

運用報告書 (全体版)

MHAM J-REITインデックスファンド (隔月決算型)

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／国内／不動産投信／インデックス型	
信託期間	2023年11月16日から2048年10月15日までです。	
運用方針	東京証券取引所に上場している不動産投資信託証券に主として投資を行い、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	MHAM J-REITインデックスファンド（隔月決算型）	J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託を主要投資対象とします。
運用方法	不動産投資信託証券への投資比率は、原則として高位を維持します。	
組入制限	MHAM J-REITインデックスファンド（隔月決算型）	マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時（毎年2月、4月、6月、8月、10月、12月の各15日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。</p> <p>原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。以下同じ。）等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は原則として配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことを目指し、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p> <p>なお、売買益等については、原則として毎年2月および8月の決算時に委託者が基準価額の水準ならびに分配対象額等を勘案したうえで、分配することを目指します。ただし、分配対象額が少額の場合ならびに委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案したうえで、分配を見送る場合があります。</p> <p>※第1期（2023年12月15日）および第2期（2024年2月15日）の決算は収益分配を行いません。</p>	

愛称：ビルオーナー（隔月決算型）

第1期 <決算日 2023年12月15日>
 第2期 <決算日 2024年2月15日>
 第3期 <決算日 2024年4月15日>

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、「MHAM J-REITインデックスファンド（隔月決算型）」は、2024年4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

お客様の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

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

MHAM J-REITインデックスファンド (隔月決算型)

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
第1作成期	(設定日) 2023年11月16日	円	円	%	ポイント (11月15日)	%	%	%	百万円
	1期(2023年12月15日)	10,000	-	-	4,439.81	-	-	-	1
	2期(2024年2月15日)	9,839	0	△1.6	4,371.88	△1.5	97.0	2.9	1
	3期(2024年4月15日)	9,453	0	△3.9	4,204.47	△3.8	97.2	2.7	19
		9,712	50	3.3	4,347.12	3.4	97.2	2.7	27

(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) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません（以下同じ）。

(注6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率
			騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率		
第 1 期	(設定日) 2023年11月16日	円	%	ポイント (11月15日) 4,439.81	%	%	%
	11 月 末	10,000	—	4,455.46	—	—	—
	(期 末) 2023年12月15日	10,029	0.3	4,455.46	0.4	97.1	2.7
第 2 期	(期 末) 2023年12月15日	9,839	△1.6	4,371.88	△1.5	97.0	2.9
	(期 首) 2023年12月15日	9,839	—	4,371.88	—	97.0	2.9
	12 月 末	9,861	0.2	4,382.85	0.3	97.0	2.8
	2024年1 月 末	9,847	0.1	4,378.56	0.2	97.1	2.7
第 3 期	(期 末) 2024年2月15日	9,453	△3.9	4,204.47	△3.8	97.2	2.7
	(期 首) 2024年2月15日	9,453	—	4,204.47	—	97.2	2.7
	2 月 末	9,365	△0.9	4,166.74	△0.9	97.2	2.7
	3 月 末	9,906	4.8	4,410.17	4.9	97.1	2.7
	(期 末) 2024年4月15日	9,762	3.3	4,347.12	3.4	97.2	2.7

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

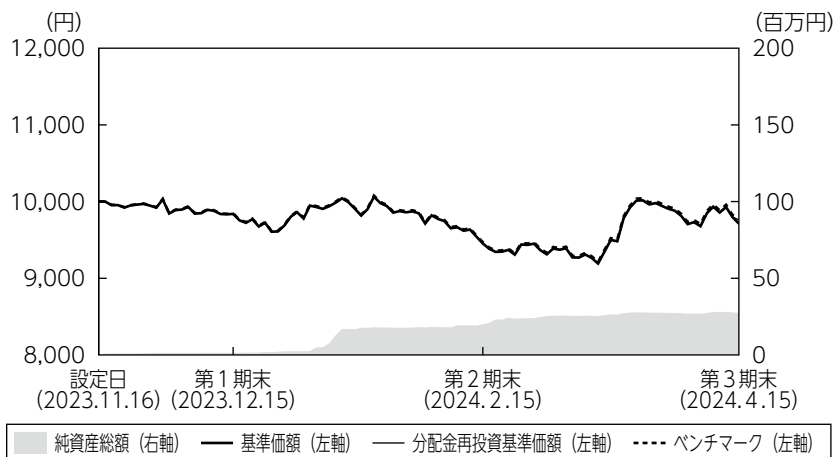
(注2) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比（第1期は設定日比）です。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第1期～第3期の運用経過（2023年11月16日から2024年4月15日まで）

