

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2021年8月23日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 外国リート・インデックス・マザーファンド 日本を除く世界各国のリート等
当ファンドの運用方法	■ S & P 先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ■ 不動産投資信託（REIT）の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ■ 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行います。
組入制限	当ファンド ■ 株式への投資は行いません。 ■ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 外国リート・インデックス・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割合には制限を設けません。
分配方針	■ 年1回（原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。
(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

三井住友DS・ 先進国リート インデックス・ファンド

【運用報告書(全体版)】

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

第 2 期

決算日 2022年11月30日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、S & P 先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投資信託 証券比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込	騰落 率	騰落	率		
(設定日) 2021年8月23日	円 10,000	円 —	% —	100.00	% —	% —	百万円 1
1期(2021年11月30日)	10,763	0	7.6	107.57	7.6	98.9	2
2期(2022年11月30日)	10,597	0	△1.5	107.39	△0.2	99.0	86

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込 み、円換算ベース)		投資信託 証券比率	純資産 総額
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2021年11月30日	円 10,763	% —	107.57	% —	% 98.9	
12月末	11,446	6.3	114.71	6.6	98.1	
2022年1月末	10,644	△1.1	106.63	△0.9	99.3	
2月末	10,615	△1.4	106.68	△0.8	99.4	
3月末	11,911	10.7	119.93	11.5	97.6	
4月末	12,104	12.5	121.90	13.3	98.0	
5月末	11,194	4.0	112.61	4.7	98.9	
6月末	10,923	1.5	109.91	2.2	97.8	
7月末	11,486	6.7	115.91	7.8	98.6	
8月末	11,221	4.3	113.44	5.5	98.3	
9月末	9,992	△7.2	100.86	△6.2	98.2	
10月末	10,862	0.9	109.91	2.2	99.2	
(期末) 2022年11月30日	10,597	△1.5	107.39	△0.2	99.0	

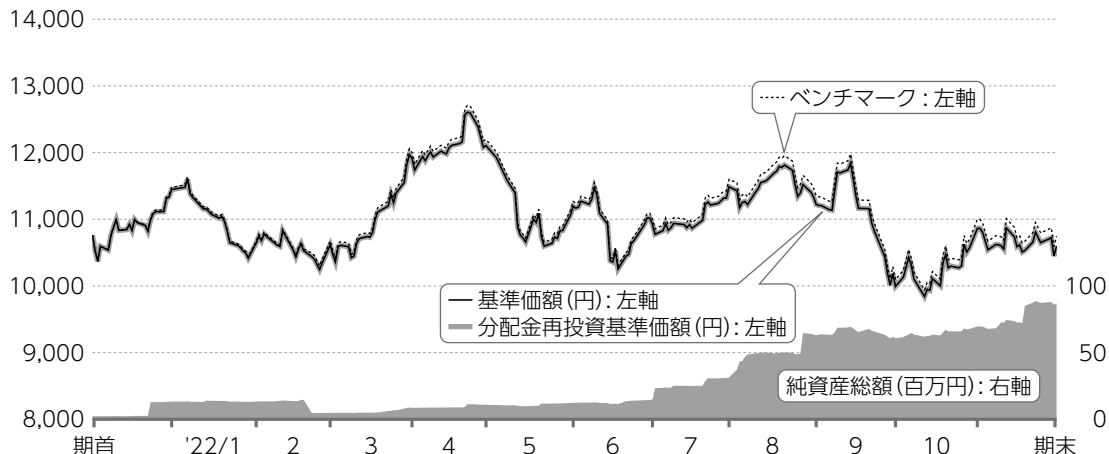
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	10,763円
期末	10,597円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-1.5% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドのベンチマークは、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)です。

※S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界各国の上場リートに投資し、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- 主要通貨に対して円安が進行したこと

下落要因

- インフレ懸念の高まりに伴うF R B (米連邦準備制度理事会)の金融引き締めへの転換、グローバルの景気減速懸念などから、グローバルリート市場が下落したこと

投資環境について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

期間におけるグローバルリート市場は、下落しました。為替市場では、米ドルは円に対して上昇しました。

グローバルリート市場

期初から年末にかけて変異ウイルス(オミクロン型)への警戒感が後退したことから、リスク選好の動きとなり経済再開への期待がグローバルリート市場を押し上げました。

しかし、1月に入るとF R Bの金融政策スタンスがインフレ懸念の高まりから積極的な利上げ姿勢へ転じたことから金利が上昇し、株価は下落しました。加えて、中国のロックダウン(都市封鎖)やロシアによるウクライナ侵攻などにより、世界的に経済に対する不透明感が広がったこともマイナス要因となりました。

4月以降も、米国を中心に世界の金融当局はインフレ率上昇を抑制する動きを強め、市場予想以上の利上げ幅の実施やそのスピードから景気後退の可能性が意識され、欧米を中心に下落しました。

また、期末にかけても米国を中心に世界各国の中央銀行による利上げが続きましたが、景気悪化懸念に伴う利上げペースの緩和期待から反発する局面も見られ、一進一退の展開となりました。

為替市場

期初は、米国で金融政策が正常化することの見方が広がったことや経済指標が改善したことなどを受けて、米ドル高・円安が進みました。その後も日銀が金融緩和を継続する中、F R Bが金融引き締めへ舵を切ったことなどから、円安が進みました。

期末にかけても、パウエルF R B議長が利上げ継続を強調したことなどを受けて日米金利差が改めて意識され、円安が一段と進行しました。

米ドル・円は、期間を通じてみると米ドルが対円で大幅に上昇しました。

ポートフォリオについて(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当ファンド

期を通して、「外国リート・インデックス・マザーファンド」を高位に組み入れました。

外国リート・インデックス・マザーファンド

S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投

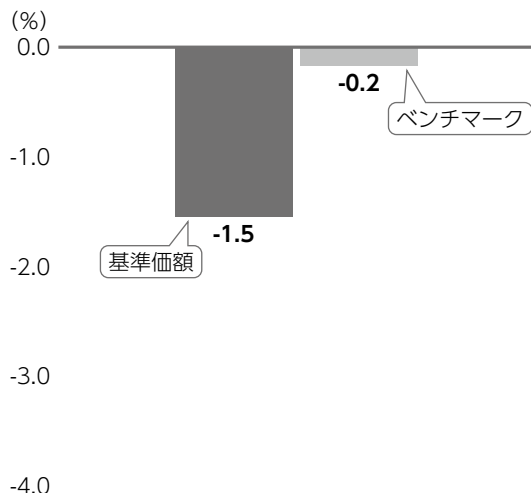
資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリートの売買を行い、トラッキングエラー(ポートフォリオのリターンとベンチマークのリターンとの乖離)の抑制に努めました。

また、3、6、9、12月のベンチマークの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

ベンチマークとの差異について(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは、S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は-1.5% (分配金再投資ベース) となり、ベンチマークの騰落率-0.2%から1.3%下方乖離しました。

下方乖離要因

- 配当に対する現地源泉税が生じたこと
- 売買コストが生じたこと
- 信託報酬が日々生じたこと

分配金について (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第2期
当期分配金 (対基準価額比率)	0 (0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	798

