

りそな国内リートインデックス (ラップ専用)

運用報告書 (全体版)

第2期 (決算日 2023年11月20日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「りそな国内リートインデックス (ラップ専用)」は、2023年11月20日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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	2021年11月19日から無期限とします。	
運用方針	東証REIT指数 (配当込み) の動き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	りそな国内リートインデックス (ラップ専用)	・ RM国内リートマザーファンドの受益証券
	RM国内リートマザーファンド	・ 東証REIT指数 (配当込み) に採用されている不動産投資信託証券
主な投資制限	りそな国内リートインデックス (ラップ専用)	・ 不動産投資信託証券および株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
	RM国内リートマザーファンド	・ 不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、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には分配を行わないことがあります。	

<照会先>

電話番号：0120-223351

(委託会社の営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ： <https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		不動産投信 指数先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配 金	期 騰落 中率	(ベンチマーク)	期 騰落 中率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2021年11月19日	10,000	—	—	4,601.73	—	—	—	1
1期(2022年11月21日)	9,868	0	△1.3	4,547.04	△1.2	1.7	98.1	443
2期(2023年11月20日)	9,596	0	△2.8	4,421.12	△2.8	1.5	98.3	3,114

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 東証REIT指数(配当込み)は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配 当 込 み) (ベンチマーク)		不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年11月21日	円	%		%	%	%
	9,868	—	4,547.04	—	1.7	98.1
11月末	9,907	0.4	4,565.38	0.4	1.4	98.3
12月末	9,557	△3.2	4,403.82	△3.1	1.1	98.6
2023年1月末	9,252	△6.2	4,263.06	△6.2	1.3	98.5
2月末	9,397	△4.8	4,331.37	△4.7	1.7	97.8
3月末	9,123	△7.5	4,204.73	△7.5	1.6	98.2
4月末	9,589	△2.8	4,420.34	△2.8	1.6	98.1
5月末	9,650	△2.2	4,448.91	△2.2	1.2	98.5
6月末	9,588	△2.8	4,421.28	△2.8	1.1	98.6
7月末	9,700	△1.7	4,472.88	△1.6	1.2	98.6
8月末	9,842	△0.3	4,539.20	△0.2	1.6	98.1
9月末	9,687	△1.8	4,468.30	△1.7	1.7	98.2
10月末	9,487	△3.9	4,372.14	△3.8	1.6	98.1
(期 末) 2023年11月20日	9,596	△2.8	4,421.12	△2.8	1.5	98.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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。

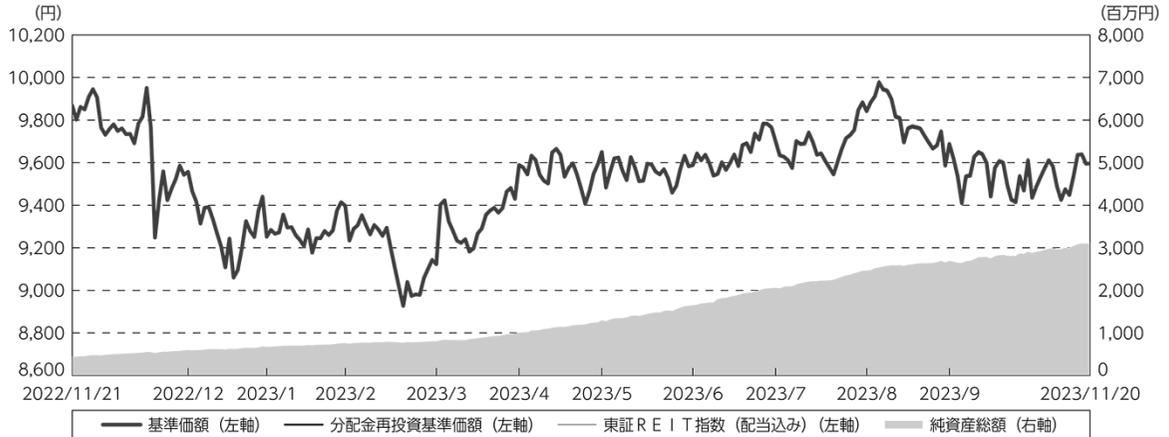
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2022年11月22日～2023年11月20日)

