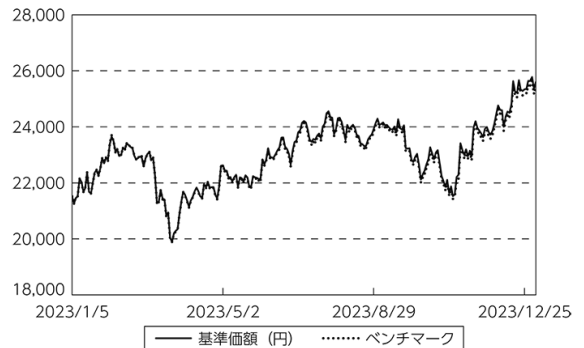
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ19.0%の上昇となりました。

◎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(18.2%)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

◎ 外国REIT市況

- ・ 外国REIT市況は上昇しました。
- ・ 主要国の長期金利の上昇などを受けて外国REIT市況は下落する場面がみられたものの、その後は主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて上昇して期間を終えました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロ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9.7%の円安・米ドル高、13.1%の円安・ユーロ高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス(除く日本、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、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様に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18.2%の上昇になったため、カイ離は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

(2023年1月6日～2024年1月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (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 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.001) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.005) | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 2 | 0.008 | (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 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (2) | (0.008) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 14 | 0.059 | (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（合併にかかる現地徴収税等） |
| (保 管 費 用) | (4) | (0.016) | |
| (そ の 他) | (10) | (0.043) | |
| 合 計 | 18 | 0.074 | |
| 期中の平均基準価額は、23,039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

(2023年1月6日～2024年1月5日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|------|------------------|-----------------------|------------------|------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 | アメリカ | 百株 — (77) | 千アメリカドル — (141) | 百株 — (77) | 千アメリカドル — (141) |
| | イギリス | 607 | 千イギリスポンド 169 | — (607) | 千イギリスポンド — (169) |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

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 | 16 | 199 | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 70 | 1,445 | 18 | 360 |
| MACERICH CO/THE | 27 | 267 | 10 | 165 |
| ACADIA REALTY TRUST | 6 | 86 | — | — |
| AGREE REALTY CORP | 14 | 922 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 22 | 2,615 | 5 | 714 |
| PROLOGIS INC | 106 | 12,213 | 25 | 3,306 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 15 | 69 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 13 | 1,377 | 4 | 447 |
| NNN REIT INC | 22 | 917 | 5 | 241 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 11 | 258 | — | — |
| COUSINS PROPERTIES INC | 15 | 332 | — | — |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 21 | 161 | — | — |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 42 | 4,612 | 8 | 1,102 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 6 | 1,045 | 0.732 | 126 |
| EPR PROPERTIES | 10 | 424 | 1 | 70 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 27 | 1,823 | 5 | 401 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 7 | 1,529 | 1 | 463 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 19 | 2,587 | 5 | 879 |
| | (43) | (4,800) | | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 8 | 846 | 2 | 260 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 17 | 827 | 4 | 217 |
| GETTY REALTY CORP | 6 | 203 | — | — |
| WELLTOWER INC | 103 | 8,151 | 14 | 1,316 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 11 | 271 | — | — |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 30 | 239 | 7 | 72 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 13 | 268 | 5 | 103 |
| KILROY REALTY CORP | 14 | 455 | 2 | 105 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 25 | 533 | 9 | 218 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 39 | 386 | — | — |
| LTC PROPERTIES INC | 4 | 144 | — | — |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 7 | 124 | — | — |
| BOSTON PROPERTIES INC | 17 | 1,004 | 4 | 330 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 69 | 553 | — | — |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 13 | 1,964 | 3 | 462 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 4 | 249 | 2 | 129 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 34 | 1,043 | 7 | 245 |
| RPT REALTY | 13 | 142 | 15 | 190 |
| | (△ 42) | (△ 435) | | |
| REALTY INCOME CORP | 126 | 7,315 | 15 | 871 |
| REGENCY CENTERS CORP | 19 | 1,131 | 5 | 373 |
| | (6) | (342) | | |
| SAUL CENTERS INC | 1 | 73 | — | — |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 65 | 110 | 28 | 65 |

| 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 |
| SL GREEN REALTY CORP | 7 | 199 | 2 | 132 |
| LIFE STORAGE INC | 5 (△ 48) | 725 (△ 4,800) | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 14 | 1,849 | 3 | 488 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 23 | 218 | 14 | 149 |
| TANGER INC | 10 | 222 | — | — |
| CUBESMART | 27 | 1,118 | 7 | 326 |
| UDR INC | 36 | 1,396 | 13 | 513 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1 | 71 | — | — |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 3 (△ 17) | 73 (△ 342) | — | — |
| VENTAS INC | 48 | 2,112 | 11 | 567 |
| ELME COMMUNITIES | 8 | 147 | — | — |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST-A | 15 | 110 | 7 (20) | 72 (161) |
| UMH PROPERTIES INC | 8 | 121 | — | — |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 5 | 73 | — | — |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 30 | 54 | — | — |
| CENTERSPACE | 1 | 72 | — | — |
| DOUGLAS EMMETT INC | 20 | 249 | 12 | 189 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 9 | 117 | — | — |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 10 | 73 | — | — |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 22 | 124 | 10 | 71 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 3 | 72 | — | — |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 12 | 87 | — | — |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 4 | 20 | — | — |
| RLJ LODGING TRUST | 14 | 143 | — | — |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 11 | 146 | — | — |
| STAG INDUSTRIAL INC | 20 | 698 | 5 | 192 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 30 | 387 | 10 | 152 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 46 | 833 | 6 | 95 |
| WP CAREY INC | 28 | 1,973 | 4 | 316 |
| WHITESTONE REIT | 8 | 71 | — | — |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 9 | 791 | 1 | 129 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 7 | 75 | — | — |
| TERRENO REALTY CORP | 17 | 1,026 | — | — |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 14 | 551 | 2 | 121 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 6 | 74 | — | — |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 37 | 1,991 | 6 | 365 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 26 | 370 | — | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 42 | 1,371 | 10 | 376 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 9 | 23 | — | — |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 10 | 73 | — | — |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 35 | 740 | 6 | 151 |
| CARETRUST REIT INC | 23 | 486 | — | — |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 32 | 1,557 | 4 | 228 |