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
 ※「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(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、「外国リート・インデックス・マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

外国リート・インデックス・マザーファンド

引き続き、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

1万口当たりの費用明細(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	52円	0.473%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 期中の平均基準価額は10,998円です。
(投信会社)	(25)	(0.225)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(25)	(0.225)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	4	0.038	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:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(4)	(0.037)	
(c) 有価証券取引税	2	0.015	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:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(2)	(0.015)	
(d) その他費用	7	0.066	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(保管費用)	(6)	(0.051)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(1)	(0.010)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	65	0.592	

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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ています。

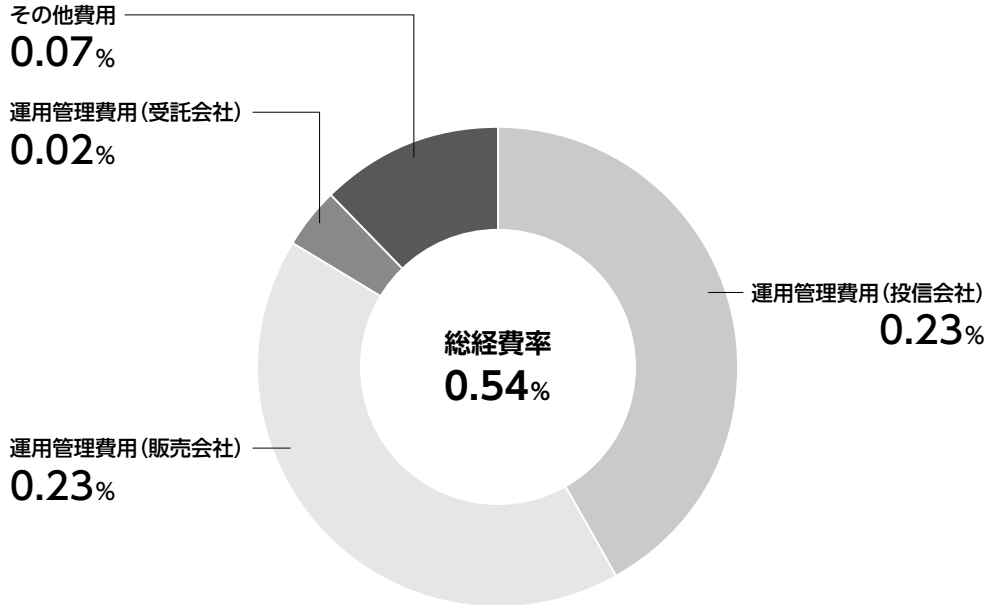
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は0.54%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国リート・インデックス・マザーファンド	千口 34,090	千円 99,380	千口 3,908	千円 10,885

■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
	外国リート・インデックス・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	80,579千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	—
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	—

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況 (2021年12月1日から2022年11月30日まで)

期首 (元)	残高 (本)	当 元	期 設 定 本	当 元	期 解 約 本	期 末 (元)	残高 (本)	取 引 の 理 由
	百万円 1		百万円 -		百万円 1		百万円 -	当初設定時または当初運用時における取得等

■ 組入れ資産の明細 (2022年11月30日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)		期末	
	口	数	口	評 価 額
外国リート・インデックス・マザーファンド		千口 819		千口 31,002 千円 87,051

※外国リート・インデックス・マザーファンドの期末の受益権総口数は8,860,732,746口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
外国リート・インデックス・マザーファンド	千円 87,051	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	0	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	87,052	100.0

※外国リート・インデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産(24,728,077千円)の投資信託財産総額(24,989,946千円)に対する比率は99.0%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港・ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シケル=40.334円、100韓国・ウォン=10.48円、1ユーロ=143.58円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月30日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	87,052,569円
コール・ローン等	664
外国リート・インデックス・マザーファンド(評価額)	87,051,905
(B) 負 債	118,724
未払信託報酬	117,174
その他未払費用	1,550
(C) 純資産総額(A-B)	86,933,845
元 本	82,034,605
次期繰越損益金	4,899,240
(D) 受益権総口数	82,034,605口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,597円

※当期における期首元本額2,141,454円、期中追加設定元本額90,161,002円、期中一部解約元本額10,267,851円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△3,522,861円
売 買 益	299,174
売 買 損	△3,822,035
(B) 信託報酬等	△ 140,897
(C) 当期損益金(A+B)	△3,663,758
(D) 前期繰越損益金	44,917
(E) 追加信託差損益金	8,518,081
(配当等相当額)	(5,379,322)
(売買損益相当額)	(3,138,759)
(F) 合計(C+D+E)	4,899,240
次期繰越損益金(F)	4,899,240
追加信託差損益金	8,518,081
(配当等相当額)	(5,564,859)
(売買損益相当額)	(2,953,222)
分配準備積立金	988,236
繰越損益金	△4,607,077

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	943,319円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	5,564,859
(d) 分配準備積立金	44,917
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	6,553,095
1万口当たり当期分配対象額	798.82
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当	期

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

第35期（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く世界各国の不動産投資信託（リート）などを主要投資対象とし、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率	純資産 総額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
31期（2020年8月25日）	円 18,760	% △22.6	209.38	% △22.5	% 99.1	百万円 7,606
32期（2021年2月25日）	21,787	16.1	243.93	16.5	99.1	10,232
33期（2021年8月25日）	26,128	19.9	293.88	20.5	99.3	15,061
34期（2022年2月25日）	27,214	4.2	305.61	4.0	99.1	18,859
35期（2022年8月25日）	30,120	10.7	339.05	10.9	98.8	24,967

※ベンチマークは、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

当期中の基準価額と市況等の推移

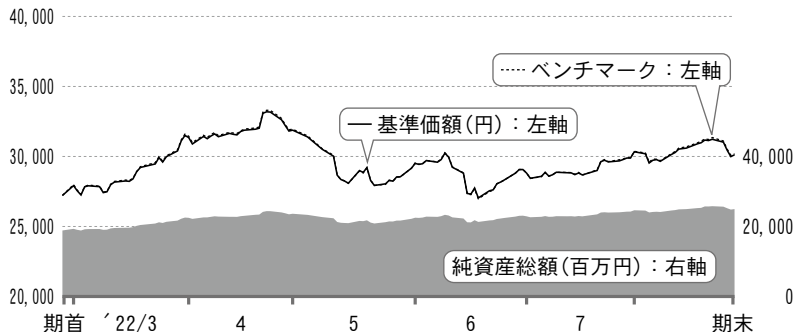
年月日	基準価額		(ベンチマーク) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、 円換算ベース)		投証比 資産信託 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2022年2月25日	円 27,214	% —	305.61	% —	% 99.1
2月末	27,917	2.6	314.34	2.9	99.2
3月末	31,351	15.2	353.16	15.6	97.5
4月末	31,880	17.1	358.74	17.4	97.8
5月末	29,507	8.4	331.73	8.5	98.7
6月末	28,812	5.9	323.71	5.9	97.8
7月末	30,335	11.5	341.00	11.6	98.6
(期末) 2022年8月25日	30,120	10.7	339.05	10.9	98.8

