

運用報告書 (全体版)

第7期<決算日2022年5月9日>

DIAM先進国REITインデックスファンド <為替ヘッジなし> (ファンドラップ)

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 | 2015年10月13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めざして運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 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。 |
| 運用方法 | 不動産投資信託証券の実質組入比率は、原則として高位を維持します。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は行いません。 | |
| 組入制限 | 投資信託証券への実質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。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 | |
| 分配方針 | 決算日 (原則として毎年5月8日。休業日の場合は翌営業日。) に経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額から、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、「DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)」は、2022年5月9日に第7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/>

D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)

■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) | | 投資信託 証券、 債券、 証券比 | 純資産額 | |
|----------------|--------|--------|--------|--|--------|---------------------------|-------|--------|
| | (分配落) | 税 分 | 込 配 | み 金 | 期 騰 | | | 中 落 |
| | 円 | | 円 | | % | ポイント | % | 百万円 |
| 3期(2018年5月8日) | 10,120 | | 0 | | △1.1 | 115,717.82 | △0.3 | 275 |
| 4期(2019年5月8日) | 11,270 | | 0 | | 11.4 | 130,377.17 | 12.7 | 208 |
| 5期(2020年5月8日) | 8,729 | | 0 | | △22.5 | 101,778.79 | △21.9 | 77 |
| 6期(2021年5月10日) | 12,560 | | 0 | | 43.9 | 148,746.30 | 46.1 | 113 |
| 7期(2022年5月9日) | 15,512 | | 0 | | 23.5 | 185,350.57 | 24.6 | 161 |

- (注1) 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2) 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3) 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4) △ (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

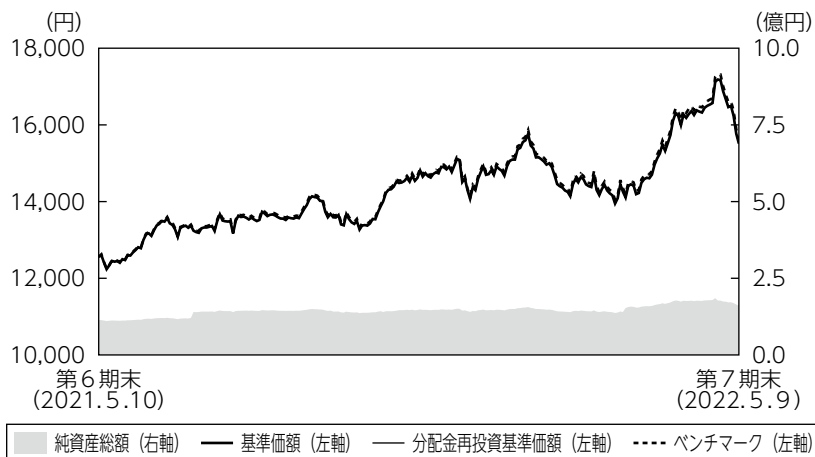
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先進国 REITインデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 証 券 比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|--------------------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2021 年 5 月 10 日 | 円 12,560 | % - | ポイント 148,746.30 | % - | % 99.6 |
| 5 月 末 | 12,809 | 2.0 | 151,940.99 | 2.1 | 99.7 |
| 6 月 末 | 13,202 | 5.1 | 156,754.65 | 5.4 | 99.4 |
| 7 月 末 | 13,533 | 7.7 | 160,838.73 | 8.1 | 99.7 |
| 8 月 末 | 13,810 | 10.0 | 164,194.41 | 10.4 | 99.6 |
| 9 月 末 | 13,492 | 7.4 | 160,446.64 | 7.9 | 90.7 |
| 10 月 末 | 14,674 | 16.8 | 174,463.23 | 17.3 | 99.7 |
| 11 月 末 | 14,606 | 16.3 | 173,578.70 | 16.7 | 89.5 |
| 12 月 末 | 15,552 | 23.8 | 185,199.89 | 24.5 | 100.1 |
| 2022 年 1 月 末 | 14,452 | 15.1 | 172,188.18 | 15.8 | 99.6 |
| 2 月 末 | 14,451 | 15.1 | 172,409.41 | 15.9 | 99.2 |
| 3 月 末 | 16,231 | 29.2 | 193,705.17 | 30.2 | 98.9 |
| 4 月 末 | 16,493 | 31.3 | 196,763.47 | 32.3 | 85.6 |
| (期 末) 2022 年 5 月 9 日 | 15,512 | 23.5 | 185,350.57 | 24.6 | 95.7 |

(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（2021年5月11日から2022年5月9日まで）

基準価額等の推移



第7期首：12,560円
第7期末：15,512円
(既払分配金0円)
騰落率：23.5%
(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

フランスや香港などのリート市場が下落したものの、新型コロナウイルス変異株への警戒感後退や経済活動の正常化などを背景に、米国など他のリート市場が上昇したことに加え、為替市場では全ての投資国の通貨に対して円安となったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスへの警戒感後退や米国株の好決算に伴うリスク選好の動きなどから堅調に推移しました。欧州リート市場も概ね上昇しましたが、地理的に隣接しているウクライナ情勢の緊迫化に加えて、ECB（欧州中央銀行）のタカ派的な政策決定が嫌気され期末にかけて弱含み、フランスは前期末の水準を下回りました。オーストラリアリート市場は好調な経済指標や主要銘柄の好決算を受け上昇しました。

為替市場では、米ドルは米国の経済活動の正常化やインフレ率の上昇により、金融緩和策の転換や継続的な利上げが意識され対円で上昇しました。2022年3月以降は日米金融政策格差を背景に円安米ドル高が急速に進行しました。ユーロやオーストラリアドルなど他の全ての投資国の通貨も対円で上昇しました。

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。

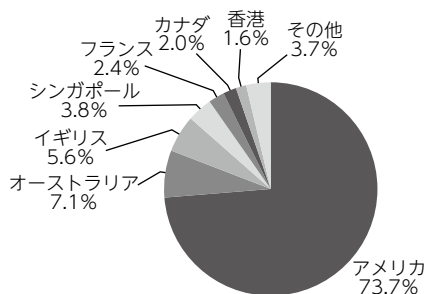
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

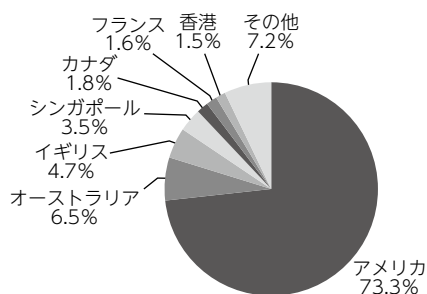
【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○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。

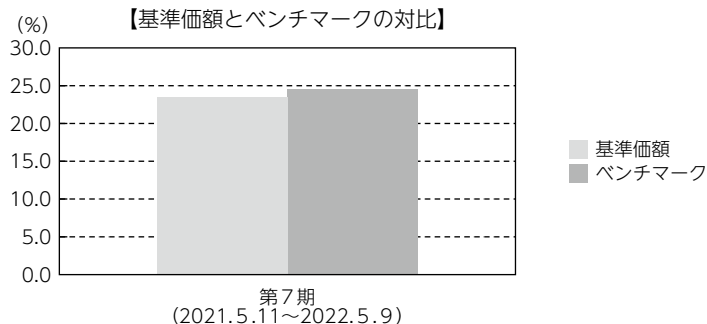
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注3) 発行国（地域）を表示しています。また、上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

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24.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.1%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、信託報酬、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。



(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す。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|--------------------------|
| | 2021年5月11日 ～2022年5月9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 | 5,512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。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざ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 | 第7期 | | 項目の概要 |
|-------------|----------------------------|---------|--|
| | (2021年5月11日 ～2022年5月9日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 23円 | 0.159% | (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14,293円です。 |
| (投信会社) | (15) | (0.104) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (2) | (0.011) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | (6) | (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 | 6 | 0.040 | (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) | (1) | (0.005) | |
| (投資証券) | (5) | (0.035) | |
| (c) 有価証券取引税 | 15 | 0.108 | (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) | (0.008) | |
| (投資証券) | (14) | (0.100) | |
| (d) その他費用 | 14 | 0.097 | (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) | (8) | (0.053) | 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) | (0.003) | 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) | (6) | (0.041) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 58 | 0.405 | |

(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。

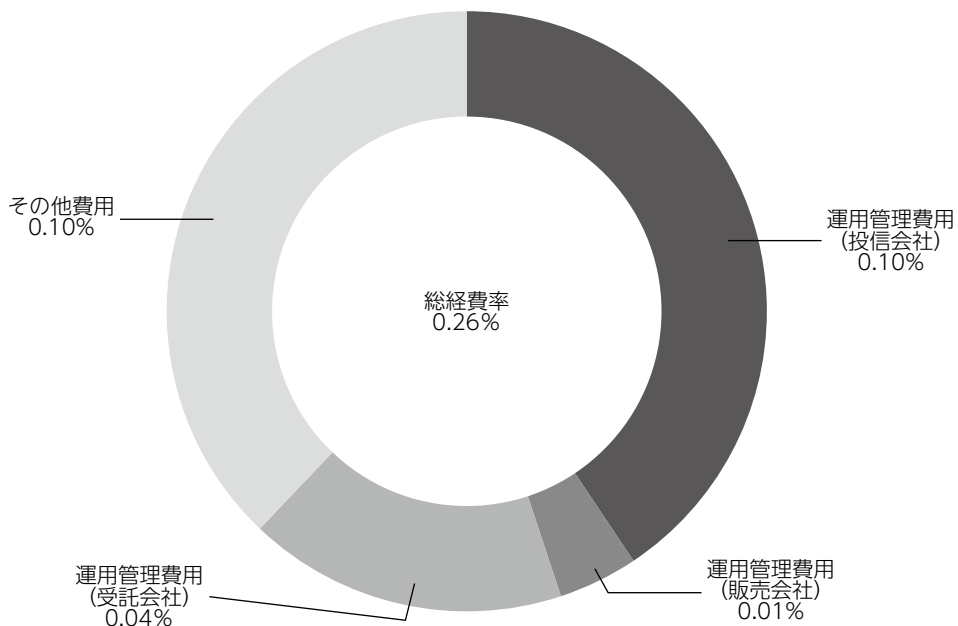
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.26%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（2021年5月11日から2022年5月9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□ 28,053 | 千円 44,808 | 千□ 16,247 | 千円 27,824 |

