

運用報告書 (全体版)

第3期<決算日2019年10月15日>

たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>

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 | 2017年3月21日から無期限です。 | |
| 運用方針 | S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円ベース、配当込み、為替ヘッジあり) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり> | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券*を主要投資対象とします。 *海外の証券取引所に上場 (これに準ずるものを含みます。) されている不動産投資信託証券とします。 |
| 運用方法 | マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。 | |
| 組入制限 | マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 | |
| 分配方針 | 決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益 (マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額 (以下「みなし配当等収益」といいます。)) を含みます。) および売買益 (評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額) 等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 | |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>」は、2019年10月15日に第3期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>

■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 (除く日本、円ベース、 配当込み、為替ヘッジあり) | | 投資信託 受益証券 組入比率 | 純資産額 |
|---------------------|-------------|-------------------|------------------|--|--------|----------------------|----------|
| | (分配落) | 税金 込 分 配 | み 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | | |
| (設定日) 2017年3月21日 | 円 10,000 | 円 - | % - | ポイント (3月17日) 522.30 | % - | % - | 百万円 5 |
| 1期(2017年10月12日) | 10,387 | 0 | 3.9 | 545.30 | 4.4 | 98.9 | 114 |
| 2期(2018年10月12日) | 9,994 | 0 | △3.8 | 530.51 | △2.7 | 86.2 | 160 |
| 3期(2019年10月15日) | 11,875 | 0 | 18.8 | 636.30 | 19.9 | 100.0 | 237 |

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

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) ベンチマークはS&P 先進国 REITインデックス (除く日本、円ベース、配当込み、為替ヘッジあり) です (以下同じ)。

(注4) S&P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社 (「SPDJ」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシズLLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC (「Dow Jones」) の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各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、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P 先進国 REITインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

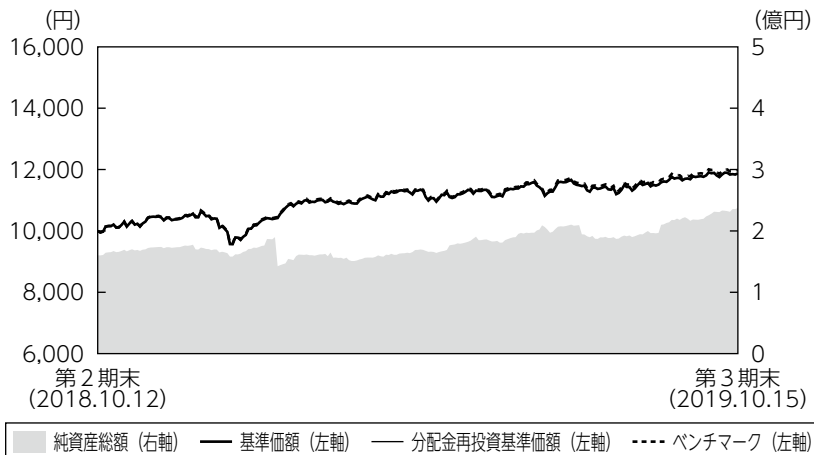
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先進国 REIT インデックス (除 く 日 本 、 円 ベ ー ス 、 配 当 込 み 、 為 替 ヘ ッ ジ あ り) (ベンチマーク) | | 投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率 |
|---------------------------|------------|--------|---|--------|-------------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2018 年 10 月 12 日 | 円 9,994 | % - | ポ ン ト 530.51 | % - | % 86.2 |
| 10 月 末 | 10,317 | 3.2 | 548.15 | 3.3 | 98.7 |
| 11 月 末 | 10,474 | 4.8 | 557.46 | 5.1 | 100.1 |
| 12 月 末 | 9,780 | △2.1 | 520.65 | △1.9 | 92.9 |
| 2019 年 1 月 末 | 10,831 | 8.4 | 576.78 | 8.7 | 101.0 |
| 2 月 末 | 10,884 | 8.9 | 579.75 | 9.3 | 101.1 |
| 3 月 末 | 11,285 | 12.9 | 601.03 | 13.3 | 99.0 |
| 4 月 末 | 11,167 | 11.7 | 594.87 | 12.1 | 100.4 |
| 5 月 末 | 11,102 | 11.1 | 591.74 | 11.5 | 98.1 |
| 6 月 末 | 11,229 | 12.4 | 598.68 | 12.9 | 98.5 |
| 7 月 末 | 11,445 | 14.5 | 611.24 | 15.2 | 99.9 |
| 8 月 末 | 11,584 | 15.9 | 619.64 | 16.8 | 97.5 |
| 9 月 末 | 11,880 | 18.9 | 636.21 | 19.9 | 101.1 |
| (期 末) 2019 年 10 月 15 日 | 11,875 | 18.8 | 636.30 | 19.9 | 100.0 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

■当期の運用経過（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

基準価額等の推移



第3期首： 9,994円
第3期末： 11,875円
(既払分配金0円)
騰落率： 18.8%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

米国やイギリスなどの主要国を含め多くの国のリート市場が二桁の上昇率を記録したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は、底堅い業績発表や長期金利の低下などを背景に堅調に推移しました。2018年12月に、長期金利の上昇が嫌気され下落する場面もありましたが、前期末比では上昇しました。欧州リート市場は、低金利環境の長期化への期待などを受け各市場で概ね上昇しました。豪州リート市場についても、長期金利の低下や豪州経済への期待などから堅調な推移となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持しました。また、実質的な組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行いました。

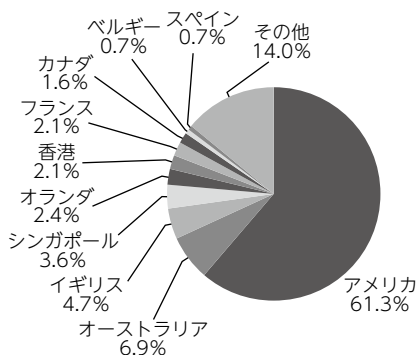
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

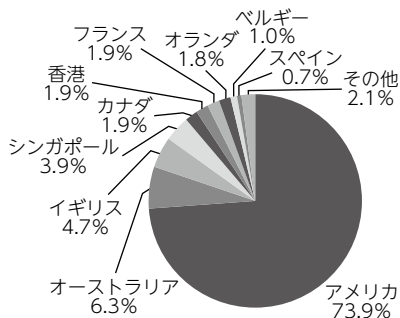
【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○国別配分

期首（前期末）



期末



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

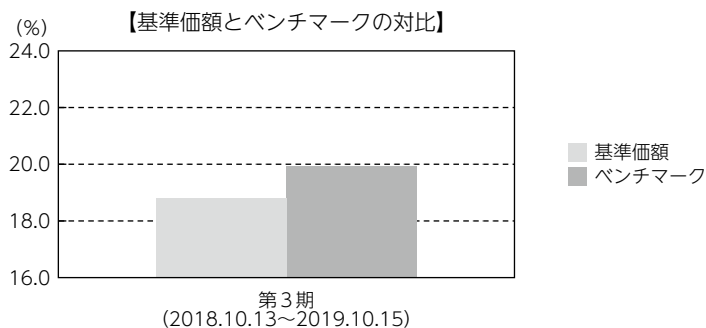
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。また、発行国（地域）を表示しています。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で19.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.1%下回り、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、信託報酬、配当課税の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|-----------------------------|
| | 2018年10月13日 ～2019年10月15日 |
| 当期分配金（税引前） | －円 |
| 対基準価額比率 | －% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,874円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。また、実質的な組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行います。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第3期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------------------------------|----------|--|
| | (2018年10月13日 ～2019年10月15日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 42円 | 0.381% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,020円です。 |
| (投信会社) | (19) | (0.169) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (19) | (0.169) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | (5) | (0.044) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 3 | 0.025 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.003) | |
| (投資証券) | (2) | (0.022) | |
| (c) 有価証券取引税 | 8 | 0.073 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (投資信託受益証券) | (1) | (0.005) | |
| (投資証券) | (8) | (0.068) | |
| (d) その他費用 | 6 | 0.058 | (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) | (6) | (0.056) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (監査費用) | (0) | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (△0) | (△0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用、支払外国税の戻入等 |
| 合計 | 59 | 0.537 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

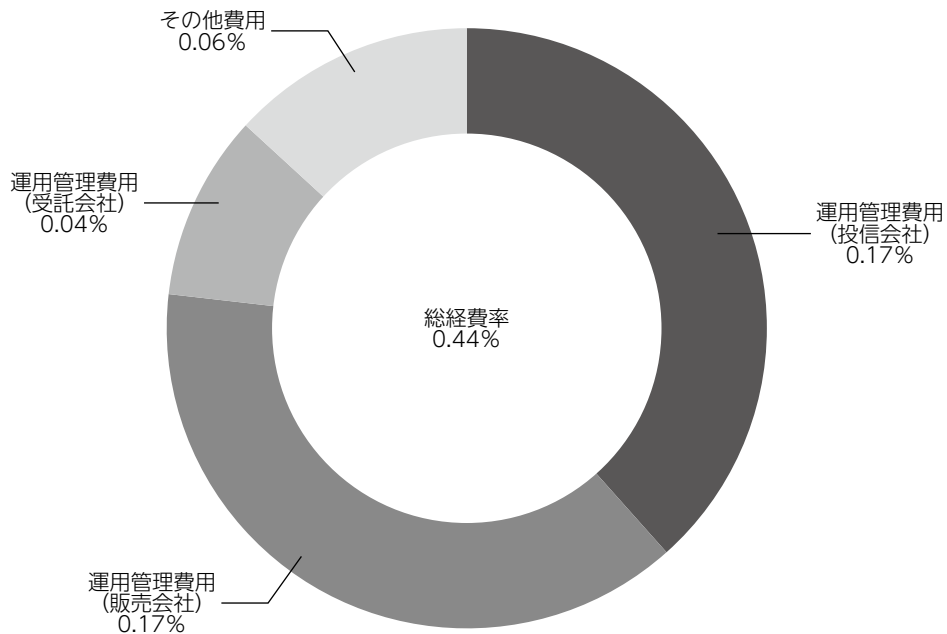
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.44%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 千□ 161,360 | 千円 205,675 | 千□ 121,129 | 千円 152,762 |