| 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 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 29 | 442 | 8 | 139 |
| IRON MOUNTAIN INC | 35 | 1,902 | 8 | 576 |
| STORE CAPITAL CORP | 6 | 200 | — | — |
| | | | (136) | (4,389) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 10 | 159 | — | — |
| EQUINIX INC | 11 | 8,052 | 2 | 2,011 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 30 | 137 | 14 | 75 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 11 | 137 | — | — |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 7 | 88 | — | — |
| UNITI GROUP INC | 146 | 758 | — | — |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 6 | 256 | 4 | 180 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 1 | 75 | — | — |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 26 | 407 | 4 | 74 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 12 | 132 | — | — |
| | (50) | (461) | | |
| CITY OFFICE REIT INC | 7 | 26 | — | — |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 12 | 311 | — | — |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 3 | 126 | — | — |
| FARMLAND PARTNERS INC | 6 | 74 | — | — |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 188 | 47 | — | — |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 26 | 309 | 14 | 217 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 42 | 2,498 | 10 | 609 |
| INVITATION HOMES INC | 67 | 2,089 | 21 | 742 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 6 | 90 | 5 | 89 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 5 | 103 | — | — |
| CLIPPER REALTY INC | 8 | 40 | — | — |
| GLADSTONE LAND CORP | 4 | 72 | — | — |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 7 | 72 | — | — |
| VICI PROPERTIES INC | 148 | 4,551 | 23 | 737 |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC | 40 | 1,162 | 19 | 595 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 8 | 20 | — | — |
| BRT APARTMENTS CORP | 3 | 73 | — | — |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 3 | 249 | — | — |
| SAFEHOLD INC | — | — | — | — |
| | (△ 12) | (△ 388) | | |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 12 | 73 | — | — |
| | (△ 74) | (△ 461) | | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 22 | 530 | — | — |
| PRIME US REIT | — | — | — | — |
| | (—) | (△ 5) | | |
| NETSTREIT CORP | 13 | 243 | — | — |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 93 | 17 | — | — |
| | (—) | (△ 8) | | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 25 | 410 | — | — |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 12 | 438 | 5 | 175 |
| CTO REALTY GROWTH INC | 2 | 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 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 4 | 76 | — | — |
| INDUS REALTY TRUST INC | — | — | — | — |
| | | | (2) | (159) |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 3 | 40 | — | — |
| ORION OFFICE REIT INC | 11 | 73 | — | — |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 246 | 137 | — | — |
| | (—) | (△ 3) | | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 12 | 405 | — | — |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 3 | 72 | — | — |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 6 | 151 | — | — |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | — | — | 1 | 19 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | — | — | — | — |
| | (0.184) | (1) | | |
| STAR HOLDINGS | — | — | 7 | 109 |
| | (7) | (141) | | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 21 | 417 | — | — |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | — | — | — | — |
| | (8) | (—) | | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 86 | 1,360 | 30 | 556 |
| SAFEHOLD INC | 18 | 221 | — | — |
| | (12) | (388) | (42) | (141) |
| PUBLIC STORAGE | 18 | 5,090 | 4 | 1,312 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 38 | 4,181 | 10 | 1,457 |
| VORNADO REALTY TRUST | 17 | 324 | 4 | 139 |
| KIMCO REALTY CORP | 75 | 1,399 | 21 | 461 |
| | (25) | (435) | | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 17 | 2,954 | 4 | 770 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 18 | 124 | 9 | 70 |
| 小 計 | 3,606 | 125,090 | 606 | 29,008 |
| | (△ 41) | (126) | (202) | (4,852) |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3 | 172 | — | — |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 7 | 194 | — | — |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8 | 366 | — | — |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 8 | 99 | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 18 | 350 | 18 | 340 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 4 | 94 | — | — |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10 | 79 | — | — |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 5 | 75 | — | — |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 11 | 101 | — | — |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3 | 271 | 1 | 108 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 7 | 98 | — | — |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 16 | 209 | — | — |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 12 | 189 | — | — |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 6 | 103 | — | — |
| SLATE GROCERY REIT-CL U | 5 | 73 | — | — |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | | |
|------|------------------------------|------------------------------|----------|--------|-----------|-----|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 | |
| 外 | カナダ | 千口 | 千カナダドル | 千口 | 千カナダドル | |
| | | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 9 | 168 | 5 | 101 |
| | | SLATE OFFICE REIT | — | — | 13 | 21 |
| | | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | — | — | — | — |
| | | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | — | — | — | — |
| | | | (△ 24) | (—) | — | — |
| | | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 11 | 159 | — | — |
| | | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | — | — | 7 | 78 |
| | | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 34 | 100 | — | — |
| | | EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | — | — | 16 | 40 |
| | | INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | — | — | 7 | 24 |
| | | NEXUS INDUSTRIAL REIT | 11 | 94 | 9 | 72 |
| | PRIMARIS REIT | 5 | 71 | — | — | |
| | BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 5 | 90 | — | — | |
| | 小計 | 207 | 3,168 | 79 | 787 | |
| | | (△ 24) | (—) | (46) | (1,060) | |
| 国 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ | |
| | ドイツ | | | | | |
| | | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | — | — | 5 | 24 |
| | | | (—) | (11) | — | — |
| | | HAMBORNER REIT AG | 6 | 37 | — | — |
| | | 小計 | 6 | 37 | 5 | 24 |
| | | | (—) | (11) | — | — |
| | フランス | | | | | |
| | | GECINA SA | 5 | 533 | 1 | 187 |
| | | KLEPIERRE | 23 | 521 | 3 | 85 |
| | | | (—) | (△ 93) | — | — |
| | | COVIVIO | 8 | 378 | 3 | 160 |
| | MERCIALYS | 16 | 148 | — | — | |
| | ICADE | 1 | 82 | — | — | |
| | | (—) | (△ 30) | — | — | |
| | ALTAREA | 0.605 | 70 | — | — | |
| | | — | — | (—) | (0.43696) | |
| | CARMILA | 3 | 45 | — | — | |
| | | (—) | (△ 37) | — | — | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 7 | 358 | 7 | 447 | |
| | | (58) | (3,042) | — | — | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 5 | 261 | — | — | |
| | | — | — | (58) | (3,042) | |
| | 小計 | 72 | 2,399 | 16 | 881 | |
| | | (58) | (2,881) | (58) | (3,042) | |
| オランダ | | | | | | |
| | NSI NV | 3 | 55 | — | — | |
| | VASTNED RETAIL NV | 3 | 66 | 6 | 133 | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 3 | 63 | — | — | |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----------------------------|-------------------------------|----------|--------|----------|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 国 | ユーロ | | 千口 | | 千ユーロ |
| | オランダ | | | | |
| | WERELDHAVE NV | 5 | 73 | — | — |
| | 小計 | 15 | 258 | 6 | 133 |
| | スペイン | | | | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | — | — | — | — |
| | | (—) | (△ 14) | | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 44 | 348 | 13 | 138 |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 23 | 137 | — | — |
| | | (—) | (△ 9) | | |
| | 小計 | 68 | 485 | 13 | 138 |
| | | (—) | (△ 23) | | |
| | ベルギー | | | | |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSE | 6 | 122 | — | — |
| | RETAIL ESTATES | 1 | 67 | — | — |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 23 | 617 | — | — |
| | AEDIFICA | 8 | 550 | — | — |
| | AEDIFICA SA-RIGHTS | — | — | 22 | 9 |
| | | (22) | (—) | | |
| | MONTEA NV | 3 | 248 | — | — |
| | CARE PROPERTY INVEST | 12 | 152 | 9 | 127 |
| | CARE PROPERTY INVEST NV-RTS | — | — | 12 | 9 |
| | | (12) | (—) | | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 4 | 139 | — | — |
| | COFINIMMO | 6 | 488 | — | — |
| | 小計 | 67 | 2,387 | 43 | 146 |
| | | (34) | (—) | | |
| | ガンジー | | | | |
| | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 19 | 758 | — | — |
| | 小計 | 19 | 758 | — | — |
| | シンガポール | | | | |
| | CROMWELL REIT EUR | 83 | 119 | 47 | 63 |
| | | (—) | (△ 16) | | |
| 小計 | 83 | 119 | 47 | 63 | |
| | (—) | (△ 16) | | | |
| ユーロ計 | 331 | 6,445 | 134 | 1,386 | |
| | (93) | (2,853) | (58) | (3,042) | |
| イギリス | | 千イギリスポンド | | 千イギリスポンド | |
| BRITISH LAND CO PLC | 117 | 407 | 49 | 186 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 33 | 153 | — | — | |
| HAMMERSON PLC | 310 | 83 | — | — | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 88 | 531 | 20 | 142 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 71 | 71 | — | — | |
| SEGRO PLC | 159 | 1,174 | 44 | 370 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 19 | 88 | 12 | 65 | |
| SHAFTESBURY PLC | — | — | — | — | |
| | (△ 141) | (△ 527) | | | |