基準価額等の推移



設定日： 10,000円
第3期末： 9,712円
(既払分配金50円)
騰落率： $\Delta 2.4\%$
(分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日前日を10,000として指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による利上げへの警戒感などから東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

投資環境

リート市場は下落しました。2024年1月までは日米の金融政策を巡る思惑から方向感に欠ける展開が続きました。その後は日銀の金融政策正常化観測を背景に国内長期金利が上昇する中で軟調な推移となりましたが、3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策が終了し、加えて今後も金融緩和的な環境が継続するとの見方が広がると上昇しました。作成期末にかけては日銀の追加利上げへの警戒感などからもみ合いました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

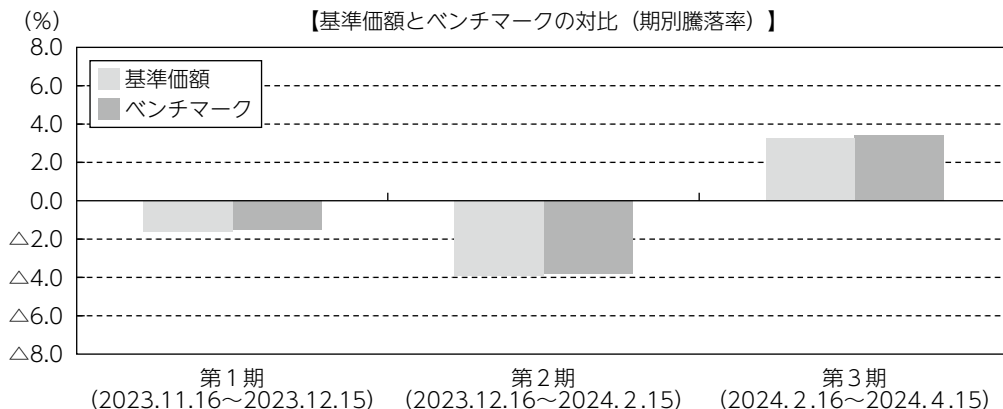
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

●J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

リートの組入比率を高め、ベンチマークである東証R E I T指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

ベンチマークとの差異について

この期間におけるベンチマークの騰落率は $\Delta 2.1\%$ である一方、当ファンドの騰落率は $\Delta 2.4\%$ （税引前分配金再投資騰落率）となりました。なお、信託報酬等の影響を除くと、概ねベンチマークに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

当作成期の収益分配金につきましては第1期から第2期までは分配方針に基づき、無分配とさせていただきます。第3期は基準価額水準、市況動向等を勘案し、以下の表のとおり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	第1期	第2期	第3期
	2023年11月16日 ～2023年12月15日	2023年12月16日 ～2024年2月15日	2024年2月16日 ～2024年4月15日
当期分配金（税引前）	-円	-円	50円
対基準価額比率	-%	-%	0.51%
当期の収益	-円	-円	50円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	26円	61円	94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、J-REITインデックスファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第1期～第3期 (2023年11月16日 ～2024年4月15日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	29円	
(投信会社)	(13)	(0.137)	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)	(13)	(0.137)	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)	(2)	(0.023)	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	0	0.001	(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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.000)	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
合計	29	0.296	