■利害関係人との取引状況等（2021年5月11日から2022年5月9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□ 78,369 | 千□ 90,175 | 千円 161,396 |

■投資信託財産の構成

2022年5月9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 | 161,396 | 99.9 |
| コール・ローン等、その他 | 130 | 0.1 |
| 投資信託財産総額 | 161,526 | 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、2022年5月9日現在、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは62,572,563千円、86.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年5月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.78円、1カナダ・ドル=101.08円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1香港・ドル=16.66円、1シンガポール・ドル=94.11円、1ニュージーランド・ドル=83.37円、1イギリス・ポンド=160.94円、1イスラエル・シェケル=38.436円、100韓国・ウォン=10.26円、1ユーロ=137.63円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年5月9日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 161,526,588円 |
| コール・ローン等 | 130,454 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 161,396,134 |
| (B) 負 債 | 124,199 |
| 未払信託報酬 | 121,599 |
| その他未払費用 | 2,600 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 161,402,389 |
| 元 本 | 104,049,205 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 57,353,184 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 104,049,205口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,512円 |

(注) 期首における元本額は90,279,907円、当期中における追加設定元本額は33,158,347円、同解約元本額は19,389,049円です。

■損益の状況

当期 自2021年5月11日 至2022年5月9日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △19円 |
| 支 払 利 息 | △19 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 26,992,827 |
| 売 買 益 | 30,894,203 |
| 売 買 損 | △3,901,376 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △235,692 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 26,757,116 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 9,427,786 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 21,168,282 |
| (配 当 等 相 当 額) | (16,708,613) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,459,669) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 57,353,184 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 57,353,184 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 21,168,282 |
| (配 当 等 相 当 額) | (16,788,204) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,380,078) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 36,184,902 |

(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 | 4,260,280円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 22,496,836 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 21,168,282 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 9,427,786 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 57,353,184 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 5,512.12 |
| (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14期（決算日 2021年6月22日）

（対象期間 2020年6月23日～2021年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14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 | 期中騰落率 | ポイント | 期中騰落率 | | |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9 | 117,262.55 | 8.5 | 99.7 | 百万円 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 |
| 13期(2020年6月22日) | 10,922 | △16.4 | 111,241.50 | △15.7 | 99.7 | 34,753 |
| 14期(2021年6月22日) | 15,336 | 40.4 | 157,949.66 | 42.0 | 99.4 | 78,959 |

（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・サービシーズ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）。

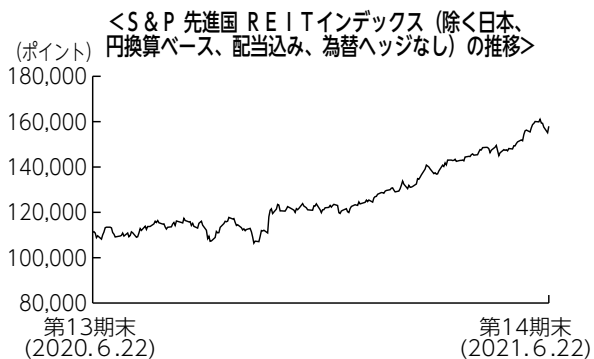
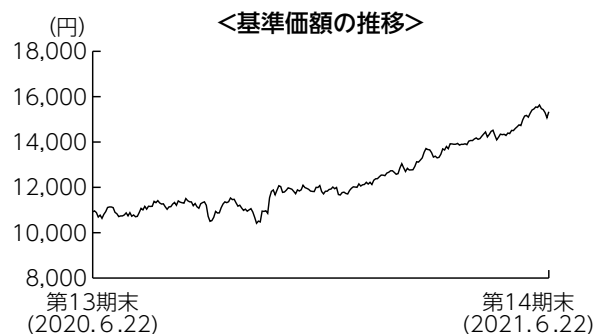
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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) | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|-------------------------|-------------|--------|--|--------|-------------------------------|
| | | 騰 落 率 | 期 騰 落 | 中 率 | |
| (期 首) 2020年 6 月 22 日 | 円 10,922 | % - | ポイント 111,241.50 | % - | % 99.7 |
| 6 月 末 | 10,809 | △1.0 | 110,069.47 | △1.1 | 99.3 |
| 7 月 末 | 11,008 | 0.8 | 112,029.46 | 0.7 | 99.7 |
| 8 月 末 | 11,349 | 3.9 | 115,692.61 | 4.0 | 99.6 |
| 9 月 末 | 10,869 | △0.5 | 110,930.39 | △0.3 | 97.4 |
| 10 月 末 | 10,511 | △3.8 | 107,293.68 | △3.5 | 98.8 |
| 11 月 末 | 11,822 | 8.2 | 120,978.81 | 8.8 | 100.4 |
| 12 月 末 | 11,940 | 9.3 | 122,315.74 | 10.0 | 99.6 |
| 2021年 1 月 末 | 12,223 | 11.9 | 125,429.06 | 12.8 | 100.1 |
| 2 月 末 | 12,864 | 17.8 | 132,415.62 | 19.0 | 99.6 |
| 3 月 末 | 13,803 | 26.4 | 141,813.22 | 27.5 | 99.4 |
| 4 月 末 | 14,442 | 32.2 | 148,529.64 | 33.5 | 99.6 |
| 5 月 末 | 14,756 | 35.1 | 151,940.99 | 36.6 | 99.7 |
| (期 末) 2021年 6 月 22 日 | 15,336 | 40.4 | 157,949.66 | 42.0 | 99.4 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は15,336円となり、前期末比で40.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は新型コロナウイルスの感染拡大や変異株の増加などから弱含む局面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動正常化への期待などから、多くの市場が上昇しました。為替市場においても多くの通貨が対円で上昇し円安となったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

外国リート市場は大幅に上昇しました。米国リート市場では新型コロナウイルスのワクチン接種の進展、金融緩和政策の長期化見通し、経済活動正常化への期待などから上昇しました。欧州リート市場では感染拡大や変異株の発生などから2020年11月頃まで下落する市場もありましたが、その後は反発し上昇する展開となりました。オーストラリアリート市場ではロックダウンにより下落する局面もありましたが、その後は好調な経済指標の発表などから上昇に転じました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。米ドルは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因となり2020年は円高が進みましたが、米国の長期金利が上昇したことなどから2021年に入ると反転し、前期末比では円安水準で期末を迎えました。ユーロなど他の通貨に対しても円安となりました。新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退し、安全資産と見られた円が売られたことが主な要因です。

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42.0%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを1.6%下回りました。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運用成果となりました。

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 | | 項 目 の 概 要 |
|---|-------------------------|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 4円 (0) (1) (3) | 0.033% (0.000) (0.005) (0.028) | (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 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 |
| (b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 12 (1) (11) | 0.096 (0.007) (0.089) | (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 |
| (c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 15 (7) (8) | 0.124 (0.057) (0.067) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 31 | 0.253 | |
| 期中の平均基準価額は12,344円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