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額等の推移



期首	27,214円
期末	30,120円
騰落率	+10.7%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

※S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の所有権およびその他一切の権利は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスが有しています。三井住友DSアセットマネジメントは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスとの間で同指数の算出・管理に関する契約を締結しています。S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、同指数の算出に関し、いかなるものに対しても責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

当ファンドは、日本を除く世界各国の上場リートに投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因	・投資対象通貨が総じて対円で上昇したこと
下落要因	・欧米を中心とした金融引き締め強化の中、長期金利が上昇したこと ・エネルギーや食品価格が上昇し、世界的にインフレ圧力が高まったこと

▶ 投資環境について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

期間におけるグローバルリート市場は下落しました。為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。

グローバルリート市場

期初にロシア・ウクライナ間の停戦協議進展観測を受けて上昇する局面がありましたが、4月から6月にかけて下落しました。特に、米国で上昇の続くインフレ率を抑制するためにFRB（米連邦準備制度理事会）が金融引き締めを強化する中、長期金利が上昇したことや、欧州においてもECB（欧州中央銀行）による利上げ観測が高まったこと（7月に利上げを実施）が、下落の要因となりました。

期末にかけては米国の長期金利が下落に転じたことが追い風となり、堅調に推移しました。

為替市場

期末の米ドル・円は、期初と比較して円安となりました。米国では利上げが進み金利が上昇した一方、日本では低金利政策が維持され国内金利の上昇が抑制されたことから、日米金利差が意識され、期を通じて米ドル高・円安となりました。

▶ ポートフォリオについて（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

ポートフォリオの特性

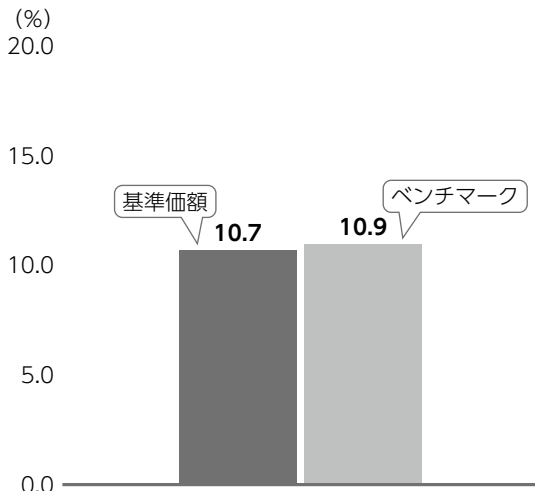
S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、リート組入比率は期を通じて高位を保ちました。

日々の追加設定・解約による資金移動に応じてリーートの売買を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオのリターンとベンチマークのリターンとの乖離）の抑制に努めました。

また、3、6月のベンチマークの定期銘柄見直しに応じて、ポートフォリオの修正を行いました。

▶ ベンチマークとの差異について（2022年2月26日から2022年8月25日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は+10.7%となり、ベンチマークの騰落率+10.9%を0.2%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・配当に対する現地源泉税が生じたこと
- ・売買コストや証券保管コストが生じたこと

2 今後の運用方針

引き続き、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。個別銘柄においてもベンチマーク時価ウェイトに沿った投資を行い、トラッキングエラーを抑制します。また、リート組入比率を高位に保つことを基本とします。

外国リート・インデックス・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2022年2月26日から2022年8月25日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券)	6円 (0) (6)	0.022% (0.002) (0.020)	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：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	3 (0) (3)	0.009 (0.000) (0.009)	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：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)	14 (8) (6)	0.047 (0.028) (0.019)	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：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	23	0.077	

期中の平均基準価額は29,616円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）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ています。
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2022年2月26日から2022年8月25日まで)

(1) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外国	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	72.68	44	615.32	367

※金額は受渡し代金。

(2) 投資信託証券

	買付		売付	
	口数	買付額	口数	売付額
外国		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2,450	49	—
	LXP INDUSTRIAL TRUST	7,988	98	—
	AGREE REALTY CORP	2,527	168	—
	EASTGROUP PROPERTIES INC	838	132	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,071	673	183
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,404	844	—
	BOSTON PROPERTIES INC	3,000	316	—
	VORNADO REALTY TRUST	5,131	173	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,434 (17,535)	238 (—)	— (—)
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,965	191	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,879	158	—
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,911	72	—
PARAMOUNT GROUP INC	5,556	60	—	

外国リート・インデックス・マザーファンド

	買 付		売 付	
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
EQUITY RESIDENTIAL	7,511	609	—	—
EPR PROPERTIES	1,626	85	—	—
EQUINIX INC	2,232	1,525	71	53
SUN COMMUNITIES INC	3,438	565	87	15
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,511	359	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	14,143	271	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,085	347	—	—
REALTY INCOME CORP	18,430	1,269	978	70
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3,823	69	—	—
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,236	72	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,681	496	—	—
TERRENO REALTY CORP	2,155	136	—	—
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5,345	74	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,496	199	—	—
INVITATION HOMES INC	15,235	570	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,457	60	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	7,834	139	—	—
CYRUSONE INC	601 (△ 13,766)	54 (△ 1,240)	— (—)	— (—)
PARK HOTELS & RESORTS INC	8,048	135	—	—
STORE CAPITAL CORP	5,668	150	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	4,730	76	—	—
JBG SMITH PROPERTIES	2,929	71	—	—
RLJ LODGING TRUST	2,948	36	—	—
PENN REAL ESTATE INVEST TST	— (△ 5,040)	— (—)	— (—)	— (—)
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	— (△ 9,490)	— (△ 199)	— (—)	— (—)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,712	44	—	—
VICI PROPERTIES INC	56,226	1,677	—	—
PS BUSINESS PARKS INC/MD	584 (△ 2,617)	104 (△ 424)	— (—)	— (—)
COUSINS PROPERTIES INC	3,912	130	—	—
AMERICOLD REALTY TRUST INC	5,714	159	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6,167	412	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,414	129	—	—
RETAIL VALUE INC	—	—	2,032	5
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5,191	122	—	—
KIMCO REALTY CORP	12,921	293	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	2,651	128	—	—
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,482	180	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	4,305	149	—	—
CARETRUST REIT INC	3,957	68	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC	7,430	159	—	—
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	12,336	409	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406	245	—	—