| 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 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 33 | 368 | 5 | 55 |
| DERWENT LONDON PLC | 11 | 251 | 4 | 102 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 124 | 218 | — | — |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 39 | 329 | 19 | 162 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 240 | 336 | 65 | 107 |
| ASSURA PLC | 290 | 138 | — | — |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 66 | 60 | — | — |
| REGIONAL REIT LTD | 138 | 37 | 233 | 71 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | — | — | 336 | 267 |
| UNITE GROUP PLC/THE | 64 | 591 | 26 | 253 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 61 | 58 | — | — |
| LXI REIT PLC | 162 | 177 | — | — |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 170 | 114 | 86 | 57 |
| AEW UK REIT PLC | 120 | 115 | 57 | 59 |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 281 | 315 | 93 | 123 |
| | (475) | (527) | | |
| BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 93 | 62 | 94 | 63 |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 143 | 117 | 71 | 58 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 151 | 124 | — | — |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 134 | 76 | 113 | 56 |
| PRS REIT PLC/THE | 52 | 45 | — | — |
| WAREHOUSE REIT PLC | 63 | 69 | — | — |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT | — | — | 100 | 68 |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 42 | 58 | — | — |
| HELICAL PLC | — | — | — | — |
| | (60) | (169) | | |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | 209 | 147 | — | — |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 371 | 291 | — | — |
| 小 計 | 3,867 (394) | 6,617 (169) | 1,434 | 2,273 |
| オーストラリア | | 千オーストラリアドル | | 千オーストラリアドル |
| VICINITY CENTRES | 449 | 838 | 162 | 314 |
| ABACUS GROUP | 61 | 161 | — | — |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 50 | 199 | — | — |
| CHARTER HALL GROUP | 56 | 587 | 19 | 243 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 31 | 96 | — | — |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 169 | 96 | — | — |
| REGION RE LTD | 123 | 270 | — | — |
| NATIONAL STORAGE REIT | 207 | 501 | — | — |
| GDI PROPERTY GROUP | 142 | 75 | 250 | 154 |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 33 | 85 | 23 | 65 |
| SCENTRE GROUP | 669 | 1,780 | 235 | 665 |
| ARENA REIT | 27 | 102 | — | — |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 31 | 112 | — | — |
| WAYPOINT REIT | 46 | 122 | — | — |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 75 | 294 | — | — |

| 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 |
| RURAL FUNDS GROUP | 48 | 97 | — | — |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 104 | 313 | 37 | 115 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 144 | 230 | — | — |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 258 | 320 | — | — |
| DEXUS/AU | 133 | 977 | 40 | 307 |
| HEALTHCO REIT | 199 | 281 | — | — |
| HMC CAPITAL LTD | 52 | 235 | — | — |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | — | — | 140 | 97 |
| ABACUS STORAGE KING | 91 | 109 | — | — |
| | (258) | (—) | | |
| GPT GROUP | 222 | 913 | 74 | 326 |
| MIRVAC GROUP | 483 | 1,034 | 83 | 175 |
| STOCKLAND | 292 | 1,128 | 96 | 408 |
| BWP TRUST | 58 | 220 | — | — |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 63 | 220 | — | — |
| GOODMAN GROUP | 200 | 3,966 | 44 | 1,058 |
| 小 計 | 4,529 | 15,377 | 1,208 | 3,933 |
| | (258) | (—) | | |
| 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 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 51 | 122 | 276 | 558 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 170 | 154 | — | — |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 168 | 358 | 84 | 181 |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 253 | 322 | 95 | 119 |
| STRIDE PROPERTY GROUP | — | — | 293 | 367 |
| 小 計 | 643 | 957 | 749 | 1,226 |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 520 | 24,640 | 73 | 2,984 |
| LINK REIT-RIGHTS | — | — | 216 | 896 |
| | (216) | (—) | | |
| CHAMPION REIT | 203 | 569 | — | — |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 331 | 636 | — | — |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 198 | 571 | — | — |
| FORTUNE REIT | 109 | 708 | — | — |
| 小 計 | 1,361 | 27,125 | 290 | 3,880 |
| | (216) | (—) | | |
| シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| SUNTEC REIT | 299 | 375 | 133 | 162 |
| | (—) | (△ 9) | | |
| KEPPEL REIT | 279 | 229 | — | — |
| | (—) | (△ 5) | | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 297 | 314 | — | — |
| | (—) | (△ 22) | (—) | (1) |
| ESR-LOGOS REIT | 1,300 | 403 | 314 | 97 |
| | (—) | (△ 13) | | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 143 | 162 | 96 | 102 |
| | (—) | (△ 2) | | |