| | 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 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 110.955 | 18,619 | 83.828 | 13,836 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.045 | 286 | 0.714 | 188 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 117.963 | 11,608 | 94.312 | 9,254 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 24.856 | 24 | 38.635 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 191.497 | 6,778 | 149.121 | 5,224 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 108.41 | 1,766 | 80.857 | 1,001 |
| | (△3.147) | (326) | (-) | (-) |
| AGREE REALTY CORP | 50.115 | 3,344 | 36.393 | 2,408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SL GREEN | 60.388 | 3,908 | 49.896 | 3,245 |
| | (△0.088) | (46) | (-) | (-) |
| EPR PROPERTIES | 57.934 | 2,349 | 45.759 | 1,877 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROLOGIS INC | 613.831 | 63,942 | 485.681 | 49,977 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 117.157 | 20,552 | 93.182 | 16,214 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 215.591 | 2,408 | 167.955 | 1,858 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 81.571 | 8,559 | 64.507 | 6,739 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 55.891 | 11 | 70.576 | 12 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MACK CALI | 62.671 | 875 | 50.446 | 732 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUINIX INC | 73.976 | 53,155 | 58.189 | 40,438 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 146.073 | 6,009 | 114.457 | 4,682 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CTO REALTY GROWTH INC | 4.656 | 218 | 1.691 | 87 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 121.376 | 4,042 | 94.397 | 3,140 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 15.282 | 209 | 10.4 | 154 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SITE CENTERS CORP | 138.089 | 1,623 | 102.413 | 1,219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 312.707 | 12,758 | 246.639 | 9,938 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | - | - | 0.908 | 1 |
| | (△8.175) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 54.325 | 14,027 | 43.137 | 10,993 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 285.969 | 18,676 | 228.377 | 14,919 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 58.294 | 5,623 | 46.246 | 4,454 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 104.125 | 4,598 | 81.096 | 3,581 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 448.772 | 13,616 | 354.783 | 10,711 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 93.145 | 2,642 | 72.169 | 2,000 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 110.414 | 3,322 | 85.218 | 2,535 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 82.4 | 3,291 | 64.905 | 2,608 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 124.758 | 1,394 | 98.562 | 1,100 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 349.563 | 23,151 | 276.887 | 18,426 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 32.283 | 4,573 | 25.073 | 3,510 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 358.539 | 6,004 | 280.112 | 4,800 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 88.581 | 5,505 | 69.901 | 4,334 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| LTC PROPERTIES INC | 27.592 | 1,083 | 21.613 | 860 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 135.997 | 588 | 95.837 | 416 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 73.691 | 1,246 | 54.737 | 926 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 140.097 | 1,704 | 106.761 | 1,301 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 240.657 | 8,102 | 190.534 | 6,576 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 97.397 | 1,262 | 53.439 | 612 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 143.513 | 9,220 | 117.607 | 7,408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 56.778 | 948 | 39.342 | 665 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 594.104 | 8,815 | 470.886 | 7,087 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 94.367 | 12,762 | 74.735 | 10,085 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 4.174 | 35 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 34.255 | 2,319 | 25.808 | 1,738 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CENTERSPACE | 7.768 | 554 | 5.267 | 369 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 7.745 | 169 | 5.072 | 112 |
| | (0.086) | (1) | (-) | (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 45.612 | 96 | 24.87 | 10 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GETTY REALTY CORP | 22.569 | 646 | 15.998 | 457 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 15.626 | 2,236 | 12.082 | 1,721 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RPT REALTY | 61.298 | 585 | 48.894 | 483 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 306.116 | 19,171 | 232.168 | 14,328 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 134.757 | 6,932 | 110.005 | 5,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 245.5 | 10,086 | 193.137 | 7,895 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 85.52 | 2,243 | 65.727 | 1,717 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORECIVIC INC | 27.418 | 217 | 63.211 | 421 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAUL CENTERS INC | 4.559 | 157 | 2.149 | 91 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 274.972 | 26,839 | 211.542 | 21,119 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| LIFE STORAGE INC | 52.188 (9.804) | 4,990 (-) | 40.315 (-) | 3,808 (-) |
| PUBLIC STORAGE | 127.911 (-) | 30,329 (-) | 101.076 (-) | 24,382 (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 93.136 (-) | 13,993 (-) | 69.88 (-) | 10,371 (-) |
| TAUBMAN CENTERS INC | 17.062 (-) | 644 (-) | 34.802 (-) | 1,427 (-) |
| TANGER FACTORY OUTLET | 71.465 (-) | 899 (-) | 52.696 (-) | 660 (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 23.776 (-) | 406 (-) | 17.114 (-) | 312 (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 22.796 (-) | 439 (-) | 16.452 (-) | 313 (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 8.054 (-) | 538 (-) | 5.872 (-) | 380 (-) |
| VENTAS INC | 313.759 (-) | 15,541 (-) | 248.73 (-) | 12,559 (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 133.257 (-) | 5,506 (-) | 106.394 (-) | 4,459 (-) |
| WASHINGTON REIT | 66.111 (-) | 1,498 (-) | 48.894 (-) | 1,080 (-) |
| GEO GROUP INC | 86.5 (-) | 763 (-) | 65.851 (-) | 530 (-) |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 96.481 (-) | 2,364 (-) | 75.395 (-) | 1,884 (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 114.558 (-) | 4,774 (-) | 90.633 (-) | 3,794 (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 65.403 (-) | 1,072 (-) | 50.154 (-) | 850 (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 110.153 (-) | 13,559 (-) | 85.731 (-) | 10,769 (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 72.38 (-) | 376 (-) | 58.856 (-) | 294 (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 179.464 (-) | 1,988 (-) | 144.323 (-) | 1,613 (-) |
| CUBESMART | 163.684 (-) | 5,903 (-) | 127.064 (-) | 4,641 (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 235.042 (-) | 33,562 (-) | 182.522 (-) | 25,861 (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 170.504 (-) | 1,468 (-) | 128.417 (-) | 1,120 (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 479.782 (-) | 9,914 (-) | 358.894 (-) | 7,333 (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 133.386 (-) | 4,113 (-) | 104.81 (-) | 3,189 (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 90.984 (-) | 1,338 (-) | 68.328 (-) | 1,020 (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 102.304 (-) | 1,707 (-) | 81.38 (-) | 1,352 (-) |

| | 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 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 76.394 | 655 | 58.833 | 509 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 56.238 | 3,314 | 43.608 | 2,527 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 39.997 | 1,195 | 30.694 | 932 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 138.035 | 1,851 | 109.904 | 1,480 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 205.295 | 7,536 | 145.23 | 5,273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 35.686 | 4,352 | 27.254 | 3,239 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 453.253 | 7,220 | 317.247 | 5,460 |
| | (△346.802) | (-) | (-) | (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 104.49 | 2,067 | 81.003 | 1,684 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 31.775 | 789 | 24.13 | 600 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 20.044 | 167 | 10.675 | 101 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 29.228 | 349 | 22.11 | 276 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 169.943 | 2,850 | 131.132 | 2,176 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WHITESTONE REIT | 9.906 | 66 | 5.471 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 124.175 | 3,189 | 98.7 | 2,531 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 126.984 | 4,153 | 96.854 | 3,174 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 178.403 | 1,677 | 138.584 | 1,320 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CYRUSONE INC | 101.07 | 7,275 | 77.856 | 5,389 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 145.942 | 10,186 | 113.024 | 7,755 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 59.301 | 923 | 26.081 | 462 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 11.793 | 217 | 6.505 | 129 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 183.103 | 5,034 | 144.568 | 3,886 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 43.138 | 2,798 | 33.761 | 2,273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 12.639 | 141 | 28.41 | 422 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 46.296 | 511 | 18.422 | 246 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 94.57 | 3,843 | 70.283 | 2,829 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 167.642 | 3,014 | 129.284 | 2,282 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 107.612 | 5,350 | 81.852 | 4,019 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 227.14 | 7,169 | 176.07 | 5,541 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 66.782 | 945 | 45.859 | 651 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 19.924 | 3,276 | 14.251 | 2,323 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 88.795 | 2,738 | 71.487 | 2,183 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 71.875 | 607 | 54.134 | 467 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL VALUE INC | 5.726 | 87 | 2.272 | 30 |
| | (0.336) | (5) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 478.21 | 14,636 | 372.084 | 11,321 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 53.808 | 3,434 | 39.318 | 2,443 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COREPOINT LODGING INC | 14.453 | 126 | 8.995 | 93 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 719.6 | 516 | 365.2 | 254 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 109.747 | 1,043 | 87.084 | 831 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 10.794 | 149 | 2.734 | 36 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFEHOLD INC | 8.948 | 612 | 6.341 | 439 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 98.973 | 2,127 | 72.351 | 1,551 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 47.62 | 1,074 | 37.302 | 841 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 93.556 | 1,369 | 72.487 | 1,078 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 183.791 | 7,736 | 143.608 | 5,952 |
| | (2.508) | (100) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 245.333 | 4,354 | 193.409 | 3,527 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8.056 | 22 | 13.391 | 36 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 37.354 | 589 | 36.549 | 584 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIME US REIT | 371.2 | 301 | 303.4 | 244 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 42.4 | 15 | 197.5 | 61 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | 12.476 | 132 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 2.541 | 27 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 4.82 | 53 | 3.022 | 41 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| CITY OFFICE REIT INC | 25.759 | 250 | 18.121 | 176 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NETSTREIT CORP | 10.996 | 216 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 40.053 | 24 | 9.926 | 18 |
| | (△79.4) | (—) | (—) | (—) |
| CARETRUST REIT INC | 77.978 | 1,699 | 59.797 | 1,283 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 81.617 | 3,533 | 70.035 | 2,970 |
| | (62.174) | (—) | (—) | (—) |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 75.559 | 1,735 | 6.983 | 140 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 34.72 | 201 | 25.202 | 142 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| STORE CAPITAL CORP | 197.895 | 6,267 | 150.39 | 4,717 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 129.796 | 1,151 | 104.552 | 921 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 21.594 | 302 | 8.051 | 109 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 87.924 | 1,323 | 66.193 | 1,015 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 63.539 | 1,393 | 47.25 | 1,000 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 96.335 | 1,526 | 77.994 | 1,285 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 14.983 | 665 | 11.479 | 529 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 52.808 | 2,060 | 38.174 | 1,479 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 13.617 | 628 | 9.326 | 443 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 161.5 | 2,153 | 125.605 | 1,687 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 67.743 | 1,175 | 53.161 | 923 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,187.6 | 881 | 951.3 | 684 |
| | (—) | (△8) | (—) | (—) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 190.22 | 3,371 | 148.94 | 2,734 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| VICI PROPERTIES INC | 463.276 | 12,455 | 348.152 | 9,456 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 15.938 | 249 | 9.706 | 151 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 56.394 | 1,551 | 39.877 | 1,072 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |

| | 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 |
| COLONY CAPITAL INC | 389.126 | 2,032 | 289.658 | 1,581 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 64.667 | 1,616 | 51.366 | 1,300 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 74.876 | 3,867 | 59.233 | 3,061 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 130.933 | 1,742 | 103.689 | 1,405 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 69.508 | 1,101 | 47.408 | 781 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 132.859 | 2,410 | 106.957 | 1,968 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 54.719 | 2,192 | 43.752 | 1,743 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 82.534 | 724 | 63.029 | 554 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 20.124 | 412 | 15.885 | 316 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 6.455 | 222 | 16.452 | 591 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 16.236 | 563 | 12.456 | 430 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 40.38 | 404 | 30.455 | 304 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 36.382 | 534 | 28.574 | 427 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 63.35 | 893 | 50.078 | 694 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 81.702 | 1,033 | 61.954 | 781 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 4.712 | 70 | 2.131 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 63.315 | 814 | 42.925 | 550 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 71.588 | 1,002 | 54.582 | 772 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 26.954 | 2,080 | 20.881 | 1,596 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 36.323 | 239 | 26.718 | 171 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 137.653 | 1,838 | 109.158 | 1,462 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.257 | 150 | 3.429 | 73 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 37.226 | 573 | 27.11 | 425 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLAZA RETAIL REIT | 30.759 | 112 | 10.148 | 33 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|--|------------------|---------------|------------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.277 (-) | 529 (-) | 21.219 (-) | 395 (-) |
| SLATE GROCERY REIT | 16.175 (-) | 182 (-) | 11.141 (-) | 121 (-) |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11.824 (-) | 123 (-) | 4.736 (-) | 48 (-) |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 34.635 (-) | 630 (-) | 24.623 (-) | 449 (-) |
| 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 | 400.076 (-) | 1,645 (-) | 321.248 (-) | 1,300 (-) |
| MIRVAC GROUP | 3,340.585 (-) | 8,245 (-) | 2,675.213 (-) | 6,532 (-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 1,351.602 (-) | 1,177 (-) | 1,056.859 (-) | 885 (-) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 433.207 (-) | 1,586 (-) | 333.977 (-) | 1,225 (-) |
| GPT GROUP | 1,645.239 (-) | 7,294 (-) | 1,310.039 (-) | 5,830 (-) |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 478.84 (-) | 1,117 (-) | 249.712 (-) | 604 (-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 297.815 (-) | 861 (-) | 201.422 (-) | 563 (-) |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 221.401 (-) | 669 (-) | 142.208 (-) | 432 (-) |
| STOCKLAND | 1,992.086 (-) | 8,608 (-) | 1,590.344 (-) | 6,859 (-) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 199.425 (-) | 1,003 (-) | 133.442 (-) | 674 (-) |
| DEXUS | 950.177 (-) | 8,958 (-) | 766.973 (-) | 7,215 (-) |
| GOODMAN GROUP | 1,420.64 (-) | 25,629 (-) | 1,109.628 (-) | 19,853 (-) |
| VICINITY CENTRES | 3,334.19 (-) | 5,243 (-) | 2,705.043 (-) | 4,206 (-) |
| CHARTER HALL GROUP | 380.505 (-) | 4,955 (-) | 296.319 (-) | 3,790 (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 209.892 (-) | 731 (-) | 159.678 (-) | 547 (-) |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 919.023 (-) | 2,200 (-) | 706.805 (-) | 1,682 (-) |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 430.095 (-) | 1,378 (-) | 217.121 (-) | 695 (-) |
| ARENA REIT | 198.806 (-) | 589 (-) | 133.033 (-) | 400 (-) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 470.705 (-) | 2,230 (-) | 332.916 (-) | 1,579 (-) |
| APN INDUSTRIA REIT | 96.073 (-) | 285 (-) | 64.835 (-) | 191 (-) |

| | 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 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 843.968 | 1,643 | 608.162 | 1,163 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 32.489 | 105 | 9.185 | 28 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GDI PROPERTY GROUP | 236.815 | 267 | 126.789 | 135 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOME CONSORTIUM LTD | 133.803 | 549 | 47.823 | 196 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RURAL FUNDS GROUP | 231.597 | 558 | 173.393 | 408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRONGATE GROUP | 479.341 | 657 | 223.193 | 301 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCENTRE GROUP | 4,384.993 | 11,752 | 3,491.308 | 9,302 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOME CO DAILY NEEDS REIT | 229.327 | 308 | 46.547 | 61 |
| | (30.33) | (-) | (-) | (-) |
| CENTURIA OFFICE REIT | 298.744 | 638 | 235.378 | 491 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD | 364.512 | 983 | 188.049 | 521 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAYPOINT REIT LTD | 671.797 | 1,730 | 497.872 | 1,263 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 1,715.3 | 119,146 | 1,345.6 | 92,987 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROSPERITY REIT | 791 | 1,970 | 555 | 1,381 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,040 | 3,993 | 727 | 2,784 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHAMPION REIT | 1,496 | 6,593 | 1,161 | 5,036 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 737 | 2,906 | 599 | 2,373 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,193 | 8,695 | 918 | 6,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 3,541.1 | 7,366 | 2,946.7 | 6,038 |
| | (735.249) | (1,493) | (-) | (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 2,855 | 8,720 | 2,191.9 | 6,566 |
| | (-) | (△52) | (-) | (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 460 | 785 | 279.8 | 479 |
| | (△1,021.179) | (△1,757) | (-) | (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 1,785 | 2,661 | 1,476.6 | 2,212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 2,606.5 | 5,110 | 2,116 | 4,080 |
| | (-) | (△11) | (-) | (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 1,199.3 | 596 | 916.7 | 455 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASCOTT TRUST | 1,595.5 | 1,624 | 1,234 | 1,233 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |

| | 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 |
| KEPPEL REIT | 1,741 | 1,977 | 1,343.1 | 1,526 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 1,208 | 2,987 | 793.4 | 1,893 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESR REIT | 1,765.3 | 687 | 1,253.1 | 476 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 584.2 | 712 | 469.9 | 556 |
| | (-) | (△5) | (-) | (-) |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 729.9 | 963 | 512.3 | 669 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 554.9 | 192 | 126.2 | 53 |
| | (-) | (△11) | (-) | (-) |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 462.1 | 595 | 385.8 | 492 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 339 | 1,377 | 279.3 | 1,130 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 3,757.7 | 277 | 1,613.6 | 108 |
| | (-) | (△4) | (-) | (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 1,625.5 | 4,650 | 1,168.2 | 3,260 |
| | (-) | (△0.81437) | (-) | (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,857 | 3,797 | 1,473.4 | 2,961 |
| | (-) | (△8) | (-) | (-) |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 1,070.7 | 740 | 793.6 | 541 |
| | (-) | (△0.60706) | (-) | (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 364.1 | 133 | 337.1 | 120 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 1,562.4 | 1,534 | 1,157.6 | 1,125 |
| | (-) | (△20) | (-) | (-) |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 761.4 | 454 | 541.2 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPH REIT | 712.8 | 601 | 477.9 | 391 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 659.9 | 339 | 934.9 | 489 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 169.5 | 118 | 42.1 | 29 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 325.1 | 266 | 282.2 | 235 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QUE COMMERCIAL REIT | 1,496.3 | 568 | 1,149 | 414 |
| | (-) | (△0.35666) | (-) | (-) |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 783.9 | 570 | 565.3 | 422 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST-RTS | - | - | 3,422.4 | - |
| | (3,422.4) | (-) | (-) | (-) |
| IREIT GLOBAL-RTS | - | - | 98.926 | 11 |
| | (98.926) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | - | - | 596.624 | 0.59609 |
| | (596.624) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 400.4 | 196 | 259 | 119 |
| | (-) | (△0.72217) | (-) | (-) |

| | 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 |
| IREIT GLOBAL | 355.6 | 241 | 141.1 | 85 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 1,050.6 | 2,906 | 818.8 | 2,212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 2,329.8 | 3,237 | 1,738 | 2,399 |
| | (-) | (△25) | (-) | (-) |
| 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 | 818.851 | 1,369 | 634.984 | 1,044 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 326.559 | 997 | 253.05 | 752 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 955.298 | 2,179 | 763.949 | 1,734 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 1,275.587 | 1,541 | 980.325 | 1,174 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 480.741 | 704 | 339.798 | 492 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 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 | 809.176 | 3,771 | 648.99 | 3,069 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | - | - | 9.186 | 4 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DERWENT LONDON PLC | 98.214 | 3,129 | 76.905 | 2,431 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 135.61 | 1,541 | 106.284 | 1,201 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 4,457.433 | 1,893 | 2,508.405 | 724 |
| | (△206.045) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 647.307 | 4,259 | 513.372 | 3,373 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 100.7 | 766 | 76.048 | 576 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNITE GROUP PLC | 350.775 | 3,565 | 271.617 | 2,731 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 1,083.806 | 1,627 | 821.88 | 1,213 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHAFTESBURY PLC | 269.444 | 1,562 | 188.826 | 1,118 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SEGRO PLC | 1,030.372 | 9,810 | 793.102 | 7,430 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 196.688 | 1,322 | 151.001 | 1,011 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASSURA PLC | 2,162.775 | 1,628 | 1,708.072 | 1,267 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD | 179.591 | 99 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 126.599 | 43 | 59.156 | 19 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 423.894 | 337 | 336.768 | 262 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 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 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 499.046 (-) | 355 (-) | 405.154 (-) | 288 (-) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 172.095 (-) | 1,406 (-) | 134.653 (-) | 1,079 (-) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 722.168 (-) | 1,628 (-) | 567.785 (-) | 1,241 (-) |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 588.23 (-) | 433 (-) | 462.843 (-) | 334 (-) |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 731.393 (-) | 1,120 (-) | 580.621 (-) | 896 (-) |
| GCP STUDENT LIVING PLC | 484.173 (-) | 688 (-) | 273.977 (-) | 396 (-) |
| RDI REIT PLC | 171.611 (-) | 179 (-) | 245.662 (-) | 280 (-) |
| NEWRIVER REIT PLC | 172.393 (-) | 146 (-) | 134.927 (-) | 116 (-) |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 420.594 (-) | 467 (-) | 316.392 (-) | 343 (-) |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 285.966 (-) | 306 (-) | 218.614 (-) | 230 (-) |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 750.126 (-) | 819 (-) | 378.359 (-) | 410 (-) |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 1,443.65 (-) | 2,536 (-) | 1,145.637 (-) | 2,002 (-) |
| CUSTODIAN REIT PLC | 376.931 (-) | 350 (-) | 174.011 (-) | 156 (-) |
| HOME REIT PLC | 134.476 (-) | 154 (-) | 33.663 (-) | 38 (-) |
| HAMMERSON PLC-RTS | - (7,236.264) | - (-) | 7,236.264 (-) | 496 (-) |
| ELITE COMMERCIAL REIT | 112 (-) | 74 (-) | 112 (-) | 68 (-) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 391.663 (-) | 287 (-) | 296.627 (-) | 210 (-) |
| AEW UK REIT PLC | 74.995 (-) | 67 (-) | 45.965 (-) | 45 (-) |
| LXI REIT PLC | 452.547 (-) | 566 (-) | 320.025 (-) | 387 (-) |
| REGIONAL REIT LTD | 234.481 (-) | 183 (-) | 157.884 (-) | 119 (-) |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 327.512 (-) | 358 (-) | 174.095 (-) | 188 (-) |
| イスラエル | 千□ | 千イスラエル・シュケル | 千□ | 千イスラエル・シュケル |
| REIT 1 LTD | 103.154 (-) | 1,603 (-) | 70.342 (-) | 1,057 (-) |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT | 82.061 (-) | 340,087 (-) | 42.218 (-) | 180,520 (-) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 31.802 (-) | 229,457 (-) | 23.061 (-) | 167,543 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------|---------|---------|---------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 9.958 | 47,204 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LOTTE REIT CO LTD | 119.571 | 626,223 | 90.462 | 470,659 |
| | (-) | (26) | (-) | (-) |
| LOTTE REIT CO LTD RTS | - | - | 20.343 | 2,443 |
| | (20.343) | (△26) | (-) | (-) |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 27.582 | 145,503 | 9.722 | 58,867 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JR REIT XXVII | 98.87 | 519,809 | 42.648 | 220,349 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 46.423 | 354,574 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (シンガポール) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| CROMWELL REIT EUR | 1,296.1 | 608 | 529 | 290 |
| | (△635.36) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HIBERNIA REIT PLC | 518.752 | 597 | 420.108 | 466 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 297.438 | 461 | 202.808 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 28.976 | 485 | 23.192 | 384 |
| | (0.958) | (-) | (-) | (-) |
| VASTNED RETAIL | 14.275 | 344 | 11.302 | 270 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WERELDHAVE NV | 23.656 | 296 | 16.76 | 224 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NSI NV | 13.815 | 453 | 10.836 | 352 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BEFIMMO | 20.334 | 738 | 14.982 | 530 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COFINIMMO SA | 23.405 | 2,939 | 16.927 | 2,108 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL ESTATES | 8.705 | 522 | 6.848 | 400 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 16.202 | 357 | 12.566 | 271 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 119.698 | 3,444 | 93.353 | 2,646 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONTEA SCA | 7.779 | 745 | 6.313 | 588 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA | 26.131 | 2,595 | 18.409 | 1,811 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARE PROPERTY INVEST NV | 19.974 | 527 | 7.94 | 200 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA SA-RTS | - | - | 10.417 | 8 |
| | (10.417) | (-) | (-) | (-) |
| XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS | - | - | 6.997 | 2 |
| | (6.997) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|----------------|-----------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 13.746 (-) | 670 (-) | 5.507 (-) | 257 (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 45.846 (-) | 5,543 (-) | 36.902 (-) | 4,373 (-) |
| ICADE | 25.127 (-) | 1,557 (-) | 18.718 (-) | 1,146 (-) |
| ALTAREA | 2.295 (-) | 324 (△10) | 1.629 (-) | 227 (-) |
| KLEPIERRE | 165.257 (-) | 3,136 (△151) | 132.011 (-) | 2,498 (-) |
| COVIVIO | 41.233 (-) | 2,908 (-) | 32.657 (-) | 2,280 (-) |
| MERCIALYS | 26.14 (-) | 203 (-) | 14.283 (-) | 134 (-) |
| CARMILA SA | 38.138 (-) | 389 (△7) | 16.285 (-) | 221 (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 115.654 (-) | 6,959 (-) | 91.353 (-) | 5,538 (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 44.28 (-) | 395 (-) | 33.716 (-) | 296 (-) |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 145.224 (-) | 1,997 (△80) | 107.058 (-) | 1,450 (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 212.459 (-) | 1,719 (△3) | 165.535 (-) | 1,329 (-) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 22.988 (-) | 107 (△3) | 13.966 (-) | 68 (-) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 271.462 (-) | 2,223 (△43) | 222.224 (-) | 1,818 (-) |
| ユーロ (イタリア) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 27.255 (-) | 94 (-) | 16.303 (-) | 54 (-) |