■利害関係人との取引状況等（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

親投資信託残高

| | 期首 (前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 千□ 134,698 | 千□ 174,929 | 千円 239,216 |

■投資信託財産の構成

2019年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 239,216 | 99.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 476 | 0.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 239,692 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2019年10月15日現在、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは39,654,032千円、74.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.42円、1カナダ・ドル=81.96円、1オーストラリア・ドル=73.42円、1香港・ドル=13.82円、1シンガポール・ドル=79.23円、1ニュージーランド・ドル=68.33円、1イギリス・ポンド=136.63円、1イスラエル・シケル=30.86円、100韓国・ウォン=9.16円、1ユーロ=119.53円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年10月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 477,363,724円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 458,841 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 239,216,260 |
| 未 収 入 金 | 237,688,623 |
| (B) 負 債 | 239,986,536 |
| 未 払 金 | 239,541,520 |
| 未 払 解 約 金 | 62,101 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 379,302 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 3,613 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 237,377,188 |
| 元 本 | 199,898,449 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 37,478,739 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 199,898,449口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 11,875円 |

(注) 期首における元本額は160,162,956円、当期中における追加設定元本額は222,394,636円、同解約元本額は182,659,143円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月13日 至2019年10月15日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △573円 |
| 受 取 利 息 | 268 |
| 支 払 利 息 | △841 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 18,505,819 |
| 売 買 益 損 | 43,069,161 |
| 買 入 損 益 | △24,563,342 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △695,836 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 17,809,410 |
| (E) 当 期 繰 越 損 益 金 | △1,412,664 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 21,081,993 |
| (配 当 等 相 当 額) | (9,719,005) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (11,362,988) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 37,478,739 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 37,478,739 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 21,081,993 |
| (配 当 等 相 当 額) | (10,091,790) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (10,990,203) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 16,396,746 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 6,958,853円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 6,798,874 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 21,081,993 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 2,639,019 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 37,478,739 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 1,874.89 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第12期（決算日 2019年6月24日）

（対象期間 2018年6月23日～2019年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2007年4月11日から無期限です。 |
| 運用方針 | S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各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 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 |

■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、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|--------|------|--|------|-------------------------------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| 8期(2015年6月22日) | 11,550 | 27.0 | 113,473.63 | 27.7 | 99.5 | 百万円 26,943 |
| 9期(2016年6月22日) | 10,906 | △5.6 | 108,051.29 | △4.8 | 99.6 | 32,918 |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9 | 117,262.55 | 8.5 | 99.7 | 43,023 |
| 11期(2018年6月22日) | 11,979 | 1.8 | 120,101.82 | 2.4 | 99.3 | 53,148 |
| 12期(2019年6月24日) | 13,060 | 9.0 | 131,885.51 | 9.8 | 99.2 | 47,410 |

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注2）S & P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S & P、それらの各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、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REITインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

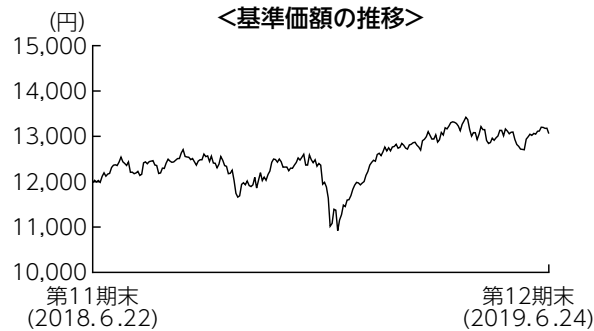
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | 期 騰 落 中 騰 落 率 | 投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率 |
|--------------------------|---------|--------|--|------------------|---|
| | 円 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2018 年 6 月 22 日 | 11,979 | % - | ポ イ ン ト 120,101.82 | % - | % 99.3 |
| 6 月 末 | 12,118 | 1.2 | 121,653.84 | 1.3 | 99.2 |
| 7 月 末 | 12,163 | 1.5 | 122,169.90 | 1.7 | 99.5 |
| 8 月 末 | 12,556 | 4.8 | 126,198.03 | 5.1 | 98.8 |
| 9 月 末 | 12,385 | 3.4 | 124,660.21 | 3.8 | 99.3 |
| 10 月 末 | 12,199 | 1.8 | 122,854.06 | 2.3 | 99.2 |
| 11 月 末 | 12,478 | 4.2 | 125,696.31 | 4.7 | 99.4 |
| 12 月 末 | 11,371 | △5.1 | 114,497.86 | △4.7 | 95.2 |
| 2019 年 1 月 末 | 12,425 | 3.7 | 125,279.31 | 4.3 | 99.5 |
| 2 月 末 | 12,719 | 6.2 | 128,472.03 | 7.0 | 99.5 |
| 3 月 末 | 13,189 | 10.1 | 133,215.20 | 10.9 | 99.0 |
| 4 月 末 | 13,149 | 9.8 | 132,848.94 | 10.6 | 99.6 |
| 5 月 末 | 12,780 | 6.7 | 129,142.44 | 7.5 | 99.6 |
| (期 末) 2019 年 6 月 24 日 | 13,060 | 9.0 | 131,885.51 | 9.8 | 99.2 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2018年6月23日から2019年6月24日まで）

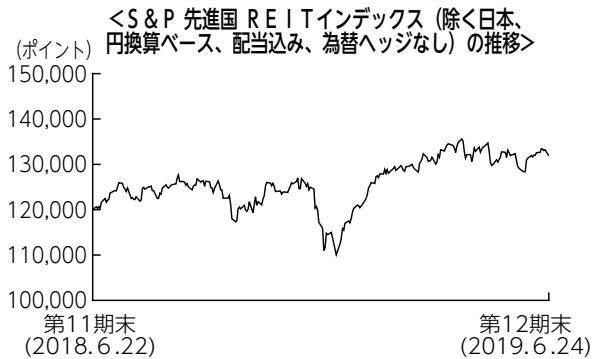


基準価額の推移

当期末の基準価額は13,060円となり、前期末に比べ9.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドで組入れている全ての通貨に対して円高となったことはマイナスに寄与したものの、世界的に金利の低下観測が広がった結果、米国やオーストラリアなど多くのリート市場が上昇し、基準価額は上昇しました。



投資環境

米国リート市場は、米中通商問題の深刻化や米国長期金利の上昇局面には下落する場面もありましたが、期を通じては長期金利の低下傾向やF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締め姿勢からの転換を背景に上昇しました。欧州リート市場では、政治的な不透明感が高まったフランスや英国などが下落しました。オーストラリアリート市場は、オーストラリア長期金利の低下基調を背景に力強く上昇しました。

為替市場では、2018年の年末にかけて、米中通商問題や世界経済の減速懸念などから安全資産とされる

円が買われ、円高が進む展開となりました。2019年1月に米中通商問題の進展期待などから米ドルが買われ、米ドル高円安方向へと反転したものの、4月後半以降は米国の金利低下観測などから米ドル安円高となりました。ユーロは欧州経済の減速や、イタリアの財政悪化に対する懸念などから弱含む展開となり、ユーロ安円高となりました。豪ドルに対しても円高が進みました。