(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せん。

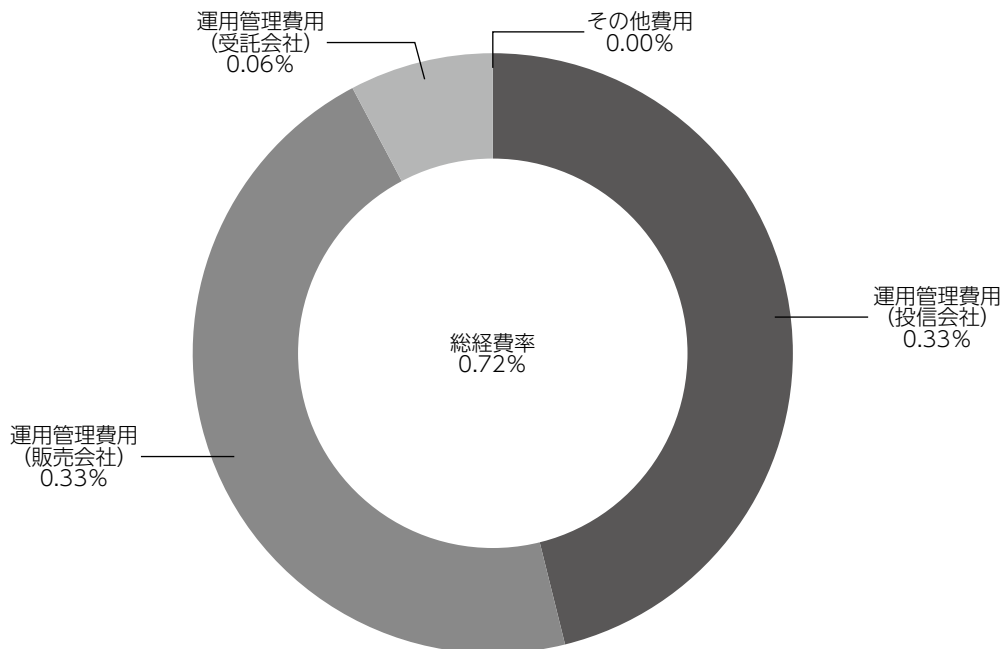
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当作成期中の運用・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0.72%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（2023年11月16日から2024年4月15日まで）

	第 1 期 ~ 第 3 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	千□ 12,289	千円 28,510	千□ 453	千円 1,038

■利害関係人との取引状況等（2023年11月16日から2024年4月15日まで）

【MHAM J-REITインデックスファンド（隔月決算型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 1 期 ~ 第 3 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	0.092千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.046千円
(B) / (A)	50.0%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【J-REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 1 期 ~ 第 3 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
投 資 証 券	百万円 33,871	百万円 4,043	% 11.9	百万円 32,328	百万円 2,431	% 7.5
不動産投信指数先物取引	9,976	5,118	51.3	10,084	4,890	48.5

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 1 期 ~ 第 3 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 1,042

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時又は当初運用時における取得

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 1 作 成 期 末	
	□ 数	評 価 額
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	千□ 11,836	千円 27,483

■投資信託財産の構成

2024年4月15日現在

項 目	第 1 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	千円 27,483	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	176	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	27,660	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月15日)、 (2024年2月15日)、 (2024年4月15日)現在

項 目	第 1 期 末	第 2 期 末	第 3 期 末
(A) 資 産	1,435,718円	20,006,512円	27,660,659円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,581	17,718	43,880
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	1,434,137	19,988,794	27,483,779
未 収 入 金	—	—	133,000
(B) 負 債	680	13,247	171,782
未 払 収 益 分 配 金	—	—	141,514
未 払 解 約 金	—	196	—
未 払 信 託 報 酬	680	13,051	30,214
そ の 他 未 払 費 用	—	—	54
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,435,038	19,993,265	27,488,877
元 本	1,458,525	21,149,677	28,302,954
次 期 繰 越 損 益 金	△23,487	△1,156,412	△814,077
(D) 受 益 権 総 口 数	1,458,525口	21,149,677口	28,302,954口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,839円	9,453円	9,712円