期中の基準価額等の推移



期首：9,868円

期末：9,596円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 2.8% (分配金再投資ベース)

- (注) 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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額および東証REIT指数(配当込み)は、期首(2022年11月21日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 東証REIT指数(配当込み)は当ファンドのベンチマークです。
- (注) 東証REIT指数(配当込み)は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

投資環境

国内リート市況

国内のリート市場は、前期末と比較して下落しました。前半は、主要国中央銀行（日本除く）による金融引き締めの影響や国内金利上昇が嫌気され、相場が不安定化する場面もみられました。2023年3月には、米欧を中心とする金融システム不安の影響を受け、国内リート市場は下落しました。その後、株式などリスク性資産の上昇につれて買い戻される場面もみられましたが、日銀による長短金利操作（イールドカーブ・コントロール、YCC）の修正など金融政策を巡る先行き不透明感から、国内リート市場は上値の重さが残りました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM国内リートマザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

RM国内リートマザーファンド

国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-2.8%となり、ベンチマークの-2.8%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

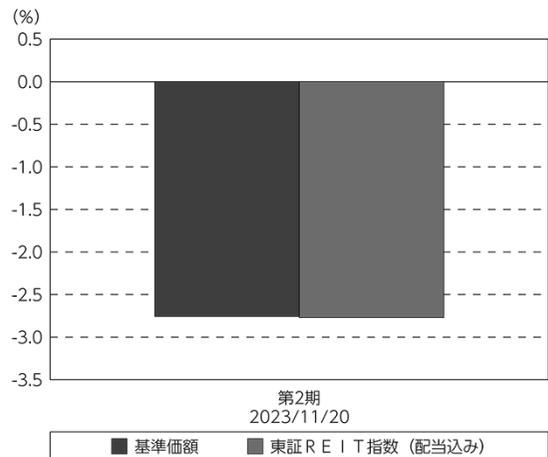
（マイナス要因）

- ・信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・コスト負担（リート等に係る取引費用）が生じたこと

（その他の要因）

- ・リートの取引価格と評価に用いる価格が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（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、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第2期
	2022年11月22日～ 2023年11月20日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	260

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RM国内リートマザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RM国内リートマザーファンド

引き続き、主として東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2022年11月22日～2023年11月20日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	10	0.110	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	（ 7 ）	（ 0.077 ）	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	（ 1 ）	（ 0.011 ）	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、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	（ 2 ）	（ 0.022 ）	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	（ 0 ）	（ 0.001 ）	
(c) そ の 他 費 用	1	0.007	(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 ）	（ 1 ）	（ 0.007 ）	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	（ 0 ）	（ 0.000 ）	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	11	0.118	
期中の平均基準価額は、9,564円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

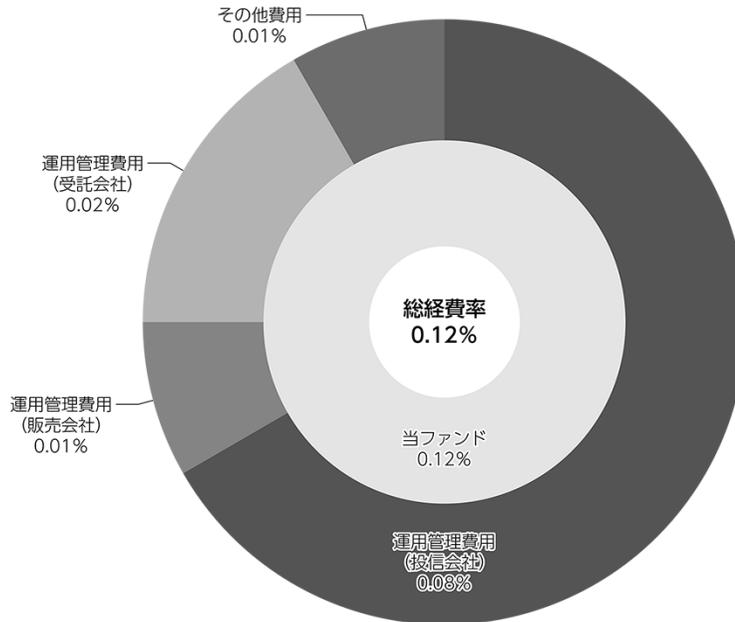
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.12%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年11月22日～2023年11月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
RM国内リートマザーファンド		1,861,048	2,673,743	1,147	1,653