(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 (2020年6月23日から2021年6月22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) | | | | | | | |
| | KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | — | 354.4 | 269 | 29,703 | | 0.0 |
| | EAGLE HOSPITALITY TRUST | 72.7 | 72.7 | 0 | 0 | | 0.0 |
| | PRIME US REIT | 143.6 | 211.4 | 182 | 20,165 | | 0.0 |
| | ARA US HOSPITALITY TRUST | 155.1 | — | — | — | | — |
| | MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME | 422.1 | 658.4 | 506 | 55,908 | | 0.1 |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 37.388 | 64.515 | 12,029 | 1,326,609 | | 1.7 |
| | ALEXANDER'S INC. | 0.658 | 0.989 | 272 | 30,066 | | 0.0 |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 42.842 | 66.493 | 7,954 | 877,228 | | 1.1 |
| | CEDAR REALTY TRUST INC | 13.779 | — | — | — | | — |
| | OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 67.224 | 109.6 | 4,022 | 443,581 | | 0.6 |
| | APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 44.475 | 68.881 | 515 | 56,819 | | 0.1 |
| | AGREE REALTY CORP | 15.954 | 29.676 | 2,087 | 230,199 | | 0.3 |
| | BRT APARTMENTS CORP | 3.832 | 3.832 | 68 | 7,593 | | 0.0 |
| | SL GREEN | 22.676 | 33.08 | 2,646 | 291,881 | | 0.4 |
| | EPR PROPERTIES | 22.743 | 34.918 | 1,857 | 204,821 | | 0.3 |
| | PROLOGIS INC | 218.819 | 346.969 | 42,534 | 4,690,752 | | 5.9 |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 41.682 | 65.657 | 13,925 | 1,535,742 | | 1.9 |
| | LEXINGTON REALTY TRUST | 81.846 | 129.482 | 1,615 | 178,205 | | 0.2 |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 28.877 | 45.941 | 6,222 | 686,189 | | 0.9 |
| | CBL & ASSOCIATES | 14.685 | — | — | — | | — |
| | MACK CALI | 27.227 | 39.452 | 668 | 73,701 | | 0.1 |
| | EQUINIX INC | 26.224 | 42.011 | 34,554 | 3,810,620 | | 4.8 |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 51.259 | 82.875 | 3,971 | 437,962 | | 0.6 |
| | CTO REALTY GROUTH INC | — | 2.965 | 157 | 17,388 | | 0.0 |
| | COUSINS PROPERTIES INC | 43.872 | 70.851 | 2,696 | 297,379 | | 0.4 |
| | URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 9.558 | 14.44 | 283 | 31,307 | | 0.0 |
| | SITE CENTERS CORP | 45.456 | 81.132 | 1,225 | 135,103 | | 0.2 |
| | DUKE REALTY TRUST | 109.515 | 175.583 | 8,559 | 943,960 | | 1.2 |
| | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 9.083 | — | — | — | | — |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 19.381 | 30.569 | 9,420 | 1,038,887 | | 1.3 |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 103.634 | 161.226 | 12,794 | 1,411,021 | | 1.8 |
| | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 20.972 | 33.02 | 3,953 | 435,990 | | 0.6 |
| | FIRST INDUSTRIAL RT | 37.957 | 60.986 | 3,257 | 359,210 | | 0.5 |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 159.473 | 253.462 | 8,577 | 945,888 | | 1.2 |
| | EQUITY COMMONWEALTH | 35.738 | 56.714 | 1,577 | 173,935 | | 0.2 |
| | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 40.136 | 65.332 | 2,015 | 222,268 | | 0.3 |
| | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 31.134 | 48.629 | 2,274 | 250,818 | | 0.3 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 49.829 | 76.025 | 1,036 | 114,274 | | 0.1 |
| | WELLTOWER INC | 123.686 | 196.362 | 15,822 | 1,744,943 | | 2.2 |
| | EAST GROUP | 11.518 | 18.728 | 3,177 | 350,361 | | 0.4 |
| | KIMCO REALTY | 126.14 | 204.567 | 4,299 | 474,203 | | 0.6 |
| | KILROY REALTY CORP | 31.365 | 50.045 | 3,615 | 398,689 | | 0.5 |
| | LTC PROPERTIES INC | 11.953 | 17.932 | 687 | 75,779 | | 0.1 |
| | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 72.676 | 112.836 | 454 | 50,147 | | 0.1 |
| | MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 29.217 | 48.171 | 919 | 101,358 | | 0.1 |
| | BRANDYWINE REALTY TRUST | 49.719 | 83.055 | 1,200 | 132,351 | | 0.2 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 85.668 | 135.791 | 6,159 | 679,267 | | 0.9 |
| | THE MACERICH COMPANY | 34.714 | 78.672 | 1,398 | 154,171 | | 0.2 |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 53.835 | 79.741 | 6,120 | 674,927 | | 0.9 |
| | ACADIA REALTY TRUST | 24.839 | 42.275 | 919 | 101,447 | | 0.1 |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 208.857 | 332.075 | 5,854 | 645,632 | | 0.8 |