外国リート・インデックス・マザーファンド

	買 付		売 付		
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648	103	—	—
	LIFE STORAGE INC	1,857	216	—	—
	VENTAS INC	9,202	504	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	6,791	362	831	46
	PROLOGIS INC	17,496	2,407	624	105
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,551	774	419	85
	VERIS RESIDENTIAL INC	3,000	41	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,116	450	274	47
	SITE CENTERS CORP	7,985	118	—	—
	DUKE REALTY CORP	7,921	455	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,630	485	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,989	224	—	—
	WELLTOWER INC	13,444	1,155	885	85
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12,168	357	—	—
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,325	129	—	—
	SERVICE PROPERTIES TRUST	8,811	57	559	4
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,622 (△ 17,535)	72 (—)	— (—)	— (—)
	KILROY REALTY CORP	1,727	113	—	—
	MACERICH CO/THE	8,969	110	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,347	323	—	—
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,327	59	—	—
	PUBLIC STORAGE	3,557	1,227	90	36
	REGENCY CENTERS CORP	5,196	344	1,127	77
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,585	71	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	1,019	62	—	—
	UDR INC	8,049	414	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,045	186	—	—
	CUBESMART	6,334	292	—	—
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4,710	46	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,326	843	—	—
	CEDAR REALTY TRUST INC	— (△ 2,376)	— (△ 54)	— (—)	— (—)
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,097	579	—	—
	KITE REALTY GROUP TRUST	3,506	60	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,446 (△ 17,614)	158 (△ 952)	— (—)	— (—)	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,722	54	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12,041	203	—	—	
DOUGLAS EMMETT INC	5,415	148	—	—	
ACADIA REALTY TRUST	1,935	37	—	—	
ALEXANDER & BALDWIN INC	1,756	35	—	—	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,586	47	—	—	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,581	53	—	—	
CHATHAM LODGING TRUST	—	—	1,866	23	
COREPOINT LODGING INC	— (△ 3,610)	— (△ 57)	— (—)	— (—)	
国					

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	CTO REALTY GROWTH INC	— (620)	— (—)	— (—)	— (—)
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,100	39	—	—
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	8,461	67	—	—
	EQUITY COMMONWEALTH	2,513	68	—	—
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	9,100	39	—	—
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,266	47	—	—
	GLADSTONE LAND CORP	1,890	72	—	—
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	17,071	417	—	—
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,348	210	—	—
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,331	129	636	40
	NEXPOINT RESIDENTIAL	1,174	76	—	—
	PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	—	—	6,243	155
	SAUL CENTERS INC	1,437	61	—	—
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	3,468	27
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,377	43	—	—
	WP CAREY INC	4,204	350	—	—
	WASHINGTON REIT	2,822	72	—	—
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000 (—)	60 (△ 0)	— (—)	— (—)
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	76,900 (—)	55 (△ 1)	— (—)	— (—)
	PRIME US REIT	— (—)	— (△ 0)	— (—)	— (—)
MANULIFE US REAL ESTATE INV	73,900	50	—	—	
カ ナ ダ		□	千カナダ・ドル	□	千カナダ・ドル
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,944	62	—	—
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4,623	77	—	—
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,270	54	1,927	24
	PRIMARIS REIT	2,212	35	—	—
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,325	57	—	—
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,010	14	—	—
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	— (△ 12,355)	— (△ 144)	— (—)	— (—)
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,488	71	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,000	57	—	—
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	387	37	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,020	67	—	—
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,376	67	—	—
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,478	120	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,927	66	—	—
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,190	68	—	—
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1,779	59	—	—
オーストラリア		□	千オーストラリア・ドル	□	千オーストラリア・ドル
	SCENTRE GROUP	106,250	296	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	27,341	81	—	—

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	NATIONAL STORAGE REIT	20,000	42	—	—
	WAYPOINT REIT	37,066	96	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	30,975	91	—	—
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10,000	33	—	—
	IRONGATE GROUP	44,630 (△ 87,034)	85 (△ 158)	— (—)	— (—)
	CENTURIA CAPITAL GROUP	40,048	81	—	—
	HOMECA DAILY NEEDS REIT	70,305	100	—	—
	DEXUS/AU	24,170	252	—	—
	HOME CONSORTIUM LTD	17,279	80	—	—
	HEALTHCO REIT	51,410	105	—	—
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106	83	—	—
	BWP TRUST	21,950	89	—	—
	GPT GROUP	31,228	155	—	—
	MIRVAC GROUP	96,196	212	—	—
	STOCKLAND	47,492	192	—	—
	ABACUS PROPERTY GROUP	18,000	47	—	—
	GOODMAN GROUP	42,175	862	3,938	91
	VICINITY CENTRES	80,412	149	—	—
CHARTER HALL GROUP	13,312	186	—	—	
香 港		□	千香港・ドル	□	千香港・ドル
	CHAMPION REIT	62,000	225	—	—
	LINK REIT	51,000	3,417	—	—
	FORTUNE REIT	56,000	369	—	—
シ ン ガ ポ ー ル		□	千シンガポール・ドル	□	千シンガポール・ドル
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	60,600 (—)	82 (△ 2)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	50,300 (—)	130 (△ 0)	— (—)	— (—)
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	— (—)	— (△ 1)	— (—)	— (—)
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	38,400	92	—	—
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	90,400	58	—	—
	KEPPEL DC REIT	27,300 (—)	55 (△ 1)	— (—)	— (—)
	IREIT GLOBAL	— (—)	— (△ 1)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	— (△235,000)	— (△ 244)	— (—)	— (—)
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	86,000 (—)	242 (△ 7)	— (—)	— (—)
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	121,900 (—)	265 (△ 0)	— (—)	— (—)
	SUNTEC REIT	26,000 (—)	44 (△ 1)	— (—)	— (—)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	101,200 (—)	184 (△ 5)	— (—)	— (—)
KEPPEL REIT	72,900	86	—	—	

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外	ASCOTT RESIDENCE TRUST	54,500 (-)	62 (△ 3)	- (-)	- (-)
	ESR-LOGOS REIT	- (207,961)	- (△ 11)	- (-)	- (-)
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	- (-)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	CAPITALAND CHINA TRUST	- (-)	- (△ 3)	- (-)	- (-)
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	8,400 (-)	41 (△ 0)	- (-)	- (-)
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	81,900 (-)	156 (△ 1)	- (-)	- (-)
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	(△117,300)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	AIMS APAC REIT	- (-)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	203,200	161	79,500	62
ニュージーランド	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル	□ キニューゼーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	53,399	57	-	-
	ARGOSY PROPERTY LTD	23,725	29	-	-
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	11,358	32	-	-
	GOODMAN PROPERTY TRUST	8,932	20	-	-
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	41,326	60	-	-	
イギリス	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド	□ キイギリス・ポンド
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	45,499	98	-	-
	ASSURA PLC	91,163	61	-	-
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	19,264	53	-	-
	UNITE GROUP PLC/THE	12,671	144	3,498	39
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,252	56	-	-
	HOME REIT PLC	30,904	35	-	-
	PRS REIT PLC/THE	47,362	51	-	-
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	29,815	43	-	-
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,077	123	-	-
	SEGro PLC	28,017	314	-	-
	BRITISH LAND CO PLC	19,664	102	-	-
	DERWENT LONDON PLC	3,362	95	-	-
	WORKSPACE GROUP PLC	6,854	44	-	-
	SHAFTESBURY PLC	9,022	56	-	-
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,968	87	-	-
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	56,726	45	-	-	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	40,000	52	-	-	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	34,963	34	-	-	
LXI REIT PLC	168,627	238	-	-	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	35,417	49	-	-	
イスラエル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル	□ キイスラエル・シェケル
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500	256	-	-	