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月22日～2023年11月20日)

該当事項はございません。

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11月22日～2023年11月20日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年11月22日～2023年11月20日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年11月20日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
RM国内リートマザーファンド	299,086	2,158,987	3,109,805

○投資信託財産の構成

(2023年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM国内リートマザーファンド	千円 3,109,805	% 99.8
コール・ローン等、その他	7,152	0.2
投資信託財産総額	3,116,957	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2022年11月22日～2023年11月20日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年11月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,116,957,856
コール・ローン等	7,152,218
RM国内リートマザーファンド(評価額)	3,109,805,638
(B) 負債	2,509,430
未払解約金	1,216,042
未払信託報酬	1,218,981
未払利息	19
その他未払費用	74,388
(C) 純資産総額(A-B)	3,114,448,426
元本	3,245,637,032
次期繰越損益金	△ 131,188,606
(D) 受益権総口数	3,245,637,032口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,596円

(注) 当ファンドの期首元本額は449,123,937円、期中追加設定元本額は2,882,060,331円、期中一部解約元本額は85,547,236円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.9596円です。

(注) 2023年11月20日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は131,188,606円です。

○損益の状況（2022年11月22日～2023年11月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,102
支払利息	△ 3,102
(B) 有価証券売買損益	△ 4,462,632
売買益	746,363
売買損	△ 5,208,995
(C) 信託報酬等	△ 1,721,930
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 6,187,664
(E) 前期繰越損益金	2,404,143
(F) 追加信託差損益金	△127,405,085
(配当等相当額)	(21,243,648)
(売買損益相当額)	(△148,648,733)
(G) 計(D+E+F)	△131,188,606
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△131,188,606
追加信託差損益金	△127,405,085
(配当等相当額)	(24,851,758)
(売買損益相当額)	(△152,256,843)
分配準備積立金	59,636,052
繰越損益金	△ 63,419,573

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(56,882,673円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(24,851,758円)および分配準備積立金(2,753,379円)より分配対象収益は84,487,810円(1万口当たり260円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

RM国内リートマザーファンド

運用報告書

第7期（決算日 2023年1月25日）
（2022年1月26日～2023年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT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。なお、東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②不動産投資信託証券またはETFの組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券
主な投資制限	・不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み) (ベンチマーク)		不動産投資 先物比率	投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
3期(2019年1月25日)	11,929	8.1	3,654.11	8.1	4.4	95.6	12,367
4期(2020年1月27日)	14,787	24.0	4,533.90	24.1	2.1	97.8	24,559
5期(2021年1月25日)	12,646	△14.5	3,887.39	△14.3	2.3	95.2	24,302
6期(2022年1月25日)	13,731	8.6	4,220.06	8.6	1.0	99.0	28,802
7期(2023年1月25日)	13,915	1.3	4,275.54	1.3	1.2	98.8	34,137