| 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 | % |
| MID AMERICA | | 33.983 | | 53.615 | 9,167 | 1,010,946 | 1.3 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | | 12.444 | | 16.618 | 193 | 21,313 | 0.0 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | | 12.733 | | 21.18 | 1,397 | 154,111 | 0.2 |
| CENTERSPACE | | 3.559 | | 6.06 | 470 | 51,913 | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | | 5.097 | | 7.856 | 226 | 24,959 | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | | 8.333 | | 29.075 | 72 | 8,015 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | | 10.38 | | 16.951 | 555 | 61,296 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS | | 5.805 | | 9.349 | 1,429 | 157,641 | 0.2 |
| RPT REALTY | | 25.39 | | 37.794 | 503 | 55,558 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 101.743 | | 175.691 | 11,957 | 1,318,676 | 1.7 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 49.99 | | 74.742 | 4,891 | 539,474 | 0.7 |
| UDR INC | | 87.344 | | 139.707 | 6,922 | 763,411 | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | | 32.504 | | 52.297 | 1,527 | 168,405 | 0.2 |
| CORECIVIC INC | | 35.793 | | — | — | — | — |
| SAUL CENTERS INC | | 3.788 | | 6.198 | 291 | 32,125 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 90.583 | | 154.013 | 20,252 | 2,233,468 | 2.8 |
| LIFE STORAGE INC | | 13.99 | | 35.667 | 3,867 | 426,454 | 0.5 |
| PUBLIC STORAGE | | 44.536 | | 71.371 | 21,664 | 2,389,179 | 3.0 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 29.114 | | 52.37 | 9,227 | 1,017,561 | 1.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | | 17.74 | | — | — | — | — |
| TANGER FACTORY OUTLET | | 28.639 | | 47.408 | 876 | 96,616 | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC | | 11.534 | | 18.196 | 401 | 44,246 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | | 10.478 | | 16.822 | 381 | 42,111 | 0.1 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | | 3.813 | | 5.995 | 374 | 41,274 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 110.685 | | 175.714 | 10,124 | 1,116,545 | 1.4 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 47.3 | | 74.163 | 3,569 | 393,640 | 0.5 |
| WASHINGTON REIT | | 24.141 | | 41.358 | 953 | 105,130 | 0.1 |
| GEO GROUP INC | | 36.455 | | 57.104 | 446 | 49,245 | 0.1 |
| WEINGARTEN REALTY INVST | | 35.001 | | 56.087 | 1,803 | 198,856 | 0.3 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | 41.075 | | 65 | 3,172 | 349,879 | 0.4 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 25.625 | | 40.874 | 901 | 99,437 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 38.157 | | 62.579 | 10,241 | 1,129,452 | 1.4 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | | 33.124 | | 46.648 | 247 | 27,316 | 0.0 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | | 64.963 | | 100.104 | 1,307 | 144,175 | 0.2 |
| CUBESMART | | 57.831 | | 94.451 | 4,459 | 491,742 | 0.6 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 79.493 | | 132.013 | 20,551 | 2,266,450 | 2.9 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | | 60.643 | | 102.73 | 1,047 | 115,556 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 156.528 | | 277.416 | 5,623 | 620,128 | 0.8 |
| DOUGLAS EMMETT INC | | 49.264 | | 77.84 | 2,777 | 306,284 | 0.4 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | | 35.098 | | 57.754 | 1,038 | 114,580 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 36.359 | | 57.283 | 1,114 | 122,932 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | | 31.285 | | 48.846 | 477 | 52,628 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | | 19.467 | | 32.097 | 2,134 | 235,422 | 0.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 14.433 | | 23.736 | 899 | 99,154 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | | 48.111 | | 76.242 | 1,191 | 131,416 | 0.2 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | 59.337 | | 119.402 | 4,532 | 499,844 | 0.6 |
| CORESITE REALTY CORP | | 11.921 | | 20.353 | 2,694 | 297,153 | 0.4 |
| VEREIT INC | | 318.763 | | 107.967 | 5,090 | 561,396 | 0.7 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 37.688 | | 61.175 | 1,444 | 159,349 | 0.2 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | | 14.519 | | 22.164 | 656 | 72,423 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | | 14.783 | | 24.152 | 252 | 27,860 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 15.244 | | 22.362 | 301 | 33,292 | 0.0 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | | 59.548 | | 98.359 | 1,751 | 193,185 | 0.2 |
| WHITESTONE REIT | | 13.415 | | 17.85 | 148 | 16,397 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | | 45.098 | | 70.573 | 2,040 | 225,000 | 0.3 |

| 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 | % |
| STAG INDUSTRIAL INC | | 44.62 | | 74.75 | 2,916 | 321,658 | 0.4 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | | 64.534 | | 104.353 | 1,241 | 136,945 | 0.2 |
| CYRUSONE INC | | 33.769 | | 56.983 | 3,979 | 438,817 | 0.6 |
| WP CAREY INC | | 50.961 | | 83.879 | 6,449 | 711,246 | 0.9 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | | — | | 33.22 | 633 | 69,826 | 0.1 |
| GLADSTONE LAND CORP | | 6.064 | | 11.352 | 281 | 31,047 | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | | 64.729 | | 103.264 | 2,943 | 324,556 | 0.4 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | | 16.325 | | 25.702 | 2,128 | 234,774 | 0.3 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | | 15.771 | | — | — | — | — |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | | — | | 27.874 | 391 | 43,158 | 0.1 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | | 30.498 | | 54.785 | 2,662 | 293,626 | 0.4 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | | 60.012 | | 98.37 | 1,876 | 206,984 | 0.3 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | | 36.348 | | 62.108 | 3,656 | 403,285 | 0.5 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | | 76.081 | | 127.151 | 4,986 | 549,951 | 0.7 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | | 25.835 | | 46.758 | 863 | 95,188 | 0.1 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | | 5.514 | | 11.187 | 2,109 | 232,688 | 0.3 |
| JBG SMITH PROPERTIES | | 34.3 | | 51.608 | 1,743 | 192,253 | 0.2 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | | 32.571 | | 50.312 | 424 | 46,828 | 0.1 |
| RETAIL VALUE INC | | 5.004 | | 8.794 | 189 | 20,860 | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC | | 160.366 | | 266.492 | 10,001 | 1,102,959 | 1.4 |
| QTS REALTY TRUST INC | | 17.856 | | 32.346 | 2,497 | 275,381 | 0.3 |
| COREPOINT LODGING INC | | 13.648 | | 19.106 | 197 | 21,828 | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | | 45.046 | | 67.709 | 838 | 92,515 | 0.1 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | | 4.986 | | 13.046 | 263 | 29,004 | 0.0 |
| SAFEHOLD INC | | 4.045 | | 6.652 | 521 | 57,527 | 0.1 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | | 26.537 | | 53.159 | 1,467 | 161,801 | 0.2 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | | 19.666 | | 29.984 | 787 | 86,865 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | | 35.108 | | 56.177 | 989 | 109,097 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | | 60.857 | | 103.548 | 4,826 | 532,252 | 0.7 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | | 88.264 | | 140.188 | 3,259 | 359,443 | 0.5 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | | 5.335 | | — | — | — | — |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | | 16.848 | | 17.653 | 328 | 36,190 | 0.0 |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | | — | | 12.476 | 114 | 12,657 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | | 8.102 | | 10.643 | 105 | 11,643 | 0.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | | 9.378 | | 11.176 | 139 | 15,430 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | | 13.297 | | 20.935 | 264 | 29,159 | 0.0 |
| NETSTREIT CORP | | — | | 10.996 | 259 | 28,630 | 0.0 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | | 49.273 | | — | — | — | — |
| CARETRUST REIT INC | | 28.677 | | 46.858 | 1,087 | 119,937 | 0.2 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | | — | | 73.756 | 3,571 | 393,839 | 0.5 |
| BROADSTONE NET LEASE INC | | — | | 68.576 | 1,710 | 188,610 | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | | 27.59 | | 37.108 | 257 | 28,441 | 0.0 |
| STORE CAPITAL CORP | | 65.92 | | 113.425 | 3,965 | 437,297 | 0.6 |
| PARAMOUNT GROUP INC | | 55.473 | | 80.717 | 874 | 96,402 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | | 12.189 | | 25.732 | 392 | 43,303 | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | | 32.034 | | 53.765 | 1,059 | 116,805 | 0.1 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | | 21.404 | | 37.693 | 811 | 89,495 | 0.1 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | | 34.147 | | 52.488 | 1,027 | 113,278 | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | | 6.893 | | 10.397 | 582 | 64,254 | 0.1 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | | 17.791 | | 32.425 | 1,634 | 180,293 | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | | 6.19 | | 10.481 | 508 | 56,116 | 0.1 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | | 60.884 | | 96.779 | 1,546 | 170,551 | 0.2 |
| GLOBAL NET LEASE INC | | 26.964 | | 41.546 | 766 | 84,486 | 0.1 |
| CLIPPER REALTY INC | | 5.086 | | 5.086 | 38 | 4,206 | 0.0 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | | 69.339 | | 110.619 | 2,372 | 261,669 | 0.3 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|--------------|--------------|-------------|------------|----|------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| (アメリカ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| VICI PROPERTIES INC | 137.449 | 252,573 | 8,089 | 892,155 | | 1.1 |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 9.418 | 15.65 | 294 | 32,429 | | 0.0 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 20.693 | 37.21 | 1,080 | 119,166 | | 0.2 |
| COLONY CAPITAL INC | 139.081 | 238,549 | 2,027 | 223,611 | | 0.3 |
| 小計 | 7,409.052 | 11,651.995 | 534.054 | 58,895.551 | | - |
| | 157銘柄<74.6%> | 156銘柄<74.6%> | - | - | | 74.6 |
| (カナダ) | 千口 | 千円 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 20.064 | 33.365 | 996 | 88,778 | | 0.1 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 24.536 | 40.179 | 2,380 | 211,992 | | 0.3 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 39.965 | 67.209 | 1,102 | 98,213 | | 0.1 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | 30.633 | 52.733 | 942 | 83,915 | | 0.1 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 46.927 | 72.829 | 1,610 | 143,392 | | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 18.176 | 29.143 | 1,344 | 119,741 | | 0.2 |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 24.741 | 44.246 | 477 | 42,513 | | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 8.627 | 12.866 | 308 | 27,439 | | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 9.997 | - | - | - | | - |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.095 | 10.875 | 457 | 40,751 | | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 21.186 | 31.111 | 364 | 32,497 | | 0.0 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 13.784 | 21.592 | 387 | 34,513 | | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 18.272 | 31.544 | 542 | 48,286 | | 0.1 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 24.249 | 43.997 | 568 | 50,658 | | 0.1 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 6.002 | 8.583 | 144 | 12,871 | | 0.0 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 22.509 | 42.899 | 650 | 57,951 | | 0.1 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 20.873 | 37.879 | 669 | 59,603 | | 0.1 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 8.495 | 14.568 | 1,238 | 110,268 | | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 12.414 | 22.019 | 164 | 14,666 | | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 46.042 | 74.537 | 1,092 | 97,306 | | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | 4.997 | 8.825 | 211 | 18,860 | | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 14.064 | 24.18 | 410 | 36,518 | | 0.0 |
| PLAZA RETAIL REIT | - | 20.611 | 96 | 8,608 | | 0.0 |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES | 12.087 | 19.145 | 438 | 39,075 | | 0.0 |
| SLATE GROCERY REIT | 5.623 | 10.657 | 137 | 12,270 | | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 11.634 | 11.634 | 62 | 5,584 | | 0.0 |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT | - | 7.088 | 87 | 7,807 | | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | 14.74 | 24.752 | 513 | 45,736 | | 0.1 |
| 小計 | 487.732 | 819.066 | 17,403 | 1,549,824 | | - |
| | 26銘柄<1.9%> | 27銘柄<2.0%> | - | - | | 2.0 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千円 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| BWP TRUST | 145.963 | 224.791 | 973 | 80,738 | | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | 1,181.612 | 1,846.984 | 5,393 | 447,365 | | 0.6 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 570.442 | 865.185 | 787 | 65,308 | | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 136.991 | 236.221 | 921 | 76,418 | | 0.1 |
| GPT GROUP | 575.807 | 911.007 | 4,391 | 364,237 | | 0.5 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | - | 229.128 | 607 | 50,366 | | 0.1 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 100.258 | 196.651 | 619 | 51,383 | | 0.1 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU | 75.176 | 154.369 | 534 | 44,304 | | 0.1 |
| STOCKLAND | 727.078 | 1,128.82 | 5,260 | 436,341 | | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 68.692 | 134.675 | 816 | 67,698 | | 0.1 |
| DEXUS | 321.924 | 505.128 | 5,435 | 450,847 | | 0.6 |
| GOODMAN GROUP | 478.528 | 789.54 | 16,517 | 1,370,099 | | 1.7 |
| VICINITY CENTRES | 1,197.4 | 1,826.547 | 2,986 | 247,722 | | 0.3 |
| CHARTER HALL GROUP | 136.701 | 220.887 | 3,339 | 277,037 | | 0.4 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 86.456 | 136.67 | 552 | 45,800 | | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 301.574 | 513.792 | 1,310 | 108,678 | | 0.1 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | - | 212.974 | 796 | 66,071 | | 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 | |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % | |
| ARENA REIT | 93.469 | 159,242 | 547 | 45,439 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 123.086 | 260,875 | 1,254 | 104,086 | 0.1 | |
| APN INDUSTRIA REIT | 41.907 | 73,145 | 234 | 19,415 | 0.0 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 280.409 | 516,215 | 1,047 | 86,924 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 50.661 | 73,965 | 241 | 20,062 | 0.0 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 137.85 | 247,876 | 280 | 23,234 | 0.0 | |
| HOME CONSORTIUM LTD | - | 85.98 | 498 | 41,365 | 0.1 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 101.989 | 160.193 | 397 | 32,954 | 0.0 | |
| IRONGATE GROUP | - | 256.148 | 371 | 30,808 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 1,543.922 | 2,437.607 | 6,874 | 570,202 | 0.7 | |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | - | 213.11 | 303 | 25,190 | 0.0 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 115.908 | 179,274 | 419 | 34,797 | 0.0 | |
| AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD | - | 176.463 | 538 | 44,644 | 0.1 | |
| WAYPOINT REIT LTD | 208.852 | 382.777 | 1,014 | 84,141 | 0.1 | |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 8,802.655 25銘柄<6.6%> | 15,356.239 31銘柄<6.9%> | 65,264 - | 5,413,690 - | - 6.9 |
| (香港) | 千口 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % | |
| LINK REIT | 608.02 | 977.72 | 76,066 | 1,080,145 | 1.4 | |
| PROSPERITY REIT | 361 | 597 | 1,779 | 25,262 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 448 | 761 | 3,135 | 44,521 | 0.1 | |
| CHAMPION REIT | 602.07 | 937.07 | 4,216 | 59,878 | 0.1 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 313 | 451 | 2,056 | 29,203 | 0.0 | |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T | 405 | 680 | 5,712 | 81,110 | 0.1 | |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 2,737.09 6銘柄<1.9%> | 4,403.79 6銘柄<1.7%> | 92,966 - | 1,320,122 - | - 1.7 |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 839.66 | 2,169,309 | 4,555 | 373,509 | 0.5 | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | 881.66 | 1,544.76 | 4,526 | 371,098 | 0.5 | |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 840.979 | - | - | - | - | |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 698.59 | 1,006.99 | 1,470 | 120,542 | 0.2 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 880.12 | 1,370.62 | 2,768 | 227,001 | 0.3 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 374.2 | 656.8 | 361 | 29,618 | 0.0 | |
| ASCOTT TRUST | 530.116 | 891.616 | 891 | 73,103 | 0.1 | |
| KEPPEL REIT | 553.6 | 951.5 | 1,094 | 89,715 | 0.1 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 208.3 | 622.9 | 1,501 | 123,082 | 0.2 | |
| ESR REIT | 636.53 | 1,148.73 | 470 | 38,615 | 0.0 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 250.9 | 365.2 | 452 | 37,129 | 0.0 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 232.58 | 450.18 | 621 | 50,936 | 0.1 | |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 180.1 | 608.8 | 167 | 13,726 | 0.0 | |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 140.595 | 216.895 | 307 | 25,252 | 0.0 | |
| PARKWAY LIFE REIT | 119.3 | 179 | 789 | 64,722 | 0.1 | |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | 615 | 2,759.1 | 176 | 14,477 | 0.0 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 455.82 | 913.12 | 2,556 | 209,626 | 0.3 | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 644.6 | 1,028.2 | 2,200 | 180,406 | 0.2 | |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 310.78 | 587.88 | 485 | 39,765 | 0.1 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 286.2 | 313.2 | 134 | 11,042 | 0.0 | |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 614.2 | 1,019 | 1,080 | 88,560 | 0.1 | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 271.3 | 491.5 | 289 | 23,775 | 0.0 | |
| SPH REIT | 237 | 471.9 | 410 | 33,661 | 0.0 | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 275 | - | - | - | - | |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT | - | 127.4 | 102 | 8,408 | 0.0 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T | 165.2 | 208.1 | 193 | 15,867 | 0.0 | |
| OUÉ COMMERCIAL REIT | 773.055 | 1,120.355 | 448 | 36,743 | 0.0 | |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 203.6 | 422.2 | 339 | 27,866 | 0.0 | |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 235.7 | 377.1 | 197 | 16,232 | 0.0 | |