外国リート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付		
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外 韓 国		REIT 1 LTD	8,073	170	-	-
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	□ 3,626	千韓国・ウォン 23,748	□ -	千韓国・ウォン -
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	(9,692 -)	(△ 56,722 30)	(-)	(-)
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	(2,023)	(-)	2,023 (-)	(-)
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	(706)	(-)	706 (-)	(-)
		D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350	34,138	-	-
		SK REITS CO LTD	12,831	81,660	-	-
		JR GLOBAL REIT	(2,449)	(-)	2,449 (-)	(-)
		SK REITS CO LTD-RIGHTS	(3,437)	(-)	3,437 (-)	(-)
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	3,460	27,400	-	-
		JR REIT XXVII	6,233	27,726	-	-
	ユ ー ロ ー プ 国	アイルランド	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	□ 7,207	千ユーロ 10	□ -
HIBERNIA REIT PLC			6,079 (△ 77,486)	9 (△ 90)	-	(-)
オランダ		NSI NV	381	14	-	-
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	(831 63)	(17 -)	(-)	(-)
		WERELDHAVE NV	1,572	22	-	-
ベルギー		MONTEA NV	245	23	-	-
		AEDIFICA	1,188	122	-	-
		COFINIMMO	991	118	86	11
		BEFIMMO	624	29	2,757	130
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,436	120	-	-
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	1,112	29	-	-
		XIOR STUDENT HOUSING NV	457	23	-	-
フランス		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,823	176	-	-
		ICADE	(-)	(△ 3)	(-)	(-)
		GECINA SA	1,297	137	-	-
		KLEPIERRE	(4,338 -)	(△ 85 35)	(-)	(-)
		COVIVIO	1,231	83	-	-
		ALTAREA	218 (-)	33 (△ 3)	96 (-)	13 (-)
	CARMILA	(2,418 -)	(△ 37 4)	(-)	(-)	
ドイツ	HAMBORNER REIT AG	2,978	25	1,562	14	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	280	3	-	-	
スペイン	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	(7,998 -)	(△ 82 8)	(-)	(-)	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	(7,052 -)	(△ 52 5)	(-)	(-)	

外国リート・インデックス・マザーファンド

			買 付		売 付	
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国	ユ ー ロ ー ン	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	(-)	(Δ) 1	(-)	(-)
		イ タ リ ア	1,165	9	3,144	31
	そ の 他	CROMWELL REIT EUR	(20,600)	(Δ) 47	(-)	(-)

※金額は受渡し代金。

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

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年2月26日から2022年8月25日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	55,957千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	-
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	-

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年2月26日から2022年8月25日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2022年2月26日から2022年8月25日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2022年8月25日現在)