(注) 設定当初の元本額は1,000,000円、当作成期間(第1期~第3期)中における追加設定元本額は28,399,228円、同解約元本額は1,096,274円です。

■損益の状況

〔自 2023年11月16日〕
〔至 2023年12月15日〕

〔自 2023年12月16日〕
〔至 2024年 2月15日〕

〔自 2024年 2月16日〕
〔至 2024年 4月15日〕

項 目	第 1 期	第 2 期	第 3 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△19,863円	△889,038円	920,097円
売 買 益	-	3,322	932,606
売 買 損	△19,863	△892,360	△12,509
(B) 信 託 報 酬 等	△680	△13,051	△30,268
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△20,543	△902,089	889,829
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	-	△19,811	△895,929
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,944	△234,512	△666,463
(配 当 等 相 当 額)	(-)	(53,429)	(110,773)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,944)	(△287,941)	(△777,236)
(F) 合 計(C+D+E)	△23,487	△1,156,412	△672,563
(G) 収 益 分 配 金	-	-	△141,514
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△23,487	△1,156,412	△814,077
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,944	△234,512	△666,463
(配 当 等 相 当 額)	(865)	(64,737)	(126,098)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,809)	(△299,249)	(△792,561)
分 配 準 備 積 立 金	3,023	65,902	140,595
繰 越 損 益 金	△23,566	△987,802	△288,209

(注1) (A)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) (B)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) (E)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	第 1 期	第 2 期	第 3 期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,023円	62,986円	218,065円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	865	64,737	126,098
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0	2,916	64,044
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	3,888	130,639	408,207
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	26.66	61.77	144.23
(g) 分 配 金	0	0	141,514
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0	0	50

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 1 期	第 2 期	第 3 期
1 万口当たり分配金	-円	-円	50円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期 (決算日 2023年6月6日)

(計算期間 2022年6月7日~2023年6月6日)

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの第17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	2006年8月4日から無期限です。
運用方針	東証R E I T指数(配当込み)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	東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証R E I T指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先物 指数率	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 騰落率			
13期(2019年6月6日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期(2020年6月8日)	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
15期(2021年6月7日)	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
16期(2022年6月6日)	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
17期(2023年6月6日)	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921
	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数(配当込み)の指数値および同指数にかかる商標または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません(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)。

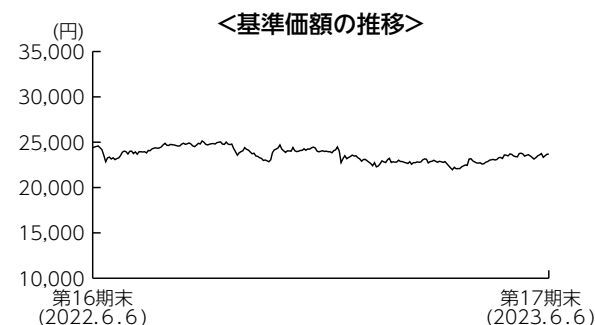
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 6 月 6 日	円 24,389	% -	ポイント 4,567.99	% -	% 97.6	% 2.3
6 月 末	23,959	△1.8	4,487.40	△1.8	97.6	2.4
7 月 末	24,713	1.3	4,628.79	1.3	97.6	2.3
8 月 末	25,003	2.5	4,683.62	2.5	97.6	2.2
9 月 末	23,964	△1.7	4,488.86	△1.7	97.4	2.5
10 月 末	24,369	△0.1	4,564.72	△0.1	97.4	2.3
11 月 末	24,373	△0.1	4,565.38	△0.1	97.8	2.2
12 月 末	23,509	△3.6	4,403.82	△3.6	97.6	2.3
2023 年 1 月 末	22,762	△6.7	4,263.06	△6.7	97.8	2.2
2 月 末	23,116	△5.2	4,331.37	△5.2	97.9	2.1
3 月 末	22,445	△8.0	4,204.73	△8.0	97.6	2.3
4 月 末	23,595	△3.3	4,420.34	△3.2	97.8	2.1
5 月 末	23,748	△2.6	4,448.91	△2.6	97.9	2.1
(期 末) 2023 年 6 月 6 日	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年6月7日から2023年6月6日まで）