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、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で9.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 3円 | 0.025% |
| (株 式) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (1) | (0.004) |
| (投 資 証 券) | (3) | (0.020) |
| (b) 有価証券取引税 | 7 | 0.059 |
| (株 式) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.003) |
| (投 資 証 券) | (7) | (0.056) |
| (c) その他費用 | 13 | 0.108 |
| (保 管 費 用) | (7) | (0.055) |
| (そ の 他) | (7) | (0.052) |
| 合 計 | 24 | 0.191 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(12,500円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については6ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------|----------|----------|--------|----------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外国 | | 百株 | 千アメリカ・ドル | 百株 | 千アメリカ・ドル |
| | ア メ リ カ | (939.19) | (1,331) | 939.19 | 1,846 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 51.516 | 6,602 | 54.92 | 7,017 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.909 | 644 | 2.109 | 721 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 69.446 | 8,705 | 79.741 | 9,892 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 28.857 | 111 | 34.991 | 131 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 94.892 | 3,345 | 106.311 | 3,648 |
| | (2.152) | (73) | (-) | (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 73.746 | 3,391 | 86.508 | 3,935 |
| | (△1.902) | (-) | (-) | (-) |
| AGREE REALTY CORP | 15.822 | 958 | 15.848 | 934 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRT APARTMENTS CORP | 6.485 | 75 | 3.672 | 43 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SL GREEN | 38.987 | 3,601 | 46.27 | 4,211 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| EPR PROPERTIES | 36.696 (-) | 2,589 (-) | 37.75 (-) | 2,650 (-) |
| PROLOGIS INC | 270.614 (38,097) | 18,158 (-) | 312.238 (-) | 20,970 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 62.176 (-) | 11,494 (-) | 71.282 (-) | 13,104 (-) |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 90.68 (-) | 789 (-) | 105.782 (-) | 901 (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 43.075 (-) | 4,047 (-) | 47.892 (-) | 4,480 (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 85.442 (-) | 213 (-) | 110.449 (-) | 266 (-) |
| MACK CALI | 43.703 (-) | 916 (-) | 50.278 (-) | 1,058 (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 72.133 (-) | 3,530 (-) | 80.15 (-) | 3,844 (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 192.222 (△95.762) | 1,693 (-) | 222.783 (-) | 1,959 (-) |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 20.928 (△33.49) | 710 (-) | 33.896 (-) | 1,130 (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 10.337 (-) | 217 (-) | 11.376 (-) | 238 (-) |
| SITE CENTERS CORP | 62.071 (-) | 804 (-) | 76.856 (-) | 999 (-) |
| ISTAR INC | 1.455 (-) | 15 (-) | 29.85 (-) | 333 (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 162.249 (-) | 4,622 (-) | 185.327 (-) | 5,270 (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 15.635 (-) | 85 (-) | 29.663 (-) | 177 (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 29.876 (-) | 7,700 (-) | 34.406 (-) | 8,829 (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 165.741 (-) | 11,471 (-) | 190.111 (-) | 13,025 (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 33.211 (-) | 4,234 (-) | 37.721 (-) | 4,748 (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 57.032 (-) | 1,828 (-) | 65.302 (-) | 2,086 (-) |
| GGP INC | 29.411 (-) | 616 (△1,331) | 296.261 (-) | 1,052 (-) |
| HCP INC | 216.819 (-) | 6,247 (-) | 245.408 (-) | 6,834 (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 54.381 (-) | 1,702 (-) | 62.791 (-) | 1,938 (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 55.449 (-) | 1,677 (-) | 64.426 (-) | 1,897 (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 49.393 (-) | 2,198 (-) | 56.792 (-) | 2,548 (-) |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 70.873 (-) | 1,886 (-) | 82.804 (-) | 2,191 (-) |
| WELLTOWER INC | 172.408 (-) | 12,327 (-) | 192.047 (-) | 13,223 (-) |
| EAST GROUP | 16.855 (-) | 1,691 (-) | 18.78 (-) | 1,871 (-) |
| KIMCO REALTY | 194.856 (-) | 3,226 (-) | 225.334 (-) | 3,685 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-----------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| KILROY REALTY CORP | 46.475 | 3,288 | 52.409 | 3,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LTC PROPERTIES INC | 18.779 | 833 | 21.004 | 924 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST | 101.848 | 1,394 | 119.626 | 1,621 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 38.01 | 555 | 36.722 | 546 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 68.047 | 3,035 | 78.212 | 3,451 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 77.488 | 1,146 | 89.924 | 1,334 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 129.031 | 4,352 | 146.371 | 4,796 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 49.035 | 2,362 | 57.847 | 2,788 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 40.885 | 4,165 | 46.185 | 4,651 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 34.42 | 950 | 40.229 | 1,106 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 339.44 | 6,423 | 389.543 | 7,504 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 51.864 | 5,292 | 59.502 | 6,047 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 11.412 | 202 | 13.291 | 254 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 19.319 | 1,500 | 21.953 | 1,651 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 18.845 | 234 | 30.513 | 257 |
| | (△33.797) | (-) | (-) | (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 5.087 | 135 | 7.385 | 195 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 32.609 | 273 | 44.52 | 363 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GETTY REALTY CORP | 14.456 | 425 | 15.166 | 445 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 8.613 | 1,201 | 10.055 | 1,372 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RPT REALTY | 34.058 | 446 | 40.201 | 524 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 135.852 | 8,640 | 147.998 | 9,179 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 83.618 | 5,314 | 86.319 | 5,453 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 126.173 | 5,190 | 141.55 | 5,776 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 41.911 | 1,109 | 46.256 | 1,253 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORECIVIC INC | 47.876 | 1,033 | 56.529 | 1,230 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAUL CENTERS INC | 5.197 | 272 | 5.818 | 310 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 138.155 | 24,451 | 160.362 | 28,042 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIFE STORAGE INC | 19.507 | 1,864 | 22.845 | 2,155 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| PUBLIC STORAGE | 67.783 (-) | 14,402 (-) | 78.32 (-) | 16,545 (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 41.357 (-) | 4,411 (-) | 44.529 (-) | 4,721 (-) |
| TAUBMAN CENTERS INC | 27.742 (-) | 1,457 (-) | 32.194 (-) | 1,694 (-) |
| TANGER FACTORY OUTLET | 39.061 (-) | 847 (-) | 46.467 (-) | 992 (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 12.627 (-) | 168 (-) | 14.076 (-) | 193 (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 9.842 (-) | 195 (-) | 11.279 (-) | 218 (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 4.471 (-) | 312 (-) | 5.022 (-) | 360 (-) |
| VENTAS INC | 160.455 (-) | 9,696 (-) | 184.264 (-) | 10,839 (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 79.398 (-) | 5,462 (-) | 91.041 (-) | 6,222 (-) |
| WASHINGTON REIT | 34.047 (-) | 919 (-) | 39.493 (-) | 1,099 (-) |
| GEO GROUP INC | 55.736 (-) | 1,262 (-) | 65.134 (-) | 1,472 (-) |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 53.776 (-) | 1,539 (-) | 62.494 (-) | 1,781 (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 60.197 (-) | 2,596 (-) | 68.994 (-) | 2,953 (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 36.187 (-) | 580 (-) | 40.688 (-) | 645 (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 56.934 (-) | 5,390 (-) | 65.076 (-) | 6,129 (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 32.657 (-) | 238 (-) | 36.853 (-) | 277 (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 92.764 (-) | 1,363 (-) | 108.365 (-) | 1,607 (-) |
| CUBESMART | 83.044 (-) | 2,522 (-) | 93.599 (-) | 2,820 (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 91.946 (-) | 10,374 (-) | 105.056 (-) | 11,808 (-) |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 7.995 (-) | 331 (-) | 40.156 (-) | 1,665 (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 92.217 (-) | 970 (-) | 103.416 (-) | 1,104 (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 163.601 (-) | 2,711 (-) | 181.805 (-) | 2,889 (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 72.261 (-) | 2,707 (-) | 81.928 (-) | 3,092 (-) |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 3.449 (△37.35) | 227 (-) | 5.841 (-) | 386 (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 48.701 (-) | 862 (-) | 54.561 (-) | 967 (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 54.775 (-) | 1,047 (-) | 65.251 (-) | 1,246 (-) |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 45.395 (-) | 526 (-) | 50.84 (-) | 611 (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 26.463 (-) | 1,042 (-) | 28.614 (-) | 1,112 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 18.468 (-) | 756 (-) | 22.929 (-) | 918 (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 69.766 (-) | 1,344 (-) | 82.493 (-) | 1,603 (-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 87.163 (-) | 2,590 (-) | 42.141 (-) | 1,190 (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 16.562 (-) | 1,712 (-) | 18.189 (-) | 1,878 (-) |
| VEREIT INC | 433.716 (-) | 3,384 (-) | 499.279 (-) | 3,806 (-) |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 27.449 (-) | 800 (-) | 31.85 (-) | 941 (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 35.91 (30.81) | 1,132 (-) | 50.164 (-) | 1,641 (-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 25.099 (△14.934) | 435 (275) | 34.446 (-) | 460 (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 19.218 (-) | 315 (-) | 18.992 (-) | 308 (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 18.943 (-) | 379 (-) | 21.062 (-) | 421 (-) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 76.051 (-) | 1,533 (-) | 89.1 (-) | 1,790 (-) |
| WHITESTONE REIT | 11.785 (-) | 159 (-) | 14.266 (-) | 187 (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 67.412 (-) | 2,143 (-) | 78.979 (-) | 2,526 (-) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 49.711 (-) | 1,368 (-) | 46.981 (-) | 1,269 (-) |
| SELECT INCOME REIT | 17.842 (△30.041) | 358 (△275) | 15.153 (-) | 303 (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 82.921 (-) | 1,006 (-) | 100.523 (-) | 1,201 (-) |
| CYRUSONE INC | 47.651 (-) | 2,745 (-) | 51.267 (-) | 2,962 (-) |
| WP CAREY INC | 88.533 (-) | 6,276 (-) | 73.747 (-) | 5,184 (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 6.716 (-) | 159 (-) | 35.458 (-) | 806 (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 4.885 (-) | 61 (-) | 6.282 (-) | 75 (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 88.972 (-) | 2,415 (-) | 103.593 (-) | 2,774 (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 23.653 (-) | 1,864 (-) | 27.331 (-) | 2,167 (-) |
| WHEELER REIT INC | 3.005 (-) | 14 (-) | 5.966 (-) | 23 (-) |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 31.774 (-) | 356 (-) | 13.019 (-) | 132 (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 2.17 (-) | 33 (-) | 21.357 (-) | 310 (-) |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 10.242 (-) | 280 (-) | 78.4 (-) | 2,154 (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 102.812 (△114.402) | 1,395 (-) | 138.549 (-) | 1,607 (-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 74.371 (-) | 1,277 (-) | 86.48 (-) | 1,455 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|--------------------|--------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 46.596 (-) | 1,566 (-) | 44.125 (-) | 1,465 (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 116.839 (-) | 2,536 (-) | 134.902 (-) | 2,907 (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 31.335 (-) | 318 (-) | 34.041 (-) | 343 (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 6.242 (-) | 334 (-) | 2.548 (-) | 162 (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 51.021 (-) | 1,957 (-) | 48.676 (-) | 1,864 (-) |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 26.656 (-) | 345 (-) | 6.054 (-) | 61 (-) |
| RETAIL VALUE INC | 3.809 (6.384) | 117 (4) | 4.277 (-) | 131 (-) |
| INVITATION HOMES INC | 155.931 (-) | 3,584 (-) | 141.784 (-) | 3,172 (-) |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 7.702 (△9.16) | 72 (△92) | 11.685 (-) | 106 (-) |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 52.941 (-) | 1,308 (-) | 166.076 (-) | 4,168 (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 22.055 (-) | 925 (-) | 24.285 (-) | 992 (-) |
| SPIRIT MTA REIT | 6.315 (-) | 57 (-) | 9.466 (-) | 85 (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 54.236 (-) | 850 (-) | 61.314 (-) | 959 (-) |
| SAFEHOLD INC | 6.107 (-) | 111 (-) | 3.363 (-) | 56 (-) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 26.062 (-) | 435 (-) | 8.327 (-) | 158 (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 12.934 (15.095) | 255 (-) | 12.233 (-) | 247 (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 43.876 (-) | 946 (-) | 52.732 (-) | 1,136 (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 90.403 (-) | 3,218 (-) | 103.396 (-) | 3,681 (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 130.176 (-) | 2,165 (-) | 152.641 (-) | 2,521 (-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8.292 (-) | 82 (-) | 13.258 (-) | 140 (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 49.906 (-) | 993 (-) | 16.528 (-) | 331 (-) |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 3.807 (-) | 39 (-) | 6.214 (-) | 61 (-) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 8.074 (-) | 55 (-) | 12.967 (-) | 77 (-) |
| CITY OFFICE REIT INC | 11.401 (-) | 130 (-) | 10.54 (-) | 119 (-) |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 78.797 (-) | 477 (-) | 87.457 (-) | 527 (-) |
| CARETRUST REIT INC | 41.653 (-) | 862 (-) | 40.995 (-) | 823 (-) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 18.156 (-) | 101 (-) | 21.104 (-) | 119 (-) |
| STORE CAPITAL CORP | 81.675 (-) | 2,488 (-) | 83.58 (-) | 2,497 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------------|-----------|------------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| PARAMOUNT GROUP INC | 75.42 | 1,067 | 91.771 | 1,299 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 8.43 | 81 | 9.372 | 90 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 52.551 | 1,037 | 53.423 | 1,045 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INFREIT INC | 12.483 | 261 | 28.615 | 602 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 29.853 | 549 | 23.175 | 419 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 40.549 | 823 | 46.325 | 985 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 5.796 | 212 | 5.556 | 200 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 24.672 | 683 | 26.347 | 716 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 4.323 | 145 | 4.537 | 141 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 84.215 | 1,351 | 99.901 | 1,617 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 35.862 | 713 | 35.307 | 692 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TIER REIT INC | 21.709 | 511 | 21.964 | 525 |
| | (△20.073) | (-) | (-) | (-) |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC | - | - | 39.836 | 826 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MANULIFE US REIT | 544.2 | 449 | 599.2 | 482 |
| | (-) | (△12) | (-) | (-) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 83.394 | 2,489 | 97.853 | 2,948 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 207.696 | 4,456 | 80.417 | 1,709 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 15.23 | 249 | 17.937 | 273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 9.588 | 378 | 10.272 | 423 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 26.462 | 714 | 27.36 | 727 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLONY CAPITAL INC | 183.257 | 1,039 | 220.405 | 1,213 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 28.769 | 917 | 32.456 | 1,016 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 31.269 | 1,458 | 34.809 | 1,608 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MORGUARD REAL ESTATE INVNT TR | 1.872 | 23 | 11.888 | 145 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 63.055 | 1,340 | 74.795 | 1,561 |
| | (-) | (△0.00021) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 74.559 | 1,857 | 87.619 | 2,168 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 21.435 | 964 | 22.484 | 999 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 43.668 | 520 | 51.892 | 605 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 14.715 | 343 | 17.361 | 405 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 13.732 | 357 | 13.305 | 347 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 9.999 | 433 | 12.044 | 521 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 33.972 | 363 | 39.625 | 427 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 21.802 | 295 | 22.991 | 304 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 21.662 | 275 | 21.914 | 268 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.331 | 316 | 27.451 | 301 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 5.315 | 92 | 6.065 | 101 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 44.11 | 597 | 48.142 | 656 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 16.637 | 184 | 8.155 | 86 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT | 1.817 | 24 | 8.847 | 121 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 34.28 | 393 | 32.393 | 371 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8.269 | 475 | 9.657 | 541 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 17.602 | 116 | 7.137 | 45 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 60.2 | 758 | 65.242 | 811 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.287 | 139 | 2.25 | 43 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 20.46 | 258 | 16.695 | 212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SLATE RETAIL REIT | - | - | 1.333 | 16 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILLAM APARTMENT REIT | 14.397 | 244 | 12.805 | 214 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 242.529 | 854 | 281.491 | 965 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MIRVAC GROUP | 1,707.557 | 4,235 | 1,871.957 | 4,516 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTA OFFICE FUND | 100.574 | 553 | 312.012 | 1,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 792.327 | 843 | 858.175 | 919 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 194.63 | 859 | 210.659 | 911 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GPT GROUP | 815.73 | 4,457 | 944.51 | 5,031 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 121.863 | 423 | 138.637 | 471 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 70.981 | 233 | 63.558 | 200 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|------------------|----------------|------------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| STOCKLAND | 1,134.738 (-) | 4,452 (-) | 1,295.009 (-) | 4,980 (-) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 105.055 (-) | 316 (-) | 110.745 (-) | 332 (-) |
| DEXUS | 474.812 (-) | 5,255 (-) | 520.639 (-) | 5,654 (-) |
| GOODMAN GROUP | 736.22 (-) | 8,330 (-) | 844.47 (-) | 9,396 (-) |
| VICINITY CENTRES | 1,388.558 (-) | 3,692 (-) | 1,620.371 (-) | 4,201 (-) |