| 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 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 126 | 278 | — | — |
| STARHILL GLOBAL REIT | 608 | 305 | 587 | 290 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 405 | 682 | 102 | 169 |
| | (—) | (△ 77) | | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 112 | 127 | — | — |
| | (—) | (△ 33) | | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 246 | 65 | 758 | 170 |
| | (—) | (△ 7) | | |
| AIMS APAC REIT | 167 | 223 | — | — |
| | (—) | (△ 9) | | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 56 | 213 | — | — |
| | (—) | (△ 7) | | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 235 | 536 | — | — |
| | (—) | (△ 4) | | |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 317 | 502 | 65 | 99 |
| | (—) | (△ 11) | | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 282 | 173 | 154 | 96 |
| | (—) | (△ 2) | | |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | — | — | 1,306 | 274 |
| | (—) | (△ 3) | | |
| PARAGON REIT | 120 | 108 | — | — |
| KEPPEL DC REIT | 179 | 339 | 78 | 141 |
| | (—) | (△ 16) | | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL | 355 | 426 | — | — |
| | (—) | (△ 17) | | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT | — | — | — | — |
| | (—) | (△0.50412) | | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 126 | 85 | — | — |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | — | — | 246 | 135 |
| | (—) | (△ 12) | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 627 | 1,205 | 202 | 390 |
| | (—) | (△ 9) | | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 473 | 1,319 | 75 | 219 |
| | (—) | (△ 39) | | |
| 小 計 | 6,759 | 8,078 | 4,120 | 2,351 |
| | (—) | (△ 306) | (—) | (1) |
| 韓国 | | 千韓国ウォン | | 千韓国ウォン |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 15 | 98,675 | — | — |
| | | | (—) | (652) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO-RTS | — | — | 5 | 833 |
| | (5) | (652) | | |
| LOTTE REIT CO LTD | 23 | 89,771 | — | — |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 24 | 100,956 | 61 | 243,870 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 22 | 89,421 | — | — |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 19 | 93,129 | 49 | 215,207 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---------------------------|------------------------------|------------|---------|------------|--------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 国 | 韓国 | 千口 | 千韓国ウォン | 千口 | 千韓国ウォン |
| | IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS | — | — | 13 | 1,531 |
| | | (13) | (—) | | |
| | JR REIT XXVII | 23 | 102,685 | — | — |
| | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 21 | 70,004 | — | — |
| | SK REITS CO LTD | 27 | 123,072 | — | — |
| | SK REITS CO LTD-RIGHTS | — | — | — | — |
| | | (13) | (—) | (13) | (363) |
| | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT | — | — | 18 | 57,853 |
| | E KOCREF CR-REIT CO LTD | — | — | 12 | 62,821 |
| 小計 | 176 | 767,715 | 161 | 582,119 | |
| | (32) | (652) | (13) | (1,016) | |
| イスラエル | | 千イスラエルシェケル | | 千イスラエルシェケル | |
| REIT 1 LTD | 19 | 299 | — | — | |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 101 | 170 | — | — | |
| 小計 | 121 | 470 | — | — | |

(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 36,524 | 百万円 38,784 | 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。

○株式売買比率

(2023年1月6日～2024年1月5日)

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 |
|---------------------|----------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 31,045千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | —千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | — |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月6日～2024年1月5日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | 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 21,762 | 百万円 491 | % 2.3 | 百万円 11,838 | 百万円 626 | % 5.3 |

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月5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 | 91 | 107 | 1,436 | 208,289 | 0.2 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 265 | 316 | 6,227 | 903,117 | 0.8 |
| MACERICH CO/THE | 105 | 121 | 1,821 | 264,200 | 0.2 |
| ACADIA REALTY TRUST | 48 | 54 | 920 | 133,422 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 43 | 58 | 3,691 | 535,309 | 0.5 |
| ALEXANDER'S INC | 1 | 1 | 244 | 35,422 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 73 | 90 | 11,381 | 1,650,553 | 1.4 |
| PROLOGIS INC | 456 | 537 | 70,028 | 10,155,461 | 8.7 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 15 | 15 | 28 | 4,164 | 0.0 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 81 | 96 | 513 | 74,447 | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 52 | 61 | 6,028 | 874,199 | 0.8 |
| NNN REIT INC | 88 | 105 | 4,512 | 654,391 | 0.6 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 56 | 67 | 1,705 | 247,319 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 75 | 90 | 2,171 | 314,956 | 0.3 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 105 | 126 | 1,178 | 170,856 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 142 | 176 | 23,203 | 3,364,980 | 2.9 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 21 | 27 | 4,887 | 708,832 | 0.6 |
| EPR PROPERTIES | 36 | 45 | 2,148 | 311,529 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 85 | 108 | 7,536 | 1,092,919 | 0.9 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 32 | 37 | 9,087 | 1,317,854 | 1.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 66 | 122 | 19,264 | 2,793,762 | 2.4 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 35 | 42 | 4,303 | 624,050 | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 64 | 77 | 4,041 | 586,046 | 0.5 |
| GETTY REALTY CORP | 21 | 27 | 795 | 115,378 | 0.1 |
| WELLTOWER INC | 233 | 322 | 28,562 | 4,142,089 | 3.6 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 51 | 63 | 1,448 | 210,089 | 0.2 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 77 | 100 | 838 | 121,661 | 0.1 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 54 | 63 | 1,228 | 178,164 | 0.2 |
| KILROY REALTY CORP | 51 | 62 | 2,465 | 357,580 | 0.3 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 109 | 125 | 2,789 | 404,569 | 0.3 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 134 | 174 | 1,676 | 243,071 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 20 | 24 | 783 | 113,649 | 0.1 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 39 | 47 | 718 | 104,192 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 70 | 83 | 5,764 | 835,908 | 0.7 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 295 | 365 | 1,825 | 264,732 | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 57 | 67 | 8,932 | 1,295,323 | 1.1 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 22 | 24 | 1,326 | 192,379 | 0.2 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 115 | 141 | 4,329 | 627,929 | 0.5 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 9 | 9 | 203 | 29,561 | 0.0 |
| RPT REALTY | 43 | — | — | — | — |