(1) 外国株式

銘 柄	株 数	期 末	評 価 額		業 種 等
			株 数	株 数	
(アメリカ) DIGITALBRIDGE GROUP INC	百株 542.64	百株 -	千アメリカ・ドル -	千円 -	不動産
小 計	株 数 542.64	株 数 -	-	-	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	-	<->	
合 計	株 数 542.64	株 数 -	-	-	
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	-	<->	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首(前期末)		期		末		
		口	数	口	数	評価額		組入比率
						外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		口	口	千アメリカ・ドル	千円		%	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT		—	69,000	54	7,466		0.0	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		54,000	130,900	85	11,654		0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST		20,000	20,000	2	375		0.0	
PRIME US REIT		54,200	54,200	34	4,714		0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV		172,000	245,900	122	16,841		0.1	
(アメリカ)								
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		15,094	17,544	335	45,900		0.2	
LXP INDUSTRIAL TRUST		29,012	37,000	391	53,672		0.2	
RPT REALTY		8,262	8,262	83	11,464		0.0	
AGREE REALTY CORP		7,050	9,577	745	102,114		0.4	
EASTGROUP PROPERTIES INC		4,512	5,350	905	124,070		0.5	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		15,039	17,927	3,764	515,610		2.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC		35,270	42,674	4,552	623,596		2.5	
BOSTON PROPERTIES INC		15,428	18,428	1,523	208,681		0.8	
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A		15,893	15,893	147	20,181		0.1	
VORNADO REALTY TRUST		16,715	21,846	606	83,100		0.3	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		22,831	48,800	1,260	172,596		0.7	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		31,235	39,200	880	120,547		0.5	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		13,256	17,135	724	99,214		0.4	
URBAN EDGE PROPERTIES		11,117	15,028	244	33,554		0.1	
PARAMOUNT GROUP INC		14,599	20,155	145	19,905		0.1	
EQUITY RESIDENTIAL		36,389	43,900	3,367	461,229		1.8	
EPR PROPERTIES		7,974	9,600	444	60,832		0.2	
EQUINIX INC		9,601	11,762	7,897	1,081,844		4.3	
SUN COMMUNITIES INC		12,366	15,717	2,512	344,100		1.4	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		23,563	31,074	1,585	217,124		0.9	
HOST HOTELS & RESORTS INC		76,626	90,769	1,697	232,507		0.9	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		29,419	38,504	1,409	193,091		0.8	
REALTY INCOME CORP		60,803	78,255	5,527	757,216		3.0	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		17,289	17,289	237	32,516		0.1	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN		12,609	16,432	285	39,142		0.2	
NATL HEALTH INVESTORS INC		4,815	6,051	402	55,144		0.2	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		12,436	15,117	2,675	366,435		1.5	
TERRENO REALTY CORP		7,571	9,726	618	84,678		0.3	
SABRA HEALTH CARE REIT INC		22,878	28,223	437	59,961		0.2	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		18,204	22,700	1,045	143,158		0.6	
INVITATION HOMES INC		63,633	78,868	2,971	407,069		1.6	
XENIA HOTELS & RESORTS INC		11,870	15,327	262	35,964		0.1	
PHYSICIANS REALTY TRUST		23,370	31,204	541	74,202		0.3	
CYRUSONE INC		13,165	—	—	—		—	
PARK HOTELS & RESORTS INC		24,384	32,432	474	64,949		0.3	
STORE CAPITAL CORP		26,534	32,202	888	121,744		0.5	
APPLE HOSPITALITY REIT INC		21,470	26,200	437	59,898		0.2	
JBG SMITH PROPERTIES		12,389	15,318	352	48,301		0.2	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
RLJ LODGING TRUST	17,225	20,173	258	35,397	0.1	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,400	360	1	273	0.0	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9,490	—	—	—	—	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,024	9,736	272	37,288	0.1	
VICI PROPERTIES INC	68,217	124,443	4,229	579,400	2.3	
PS BUSINESS PARKS INC/MD	2,033	—	—	—	—	
COUSINS PROPERTIES INC	15,388	19,300	546	74,896	0.3	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	28,024	33,738	1,031	141,230	0.6	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,714	21,881	1,425	195,331	0.8	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,712	7,126	625	85,683	0.3	
RETAIL VALUE INC	2,032	—	—	—	—	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,429	17,620	409	56,115	0.2	
KIMCO REALTY CORP	67,097	80,018	1,768	242,235	1.0	
APARTMENT INCOME REIT CO	17,009	19,660	850	116,527	0.5	
GETTY REALTY CORP	5,036	5,036	152	20,860	0.1	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	13,518	17,000	891	122,091	0.5	
STAG INDUSTRIAL INC	18,095	22,400	727	99,690	0.4	
CARETRUST REIT INC	9,346	13,303	288	39,451	0.2	
BROADSTONE NET LEASE INC	16,254	23,684	478	65,533	0.3	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165	2,165	39	5,415	0.0	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515	2,515	23	3,234	0.0	
INDUS REALTY TRUST INC	823	823	51	7,088	0.0	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424	1,424	22	3,029	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	5,199	5,199	52	7,164	0.0	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,918	15,254	506	69,392	0.3	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	8,406	230	31,561	0.1	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	3,648	108	14,926	0.1	
LIFE STORAGE INC	9,001	10,858	1,459	199,867	0.8	
VENTAS INC	43,197	52,399	2,527	346,248	1.4	
IRON MOUNTAIN INC	31,628	37,588	2,046	280,352	1.1	
PROLOGIS INC	79,064	95,936	12,579	1,723,088	6.9	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,113	19,245	3,066	420,075	1.7	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191	20,191	165	22,679	0.1	
VERIS RESIDENTIAL INC	7,798	10,798	149	20,485	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	10,746	13,588	1,857	254,474	1.0	
SITE CENTERS CORP	18,028	26,013	359	49,279	0.2	
DUKE REALTY CORP	41,226	49,147	3,044	417,057	1.7	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,940	8,570	2,401	329,025	1.3	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,311	9,300	987	135,289	0.5	
WELLTOWER INC	46,568	59,127	4,582	627,770	2.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	56,651	68,819	1,864	255,372	1.0	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,521	13,846	441	60,540	0.2	
SERVICE PROPERTIES TRUST	17,194	25,446	190	26,072	0.1	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,913	—	—	—	—	
KILROY REALTY CORP	11,327	13,054	657	89,996	0.4	
LTC PROPERTIES INC	5,036	5,036	223	30,600	0.1	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
MACERICH CO/THE	21,231	30,200	300	41,202	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,499	22,846	1,671	228,950	0.9	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,896	14,223	374	51,278	0.2	
PUBLIC STORAGE	16,267	19,734	6,768	927,212	3.7	
REGENCY CENTERS CORP	16,551	20,620	1,303	178,510	0.7	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10,751	15,336	248	34,094	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	7,052	8,071	371	50,844	0.2	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	23,884	39	5,398	0.0	
UDR INC	30,627	38,676	1,825	250,057	1.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,932	30,977	1,007	137,989	0.6	
CUBESMART	22,914	29,248	1,427	195,592	0.8	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24,669	29,379	348	47,688	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	30,461	36,787	4,621	633,110	2.5	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,376	—	—	—	—	
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,431	17,528	3,640	498,636	2.0	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876	2,876	31	4,325	0.0	
KITE REALTY GROUP TRUST	24,850	28,356	576	78,965	0.3	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15,168	—	—	—	—	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	20,954	26,676	249	34,202	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	65,190	77,231	1,174	160,908	0.6	
DOUGLAS EMMETT INC	18,117	23,532	481	65,918	0.3	
ACADIA REALTY TRUST	8,247	10,182	169	23,166	0.1	
ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758	8,514	163	22,391	0.1	
ALEXANDER'S INC	300	300	74	10,183	0.0	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,414	7,000	199	27,375	0.1	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023	17,023	134	18,421	0.1	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,848	8,429	115	15,841	0.1	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745	3,745	96	13,224	0.1	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400	8,400	47	6,443	0.0	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658	2,658	18	2,552	0.0	
CENTERSPACE	1,542	1,542	121	16,690	0.1	
CHATHAM LODGING TRUST	7,423	5,557	71	9,827	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	4,603	57	7,824	0.0	
CLIPPER REALTY INC	800	800	6	922	0.0	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216	3,216	124	17,083	0.1	
COREPOINT LODGING INC	3,610	—	—	—	—	
CTO REALTY GROWTH INC	310	930	19	2,732	0.0	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,769	11,869	218	29,947	0.1	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,815	21,276	157	21,537	0.1	
EQUITY COMMONWEALTH	12,245	14,758	396	54,319	0.2	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666	4,666	67	9,242	0.0	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	6,015	15,115	45	6,252	0.0	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,102	5,368	106	14,639	0.1	
GLADSTONE LAND CORP	2,574	4,464	107	14,767	0.1	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146	13,146	186	25,498	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669	5,669	64	8,798	0.0	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘 柄	期首(前期末)		期 末		組 入 比 率		
	口 数	口 数	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	10,979	28,050	573	78,574	0.3		
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274	6,274	51	7,038	0.0		
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,474	3,822	370	50,725	0.2		
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,500	10,195	556	76,207	0.3		
NETSTREIT CORP	4,793	4,793	98	13,544	0.1		
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,355	3,529	203	27,839	0.1		
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071	5,071	94	12,913	0.1		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352	2,352	58	8,018	0.0		
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040	14,040	174	23,847	0.1		
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	6,243	—	—	—	—		
SAFEHOLD INC	1,242	1,242	52	7,223	0.0		
SAUL CENTERS INC	894	2,331	108	14,927	0.1		
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468	—	—	—	—		
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,721	14,098	120	16,453	0.1		
UMH PROPERTIES INC	6,284	6,284	115	15,812	0.1		
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344	1,344	70	9,639	0.0		
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927	2,927	51	6,988	0.0		
WP CAREY INC	20,296	24,500	2,103	288,147	1.2		
WASHINGTON REIT	7,968	10,790	216	29,648	0.1		
WHITESTONE REIT	4,511	4,511	47	6,463	0.0		
BRT APARTMENTS CORP	500	500	12	1,682	0.0		
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774	4,774	99	13,582	0.1		
小 計	口 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	2,608,015 154銘柄	3,362,199 147銘柄	140,694 <77.2%>	19,272,330 <77.2%>	77.2
(カナダ)				千カナダ・ドル			
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,163	8,107	140	14,855	0.1		
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447	1,447	22	2,356	0.0		
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551	4,551	75	7,993	0.0		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,177	13,800	258	27,360	0.1		
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622	13,622	50	5,358	0.0		
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377	11,377	40	4,318	0.0		
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387	1,387	6	736	0.0		
NEXUS INDUSTRIAL REIT	2,002	4,345	46	4,879	0.0		
PRIMARIS REIT	4,106	6,318	88	9,319	0.0		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	9,662	108	11,503	0.0		
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715	2,725	35	3,757	0.0		
CHOICE PROPERTIES REIT	17,893	17,893	251	26,544	0.1		
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,355	—	—	—	—		
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107	5,107	82	8,726	0.0		
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,411	17,899	216	22,919	0.1		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,775	14,775	228	24,137	0.1		
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,176	3,563	275	29,137	0.1		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178	11,198	141	14,966	0.1		
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557	1,557	27	2,889	0.0		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305	12,305	160	16,953	0.1		
SLATE OFFICE REIT	3,663	3,663	16	1,742	0.0		