| CHARTER HALL GROUP | 204.429 (-) | 1,599 (-) | 238.778 (-) | 1,840 (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 120.316 (-) | 457 (-) | 124.733 (-) | 473 (-) |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 357.474 (-) | 919 (-) | 350.961 (-) | 875 (-) |
| ARENA REIT | 82.031 (-) | 206 (-) | 83.801 (-) | 205 (-) |
| PROPERTYLINK GROUP | 85.162 (-) | 95 (-) | 236.384 (-) | 273 (-) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 72.038 (-) | 317 (-) | 66.989 (-) | 289 (-) |
| APN INDUSTRIA REIT | 10.177 (-) | 28 (-) | 13.842 (-) | 35 (-) |
| NATIONAL STORAGE REIT | 232.204 (-) | 400 (-) | 212.63 (-) | 359 (-) |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 24.928 (-) | 83 (-) | 35.314 (-) | 110 (-) |
| GDI PROPERTY GROUP | 116.482 (-) | 150 (-) | 164.948 (-) | 215 (-) |
| RURAL FUNDS GROUP | 132.102 (-) | 291 (-) | 131.091 (-) | 286 (-) |
| SCENTRE GROUP | 2,387.236 (-) | 9,609 (-) | 2,758.491 (-) | 10,773 (-) |
| VIVA ENERGY REIT | 137.23 (-) | 321 (-) | 164.432 (-) | 372 (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 954.5 (-) | 77,547 (-) | 1,116.5 (-) | 88,799 (-) |
| PROSPERITY REIT | 475 (-) | 1,505 (-) | 535 (-) | 1,673 (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 647 (-) | 3,348 (-) | 658 (-) | 3,335 (-) |
| CHAMPION REIT | 683 (-) | 3,963 (-) | 863 (-) | 4,929 (-) |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 493 (-) | 2,629 (-) | 512 (-) | 2,656 (-) |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK) | 467 (-) | 4,332 (-) | 578 (-) | 5,320 (-) |
| SPRING REIT | - (-) | - (-) | 351 (-) | 1,129 (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND MALL TRUST | 1,392.6 (-) | 3,168 (-) | 1,527.5 (-) | 3,427 (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 1,307.3 (-) | 3,540 (△16) | 1,409.9 (-) | 3,776 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|---------|------------|---------|------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,354.3 | 2,447 | 1,494.6 | 2,659 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 1,106.7 | 2,024 | 1,251.1 | 2,259 |
| | (-) | (△12) | (-) | (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,159.6 | 1,525 | 1,196.1 | 1,556 |
| | (-) | (△5) | (-) | (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 446.8 | 312 | 528.1 | 367 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 579.6 | 646 | 688.9 | 755 |
| | (-) | (△9) | (-) | (-) |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 269.8 | 384 | 296.4 | 418 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |
| KEPPEL REIT | 836 | 977 | 979.3 | 1,137 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 219.6 | 503 | 237.1 | 531 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESR REIT | 783.4 | 406 | 662.5 | 335 |
| | (-) | (△0.49376) | (-) | (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 284.3 | 436 | 341 | 519 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 258.7 | 369 | 259.9 | 362 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 311.4 | 356 | 349.5 | 385 |
| | (-) | (△8) | (-) | (-) |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 289.4 | 394 | 306.8 | 419 |
| | (-) | (△0.80117) | (-) | (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 139.3 | 378 | 175.4 | 468 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 721.7 | 170 | 948.2 | 223 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 555.8 | 1,095 | 619.1 | 1,209 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 761.3 | 1,308 | 915.9 | 1,553 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 517.2 | 371 | 542.2 | 384 |
| | (-) | (△0.51059) | (-) | (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 98.2 | 40 | 236.8 | 97 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 771.3 | 918 | 942.2 | 1,109 |
| | (-) | (△11) | (-) | (-) |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 278.6 | 230 | 312.3 | 256 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 284.3 | 179 | 288.3 | 180 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPH REIT | 254.9 | 257 | 295.4 | 296 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 382.9 | 268 | 426.2 | 296 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 172.7 | 104 | 192.4 | 112 |
| | (-) | (△0.09142) | (-) | (-) |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 398.4 | 285 | 125.4 | 89 |
| | (-) | (△4) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 408.1 | 577 | 469.3 | 654 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 820.8 | 886 | 837.9 | 898 |
| | (-) | (△10) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|---------|--------------|-----------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ニュージーランド | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千□ | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 476.379 | 706 | 519.884 | 758 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 131.176 | 281 | 133.251 | 280 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 479.081 | 754 | 558.658 | 868 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 610.536 | 865 | 704.745 | 990 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 279.934 | 331 | 353.982 | 415 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVESTORE PROPERTY LTD | - | - | 88.877 | 135 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STRIDE STAPLED GROUP | 132.924 | 262 | 141.986 | 273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 454.367 | 2,653 | 536.609 | 3,171 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 97.167 | 33 | 191.461 | 64 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DERWENT LONDON PLC | 50.122 | 1,541 | 58.014 | 1,752 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 60.671 | 569 | 69.34 | 653 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 358.576 | 1,389 | 422.594 | 1,668 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 346.004 | 2,983 | 397.676 | 3,475 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 61.546 | 581 | 65.953 | 622 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTU PROPERTIES PLC | 337.034 | 468 | 413.403 | 632 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNITE GROUP PLC | 118.308 | 1,039 | 138.011 | 1,204 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 346.823 | 419 | 264.264 | 299 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHAFTESBURY PLC | 103.837 | 915 | 126.292 | 1,120 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SEGRO PLC | 504.351 | 3,270 | 549.647 | 3,507 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 116.446 | 832 | 140.521 | 995 |
| | (-) | (4) | (-) | (-) |
| ASSURA PLC | 979.633 | 561 | 1,138.511 | 642 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 210.591 | 124 | 227.094 | 132 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 257.154 | 230 | 62.879 | 58 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 146.332 | 137 | 154.385 | 145 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 544.164 | 483 | 316.63 | 272 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 96.354 | 544 | 113.596 | 636 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 302.075 | 564 | 345.983 | 645 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| RDI REIT PLC | 268.946 (△435.616) | 85 (-) | 284.57 (-) | 119 (-) |
| NEWRIVER REIT PLC | 103.299 (-) | 231 (-) | 130.334 (-) | 308 (-) |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 278.488 (-) | 278 (-) | 124.548 (-) | 116 (-) |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC | - (-) | - (-) | 37.06 (-) | 35 (-) |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 249.974 (-) | 258 (-) | 115.017 (-) | 116 (-) |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 730.342 (-) | 1,046 (-) | 758.831 (-) | 1,092 (-) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 195.483 (-) | 183 (-) | 227.97 (-) | 213 (-) |
| LXI REIT PLC | 163.221 (-) | 199 (-) | 102.424 (-) | 127 (-) |
| REGIONAL REIT LTD | 42.589 (-) | 43 (-) | 50.002 (-) | 50 (-) |
| イスラエル | 千□ | 千イスラエル・シケル | 千□ | 千イスラエル・シケル |
| REIT 1 LTD | 49.236 (-) | 741 (-) | 55.868 (-) | 848 (-) |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 11.931 (-) | 68,035 (-) | 2.615 (-) | 16,416 (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GREEN REIT PLC | 236.998 (-) | 359 (-) | 289.749 (-) | 436 (-) |
| HIBERNIA REIT PLC | 301.843 (-) | 419 (-) | 359.133 (-) | 497 (-) |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 123.754 (-) | 185 (-) | 138.475 (-) | 204 (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 18.473 (-) | 525 (-) | 25.483 (-) | 749 (-) |
| VASTNED RETAIL | 6.129 (-) | 200 (-) | 6.597 (-) | 217 (-) |
| WERELDHAVE NV | 18.915 (-) | 542 (-) | 21.418 (-) | 611 (-) |
| NSI NV | 5.389 (-) | 189 (-) | 6.676 (-) | 233 (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 62.815 (-) | 9,724 (-) | 71.729 (-) | 11,288 (-) |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BEFIMMO | 9.827 (-) | 494 (-) | 11.687 (-) | 582 (-) |
| COFINIMMO SA | 10.427 (-) | 1,144 (-) | 11.214 (-) | 1,220 (-) |
| RETAIL ESTATES | 3.173 (-) | 240 (-) | 3.796 (-) | 287 (-) |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 8.965 (-) | 205 (-) | 7.531 (-) | 173 (-) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 7.777 (-) | 944 (-) | 8.578 (-) | 1,030 (-) |
| MONTEA SCA | 5.495 (-) | 379 (-) | 1.933 (-) | 144 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---|-----------------------|------------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| AEDIFICA | 9.653 (-) | 765 (-) | 8.616 (-) | 674 (-) |
| COFINIMMO SA-RTS | - (-) | - (-) | 8.342 (-) | 5 (-) |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES-RTS | - (6.367) | - (-) | 6.367 (-) | 1 (-) |
| MONTEA CVA-RTS | - (2.68) | - (-) | 2.68 (-) | 1 (-) |
| AEDIFICA SA-RTS | - (7.159) | - (-) | 7.159 (-) | 23 (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 27.493 (-) | 3,620 (-) | 28.486 (-) | 3,740 (-) |
| ICADE | 18.147 (-) | 1,356 (-) | 20.929 (-) | 1,547 (-) |
| ALTAREA | 1.082 (-) | 195 (-) | 1.391 (-) | 258 (-) |
| KLEPIERRE | 93.413 (-) | 2,800 (-) | 109.79 (-) | 3,292 (-) |
| COVIVIO | 24.261 (-) | 2,156 (-) | 27.794 (-) | 2,471 (-) |
| MERCIALYS | 18.313 (-) | 228 (-) | 22.454 (-) | 280 (-) |
| COVIVIO | - (2.776) | - (-) | - (-) | - (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 28.848 (-) | 261 (-) | 34.209 (-) | 305 (-) |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 69.158 (-) | 888 (△24) | 74.4 (-) | 959 (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 132.264 (-) | 1,204 (-) | 171.48 (-) | 1,538 (-) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 29.717 (-) | 235 (△1) | 44.258 (-) | 357 (-) |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA | 4.117 (-) | 75 (-) | 50.296 (-) | 917 (-) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 151.755 (-) | 1,734 (△13) | 163.968 (-) | 1,881 (-) |
| ユーロ (イタリア) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BENI STABILI SPA | 185.952 (△336.763) | 139 (-) | 286.949 (-) | 208 (-) |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 11.626 (-) | 69 (△0.18159) | 15.741 (-) | 97 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|--------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| 不動産ファンド (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| MANULIFE US REIT | | 511.5 | | 456.5 | 394 | 42,417 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 43.436 | | 40.032 | 5,815 | 624,738 | 1.3 |
| ALEXANDER'S INC. | | 1.606 | | 1.406 | 525 | 56,433 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 65.092 | | 54.797 | 7,456 | 800,947 | 1.7 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | | 33.531 | | 27.397 | 72 | 7,828 | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 84.226 | | 74.959 | 2,852 | 306,382 | 0.6 |
| APARTMENT INVNT & MGMT CO-A | | 66.724 | | 52.06 | 2,663 | 286,157 | 0.6 |
| AGREE REALTY CORP | | 13.167 | | 13.141 | 877 | 94,252 | 0.2 |
| BRT APARTMENTS CORP | | — | | 2.813 | 36 | 3,967 | 0.0 |
| SL GREEN | | 37.248 | | 29.965 | 2,532 | 272,056 | 0.6 |
| EPR PROPERTIES | | 27.43 | | 26.376 | 2,049 | 220,204 | 0.5 |
| PROLOGIS INC | | 224.948 | | 221.421 | 18,008 | 1,934,437 | 4.1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 58.29 | | 49.184 | 10,220 | 1,097,879 | 2.3 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | | 91.973 | | 76.871 | 747 | 80,262 | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 39.066 | | 34.249 | 3,636 | 390,602 | 0.8 |
| CBL & ASSOCIATES | | 72.069 | | 47.062 | 44 | 4,822 | 0.0 |
| MACK CALI | | 38.286 | | 31.711 | 755 | 81,208 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | 65.269 | | 57.252 | 3,148 | 338,250 | 0.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC | | 178.182 | | 51.859 | 1,983 | 213,079 | 0.4 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | | 46.458 | | — | — | — | — |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | | 12.432 | | 11.393 | 244 | 26,263 | 0.1 |
| SITE CENTERS CORP | | 64.983 | | 50.198 | 679 | 72,957 | 0.2 |
| ISTAR INC | | 28.395 | | — | — | — | — |
| DUKE REALTY TRUST | | 150.436 | | 127.358 | 4,063 | 436,554 | 0.9 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | 39.727 | | 25.699 | 79 | 8,530 | 0.0 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 27.845 | | 23.315 | 6,994 | 751,299 | 1.6 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 155.294 | | 130.924 | 10,215 | 1,097,402 | 2.3 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 30.863 | | 26.353 | 3,526 | 378,822 | 0.8 |
| FIRST INDUSTRIAL RT | | 52.771 | | 44.501 | 1,642 | 176,392 | 0.4 |
| GGP INC | | 266.85 | | — | — | — | — |
| HCP INC | | 198.084 | | 169.495 | 5,542 | 595,373 | 1.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH | | 51.112 | | 42.702 | 1,416 | 152,152 | 0.3 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | 52.993 | | 44.016 | 1,431 | 153,808 | 0.3 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | | 43.81 | | 36.411 | 1,583 | 170,140 | 0.4 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | | 69.715 | | 57.784 | 1,437 | 154,434 | 0.3 |
| WELLTOWER INC | | 156.947 | | 137.308 | 11,485 | 1,233,806 | 2.6 |
| EAST GROUP | | 14.741 | | 12.816 | 1,494 | 160,522 | 0.3 |
| KIMCO REALTY | | 179.68 | | 149.202 | 2,819 | 302,915 | 0.6 |
| KILROY REALTY CORP | | 41.605 | | 35.671 | 2,709 | 291,061 | 0.6 |
| LTC PROPERTIES INC | | 16.835 | | 14.61 | 679 | 72,961 | 0.2 |
| SENIOR HOUSING PPTYS TRUST | | 100.809 | | 83.031 | 678 | 72,869 | 0.2 |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | | 33.032 | | 34.32 | 474 | 50,986 | 0.1 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | | 62.537 | | 52.372 | 2,663 | 286,071 | 0.6 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | | 74.331 | | 61.895 | 930 | 99,997 | 0.2 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 118.572 | | 101.232 | 3,245 | 348,631 | 0.7 |
| THE MACERICH COMPANY | | 45.998 | | 37.186 | 1,255 | 134,894 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 37.342 | | 32.042 | 3,912 | 420,262 | 0.9 |
| ACADIA REALTY TRUST | | 34.26 | | 28.451 | 807 | 86,735 | 0.2 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 312.724 | | 262.621 | 4,771 | 512,589 | 1.1 |
| MID AMERICA | | 47.941 | | 40.303 | 4,799 | 515,582 | 1.1 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | | 15.638 | | 13.759 | 231 | 24,904 | 0.1 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | | 17.625 | | 14.991 | 1,206 | 129,567 | 0.3 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | | 50.011 | | 4.546 | 271 | 29,138 | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | | 6.553 | | 4.255 | 132 | 14,214 | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | | 29.416 | | 17.505 | 108 | 11,696 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | | 13.326 | | 12.616 | 393 | 42,296 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|----------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| PS BUSINESS PARKS | | 8.446 | | 7,004 | 1,234 | 132,612 | 0.3 |
| RPT REALTY | | 33.773 | | 27.63 | 347 | 37,337 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 119.894 | | 107.748 | 7,784 | 836,242 | 1.8 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 62.085 | | 59,384 | 4,128 | 443,470 | 0.9 |
| UDR INC | | 113.114 | | 97,737 | 4,464 | 479,590 | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | | 42.988 | | 38,643 | 1,094 | 117,598 | 0.2 |
| CORECIVIC INC | | 50.174 | | 41,521 | 928 | 99,774 | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC | | 5.042 | | 4,421 | 244 | 26,243 | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 130.666 | | 108,459 | 17,797 | 1,911,757 | 4.0 |
| LIFE STORAGE INC | | 19.733 | | 16,395 | 1,591 | 170,919 | 0.4 |
| PUBLIC STORAGE | | 63.208 | | 52,671 | 12,667 | 1,360,729 | 2.9 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 33.726 | | 30,554 | 3,967 | 426,182 | 0.9 |
| TAUBMAN CENTERS INC | | 25.845 | | 21,393 | 902 | 96,977 | 0.2 |
| TANGER FACTORY OUTLET | | 40.143 | | 32,737 | 527 | 56,687 | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC | | 14.882 | | 13,433 | 175 | 18,888 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | | 12.671 | | 11,234 | 241 | 25,921 | 0.1 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | | 5.259 | | 4,708 | 407 | 43,781 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 150.254 | | 126,445 | 8,891 | 955,137 | 2.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 73.134 | | 61,491 | 4,105 | 441,040 | 0.9 |
| WASHINGTON REIT | | 33.313 | | 27,867 | 770 | 82,799 | 0.2 |
| GEO GROUP INC | | 51.638 | | 42,24 | 928 | 99,777 | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVST | | 50.686 | | 41,968 | 1,190 | 127,897 | 0.3 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | 57.893 | | 49,096 | 2,296 | 246,712 | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 35.532 | | 31,031 | 482 | 51,866 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 53.193 | | 45,051 | 4,853 | 521,394 | 1.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | | 44.756 | | 40.56 | 307 | 33,025 | 0.1 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | | 95.603 | | 80,002 | 1,085 | 116,618 | 0.2 |
| CUBESMART | | 77.311 | | 66,756 | 2,280 | 244,958 | 0.5 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 86.876 | | 73,766 | 9,084 | 975,833 | 2.1 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | | 32.161 | | - | - | - | - |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | | 85.121 | | 73,922 | 754 | 81,074 | 0.2 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 154.694 | | 136.49 | 2,485 | 266,990 | 0.6 |
| DOUGLAS EMMETT INC | | 67.6 | | 57,933 | 2,368 | 254,402 | 0.5 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | | 39.742 | | - | - | - | - |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | | 47.738 | | 41,878 | 724 | 77,824 | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 54.405 | | 43,929 | 903 | 97,019 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | | 44.281 | | 38,836 | 443 | 47,683 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | | 23.552 | | 21,401 | 1,026 | 110,232 | 0.2 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 17.616 | | 13,155 | 624 | 67,108 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | | 74.135 | | 61,408 | 1,094 | 117,614 | 0.2 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | 19.99 | | 65,012 | 2,209 | 237,302 | 0.5 |
| CORESITE REALTY CORP | | 14.529 | | 12,902 | 1,514 | 162,666 | 0.3 |
| VEREIT INC | | 407.682 | | 342,119 | 3,250 | 349,129 | 0.7 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | | 25.52 | | 21,119 | 605 | 65,063 | 0.1 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 29.264 | | 45.82 | 1,304 | 140,079 | 0.3 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | | 42.132 | | 17,851 | 467 | 50,220 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | | 16.134 | | 16.36 | 244 | 26,220 | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 19.517 | | 17,398 | 334 | 35,882 | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | | 75.62 | | 62,571 | 1,224 | 131,537 | 0.3 |
| WHITESTONE REIT | | 17.842 | | 15,361 | 197 | 21,203 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | | 65.87 | | 54,303 | 1,843 | 198,038 | 0.4 |