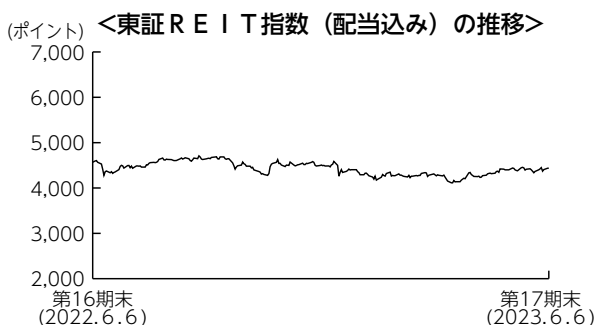


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,686円となり、前期末比で2.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国の金融引き締め加速懸念や日銀による長期金利の許容変動幅拡大などにより東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。



投資環境

リート市場は下落しました。期の前半は米国の金融引き締めペースを巡る思惑などから不安定な相場展開となりました。後半は日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことや米国の銀行破綻等による金融システム不安などが相場下落要因となりましたが、期末にかけては日銀による追加政策修正への警戒感や米国の利上げ観測が後退し、やや値を戻しました。

ポートフォリオについて

リーートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

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2.9%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ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、リーートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 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 (先物・オプション) (投資証券)	0円 (0) (0)	0.001% (0.001) (0.000)	(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) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,630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 (2022年6月7日から2023年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	2.446 (-)	283,598 (-)	2.216 (-)	257,405 (-)
サンケイリアルエステート投資法人	3.866 (-)	352,134 (-)	3.493 (-)	317,841 (-)
S O S I L A物流リート投資法人	5.863 (-)	817,652 (-)	4.818 (-)	676,465 (-)
東海道リート投資法人	3.155 (-)	382,649 (-)	1.42 (-)	166,089 (-)
日本アコモデーションファンド投資法人	4.108 (-)	2,608,591 (-)	3.774 (-)	2,386,905 (-)
森ヒルズリート投資法人	13.988 (-)	2,164,435 (-)	12.853 (-)	1,953,913 (-)
産業ファンド投資法人	19.547 (-)	3,155,155 (-)	16.212 (-)	2,579,137 (-)
アドバンス・レジデンス投資法人	11.888 (-)	4,058,437 (-)	10.922 (-)	3,707,214 (-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8.925 (-)	1,889,757 (-)	7.904 (-)	1,647,056 (-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6.202 (-)	2,550,773 (-)	5.78 (-)	2,337,835 (-)
G L P投資法人	43.091 (-)	6,649,002 (-)	37.508 (-)	5,829,268 (-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5.825 (-)	1,843,548 (-)	5.135 (-)	1,642,415 (-)
日本プロロジスリート投資法人	20.572 (-)	6,454,889 (-)	17.09 (-)	5,347,590 (-)
星野リゾート・リート投資法人	2.191 (-)	1,509,542 (-)	1.894 (-)	1,279,408 (-)
Oneリート投資法人	2.089 (-)	520,643 (-)	1.905 (-)	477,606 (-)
イオンリート投資法人	14.23 (-)	2,174,340 (-)	13.613 (-)	2,058,639 (-)
ヒューリックリート投資法人	11.164 (-)	1,806,029 (-)	10.213 (-)	1,620,993 (-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
日本リート投資法人		4.109		1,439,715		3.51		1,222,524
		(-)		(-)		(-)		(-)
積水ハウス・リート投資法人		35.816		2,783,839		33.45		2,587,705
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		2.838		382,704		2.397		316,989
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		5.673		1,478,817		4.631		1,199,302
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.957		519,642		2.691		454,549
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		3.604		434,109		2.767		329,919
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		38.457		6,248,196		35.334		5,628,241
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.97		205,309		1.81		184,359
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		14.561		2,344,829		13.379		2,163,123
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		18.174		1,036,955		13.194		740,952
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		2.233		293,864		1.46		189,773