| 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 | % | |
| REALTY INCOME CORP | 310 | 421 | 24,291 | 3,522,723 | 3.0 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 75 | 95 | 6,238 | 904,668 | 0.8 | |
| SAUL CENTERS INC | 6 | 8 | 320 | 46,484 | 0.0 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 94 | 131 | 440 | 63,863 | 0.1 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 31 | 36 | 1,620 | 235,005 | 0.2 | |
| LIFE STORAGE INC | 42 | — | — | — | — | |
| SUN COMMUNITIES INC | 61 | 72 | 9,571 | 1,388,079 | 1.2 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 104 | 113 | 1,233 | 178,827 | 0.2 | |
| TANGER INC | 51 | 62 | 1,696 | 246,011 | 0.2 | |
| CUBESMART | 110 | 130 | 5,950 | 862,934 | 0.7 | |
| UDR INC | 151 | 174 | 6,622 | 960,352 | 0.8 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 5 | 7 | 317 | 46,046 | 0.0 | |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 14 | — | — | — | — | |
| VENTAS INC | 196 | 233 | 11,509 | 1,669,107 | 1.4 | |
| ELME COMMUNITIES | 42 | 51 | 731 | 106,084 | 0.1 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST-A | 12 | — | — | — | — | |
| UMH PROPERTIES INC | 27 | 35 | 523 | 75,877 | 0.1 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 18 | 24 | 321 | 46,581 | 0.0 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 34 | 64 | 171 | 24,884 | 0.0 | |
| CENTERSPACE | 7 | 8 | 493 | 71,618 | 0.1 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 87 | 95 | 1,359 | 197,167 | 0.2 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 64 | 74 | 1,165 | 169,048 | 0.1 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 63 | 73 | 516 | 74,893 | 0.1 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 65 | 78 | 753 | 109,254 | 0.1 | |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 26 | 29 | 670 | 97,261 | 0.1 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 49 | 61 | 407 | 59,107 | 0.1 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 25 | 30 | 204 | 29,716 | 0.0 | |
| RLJ LODGING TRUST | 80 | 95 | 1,106 | 160,498 | 0.1 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 61 | 72 | 995 | 144,349 | 0.1 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 88 | 104 | 4,030 | 584,502 | 0.5 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 112 | 131 | 1,847 | 267,958 | 0.2 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 187 | 227 | 3,865 | 560,566 | 0.5 | |
| WP CAREY INC | 102 | 126 | 8,208 | 1,190,384 | 1.0 | |
| WHITESTONE REIT | 19 | 27 | 330 | 47,978 | 0.0 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 27 | 35 | 3,921 | 568,697 | 0.5 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 22 | 29 | 321 | 46,672 | 0.0 | |
| TERRENO REALTY CORP | 32 | 49 | 3,092 | 448,493 | 0.4 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 69 | 81 | 3,566 | 517,185 | 0.4 | |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 31 | 38 | 465 | 67,567 | 0.1 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 91 | 122 | 6,742 | 977,784 | 0.8 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 114 | 140 | 1,824 | 264,598 | 0.2 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 152 | 184 | 6,584 | 954,916 | 0.8 | |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 25 | 34 | 86 | 12,544 | 0.0 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 68 | 78 | 770 | 111,765 | 0.1 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 147 | 176 | 4,018 | 582,746 | 0.5 | |

| 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 | % | |
| CARETRUST REIT INC | 48 | 71 | 1,569 | 227,556 | 0.2 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES | 127 | 155 | 7,523 | 1,091,130 | 0.9 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 109 | 130 | 1,950 | 282,858 | 0.2 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 142 | 169 | 11,284 | 1,636,528 | 1.4 | |
| STORE CAPITAL CORP | 130 | — | — | — | — | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 58 | 69 | 1,258 | 182,532 | 0.2 | |
| EQUINIX INC | 45 | 54 | 43,380 | 6,291,051 | 5.4 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 86 | 102 | 511 | 74,180 | 0.1 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 45 | 57 | 771 | 111,940 | 0.1 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 56 | 64 | 848 | 123,048 | 0.1 | |
| UNITI GROUP INC | — | 146 | 872 | 126,532 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 42 | 44 | 1,786 | 259,073 | 0.2 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 11 | 13 | 445 | 64,604 | 0.1 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 105 | 127 | 2,148 | 311,639 | 0.3 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 52 | 115 | 1,127 | 163,475 | 0.1 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 18 | 25 | 157 | 22,910 | 0.0 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 40 | 52 | 1,309 | 189,967 | 0.2 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 11 | 14 | 386 | 56,055 | 0.0 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 22 | 29 | 348 | 50,611 | 0.0 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 822 | 1,011 | 78 | 11,436 | 0.0 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 111 | 123 | 1,944 | 282,003 | 0.2 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 168 | 200 | 12,187 | 1,767,384 | 1.5 | |
| INVITATION HOMES INC | 287 | 333 | 11,340 | 1,644,528 | 1.4 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 49 | 51 | 853 | 123,719 | 0.1 | |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 36 | 42 | 778 | 112,961 | 0.1 | |
| CLIPPER REALTY INC | 2 | 11 | 60 | 8,744 | 0.0 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 14 | 18 | 262 | 38,026 | 0.0 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 28 | 36 | 388 | 56,381 | 0.0 | |
| VICI PROPERTIES INC | 476 | 601 | 19,198 | 2,784,199 | 2.4 | |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC | 132 | 153 | 4,536 | 657,827 | 0.6 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 28 | 36 | 167 | 24,312 | 0.0 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 4 | 8 | 151 | 21,961 | 0.0 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | 13 | 17 | 1,635 | 237,230 | 0.2 | |
| SAFEHOLD INC | 12 | — | — | — | — | |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 62 | — | — | — | — | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 70 | 92 | 2,362 | 342,566 | 0.3 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 20 | 20 | 486 | 70,571 | 0.1 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 202 | 202 | — | — | — | |
| PRIME US REIT | 348 | 348 | 76 | 11,115 | 0.0 | |
| NETSTREIT CORP | 25 | 39 | 708 | 102,799 | 0.1 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 384 | 477 | 162 | 23,553 | 0.0 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 85 | 111 | 1,869 | 271,157 | 0.2 | |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 75 | 83 | 2,875 | 416,968 | 0.4 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 9 | 12 | 205 | 29,842 | 0.0 | |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 4 | 8 | 149 | 21,632 | 0.0 | |