| STAG INDUSTRIAL INC | | 40.858 | | 43,588 | 1,361 | 146,272 | 0.3 |
| SELECT INCOME REIT | | 27.352 | | - | - | - | - |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | | 92.273 | | 74,671 | 907 | 97,537 | 0.2 |
| CYRUSONE INC | | 41.756 | | 38.14 | 2,289 | 245,901 | 0.5 |
| WP CAREY INC | | 45.338 | | 60.124 | 5,145 | 552,720 | 1.2 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | | 28.742 | | - | - | - | - |
| GLADSTONE LAND CORP | | 5.526 | | 4.129 | 47 | 5,145 | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | | 86.903 | | 72.282 | 2,050 | 220,279 | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | | 21.716 | | 18.038 | 1,454 | 156,193 | 0.3 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------|-----|------|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 | 率 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| WHEELER REIT INC | 2.961 | — | — | — | — | — |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | — | 18.755 | 228 | 24,558 | 0.1 | — |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 19.187 | — | — | — | — | — |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT | 68.158 | — | — | — | — | — |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 180.298 | 30.159 | 1,354 | 145,461 | 0.3 | — |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 76.067 | 63.958 | 1,144 | 122,910 | 0.3 | — |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 34.068 | 36.539 | 1,486 | 159,709 | 0.3 | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 110.338 | 92.275 | 2,305 | 247,705 | 0.5 | — |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 35.997 | 33.291 | 393 | 42,305 | 0.1 | — |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | — | 3.694 | 434 | 46,633 | 0.1 | — |
| JBG SMITH PROPERTIES | 39.622 | 41.967 | 1,699 | 182,532 | 0.4 | — |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | — | 20.602 | 219 | 23,613 | 0.0 | — |
| RETAIL VALUE INC | — | 5.916 | 202 | 21,714 | 0.0 | — |
| INVITATION HOMES INC | 120.949 | 135.096 | 3,667 | 394,001 | 0.8 | — |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 13.143 | — | — | — | — | — |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 113.135 | — | — | — | — | — |
| QTS REALTY TRUST INC | 21.476 | 19.246 | 894 | 96,134 | 0.2 | — |
| SPIRIT MTA REIT | 17.097 | 13.946 | 122 | 13,108 | 0.0 | — |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 55.942 | 48,864 | 758 | 81,464 | 0.2 | — |
| SAFEHOLD INC | — | 2,744 | 78 | 8,433 | 0.0 | — |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | — | 17.735 | 370 | 39,816 | 0.1 | — |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 8.484 | 24.28 | 493 | 52,971 | 0.1 | — |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 49.73 | 40.874 | 901 | 96,814 | 0.2 | — |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 84.705 | 71.712 | 2,889 | 310,366 | 0.7 | — |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 127.551 | 105.086 | 1,935 | 207,931 | 0.4 | — |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 13.902 | 8.936 | 87 | 9,407 | 0.0 | — |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | — | 33.378 | 653 | 70,167 | 0.1 | — |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | 8.916 | 6,509 | 76 | 8,166 | 0.0 | — |
| FARMLAND PARTNERS INC | 14.523 | 9.63 | 65 | 7,034 | 0.0 | — |
| CITY OFFICE REIT INC | 14.463 | 15.324 | 189 | 20,378 | 0.0 | — |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 78.952 | 70.292 | 278 | 29,901 | 0.1 | — |
| CARETRUST REIT INC | 32.366 | 33.024 | 814 | 87,515 | 0.2 | — |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 34.578 | 31.63 | 218 | 23,478 | 0.0 | — |
| STORE CAPITAL CORP | 72.549 | 70.644 | 2,471 | 265,524 | 0.6 | — |
| PARAMOUNT GROUP INC | 86.597 | 70.246 | 1,029 | 110,546 | 0.2 | — |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 8.278 | 7.336 | 82 | 8,896 | 0.0 | — |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 44.936 | 44.064 | 790 | 84,869 | 0.2 | — |
| INFRAREIT INC | 16.132 | — | — | — | — | — |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 18.694 | 25.372 | 464 | 49,930 | 0.1 | — |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 45.298 | 39.522 | 828 | 88,984 | 0.2 | — |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 7.762 | 8.002 | 328 | 35,233 | 0.1 | — |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | 21.369 | 19.694 | 583 | 62,640 | 0.1 | — |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 6.974 | 6.76 | 266 | 28,668 | 0.1 | — |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 91.138 | 75.452 | 1,194 | 128,303 | 0.3 | — |
| GLOBAL NET LEASE INC | 28.621 | 29.176 | 577 | 62,086 | 0.1 | — |
| TIER REIT INC | 20.328 | — | — | — | — | — |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC | 39.836 | — | — | — | — | — |
| CLIPPER REALTY INC | 5.169 | 5.169 | 63 | 6,790 | 0.0 | — |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 85.299 | 70.84 | 1,998 | 214,667 | 0.5 | — |
| VICI PROPERTIES INC | — | 127.279 | 2,900 | 311,591 | 0.7 | — |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 21.513 | 18.806 | 300 | 32,241 | 0.1 | — |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 11.004 | 10.32 | 440 | 47,369 | 0.1 | — |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 26.006 | 25.108 | 711 | 76,381 | 0.2 | — |
| COLONY CAPITAL INC | 208.616 | 171.468 | 886 | 95,226 | 0.2 | — |
| 小 計 | □ 数 9,953,908 | □ 数 7,983,341 | 319,298 | 34,299,078 | — | — |
| | □ 銘 柄 数之比 <71.3%> | □ 銘 柄 数之比 <72.3%> | — | — | — | 72.3 |
| (カナダ) | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 27.854 | 24.167 | 823 | 67,014 | 0.1 | — |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 29.587 | 26.047 | 1,284 | 104,556 | 0.2 | — |
| MORGUARD REAL ESTATE INVT TR | 10.016 | — | — | — | — | — |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | | 末 | |
|----------------------------------|-----------|--------|-----------|-------------|---------|---|-----|
| | □ 数 | 金額 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比 | 率 |
| (カナダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 60.656 | | 48.916 | 1,128 | 91,847 | | 0.2 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 65.342 | | 52.282 | 1,393 | 113,401 | | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 19.518 | | 18.469 | 886 | 72,153 | | 0.2 |
| COMINAR REAL ESTATE INVT TR | 38.546 | | 30.322 | 376 | 30,676 | | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 12.463 | | 9.817 | 239 | 19,495 | | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 10.096 | | 10.523 | 287 | 23,415 | | 0.0 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 9.781 | | 7.736 | 314 | 25,588 | | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 30.141 | | 24.488 | 287 | 23,398 | | 0.0 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 18.049 | | 16.86 | 267 | 21,777 | | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 20.114 | | 19.862 | 280 | 22,793 | | 0.0 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 21.137 | | 22.017 | 262 | 21,324 | | 0.0 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 7.446 | | 6.696 | 122 | 9,978 | | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM | 37.235 | | 33.203 | 465 | 37,860 | | 0.1 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 13.888 | | 22.37 | 270 | 22,030 | | 0.0 |
| AGELLAN COMMERCIAL REIT | 7.03 | | — | — | — | | — |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 17.406 | | 19.293 | 256 | 20,884 | | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 9.917 | | 8.529 | 531 | 43,240 | | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | — | | 10.465 | 69 | 5,689 | | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 58.346 | | 53.304 | 747 | 60,867 | | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | — | | 5.037 | 96 | 7,854 | | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12.724 | | 16.489 | 239 | 19,513 | | 0.0 |
| SLATE RETAIL REIT | 7.739 | | 6.406 | 80 | 6,579 | | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 12.079 | | 12.079 | 72 | 5,888 | | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REIT | 15.367 | | 16.959 | 333 | 27,122 | | 0.1 |
| 小 計 | □ 数 | 金額 | □ 数 | 金額 | 金額 | | — |
| | 25銘柄 | <1.8%> | 25銘柄 | <1.9%> | — | | 1.9 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千円 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| BWP TRUST | 205.883 | | 166.921 | 645 | 48,267 | | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | 1,562.622 | | 1,398.222 | 4,404 | 329,096 | | 0.7 |
| INVESTA OFFICE FUND | 211.438 | | — | — | — | | — |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 674.83 | | 608.982 | 761 | 56,878 | | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 140.441 | | 124.412 | 577 | 43,133 | | 0.1 |
| GPT GROUP | 761.372 | | 632.592 | 3,966 | 296,365 | | 0.6 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 137.44 | | 120.666 | 520 | 38,859 | | 0.1 |
| CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 88.555 | | 95.978 | 368 | 27,538 | | 0.1 |
| STOCKLAND | 1,031.289 | | 871.018 | 3,762 | 281,156 | | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 85.235 | | 79.545 | 256 | 19,197 | | 0.0 |
| DEXUS | 429.175 | | 383.348 | 5,167 | 386,117 | | 0.8 |
| GOODMAN GROUP | 676.39 | | 568.14 | 8,567 | 640,167 | | 1.4 |
| VICINITY CENTRES | 1,363.217 | | 1,131.404 | 2,964 | 221,490 | | 0.5 |
| CHARTER HALL GROUP | 196.697 | | 162.348 | 1,803 | 134,771 | | 0.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 104.165 | | 99.748 | 428 | 32,048 | | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 307.102 | | 313.615 | 802 | 59,989 | | 0.1 |
| ARENA REIT | 108.676 | | 106.906 | 306 | 22,925 | | 0.0 |
| PROPERTYLINK GROUP | 151.222 | | — | — | — | | — |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 72.501 | | 77.55 | 396 | 29,610 | | 0.1 |
| APN INDUSTRIA REIT | 42.579 | | 38.914 | 114 | 8,577 | | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 223.901 | | 243.475 | 445 | 33,292 | | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 62.65 | | 52.264 | 183 | 13,707 | | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | 208.566 | | 160.1 | 228 | 17,106 | | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP | 104.894 | | 105.905 | 248 | 18,596 | | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 2,259.234 | | 1,887.979 | 7,268 | 543,118 | | 1.1 |
| VIVA ENERGY REIT | 183.737 | | 156.535 | 425 | 31,813 | | 0.1 |
| 小 計 | □ 数 | 金額 | □ 数 | 金額 | 金額 | | — |
| | 26銘柄 | <6.9%> | 24銘柄 | <7.0%> | — | | 7.0 |
| (香港) | 千口 | 千円 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | | % |
| LINK REIT | 910.52 | | 748.52 | 71,932 | 989,075 | | 2.1 |
| PROSPERITY REIT | 522 | | 462 | 1,570 | 21,598 | | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 492 | | 481 | 2,578 | 35,449 | | 0.1 |
| CHAMPION REIT | 871.07 | | 691.07 | 4,485 | 61,669 | | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 末 | |
|----------------------------------|---------|------------|----|------------|--------------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (香港) | | 千口 | | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | | 403 | | 384 | 2,284 | 31,416 | 0.1 |
| FORTUNE REAL ESTATE (HK) | | 588 | | 477 | 5,094 | 70,047 | 0.1 |
| SPRING REIT | | 351 | | — | — | — | — |
| 小計 | □ | 4,137.59 | □ | 3,243.59 | 87,945 | 1,209,256 | — |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄<2.1%> | | 6銘柄<2.6%> | — | — | 2.6 |
| (シンガポール) | | 千口 | | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| CAPITALAND MALL TRUST | | 1,136.76 | | 1,001.86 | 2,564 | 203,539 | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | | 1,014.36 | | 911.76 | 2,771 | 219,966 | 0.5 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 1,132.679 | | 992.379 | 2,123 | 168,536 | 0.4 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | | 952.79 | | 808.39 | 1,568 | 124,458 | 0.3 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 876.22 | | 839.72 | 1,318 | 104,625 | 0.2 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 550.5 | | 469.2 | 363 | 28,857 | 0.1 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | | 548.015 | | 438.715 | 570 | 45,261 | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | | 270.88 | | 244.28 | 385 | 30,629 | 0.1 |
| KEPPEL REIT | | 769.7 | | 626.4 | 789 | 62,635 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 247.6 | | 230.1 | 584 | 46,382 | 0.1 |
| ESR REIT | | 539.43 | | 660.33 | 353 | 28,036 | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 314.3 | | 257.6 | 414 | 32,913 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | | 234.58 | | 233.38 | 359 | 28,522 | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | | 236.6 | | 198.5 | 202 | 16,068 | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | | 235.095 | | 217.695 | 317 | 25,223 | 0.1 |
| PARKWAY LIFE REIT | | 167.7 | | 131.6 | 402 | 31,957 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | | 798.3 | | 571.8 | 131 | 10,436 | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | | 524.22 | | 460.92 | 995 | 79,009 | 0.2 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 811.8 | | 657.2 | 1,334 | 105,875 | 0.2 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | | 435.78 | | 410.78 | 328 | 26,079 | 0.1 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | | 357.2 | | 218.6 | 98 | 7,806 | 0.0 |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | | 912.6 | | 741.7 | 1,068 | 84,760 | 0.2 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | | 317.2 | | 283.5 | 277 | 22,048 | 0.0 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | | 359.6 | | 355.6 | 240 | 19,048 | 0.0 |
| SPH REIT | | 265.4 | | 224.9 | 238 | 18,918 | 0.0 |
| OUE HOSPITALITY TRUST | | 488.62 | | 445.32 | 316 | 25,091 | 0.1 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | | 276.1 | | 256.4 | 156 | 12,412 | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | | — | | 273 | 193 | 15,382 | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | | 402.2 | | 341 | 552 | 43,840 | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL T | | 572.75 | | 555.65 | 677 | 53,797 | 0.1 |
| 小計 | □ | 15,748.979 | □ | 14,058.279 | 21,700 | 1,722,122 | — |
| | 銘柄数<比率> | 29銘柄<3.2%> | | 30銘柄<3.6%> | — | — | 3.6 |
| (ニュージーランド) | | 千口 | | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | % |
| PRECINCT PROPERTIES | | 423.696 | | 380.191 | 661 | 46,876 | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | | 129.943 | | 127.868 | 310 | 22,017 | 0.0 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | | 441.448 | | 361.871 | 698 | 49,489 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | | 606.953 | | 512.744 | 825 | 58,496 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | | 356.878 | | 282.83 | 383 | 27,156 | 0.1 |
| INVESTORE PROPERTY LTD | | 88.877 | | — | — | — | — |
| STRIDE STAPLED GROUP | | 149.101 | | 140.039 | 308 | 21,830 | 0.0 |
| 小計 | □ | 2,196.896 | □ | 1,805.543 | 3,187 | 225,866 | — |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄<0.4%> | | 6銘柄<0.5%> | — | — | 0.5 |
| (イギリス) | | 千口 | | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | | 419.592 | | 337.35 | 1,821 | 249,462 | 0.5 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | | 229.731 | | 135.437 | 18 | 2,540 | 0.0 |
| DERWENT LONDON PLC | | 46.537 | | 38.645 | 1,218 | 166,805 | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | | 63.285 | | 54.616 | 543 | 74,491 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | | 333.513 | | 269.495 | 750 | 102,816 | 0.2 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 317.138 | | 265.466 | 2,210 | 302,674 | 0.6 |
| WORKSPACE GROUP PLC | | 50.811 | | 46.404 | 411 | 56,301 | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 372.244 | | 295.875 | 224 | 30,711 | 0.1 |
| UNITE GROUP PLC | | 111.92 | | 92.217 | 891 | 122,114 | 0.3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | | 312.94 | | 395.499 | 523 | 71,707 | 0.2 |
| SHAFTESBURY PLC | | 103.012 | | 80.557 | 659 | 90,292 | 0.2 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|-------------------------|-------------------------|---------|-----------|----------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 | 比率 | 比率 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| SEGRO PLC | 425.024 | 379,728 | 2,820 | 386,255 | | 0.8 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 119.899 | 95,824 | 669 | 91,645 | | 0.2 |
| ASSURA PLC | 1,013.326 | 854,448 | 541 | 74,183 | | 0.2 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 221.364 | 204,861 | 114 | 15,625 | | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | — | 194,275 | 188 | 25,752 | | 0.1 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 167.573 | 159.52 | 152 | 20,817 | | 0.0 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | — | 227,534 | 199 | 27,294 | | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 89.348 | 72,106 | 446 | 61,121 | | 0.1 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 295.326 | 251,418 | 506 | 69,409 | | 0.1 |
| RDI REIT PLC | 528.881 | 77,641 | 80 | 10,972 | | 0.0 |
| NEWRIVER REIT PLC | 131.034 | 103,999 | 194 | 26,631 | | 0.1 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 81.48 | 235.42 | 185 | 25,403 | | 0.1 |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC | 37.06 | — | — | — | | — |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | — | 134,957 | 112 | 15,413 | | 0.0 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 626.95 | 598,461 | 921 | 126,208 | | 0.3 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 228.6 | 196,113 | 180 | 24,680 | | 0.1 |
| LXI REIT PLC | 73.4 | 134,197 | 167 | 22,971 | | 0.0 |
| REGIONAL REIT LTD | 118.301 | 110,888 | 120 | 16,460 | | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 6,518,289 26銘柄<5.7%> | 6,042,951 28銘柄<4.9%> | 16,874 | 2,310,766 | — 4.9 |
| (イスラエル) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| REIT 1 LTD | 70.287 | 63,655 | 1,128 | 33,530 | | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 70.287 1銘柄<0.1%> | 63,655 1銘柄<0.1%> | 1,128 | 33,530 | — 0.1 |
| (韓国) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | — | 9,316 | 63,255 | 5,870 | | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | — —銘柄<—%> | 9,316 1銘柄<0.0%> | 63,255 | 5,870 | — 0.0 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| GREEN REIT PLC | 293.629 | 240,878 | 422 | 51,646 | | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC | 299.53 | 242,24 | 340 | 41,574 | | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 138.876 | 124,155 | 206 | 25,223 | | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 732,035 3銘柄<0.3%> | 607,273 3銘柄<0.2%> | 968 | 118,444 | — 0.2 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 21.124 | 14,114 | 347 | 42,442 | | 0.1 |
| VASTNED RETAIL | 6.794 | 6,326 | 175 | 21,420 | | 0.0 |
| WERELDHAVE NV | 16.816 | 14,313 | 335 | 40,976 | | 0.1 |
| NSI NV | 7.625 | 6,338 | 237 | 28,975 | | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 57.184 | 48,27 | 6,475 | 791,555 | | 1.7 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 109,543 5銘柄<3.0%> | 89,361 5銘柄<2.0%> | 7,570 | 925,369 | — 2.0 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| BEFIMMO | 9.8 | 7.94 | 409 | 50,082 | | 0.1 |
| COFINIMMO SA | 8.205 | 7,418 | 830 | 101,558 | | 0.2 |
| RETAIL ESTATES | 3.232 | 2,609 | 204 | 24,971 | | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 6.873 | 8,307 | 211 | 25,893 | | 0.1 |
| WAREHOUSES DE PAUW | 7.037 | 6,236 | 897 | 109,769 | | 0.2 |
| MONTEA SCA | — | 3,562 | 265 | 32,438 | | 0.1 |
| AEDIFICA | 7.647 | 8,684 | 719 | 87,894 | | 0.2 |
| COFINIMMO SA-RTS | 8.342 | — | — | — | | — |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 51,136 7銘柄<0.7%> | 44,756 7銘柄<0.9%> | 3,539 | 432,609 | — 0.9 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| GECINA SA | 20.261 | 19,268 | 2,605 | 318,439 | | 0.7 |
| ICADE | 18.935 | 16,153 | 1,281 | 156,679 | | 0.3 |
| ALTAREA | 1.518 | 1,209 | 217 | 26,631 | | 0.1 |
| KLEPIERRE | 87.317 | 70,94 | 2,111 | 258,069 | | 0.5 |
| COVIVIO | 22.663 | 21,906 | 2,018 | 246,758 | | 0.5 |