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4.717		2,314,991		4.316		2,114,375
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		1.917		127,795		1.761		114,887
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		14.501		684,775		13.265		622,025
		(-)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		2.037		270,595		1.606		206,963
	(△4.547)	(-)	(△605,985)	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人		4.793		2,069,388		3.531		1,511,139
		(-)		(-)		(-)		(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人		5.366		1,012,098		4.23		817,373
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.934		231,896		1.763		207,929
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		5.999		605,375		4.193		417,993
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		5.756		819,073		4.529		647,371
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		13.885		8,689,760		12.745		7,856,097
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		12.396		7,315,592		10.959		6,406,081
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		60.003		6,249,714		55.131		5,682,475
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		23.695		4,374,650		21.771		3,935,320
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		8.141		3,095,395		7.471		2,804,919
		(-)		(-)		(-)		(-)
N T T 都市開発リート投資法人		11.474		1,627,364		10.498		1,477,795
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		7.976		1,572,545		7.328		1,415,154
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		9.294		1,008,519		7.692		825,667
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	26.549 (-)	3,953,038 (-)	24.639 (-)	3,596,230 (-)
森トラストリート投資法人	12.178 (22,21648)	1,313,130 (605,985)	12.48448 (-)	1,221,207 (-)
インヴィンシブル投資法人	52.339 (-)	2,518,208 (-)	48.088 (-)	2,296,723 (-)
フロンティア不動産投資法人	4.732 (-)	2,417,417 (-)	4.015 (-)	2,027,849 (-)
平和不動産リート投資法人	8.152 (-)	1,238,187 (-)	7.07 (-)	1,069,645 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	8.02 (-)	2,503,490 (-)	7.369 (-)	2,271,758 (-)
福岡リート投資法人	6.15 (-)	1,033,114 (-)	5.65 (-)	931,445 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	5.664 (4,946)	2,289,568 (-)	5.268 (-)	2,323,567 (-)
いちごオフィスリート投資法人	9.748 (-)	853,933 (-)	8.957 (-)	771,258 (-)
大和証券オフィス投資法人	2.427 (-)	1,593,944 (-)	2.302 (-)	1,485,390 (-)
阪急阪神リート投資法人	5.37 (-)	797,151 (-)	4.933 (-)	723,099 (-)
スターツプロシード投資法人	2.282 (-)	540,786 (-)	1.806 (-)	429,891 (-)
大和ハウスリート投資法人	18.014 (-)	5,317,512 (-)	16.455 (-)	4,839,564 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40.847 (-)	3,025,354 (-)	34.904 (-)	2,481,629 (-)
大和証券リビング投資法人	16.924 (-)	1,948,306 (-)	14.981 (-)	1,710,910 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	10.914 (-)	1,386,912 (-)	10.028 (-)	1,261,550 (-)

(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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 18,032	百万円 18,204	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2022年6月7日から2023年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 131,188	百万円 34,238	% 26.1	百万円 115,808	百万円 9,371	% 8.1
不動産投信指数先物取引	18,032	8,688	48.2	18,204	4,241	23.3
金 銭 信 託	0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 7,433