| 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 | % | |
| INDUS REALTY TRUST INC | 2 | — | — | — | — | |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 8 | 11 | 167 | 24,306 | 0.0 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 25 | 36 | 203 | 29,545 | 0.0 | |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 177 | 423 | 281 | 40,793 | 0.0 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 57 | 69 | 2,508 | 363,778 | 0.3 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 12 | 15 | 389 | 56,552 | 0.0 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 33 | 39 | 1,012 | 146,871 | 0.1 | |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | 1 | — | — | — | — | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 16 | 16 | 120 | 17,485 | 0.0 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | — | 21 | 380 | 55,123 | 0.0 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | — | 8 | 150 | 21,755 | 0.0 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 351 | 408 | 8,041 | 1,166,112 | 1.0 | |
| SAFEHOLD INC | 38 | 27 | 637 | 92,522 | 0.1 | |
| PUBLIC STORAGE | 78 | 92 | 27,619 | 4,005,388 | 3.4 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 161 | 189 | 26,600 | 3,857,556 | 3.3 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 80 | 93 | 2,596 | 376,493 | 0.3 | |
| KIMCO REALTY CORP | 304 | 384 | 7,996 | 1,159,634 | 1.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 69 | 82 | 15,146 | 2,196,551 | 1.9 | |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 76 | 84 | 656 | 95,216 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 12,803 | 15,558 | 613,636 | 88,989,500 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 146 | 140 | — | < 76.4% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 10 | 13 | 925 | 100,514 | 0.1 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 34 | 41 | 1,051 | 114,243 | 0.1 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 40 | 48 | 2,323 | 252,390 | 0.2 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 12 | 12 | 130 | 14,174 | 0.0 | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 66 | 74 | 737 | 80,103 | 0.1 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 75 | 76 | 1,432 | 155,640 | 0.1 | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 31 | 36 | 727 | 78,995 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 26 | 36 | 250 | 27,203 | 0.0 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 25 | 30 | 418 | 45,416 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 55 | 66 | 347 | 37,708 | 0.0 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 15 | 18 | 1,386 | 150,652 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 34 | 41 | 536 | 58,299 | 0.1 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 63 | 79 | 1,088 | 118,256 | 0.1 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 10 | 10 | 158 | 17,269 | 0.0 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 79 | 92 | 1,299 | 141,161 | 0.1 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 23 | 29 | 435 | 47,329 | 0.0 | |
| SLATE GROCERY REIT-CL U | 14 | 20 | 243 | 26,441 | 0.0 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 30 | 34 | 615 | 66,822 | 0.1 | |
| SLATE OFFICE REIT | 13 | — | — | — | — | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 46 | — | — | — | — | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 29 | 5 | 52 | 5,730 | 0.0 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 12 | 12 | 195 | 21,244 | 0.0 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 53 | 64 | 988 | 107,411 | 0.1 | |

| 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 | | |
| (カナダ) | | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | | 7 | — | — | — | — |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | | 17 | 52 | 155 | 16,848 | 0.0 |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | | 16 | — | — | — | — |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | | 7 | — | — | — | — |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | | 13 | 14 | 120 | 13,089 | 0.0 |
| PRIMARIS REIT | | 25 | 31 | 431 | 46,823 | 0.0 |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | | 13 | 13 | 63 | 6,849 | 0.0 |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | | 8 | 13 | 206 | 22,466 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 913 | 969 | 16,322 | 1,773,087 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 26 | — | < 1.5% > | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 5 | — | — | — | — |
| HAMBORNER REIT AG | | 37 | 43 | 298 | 47,334 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 43 | 43 | 298 | 47,334 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | | 22 | 22 | 52 | 8,290 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 22 | 22 | 52 | 8,290 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| GECINA SA | | 27 | 30 | 3,363 | 534,155 | 0.5 |
| KLEPIERRE | | 96 | 116 | 2,883 | 457,954 | 0.4 |
| COVIVIO | | 22 | 27 | 1,316 | 209,068 | 0.2 |
| MERCIALYS | | 37 | 54 | 549 | 87,307 | 0.1 |
| ICADE | | 16 | 18 | 643 | 102,262 | 0.1 |
| ALTAREA | | 2 | 2 | 223 | 35,520 | 0.0 |
| CARMILA | | 28 | 31 | 503 | 79,994 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | — | 58 | 3,901 | 619,544 | 0.5 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 53 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 284 | 340 | 13,385 | 2,125,807 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | < 1.8% > | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| NSI NV | | 9 | 12 | 245 | 38,944 | 0.0 |
| VASTNED RETAIL NV | | 9 | 6 | 127 | 20,283 | 0.0 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | | 21 | 24 | 557 | 88,515 | 0.1 |
| WERELDHAVE NV | | 18 | 24 | 352 | 55,980 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 59 | 67 | 1,282 | 203,723 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 32 | 32 | 205 | 32,561 | 0.0 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 163 | 194 | 1,919 | 304,905 | 0.3 |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | | 146 | 170 | 1,099 | 174,582 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 343 | 397 | 3,224 | 512,050 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.4% > | |

| 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 | | |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSE | 11 | 17 | 370 | 58,778 | 0.1 | |
| RETAIL ESTATES | 5 | 6 | 440 | 69,919 | 0.1 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 77 | 100 | 2,778 | 441,233 | 0.4 | |
| AEDIFICA | 19 | 28 | 1,790 | 284,411 | 0.2 | |
| MONTEA NV | 5 | 9 | 782 | 124,209 | 0.1 | |
| CARE PROPERTY INVEST | 12 | 16 | 221 | 35,252 | 0.0 | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 12 | 16 | 497 | 79,073 | 0.1 | |
| COFINIMMO | 14 | 21 | 1,492 | 237,036 | 0.2 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 159 | 217 | 8,374 | 1,329,913 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | - | < 1.1% > | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 229 | 229 | 247 | 39,311 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 229 | 229 | 247 | 39,311 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | - | < 0.0% > | |
| (ユーロ…ガーンジー) | | | | | | |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | - | 19 | 819 | 130,155 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | - | 19 | 819 | 130,155 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | - | 1 | - | < 0.1% > | |
| (ユーロ…シンガポール) | | | | | | |
| CROMWELL REIT EUR | 163 | 199 | 281 | 44,672 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 163 | 199 | 281 | 44,672 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | - | < 0.0% > | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,304 | 1,537 | 27,965 | 4,441,258 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 28 | 28 | - | < 3.8% > | |
| (イギリス) | | | 千イギリスポンド | | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 465 | 533 | 2,111 | 388,646 | 0.3 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 122 | 155 | 657 | 121,015 | 0.1 | |
| HAMMERSON PLC | 2,022 | 2,333 | 652 | 120,152 | 0.1 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 372 | 440 | 3,070 | 565,139 | 0.5 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 671 | 742 | 765 | 140,903 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 596 | 711 | 6,144 | 1,130,957 | 1.0 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 65 | 72 | 392 | 72,162 | 0.1 | |
| SHAFTESBURY PLC | 141 | - | - | - | - | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 84 | 112 | 1,313 | 241,785 | 0.2 | |
| DERWENT LONDON PLC | 55 | 63 | 1,464 | 269,644 | 0.2 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 499 | 623 | 1,156 | 212,808 | 0.2 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 101 | 121 | 1,034 | 190,339 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 908 | 1,083 | 1,783 | 328,260 | 0.3 | |
| ASSURA PLC | 1,479 | 1,769 | 847 | 155,981 | 0.1 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 308 | 308 | 136 | 25,166 | 0.0 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 306 | 372 | 354 | 65,264 | 0.1 | |
| REGIONAL REIT LTD | 221 | 125 | 42 | 7,747 | 0.0 | |
| NEWRIVER REIT PLC | 188 | 188 | 158 | 29,187 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 336 | - | - | - | - | |
| UNITE GROUP PLC/THE | 193 | 231 | 2,392 | 440,330 | 0.4 | |