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 末 | |
|----------------------------------|---------------------|---------|---------------------------|----|----------------------------|-------|------------|------|
| | | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (ユーロ…フランス) | | | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| MERCIALYS | | | 22.547 | | 18.406 | 210 | 25,739 | 0.1 |
| 小計 | □ 数 金 額 柄 数<比 率> | | 173.241 6銘柄<2.4%> | | 147,882 6銘柄<2.2%> | 8,445 | 1,032,318 | 2.2 |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HAMBORNER REIT AG | | | 33.143 | | 27.782 | 247 | 30,292 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | | 61.358 | | 56.116 | 788 | 96,377 | 0.2 |
| 小計 | □ 数 金 額 柄 数<比 率> | | 94.501 2銘柄<0.3%> | | 83,898 2銘柄<0.3%> | 1,036 | 126,670 | 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | | | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | | 136.98 | | 97.764 | 999 | 122,135 | 0.3 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | | 39.724 | | 25.183 | 172 | 21,117 | 0.0 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS S | | | 46.179 | | - | - | - | - |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | | 140.114 | | 127.901 | 1,580 | 193,243 | 0.4 |
| 小計 | □ 数 金 額 柄 数<比 率> | | 362.997 4銘柄<1.0%> | | 250,848 3銘柄<0.7%> | 2,752 | 336,497 | 0.7 |
| (ユーロ…イタリア) | | | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BENI STABILI SPA | | | 437.76 | | - | - | - | - |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | | 20.03 | | 15.915 | 94 | 11,555 | 0.0 |
| 小計 | □ 数 金 額 柄 数<比 率> | | 457.79 2銘柄<0.1%> | | 15,915 1銘柄<0.0%> | 94 | 11,555 | 0.0 |
| 合計 | □ 数 金 額 柄 数<比 率> | | 525,734.8 311銘柄<99.3%> | | 44,555,511 303銘柄<99.2%> | - | 47,028,742 | 99.2 |