| 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 |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| IREIT GLOBAL | - | 214.5 | 140 | 11,519 | | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | 359.7 | 591.5 | 1,520 | 124,637 | | 0.2 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | 723.164 | 1,314.964 | 1,814 | 148,783 | | 0.2 |
| 小計 | □ 数 銘柄数 <比率> | 13,537.549 30銘柄<4.1%> | 24,143.319 30銘柄<3.3%> | 32,070 | 2,629,427 | - 3.3 |
| (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 | 326.171 | 510.038 | 790 | 60,833 | | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 106.603 | 180.112 | 545 | 41,994 | | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 328.996 | 520.345 | 1,194 | 91,893 | | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 447.199 | 742.461 | 864 | 66,559 | | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 247.066 | 388.009 | 601 | 46,278 | | 0.1 |
| 小計 | □ 数 銘柄数 <比率> | 1,456.035 5銘柄<0.4%> | 2,340.965 5銘柄<0.4%> | 3,996 | 307,559 | - 0.4 |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | % |
| BRITISH LAND CO PLC | 277.336 | 437.522 | 2,159 | 331,216 | | 0.4 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 9.186 | - | - | - | | - |
| DERWENT LONDON PLC | 31.508 | 52.817 | 1,827 | 280,333 | | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 48.36 | 77.686 | 995 | 152,776 | | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | 233.838 | 1,976.821 | 778 | 119,478 | | 0.2 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 221.691 | 355.626 | 2,409 | 369,651 | | 0.5 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 38.577 | 63.229 | 543 | 83,365 | | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC | 231.04 | 231.04 | 1 | 283 | | 0.0 |
| UNITE GROUP PLC | 106.992 | 186.15 | 2,068 | 317,250 | | 0.4 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 355.593 | 617.519 | 959 | 147,206 | | 0.2 |
| SHAFTESBURY PLC | 63.788 | 144.406 | 862 | 132,357 | | 0.2 |
| SEGRO PLC | 327.645 | 564.915 | 6,174 | 947,171 | | 1.2 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 73.391 | 119.078 | 878 | 134,715 | | 0.2 |
| ASSURA PLC | 788.073 | 1,242.776 | 945 | 145,078 | | 0.2 |
| STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERT | - | 179.591 | 131 | 20,110 | | 0.0 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 187.713 | 255.156 | 120 | 18,474 | | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 170.446 | 257.572 | 225 | 34,533 | | 0.0 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 254.022 | 347.914 | 271 | 41,681 | | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 60.379 | 97.821 | 924 | 141,804 | | 0.2 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 269.096 | 423.479 | 1,006 | 154,348 | | 0.2 |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT | 245.021 | 370.408 | 325 | 50,002 | | 0.1 |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL | 247.221 | 397.993 | 673 | 103,361 | | 0.1 |
| GCP STUDENT LIVING PLC | - | 210.196 | 348 | 53,396 | | 0.1 |
| RDI REIT PLC | 74.051 | - | - | - | | - |
| NEWRIVER REIT PLC | 102.138 | 139.604 | 118 | 18,224 | | 0.0 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 189.831 | 294.033 | 345 | 53,043 | | 0.1 |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | 110.038 | 177.39 | 186 | 28,572 | | 0.0 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | - | 371.767 | 438 | 67,294 | | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 512.115 | 810.128 | 1,598 | 245,191 | | 0.3 |
| CUSTODIAN REIT PLC | - | 202.92 | 199 | 30,629 | | 0.0 |
| HOME REIT PLC | - | 100.813 | 114 | 17,629 | | 0.0 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 186.961 | 281.997 | 243 | 37,288 | | 0.0 |
| AEW UK REIT PLC | 54.933 | 83.963 | 78 | 12,081 | | 0.0 |
| LXI REIT PLC | 159.926 | 292.448 | 414 | 63,523 | | 0.1 |
| REGIONAL REIT LTD | 129.74 | 206.337 | 179 | 27,537 | | 0.0 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | - | 153.417 | 169 | 25,934 | | 0.0 |
| 小計 | □ 数 銘柄数 <比率> | 5,760.649 30銘柄<5.3%> | 11,724.532 34銘柄<5.6%> | 28,719 | 4,405,550 | - 5.6 |
| (イスラエル) | 千口 | 千口 | 千イスラエル・シェケル | 千円 | | % |
| REIT 1 LTD | 52.551 | 85.363 | 1,515 | 51,165 | | 0.1 |
| 小計 | □ 数 銘柄数 <比率> | 52.551 1銘柄<0.1%> | 85.363 1銘柄<0.1%> | 1,515 | 51,165 | - 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 | |
| (韓国) | 千口 | 千口 | 千韓国・ウォン | 千円 | % | |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE | - | 39,843 | 195,230 | 19,015 | 0.0 | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 10.894 | 19,635 | 162,774 | 15,854 | 0.0 | |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | - | 9,958 | 54,769 | 5,334 | 0.0 | |
| LOTTE REIT CO LTD | 25.4 | 54,509 | 332,504 | 32,385 | 0.0 | |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | - | 17,86 | 108,053 | 10,524 | 0.0 | |
| JR REIT XXVII | - | 56,222 | 295,165 | 28,749 | 0.0 | |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | - | 46,423 | 335,174 | 32,645 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 36,294 2銘柄<0.1%> | 244,45 7銘柄<0.2%> | 1,483,671 - | 144,509 - | - 0.2 |
| (ユーロ…シンガポール) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| CROMWELL REIT EUR | - | 131.74 | 309 | 40,649 | 0.1 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | - 1銘柄<-%> | 131,74 1銘柄<0.1%> | 309 - | 40,649 - | - 0.1 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| HIBERNIA REIT PLC | 208.204 | 306,848 | 382 | 50,200 | 0.1 | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 119.677 | 214,307 | 327 | 42,995 | 0.1 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 327,881 2銘柄<0.1%> | 521,155 2銘柄<0.1%> | 709 - | 93,195 - | - 0.1 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 11.468 | 18.21 | 398 | 52,266 | 0.1 | |
| VASTNED RETAIL | 5.849 | 8,822 | 227 | 29,826 | 0.0 | |
| WERELDHAVE NV | 11.998 | 18,894 | 287 | 37,782 | 0.0 | |
| NSI NV | 5.133 | 8,112 | 280 | 36,852 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 34,448 4銘柄<0.2%> | 54,038 4銘柄<0.2%> | 1,193 - | 156,728 - | - 0.2 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| BEFIMMO | 6.929 | 12,281 | 421 | 55,389 | 0.1 | |
| COFINIMMO SA | 7.256 | 13,734 | 1,801 | 236,589 | 0.3 | |
| RETAIL ESTATES | 3.188 | 5,045 | 353 | 46,368 | 0.1 | |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 6.779 | 10,415 | 242 | 31,794 | 0.0 | |
| WAREHOUSES DE PAUW | 38.064 | 64,409 | 2,111 | 277,217 | 0.4 | |
| MONTEA SCA | 3.259 | 4,725 | 481 | 63,280 | 0.1 | |
| AEDIFICA | 7.985 | 15,707 | 1,782 | 234,074 | 0.3 | |
| CARE PROPERTY INVEST NV | - | 12,034 | 323 | 42,424 | 0.1 | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | - | 8,239 | 418 | 54,954 | 0.1 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 73,46 7銘柄<1.2%> | 146,589 9銘柄<1.3%> | 7,936 - | 1,042,092 - | - 1.3 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| GECINA SA | 16.655 | 25,599 | 3,403 | 446,864 | 0.6 | |
| ICADE | 8.117 | 14,526 | 1,077 | 141,518 | 0.2 | |
| ALTAREA | 0.977 | 1,643 | 298 | 39,175 | 0.0 | |
| KLEPIERRE | 60.564 | 93,81 | 2,133 | 280,094 | 0.4 | |
| COVIVIO | 14.277 | 22,853 | 1,732 | 227,445 | 0.3 | |
| MERCIALYS | 7.165 | 19,022 | 196 | 25,775 | 0.0 | |
| CARMILA SA | - | 21,853 | 274 | 36,095 | 0.0 | |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 40.645 | 64,946 | 5,106 | 670,510 | 0.8 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 148,4 7銘柄<2.4%> | 264,252 8銘柄<2.4%> | 14,223 - | 1,867,480 - | - 2.4 |
| (ユーロ…ドイツ) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| HAMBORNER REIT AG | 21.542 | 32,106 | 290 | 38,201 | 0.0 | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 46.459 | 84,625 | 1,331 | 174,891 | 0.2 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | 68,001 2銘柄<0.3%> | 116,731 2銘柄<0.3%> | 1,622 - | 213,092 - | - 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 72.211 | 119,135 | 1,060 | 139,295 | 0.2 | |