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196	3,196	46	4,913	0.0	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770	4,770	29	3,142	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	8,509	8,509	36	3,868	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,064	9,440	270	28,588	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,946	11,424	525	55,518	0.2	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425	16,425	215	22,803	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,598	19,525	402	42,530	0.2	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169	2,169	40	4,320	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,000	3,190	157	16,656	0.1	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,021	8,800	282	29,850	0.1	
小計	222,002 口数・金額 銘柄数<比率>	252,749 30銘柄	4,280	452,652 <1.8%>	1.8	
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル			
SCENTRE GROUP	553,750	660,000	1,874	177,824	0.7	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	116,511	143,852	386	36,711	0.1	
CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	158,718	125	11,895	0.0	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439	30,439	106	10,078	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	109,680	129,680	312	29,649	0.1	
WAYPOINT REIT	76,045	113,111	288	27,363	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955	37,955	140	13,358	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	53,468	84,443	251	23,873	0.1	
GDI PROPERTY GROUP	43,204	43,204	39	3,729	0.0	
ARENA REIT	45,981	45,981	197	18,713	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,921	25,921	85	8,090	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	52,739	52,739	134	12,758	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965	39,965	186	17,668	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237	30,237	83	7,888	0.0	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852	73,852	328	31,178	0.1	
IRONGATE GROUP	42,404	—	—	—	—	
CENTURIA OFFICE REIT	43,559	43,559	71	6,735	0.0	
CENTURIA CAPITAL GROUP	64,710	104,758	190	18,087	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	117,492	187,797	238	22,626	0.1	
DEXUS/AU	112,830	137,000	1,182	112,165	0.4	
HOME CONSORTIUM LTD	16,399	33,678	175	16,646	0.1	
HEALTHCO REIT	—	51,410	90	8,559	0.0	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	89,106	74	7,100	0.0	
BWP TRUST	45,015	66,965	267	25,411	0.1	
GPT GROUP	203,413	234,641	976	92,603	0.4	
CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449	62,449	256	24,349	0.1	
MIRVAC GROUP	438,177	534,373	1,116	105,954	0.4	
STOCKLAND	249,539	297,031	1,072	101,727	0.4	
ABACUS PROPERTY GROUP	32,980	50,980	137	13,010	0.1	
GOODMAN GROUP	182,852	221,089	4,278	405,860	1.6	
VICINITY CENTRES	398,729	479,141	900	85,457	0.3	
CHARTER HALL GROUP	50,934	64,246	805	76,431	0.3	
小計	3,499,947 口数・金額 銘柄数<比率>	4,328,320 31銘柄	16,375	1,553,511 <6.2%>	6.2	

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)			千香港・ドル			
CHAMPION REIT	177,000	239,000	814	14,229	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000	110,000	407	7,106	0.0	
PROSPERITY REIT	178,000	178,000	423	7,396	0.0	
LINK REIT	222,900	273,900	16,707	291,719	1.2	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000	230,000	556	9,718	0.0	
FORTUNE REIT	152,000	208,000	1,335	23,315	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,069,900 6銘柄	1,238,900 6銘柄	20,245	353,486 <1.4%>	1.4
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	309,638	370,238	510	50,270	0.2	
SPH REIT	115,700	115,700	108	10,643	0.0	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	193,500	243,800	636	62,607	0.3	
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	176,400	176,400	49	4,859	0.0	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	103,400	141,800	320	31,530	0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600	190,000	117	11,590	0.0	
KEPPEL DC REIT	143,600	170,900	333	32,788	0.1	
IREIT GLOBAL	57,600	57,600	32	3,202	0.0	
EC WORLD REIT	52,800	52,800	28	2,831	0.0	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	235,000	—	—	—	—	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRUST	350,000	436,000	1,255	123,546	0.5	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	538,908	660,808	1,354	133,284	0.5	
SUNTEC REIT	239,900	265,900	420	41,335	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	331,750	432,950	753	74,120	0.3	
KEPPEL REIT	202,900	275,800	306	30,120	0.1	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	205,555	260,055	288	28,401	0.1	
ESR-LOGOS REIT	398,752	606,713	248	24,474	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950	94,950	119	11,771	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	113,900	113,900	125	12,327	0.0	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,600	48,000	230	22,669	0.1	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	222,800	304,700	575	56,661	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	138,200	138,200	80	7,886	0.0	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300	—	—	—	—	
AIMS APAC REIT	38,300	38,300	52	5,124	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,700	66,700	51	5,086	0.0	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	243,200	91	8,973	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	138,300	262,000	216	21,266	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	4,968,253 27銘柄	5,767,414 25銘柄	8,307	817,374 <3.3%>	3.3
(ニュージーランド)			千ニュージーランド・ドル			
KIWI PROPERTY GROUP LTD	147,107	200,506	200	17,016	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	83,275	107,000	146	12,441	0.0	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	46,161	57,519	155	13,180	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	114,674	123,606	269	22,869	0.1	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	151,115	192,441	261	22,212	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	542,332 5銘柄	681,072 5銘柄	1,033	87,719 <0.4%>	0.4

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	評価額		組入比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)						
TRITAX BIG BOX REIT PLC	191,159	236,658	千イギリス・ポンド	412	66,669	0.3
ASSURA PLC	287,670	378,833		254	41,192	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	99,540	118,804		266	43,176	0.2
UNITE GROUP PLC/THE	42,827	52,000		562	91,040	0.4
SAFESTORE HOLDINGS PLC	21,672	25,924		284	46,058	0.2
HOME REIT PLC	65,147	96,051		115	18,681	0.1
PRS REIT PLC/THE	41,845	89,207		93	15,127	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	95,185	125,000		157	25,464	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	81,923	99,000		659	106,687	0.4
SEGRE PLC	129,942	157,959	1,548		250,583	1.0
HAMMERSON PLC	440,241	440,241		95	15,529	0.1
BRITISH LAND CO PLC	99,099	118,763		517	83,767	0.3
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485	30,485		160	26,045	0.1
INTU PROPERTIES PLC	28,500	28,500		0	46	0.0
DERWENT LONDON PLC	12,339	15,701		387	62,650	0.3
WORKSPACE GROUP PLC	13,356	20,210		106	17,282	0.1
SHAFTESBURY PLC	27,317	36,339		157	25,460	0.1
BIG YELLOW GROUP PLC	17,172	23,140		306	49,536	0.2
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	57,141		51	8,376	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847	117,847		82	13,424	0.1
NEWRIVER REIT PLC	46,021	46,021		39	6,404	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238	108,964		82	13,329	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	34,770		29	4,793	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	109,811	149,811		187	30,301	0.1
CUSTODIAN REIT PLC	39,999	39,999		41	6,769	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037	95,000		91	14,880	0.1
AEW UK REIT PLC	9,000	9,000		10	1,628	0.0
LXI REIT PLC	62,738	231,365		336	54,433	0.2
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	146,583	182,000		254	41,170	0.2
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816	41,816		49	8,024	0.0
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280	53,280		40	6,569	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698	70,698		36	5,925	0.0
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651	89,651		94	15,260	0.1
REGIONAL REIT LTD	45,664	45,664		32	5,283	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,762,713 34銘柄	3,465,842 34銘柄	7,549	1,221,576 <4.9%>	4.9
(イスラエル)						
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	— 18,096	25,500 26,169	千イスラエル・シェケル	272 567	11,428 23,784	0.0 0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	18,096 1銘柄	51,669 2銘柄	840	35,212 <0.1%>	0.1
(韓国)						
KORAMCO ENERGY PLUS REIT ESR KENDALL SQUARE REIT CO L IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	2,600 14,308 4,067	6,226 24,000 4,067	千韓国・ウォン	33,807 126,960 20,497	3,468 13,026 2,103	0.0 0.1 0.0