(注1) 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2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|---------------|------------------|-------|---|
| | 評 価 額 | 比 率 | |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 47,028,742 | 99.2 | % |
| コール・ローン等、その他 | 382,171 | 0.8 | |
| 投資信託財産総額 | 47,410,913 | 100.0 | |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、47,359,422千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.42円、1カナダ・ドル=81.39円、1オーストラリア・ドル=74.72円、1香港・ドル=13.75円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=70.86円、1イギリス・ポンド=136.94円、1イスラエル・シケル=29.71円、100韓国・ウォン=9.28円、1ユーロ=122.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月24日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 47,623,950,891円 |
| コ ー ル ・ オ ー ン 等 | 133,244,022 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 5,083,074,363 |
| 投 資 証 券(評価額) | 41,945,667,910 |
| 未 収 入 金 | 361,567,209 |
| 未 収 配 当 金 | 100,397,387 |
| (B) 負 債 | 213,744,900 |
| 未 払 金 | 213,036,900 |
| 未 払 解 約 金 | 708,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 47,410,205,991 |
| 元 本 | 36,301,672,788 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 11,108,533,203 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 36,301,672,788口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 13,060円 |

(注1) 期首元本額 44,369,434,317円
 追加設定元本額 48,480,219,419円
 一部解約元本額 56,547,980,948円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|----------------------------------|----------------|
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 160,560,827円 |
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) | 93,381,433円 |
| MITOラップ型ファンド(安定型) | 5,570,605円 |
| MITOラップ型ファンド(中立型) | 14,365,615円 |
| MITOラップ型ファンド(積極型) | 22,970,643円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 53,567,046円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 38,170,950円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 28,280,765円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 3,920,685,465円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 599,465,183円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 151,921,418円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 326,595,821円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 2,096,319円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 42,404,047円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 94,801,723円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型) | 17,099,439円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 87,460,533円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型) | 76,847,691円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型) | 204,814,938円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 676,227円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) | 2,026,563円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型) | 1,696,987円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型) | 5,195,023円 |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) | 19,026,187円 |
| マネックス資産設計ファンド(育成型) | 520,077,807円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 53,216,299円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 175,540,190円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 158,001,161円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 310,814,217円 |
| 投資のソムリエ | 7,768,303,637円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 795,364,191円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 135,937,313円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 282,312,537円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 746,055円 |