| 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…スペイン) | | 千口 | | 千口 | | 千ユーロ | 千円 | | | % | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 18.634 | | 27.656 | | 141 | 18,519 | | | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 109.392 | | 158.63 | | 1,451 | 190,618 | | | 0.2 | |
| 小 計 | □ 数 | 200.237 | | 305.421 | | 2,653 | 348,434 | | | — | |
| | 銘柄 数<比率> | 3銘柄<0.5%> | | 3銘柄<0.4%> | | — | — | | | 0.4 | |
| (ユーロ…イタリア) | | 千口 | | 千口 | | 千ユーロ | 千円 | | | % | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | 14.335 | | 25.287 | | 112 | 14,725 | | | 0.0 | |
| 小 計 | □ 数 | 14.335 | | 25.287 | | 112 | 14,725 | | | — | |
| | 銘柄 数<比率> | 1銘柄<0.0%> | | 1銘柄<0.0%> | | — | — | | | 0.0 | |
| 合 計 | □ 数 | 41,146.369 | | 72,334.932 | | — | 78,493,798 | | | — | |
| | 銘柄 数<比率> | 308銘柄<99.7%> | | 327銘柄<99.4%> | | — | — | | | 99.4 | |

(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

2021年6月22日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|---------------|------------|-------|-------|-----|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 | % | | |
| | 78,493,798 | 98.9 | | |
| コール・ローン等、その他 | 899,846 | 1.1 | | |
| 投資信託財産総額 | 79,393,645 | 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、78,945,132千円、99.4%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、2021年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.28円、1カナダ・ドル=89.05円、1オーストラリア・ドル=82.95円、1香港・ドル=14.20円、1シンガポール・ドル=81.99円、1ニュージーランド・ドル=76.95円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=33.768円、100韓国・ウォン=9.74円、1ユーロ=131.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 79,603,209,961円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 287,731,720 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 8,270,655,187 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 70,223,143,733 |
| 未 収 入 金 | 695,464,237 |
| 未 収 配 当 金 | 126,215,084 |
| (B) 負 債 | 643,996,315 |
| 未 払 金 | 639,224,315 |
| 未 払 解 約 金 | 4,772,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 78,959,213,646 |
| 元 本 | 51,487,595,373 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 27,471,618,273 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 51,487,595,373口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 15,336円 |

(注1) 期首元本額 31,818,365,833円
 追加設定元本額 95,515,055,545円
 一部解約元本額 75,845,826,005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) | 77,345,015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) | 47,730,002円 |
| MITOラップ型ファンド (安定型) | 4,079,406円 |
| MITOラップ型ファンド (中立型) | 12,324,186円 |
| MITOラップ型ファンド (積極型) | 15,806,473円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 44,427,031円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 26,820,444円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 21,242,218円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 9,199,470,870円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 1,456,488,233円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 343,415,664円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 1,594,089,364円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 15,021,163円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 269,589,574円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 517,947,206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) | 2,849,915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) | 50,517,227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) | 103,606,640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) | 217,909,913円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 126,975円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 3,199,102円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 2,537,823円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 7,804,829円 |
| One DC先進国リートインデックスファンド | 668,657,524円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 18,528,218円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 584,044,636円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 49,505,985円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10) | 214,771,724円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20) | 257,640,235円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30) | 473,479,123円 |
| 投資のソムリエ | 14,503,667,660円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 770,759,716円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 208,590,169円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 506,580,878円 |

| | |
|---|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 5,243,003,250円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 631,670,857円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 2,025,831,537円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 18,688,512円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 8,934,114円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 4,780,454円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 47,479,777円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 2,857,665,588円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 160,502,360円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 13,778,837円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 6,843,270円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 6,456,862円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | 477,053,365円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 157,404,304円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 152,689,863円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 | 136,134,551円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 186,993,439円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 136,201,588円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 94,419,783円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 | 14,584,701円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 149,262,841円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定) | 551,341,810円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 365,019,674円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 249,192,963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) | 128,259,992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) | 300,203,577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) | 4,176,747,403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) | 340,995,307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) | 554,879,654円 |
| 期末元本合計 | 51,487,595,373円 |

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 1,789,006,467 | 円 |
| | 受取配当金 | 1,788,122,236 | |
| | 受取利息 | 24,391 | |
| | その他の収益 | 1,015,455 | |
| | 支払利息 | △155,615 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 18,149,662,918 | |
| | 売買益 | 20,186,684,133 | |
| | 売買損 | △2,037,021,215 | |
| (C) | その他の費用 | △58,742,592 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 19,879,926,793 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 2,935,062,020 | |
| (F) | 解約差損益金 | △20,082,050,995 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 24,738,680,455 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 27,471,618,273 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 27,471,618,273 | |

(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。