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期		末	
	口数	口数	口数	口数	評価額	組入比率
					外貨建金額	邦貨換算金額
D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	6,350	29,146	2,990		0.0
SK REITS CO LTD	—	12,831	72,751	7,464		0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815	9,815	44,363	4,551		0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302	8,762	68,956	7,074		0.0
LOTTE REIT CO LTD	12,522	12,522	63,236	6,488		0.0
JR REIT XXVII	12,767	19,000	87,970	9,025		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	61,381 7銘柄	103,573 9銘柄	547,689	56,192	0.2
(ユーロ・・・アイルランド)			千ユーロ			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	45,608	52,815	65	8,955		0.0
HIBERNIA REIT PLC	71,407	—	—	—		—
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	117,015 2銘柄	52,815 1銘柄	65	8,955	0.0
(ユーロ・・・オランダ)			千ユーロ			
NSI NV	1,955	2,336	72	9,854		0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,947	4,841	106	14,590		0.1
WERELDHAVE NV	3,950	5,522	78	10,715		0.0
VASTNED RETAIL NV	2,035	2,035	46	6,358		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	11,887 4銘柄	14,734 4銘柄	303	41,519	0.2
(ユーロ・・・ベルギー)			千ユーロ			
MONTEA NV	989	1,234	112	15,373		0.1
RETAIL ESTATES	1,586	1,586	105	14,466		0.1
AEDIFICA	3,622	4,810	477	65,316		0.3
COFINIMMO	3,095	4,000	420	57,544		0.2
BEFIMMO	2,652	519	24	3,367		0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	15,031	18,467	585	80,053		0.3
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,388	3,500	90	12,324		0.0
CARE PROPERTY INVEST	3,490	3,490	76	10,475		0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	1,984	2,441	104	14,353		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	34,837 9銘柄	40,047 9銘柄	1,998	273,275	1.1
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,577	15,400	798	109,256		0.4
ICADE	3,844	3,844	169	23,202		0.1
GECINA SA	5,729	7,026	641	87,721		0.4
KLEPIERRE	20,731	25,069	521	71,374		0.3
COVIVIO	4,944	6,175	347	47,457		0.2
ALTAREA	384	506	67	9,216		0.0
CARMILA	4,754	7,172	112	15,417		0.1
MERCIALYS	6,257	6,257	51	7,097		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	59,220 8銘柄	71,449 8銘柄	2,711	370,745	1.5
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ			
HAMBORNER REIT AG	9,584	11,000	91	12,575		0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,480	1,760	21	2,967		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	11,064 2銘柄	12,760 2銘柄	113	15,543	0.1

外国リート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首(前期末)		期		末
		口	数	口	数	組入比率
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ・・・スペイン)				千ユーロ		
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34,598	42,596	404	55,337	0.2
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	27,806	34,858	212	29,053	0.1
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940	6,940	32	4,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	69,344	84,394	649	88,832	0.4
	銘 柄 数 <比 率>	3銘柄	3銘柄		< 0.4%>	
(ユーロ・・・イタリア)				千ユーロ		
	COIMA RES SPA	1,979	—	—	—	—
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798	4,798	16	2,316	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6,777	4,798	16	2,316	0.0
	銘 柄 数 <比 率>	2銘柄	1銘柄		< 0.0%>	
(ユーロ・・・その他)				千ユーロ		
	CROMWELL REIT EUR	27,720	48,320	98	13,479	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	27,720	48,320	98	13,479	0.1
	銘 柄 数 <比 率>	1銘柄	1銘柄		< 0.1%>	
ユーロ通貨計	口 数 ・ 金 額	337,864	329,317	5,957	814,668	3.3
	銘 柄 数 <比 率>	31銘柄	29銘柄		< 3.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	16,090,503	19,581,055	—	24,664,726	98.8
	銘 柄 数 <比 率>	326銘柄	318銘柄		<98.8%>	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年8月25日現在)

項	目	期		末
		評	価	比
		額		率
		千円		%
投 資 証 券		24,664,726		98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		325,291		1.3
投 資 信 託 財 産 総 額		24,990,018		100.0

※期末における外貨建資産（24,929,098千円）の投資信託財産総額（24,990,018千円）に対する比率は99.8%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝136.98円、1カナダ・ドル＝105.74円、1オーストラリア・ドル＝94.87円、1香港・ドル＝17.46円、1シンガポール・ドル＝98.39円、1ニュージーランド・ドル＝84.87円、1イギリス・ポンド＝161.81円、1イスラエル・シェケル＝41.884円、100韓国・ウォン＝10.26円、1ユーロ＝136.75円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年8月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	25,054,208,321円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	260,094,482
投 資 証 券 (評 価 額)	24,664,726,956
未 収 入 金	70,026,908
未 収 配 当 金	59,359,975
(B) 負 債	86,274,353
未 払 金	64,221,343
未 払 解 約 金	22,052,823
そ の 他 未 払 費 用	187
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	24,967,933,968
元 本	8,289,450,618
次 期 繰 越 損 益 金	16,678,483,350
(D) 受 益 権 総 口 数	8,289,450,618口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	30,120円

※当期における期首元本額6,930,002,827円、期中追加設定元本額1,683,021,722円、期中一部解約元本額323,573,931円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド（安定型）	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,124,195,280円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,899,696円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	132,066,306円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	73,782,762円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	57,964,497円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	75,422,855円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	619,904円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	185,442,553円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）	72,771,799円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）	254,523,444円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	16,306,846円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,778,851円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	37,295,369円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05（リスク3%）<適格機関投資家限定>	86,863,439円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2022年2月26日 至2022年8月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	443,707,741円
受 取 配 当 金	443,535,617
受 取 利 息	52,572
そ の 他 収 益 金	132,280
支 払 利 息	△ 12,728
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,638,157,428
売 買 益	3,943,848,575
売 買 損	△ 2,305,691,147
(C) そ の 他 費 用 等	△ 9,558,840
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,072,306,329
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,929,646,039
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 637,092,539
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,313,623,521
(H) 合 計 (D + E + F + G)	16,678,483,350
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	16,678,483,350

※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。

※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。

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。