(注) 不動産投資指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 東証REIT指数(配当込み)は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数 (配当込み) (ベンチマーク)		不動産投資 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2022年1月25日	円	%		%	%	%
	13,731	—	4,220.06	—	1.0	99.0
1月末	14,225	3.6	4,372.24	3.6	1.2	98.6
2月末	13,808	0.6	4,243.65	0.6	1.4	98.5
3月末	14,762	7.5	4,536.64	7.5	1.6	98.6
4月末	14,588	6.2	4,483.12	6.2	1.6	98.3
5月末	14,848	8.1	4,563.32	8.1	1.5	98.3
6月末	14,603	6.4	4,487.40	6.3	1.0	97.5
7月末	15,062	9.7	4,628.79	9.7	1.1	98.7
8月末	15,240	11.0	4,683.62	11.0	1.4	89.2
9月末	14,607	6.4	4,488.86	6.4	1.9	97.9
10月末	14,855	8.2	4,564.72	8.2	1.7	98.2
11月末	14,856	8.2	4,565.38	8.2	1.4	98.4
12月末	14,331	4.4	4,403.82	4.4	1.1	98.7
(期末) 2023年1月25日	円	%		%	%	%
	13,915	1.3	4,275.54	1.3	1.2	98.8

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 不動産投資指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2022年1月26日～2023年1月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内リート市況

国内のリート市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、主要国中央銀行（日本除く）による金融政策正常化への加速を背景に金利上昇への警戒感が高まるなか、日銀による金融緩和策継続や経済正常化進展が支えとなり上昇しました。期後半は、日銀が長期金利の変動許容幅を0.25%から0.50%へ拡大し、資金調達環境の悪化が嫌気され、国内リート市場は上昇幅を縮小しました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値(用途別の比率など)をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+1.3%となり、ベンチマークの+1.3%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

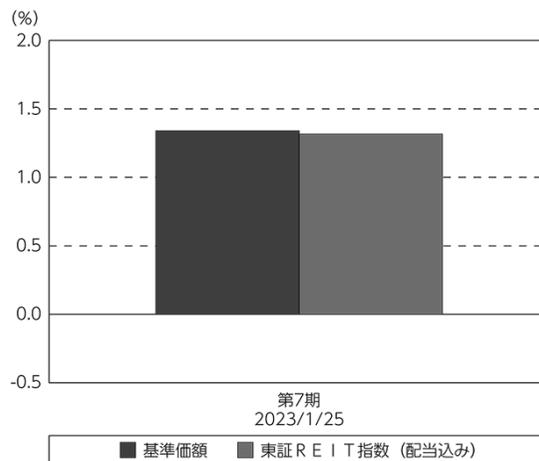
(マイナス要因)

- ・コスト負担（リート等に係る売買費用）が生じたこと

(その他の要因)

- ・リートの取引価格と評価に用いる価格が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主として東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 1 月26日～2023年 1 月25日)