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	2,071千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	771千円
(B) / (A)	37.3%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期		末
		□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
不動産ファンド		千□	千□	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人		3.532	3.762	441,282	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		5.556	5.929	510,486	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人		8.161	9.206	1,242,810	0.6
東海道リート投資法人		1.343	3.078	368,744	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人		6.057	6.391	4,224,451	2.1
森ヒルズリート投資法人		20.628	21.763	3,244,863	1.6
産業ファンド投資法人		24.904	28.239	4,408,107	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人		17.539	18.505	6,615,537	3.3
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		12.552	13.573	2,840,828	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人		9.349	9.771	3,962,140	2.0
G L P 投資法人		56.814	62.397	9,247,235	4.6
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		8.16	8.85	3,022,275	1.5
日本プロロジスリート投資法人		28.7	32.182	9,944,238	5.0
星野リゾート・リート投資法人		2.94	3.237	2,184,975	1.1
One リート投資法人		3.044	3.228	773,428	0.4
イオンリート投資法人		20.63	21.247	3,320,906	1.7
ヒューリックリート投資法人		16.365	17.316	2,765,365	1.4
日本リート投資法人		5.413	6.012	2,005,002	1.0
積水ハウス・リート投資法人		53.248	55.614	4,504,734	2.2
トーセイ・リート投資法人		3.665	4.106	538,296	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		7.004	8.046	2,030,005	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		4.297	4.563	746,050	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人		3.974	4.811	557,594	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		56.727	59.85	9,839,340	4.9
いちごホテルリート投資法人		2.906	3.066	306,293	0.2
ラサールロジポート投資法人		21.475	22.657	3,715,748	1.9
スターアジア不動産投資法人		18.128	23.108	1,356,439	0.7
マリモ地方創生リート投資法人		2.054	2.827	377,969	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		6.91	7.311	3,651,844	1.8
大江戸温泉リート投資法人		2.831	2.987	195,051	0.1
投資法人みらい		21.249	22.485	1,035,434	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		4.116	-	-	-
三菱地所物流リート投資法人		5.096	6.358	2,714,866	1.4
C R E ロジスティクスファンド投資法人		6.794	7.93	1,516,216	0.8
ザイマックス・リート投資法人		2.831	3.002	332,621	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		6.918	8.724	826,162	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人		6.84	8.067	1,114,859	0.6

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	
不動産ファンド	千□	千□	千円	%	
日本ビルファンド投資法人	20.451	21.591	12,090,960	6.0	
ジャパンリアルエステイト投資法人	17.542	18.979	10,077,849	5.0	
日本都市ファンド投資法人	88.509	93.381	9,170,014	4.6	
オリックス不動産投資法人	34.952	36.876	6,619,242	3.3	
日本プライムリアルティ投資法人	11.987	12.657	4,436,278	2.2	
N T T 都市開発リート投資法人	16.815	17.791	2,353,749	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	11.761	12.409	2,363,914	1.2	
グローバル・ワン不動産投資法人	12.018	13.62	1,461,426	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	39.49	41.4	6,110,640	3.0	
森トラストリート投資法人	12.537	34.447	2,431,958	1.2	
インヴィンシブル投資法人	77.209	81.46	4,773,556	2.4	
フロンティア不動産投資法人	6.15	6.867	3,354,529	1.7	
平和不動産リート投資法人	11.958	13.04	2,023,808	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	11.828	12.479	4,036,956	2.0	
福岡リート投資法人	9.072	9.572	1,544,920	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人	5.427	10.769	3,322,236	1.7	
いちごオフィスリート投資法人	14.374	15.165	1,373,949	0.7	
大和証券オフィス投資法人	3.709	3.834	2,277,396	1.1	
阪急阪神リート投資法人	7.923	8.36	1,220,560	0.6	
スターツプロシード投資法人	2.732	3.208	743,614	0.4	
大和ハウスリート投資法人	26.339	27.898	8,196,432	4.1	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	53.741	59.684	4,607,604	2.3	
大和証券リビング投資法人	23.703	25.646	2,895,433	1.4	
ジャパンエクセレント投資法人	16.092	16.978	2,045,849	1.0	
合 計	□ 数 ・ 金 額	1,025.069	1,128.309	196,015,084	-
	銘 柄 数 < 比 率 >	61銘柄 < 97.6% >	60銘柄 < 97.8% >	-	97.8