| | |
|--|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 4,021,843,742円 |
| ワールドアセットバランス(基本コース) | 951,671,015円 |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) | 3,735,792,629円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) | 4,282,362円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055) | 3,668,511円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) | 2,038,670円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035) | 7,614,992円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 673,546,769円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 16,954,156円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040) | 794,026円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050) | 794,026円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060) | 794,026円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | 834,894,408円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 40,270,163円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け) | 363,780,773円 |
| DIAMグローバルβ私募ファンド(適格機関投資家向け) | 12,032,969円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定) | 3,432,240,792円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 2,009,502,069円 |
| P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 3,461,256,521円 |
| DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定) | 557,905,314円 |
| 期末元本合計 | 36,301,672,788円 |

■損益の状況

当期 自2018年6月23日 至2019年6月24日

| 項 | 目 | 当 期 |
|--------------------------|-----|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 金 当 | 2,193,044,685円 |
| 受 取 配 当 | 金 | 2,191,595,379 |
| 受 取 利 息 | | 1,865,527 |
| 支 払 利 息 | | △416,221 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 損 益 | 1,897,564,952 |
| 売 買 益 | | 7,074,533,912 |
| 売 買 損 | | △5,176,968,960 |
| (C) そ の 他 費 用 | | △51,136,964 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | | 4,039,472,673 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | | 8,778,934,476 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | | △12,880,878,527 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | | 11,171,004,581 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | | 11,108,533,203 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | | 11,108,533,203 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。