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)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、14,648円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年1月26日～2023年1月25日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	口	千円	口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	515	62,905	403	49,971
サンケイリアルエステート投資法人	811	78,387	631	62,253
S O S i L A物流リート投資法人	1,276	188,069	925	140,675
東海道リート投資法人	377	46,067	190	22,647
日本アコモデーションファンド投資法人	870	570,331	688	455,749
森ヒルズリート投資法人	2,963	456,692	2,341	354,972
産業ファンド投資法人	3,873	677,757	2,877	515,600
アドバンス・レジデンス投資法人	2,516	890,184	1,987	703,283
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,942	414,003	1,416	304,388
アクティブア・プロパティーズ投資法人	1,331	554,346	1,066	443,255
GLP投資法人	8,424	1,370,429	6,748	1,135,879
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,214	394,203	927	307,201
日本プロロジスリート投資法人	4,280	1,430,508	3,253	1,111,754
星野リゾート・リート投資法人	455	303,513	342	224,450
O n e リート投資法人	436	115,775	341	92,813
イオンリート投資法人	2,864	441,235	2,468	376,459
ヒューリックリート投資法人	2,352	384,596	1,849	300,296
日本リート投資法人	843	308,341	627	232,241
積水ハウス・リート投資法人	7,627	608,753	6,122	491,547
トーセイ・リート投資法人	577	78,091	424	57,053
ケネディクス商業リート投資法人	1,134	309,009	807	223,397
ヘルスケア&メディカル投資法人	708	118,602	486	81,065
サムティ・レジデンシャル投資法人	708	89,235	479	61,366
野村不動産マスターファンド投資法人	8,142	1,348,393	6,432	1,064,139
いちごホテルリート投資法人	420	41,095	333	30,966
ラサールロジポート投資法人	3,083	521,412	2,436	419,417
スターアジア不動産投資法人	3,462	200,656	2,211	129,808
マリモ地方創生リート投資法人	417	55,442	238	31,578
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,055	549,174	782	413,402
大江戸温泉リート投資法人	404	27,082	319	21,576
投資法人みらい	3,055	149,286	2,403	119,845
森トラスト・ホテルリート投資法人	590	77,082	466	59,591
三菱地所物流リート投資法人	1,019	459,211	592	274,462
C R E ロジスティクスファンド投資法人	977	194,702	772	155,263
ザイマックス・リート投資法人	451	55,877	318	39,793
タカラレーベン不動産投資法人	1,149	125,473	797	89,991
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,135	170,130	778	119,946
日本ビルファンド投資法人	2,939	1,948,029	2,320	1,581,282
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,518	1,562,370	1,990	1,256,709

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内		口	千円	口	千円
	日本都市ファンド投資法人	12,702	1,344,350	10,034	1,057,015
	オリックス不動産投資法人	5,017	930,449	3,964	728,120
	日本プライムリアルティ投資法人	1,725	681,210	1,361	544,553
	NTT都市開発リート投資法人	2,418	352,701	1,902	281,976
	東急リアル・エステート投資法人	1,687	333,575	1,332	256,793
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,894	205,013	1,391	151,785
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,658	826,342	4,515	649,365
	森トラスト総合リート投資法人	1,800	258,520	1,422	201,836
	インヴィンシブル投資法人	11,083	485,874	8,755	362,226
	フロンティア不動産投資法人	965	507,019	712	372,229
	平和不動産リート投資法人	1,795	267,537	1,336	198,431
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,752	558,606	1,338	426,044
	福岡リート投資法人	1,300	219,032	1,026	170,976
	ケネディクス・オフィス投資法人	934 (797)	515,140 (-)	675	449,914
	いちごオフィスリート投資法人	2,064	175,917	1,631	138,287
	大和証券オフィス投資法人	530	361,483	432	299,602
	阪急阪神リート投資法人	1,141	172,560	902	135,977
	スタートアッププロシード投資法人	451	109,902	311	75,934
	大和ハウスリート投資法人	3,790	1,170,807	2,977	933,733
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,355	582,282	6,207	411,858	
大和証券リビング投資法人	3,483	410,644	2,656	312,878	
ジャパンエクセレント投資法人	2,311	296,142	1,855	236,065	
合 計	151,767 (797)	28,141,580 (-)	117,318	21,951,709	

(注) 金額は受け渡し代金。

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

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 2,273	百万円 5,970	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月26日～2023年1月25日)

該当事項はございません。

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1月26日～2023年1月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年1月25日現在)