| 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 | | |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリスポンド | 千円 | % | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 184 | 246 | 222 | 40,944 | 0.0 | |
| LXI REIT PLC | 827 | 989 | 1,024 | 188,479 | 0.2 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 464 | 464 | 294 | 54,287 | 0.0 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 175 | 175 | 110 | 20,423 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 276 | 360 | 253 | 46,716 | 0.0 | |
| AEW UK REIT PLC | 55 | 118 | 116 | 21,473 | 0.0 | |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 441 | 1,105 | 1,515 | 279,008 | 0.2 | |
| BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 418 | 417 | 300 | 55,392 | 0.0 | |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 219 | 291 | 252 | 46,557 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 603 | 754 | 649 | 119,498 | 0.1 | |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 168 | 189 | 100 | 18,434 | 0.0 | |
| HOME REIT PLC | 398 | 398 | 151 | 27,929 | 0.0 | |
| PRS REIT PLC/THE | 258 | 310 | 269 | 49,515 | 0.0 | |
| WAREHOUSE REIT PLC | 197 | 260 | 228 | 42,095 | 0.0 | |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT | 100 | — | — | — | — | |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 217 | 260 | 322 | 59,362 | 0.1 | |
| CLS HOLDINGS PLC | 90 | 90 | 90 | 16,664 | 0.0 | |
| HELICAL PLC | — | 60 | 130 | 24,090 | 0.0 | |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | — | 209 | 132 | 24,412 | 0.0 | |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | — | 371 | 324 | 59,726 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 14,239 | 17,066 | 30,970 | 5,700,507 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 37 | 37 | — | < 4.9% > | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | 1,933 | 2,220 | 4,418 | 429,946 | 0.4 | |
| ABACUS GROUP | 196 | 258 | 288 | 28,027 | 0.0 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 185 | 236 | 1,036 | 100,828 | 0.1 | |
| CHARTER HALL GROUP | 233 | 270 | 3,088 | 300,576 | 0.3 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 163 | 195 | 571 | 55,650 | 0.0 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 651 | 821 | 340 | 33,169 | 0.0 | |
| REGION RE LTD | 579 | 703 | 1,532 | 149,171 | 0.1 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 156 | 156 | 372 | 36,286 | 0.0 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 536 | 744 | 1,659 | 161,506 | 0.1 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 256 | 148 | 96 | 9,408 | 0.0 | |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 105 | 114 | 316 | 30,780 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 2,556 | 2,989 | 8,788 | 855,256 | 0.7 | |
| ARENA REIT | 166 | 193 | 696 | 67,727 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 84 | 115 | 322 | 31,365 | 0.0 | |
| WAYPOINT REIT | 338 | 384 | 915 | 89,039 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 323 | 398 | 1,439 | 140,106 | 0.1 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 223 | 223 | 296 | 28,863 | 0.0 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 179 | 228 | 461 | 44,883 | 0.0 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 259 | 327 | 1,043 | 101,509 | 0.1 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 358 | 502 | 829 | 80,750 | 0.1 | |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 786 | 1,044 | 1,258 | 122,511 | 0.1 | |
| DEXUS/AU | 530 | 623 | 4,674 | 454,845 | 0.4 | |