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、スターツプロシード投資法人、トーセイ・リート投資法人、福岡リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、いちごホテルリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、ザイマックス・リート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、東海道リート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、Oneリート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 4,383		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 196,015,084		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,050,590		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	201,065,675		100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	201,065,675,835円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	3,315,269,486
投 資 証 券(評価額)	196,015,084,850
未 収 入 金	365,658,895
未 収 配 当 金	1,275,504,874
差 入 委 託 証 拠 金	94,157,730
(B) 負 債	564,883,025
未 払 金	51,945,706
未 払 解 約 金	512,937,319
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	200,500,792,810
元 本	84,649,761,469
次 期 繰 越 損 益 金	115,851,031,341
(D) 受 益 権 総 口 数	84,649,761,469口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	23,686円

(注1) 期首元本額 81,973,373,034円
 追加設定元本額 57,914,110,381円
 一部解約元本額 55,237,721,946円

(注2) 期末における元本の内訳

M I T O ラップ型ファンド (安定型)	236,896円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,070,098円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	2,794,505円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	3,280,530円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	2,494,276円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,607,089円
たわらノーロード 国内リート	5,669,747,226円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,107,613,678円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,409,625,816円
たわらノーロード バランス (堅実型)	41,133,949円
たわらノーロード バランス (標準型)	801,212,486円
たわらノーロード バランス (積極型)	889,719,642円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	36,161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)	230,708,597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)	557,228,467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)	373,374,712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)	424,568,977円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,576,131円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	46,569,948円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,007,008円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,774,791円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	12,819,640円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	473,699,700円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	143,513,616円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	211,185,463円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	394,778,673円
投資のソムリエ	8,362,909,666円
投資のソムリエ<DC年金>	666,581,590円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	162,621,843円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	649,975,211円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,538,132,409円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	42,151,167円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,782,609円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	4,700,816円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	125,275,722円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	121,839,567円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,874,973円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	49,724,250円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	22,871,627円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	14,066,729円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	3,323,065円

One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	43,418,572円
J リートインデックスファンド (D C)	67,255,589円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	694,470,884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)	309,507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)	159,755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)	30,130,099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)	130,110円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	188,600,781円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	79,681,678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・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家限定)	66,237,972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)	387,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	465,704円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家限定)	33,968,236円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家限定)	58,420,541円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家限定)	41,811,325円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	79,204,348円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	198,008円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家限定)	41,563,452円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家限定)	59,063,740円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	3,724,997円
D I A M J - R E I T インデックスファンド (適格機関投資家向け)	3,470,360,133円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	226,204,320円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,931,359円
日本資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	435,975,434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)	394,647円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	3,419,398円
日本資産配分戦略ファンド (T I P S 活用型) (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	136,151,078円
D I A M 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)	1,084,557,096円
M H A M J - R E I T インデックスファンド<DC年金>	7,772,942,184円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (毎月決算型)	36,562,726,908円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (年1回決算型)	2,663,434,070円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (ファンドラップ)	3,992,981,440円
期末元本合計	84,649,761,469円

■損益の状況

当期 自2022年6月7日 至2023年6月6日

項	目	当	期
(A)	配当等収当益	7,616,435,397円	
	受取配当金	7,618,410,769	
	その取利	60,047	
	の他収益	1,037	
	支払利	△2,036,456	
(B)	有価証券売買損益	△14,437,084,878	
	売買益	3,000,792,575	
	売買損	△17,437,877,453	
(C)	先物取引等取引損益	△138,373,770	
	取引益	263,426,640	
	取引損	△401,800,410	
(D)	その他費用	△1	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	△6,959,023,252	
(F)	前期繰越損益金	117,948,373,616	
(G)	解約差損益金	△74,084,393,742	
(H)	追加信託差損益金	78,946,074,719	
(I)	計(E+F+G+H)	115,851,031,341	
	次期繰越損益金(I)	115,851,031,341	

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)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) (H)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。