| 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 | | |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | % | |
| HEALTHCO REIT | 103 | 303 | 418 | 40,757 | 0.0 | |
| HMC CAPITAL LTD | 99 | 151 | 862 | 83,948 | 0.1 | |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | 140 | — | — | — | — | |
| ABACUS STORAGE KING | — | 349 | 381 | 37,087 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 944 | 1,092 | 4,885 | 475,417 | 0.4 | |
| MIRVAC GROUP | 1,946 | 2,346 | 4,763 | 463,558 | 0.4 | |
| STOCKLAND | 1,176 | 1,373 | 5,934 | 577,476 | 0.5 | |
| BWP TRUST | 227 | 286 | 979 | 95,351 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 256 | 320 | 1,119 | 108,935 | 0.1 | |
| GOODMAN GROUP | 848 | 1,004 | 24,128 | 2,347,898 | 2.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 16,552 | 20,131 | 77,922 | 7,582,644 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 31 | — | <6.5%> | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 224 | — | — | — | — | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 706 | 876 | 762 | 68,986 | 0.1 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 512 | 596 | 1,347 | 121,851 | 0.1 | |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 672 | 831 | 1,055 | 95,463 | 0.1 | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 451 | 451 | 510 | 46,147 | 0.0 | |
| STRIDE PROPERTY GROUP | 293 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2,860 | 2,755 | 3,675 | 332,448 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 4 | — | <0.3%> | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| LINK REIT | 1,040 | 1,487 | 63,813 | 1,185,021 | 1.0 | |
| CHAMPION REIT | 926 | 1,129 | 2,619 | 48,640 | 0.0 | |
| PROSPERITY REIT | 760 | 760 | 1,056 | 19,617 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 973 | 1,304 | 1,577 | 29,300 | 0.0 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 437 | 635 | 1,365 | 25,352 | 0.0 | |
| FORTUNE REIT | 746 | 855 | 4,146 | 77,005 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,882 | 6,170 | 74,579 | 1,384,937 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 6 | — | <1.2%> | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| SUNTEC REIT | 1,101 | 1,267 | 1,559 | 170,134 | 0.1 | |
| KEPPEL REIT | 988 | 1,267 | 1,172 | 127,956 | 0.1 | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 1,083 | 1,381 | 1,346 | 146,935 | 0.1 | |
| ESR-LOGOS REIT | 2,797 | 3,783 | 1,229 | 134,184 | 0.1 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 380 | 427 | 470 | 51,337 | 0.0 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 527 | 653 | 1,464 | 159,831 | 0.1 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 683 | 704 | 366 | 39,963 | 0.0 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,592 | 1,896 | 3,166 | 345,508 | 0.3 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 591 | 703 | 647 | 70,664 | 0.1 | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 512 | — | — | — | — | |
| AIMS APAC REIT | 243 | 411 | 542 | 59,199 | 0.1 | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 177 | 234 | 861 | 93,965 | 0.1 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 981 | 1,217 | 3,043 | 332,052 | 0.3 | |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 1,141 | 1,393 | 2,117 | 231,079 | 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 | |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 549 | 677 | 450 | 49,140 | 0.0 |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 1,306 | — | — | — | — |
| PARAGON REIT | 599 | 719 | 626 | 68,324 | 0.1 |
| KEPPEL DC REIT | 657 | 758 | 1,440 | 157,196 | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCI | 1,413 | 1,768 | 2,016 | 220,053 | 0.2 |
| EC WORLD REIT | 199 | 199 | 55 | 6,092 | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 272 | 272 | 186 | 20,368 | 0.0 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 880 | 1,007 | 639 | 69,776 | 0.1 |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | 246 | — | — | — | — |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 2,484 | 2,909 | 5,818 | 634,888 | 0.5 |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 1,653 | 2,052 | 6,032 | 658,307 | 0.6 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 23,066 | 25,705 | 35,254 | 3,846,962 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 25 | 22 | — | < 3.3% > |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 28 | 44 | 291,261 | 32,213 | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | 57 | 80 | 254,311 | 28,126 | 0.0 |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 36 | — | — | — | — |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 74 | 96 | 352,364 | 38,971 | 0.0 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 30 | — | — | — | — |
| JR REIT XXVII | 64 | 87 | 365,086 | 40,378 | 0.0 |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 18 | 18 | 95,468 | 10,558 | 0.0 |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | 21 | 42 | 137,172 | 15,171 | 0.0 |
| SK REITS CO LTD | 35 | 62 | 248,522 | 27,486 | 0.0 |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 32 | 32 | 110,008 | 12,166 | 0.0 |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT | 18 | — | — | — | — |
| E KOCREF CR-REIT CO LTD | 12 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 429 | 463 | 1,854,195 | 205,073 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 12 | 8 | — | < 0.2% > |
| (イスラエル) | | | 千イスラエルシェケル | | |
| REIT 1 LTD | 90 | 109 | 1,944 | 77,006 | 0.1 |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 113 | 113 | 981 | 38,881 | 0.0 |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 305 | 406 | 730 | 28,947 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 508 | 629 | 3,657 | 144,835 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.1% > |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 77,560 | 90,988 | — | 114,401,255 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 325 | 305 | — | < 98.2% > |

(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。

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 | DJREIT2403 | 百万円 2,279 | 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

(2024年1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 114,401,255 | % 98.0 |
| コール・ローン等、その他 | 2,348,445 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 116,749,700 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（116,465,577千円）の投資信託財産総額（116,749,700千円）に対する比率は99.8%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=145.02円 | 1 カナダドル=108.63円 | 1 ユーロ=158.81円 | 1 イギリスポンド=184.06円 |
| 1 オーストラリアドル=97.31円 | 1 ニュージーランドドル=90.45円 | 1 香港ドル=18.57円 | 1 シンガポールドル=109.12円 |
| 100韓国ウォン=11.06円 | 1 イスラエルシェケル=39.6025円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 117,039,401,538 |
| コール・ローン等 | 912,696,203 |
| 投資証券(評価額) | 114,401,255,608 |
| 未収入金 | 290,073,979 |
| 未収配当金 | 474,174,156 |
| 差入委託証拠金 | 961,201,592 |
| (B) 負債 | 581,907,638 |
| 未払金 | 312,596,566 |
| 未払解約金 | 269,311,013 |
| 未払利息 | 59 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 116,457,493,900 |
| 元本 | 45,483,654,763 |
| 次期繰越損益金 | 70,973,839,137 |
| (D) 受益権総口数 | 45,483,654,763口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,604円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 40,515,017,562円
 期中追加設定元本額 10,954,954,792円
 期中一部解約元本額 5,986,317,591円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.5604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)

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 11,589,964,172円 |
| eMAXIS Slim 先進国リートインデックス | 10,007,487,864円 |
| eMAXIS 先進国リートインデックス | 5,993,296,223円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,653,815,055円 |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 3,277,288,724円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,342,855,681円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 1,567,691,742円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート | 872,874,739円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 777,967,410円 |
| 海外リートインデックスファンドS | 718,073,904円 |
| 三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 597,167,019円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 416,597,800円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 340,589,407円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 300,321,949円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 210,585,598円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 134,919,872円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 106,730,421円 |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド | 97,044,067円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 93,127,745円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 92,580,986円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 64,670,216円 |

○損益の状況 (2023年1月6日~2024年1月5日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 4,276,769,053 |
| 受取配当金 | 4,166,855,325 |
| 受取利息 | 107,934,343 |
| その他収益金 | 2,043,783 |
| 支払利息 | △ 64,398 |
| (B) 有価証券売買損益 | 15,121,913,208 |
| 売買益 | 19,312,572,076 |
| 売買損 | △ 4,190,658,868 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 307,082,062 |
| 取引益 | 761,589,526 |
| 取引損 | △ 1,068,671,588 |
| (D) 保管費用等 | △ 62,772,041 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 19,028,828,158 |
| (F) 前期繰越損益金 | 46,669,776,550 |
| (G) 追加信託差損益金 | 13,560,108,908 |
| (H) 解約差損益金 | △ 8,284,874,479 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 70,973,839,137 |
| 次期繰越損益金(I) | 70,973,839,137 |

- (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。

| | |
|-------------------------------|-----------------|
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 56,346,040円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (バランス型) | 54,285,579円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 34,400,995円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (分配型) | 29,997,986円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (株式重視型) | 24,888,416円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 17,980,892円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 3,944,730円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,074,028円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,591,598円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,039,197円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート (為替ヘッジあり) | 303,033円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 151,675円 |
| 合計 | 45,483,654,763円 |

[お 知 ら せ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)