国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	553	665		80,864	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	869	1,049		93,780	0.3
S O S i L A物流リート投資法人	1,277	1,628		213,756	0.6
東海道リート投資法人	210	397		47,640	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人	948	1,130		654,270	1.9
森ヒルズリート投資法人	3,227	3,849		582,353	1.7
産業ファンド投資法人	3,896	4,892		721,080	2.1
アドバンス・レジデンス投資法人	2,744	3,273		1,068,634	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,875	2,401		476,358	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,463	1,728		675,648	2.0
G L P投資法人	8,889	10,565		1,523,473	4.5
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,236	1,523		448,371	1.3
日本プロロジスリート投資法人	4,491	5,518		1,614,015	4.7
星野リゾート・リート投資法人	460	573		429,750	1.3
O n e リート投資法人	476	571		140,694	0.4
イオンリート投資法人	3,228	3,624		533,452	1.6
ヒューリックリート投資法人	2,560	3,063		472,927	1.4
日本リート投資法人	847	1,063		353,979	1.0
積水ハウス・リート投資法人	8,331	9,836		702,290	2.1
トーセイ・リート投資法人	573	726		94,888	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	1,096	1,423		350,769	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人	585	807		135,011	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人	622	851		94,631	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	8,876	10,586		1,621,775	4.8
いちごホテルリート投資法人	455	542		62,004	0.2
ラサールロジポート投資法人	3,360	4,007		627,496	1.8
スターアジア不動産投資法人	2,836	4,087		222,741	0.7
マリモ地方創生リート投資法人	321	500		62,950	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,020	1,293		581,203	1.7
大江戸温泉リート投資法人	443	528		32,683	0.1
投資法人みらい	3,325	3,977		175,783	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	644	768		104,064	0.3
三菱地所物流リート投資法人	698	1,125		453,937	1.3
C R Eロジスティクスファンド投資法人	1,063	1,268		228,493	0.7
ザイマックス・リート投資法人	398	531		62,286	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	1,082	1,434		140,962	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,070	1,427		198,923	0.6
日本ビルファンド投資法人	3,200	3,819		2,161,554	6.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,745	3,273		1,832,880	5.4
日本都市ファンド投資法人	13,848	16,516		1,653,251	4.8
オリックス不動産投資法人	5,469	6,522		1,167,438	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	1,875	2,239		800,442	2.3

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
NTT都市開発リート投資法人	2,631	3,147	426,103	1.2
東急リアル・エステート投資法人	1,840	2,195	438,780	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	1,906	2,409	259,449	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,179	7,322	1,096,835	3.2
森トラスト総合リート投資法人	1,962	2,340	342,108	1.0
インヴィンシブル投資法人	12,080	14,408	806,848	2.4
フロンティア不動産投資法人	962	1,215	611,145	1.8
平和不動産リート投資法人	1,778	2,237	341,813	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,793	2,207	664,307	1.9
福岡リート投資法人	1,419	1,693	281,038	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	849	1,905	595,312	1.7
いちごオフィスリート投資法人	2,249	2,682	227,701	0.7
大和証券オフィス投資法人	580	678	424,428	1.2
阪急阪神リート投資法人	1,240	1,479	214,159	0.6
スターツプロシード投資法人	427	567	128,028	0.4
大和ハウスリート投資法人	4,121	4,934	1,382,013	4.0
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,408	10,556	904,649	2.6
大和証券リビング投資法人	3,709	4,536	494,424	1.4
ジャパンエクセレント投資法人	2,547	3,003	378,378	1.1
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	159,864 61	195,110 61	33,717,034 < 98.8% >

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	不動産投信指数先物取引	東証REIT指数	百万円 403	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2023年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	33,717,034	98.0
コール・ローン等、その他	681,693	2.0
投資信託財産総額	34,398,727	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2022年1月26日～2023年1月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	34,397,941,470
コール・ローン等	290,911,316
投資証券(評価額)	33,717,034,200
未収入金	165,432,300
未収配当金	184,270,054
差入委託証拠金	40,293,600
(B) 負債	259,990,809
未払金	167,173,320
未払解約金	92,816,700
未払利息	789
(C) 純資産総額(A-B)	34,137,950,661
元本	24,532,566,630
次期繰越損益金	9,605,384,031
(D) 受益権総口数	24,532,566,630口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,915円

(注) 当ファンドの期首元本額は20,977,046,765円、期中追加設定元本額は20,000,393,005円、期中一部解約元本額は16,444,873,140円です。

(注) 2023年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内リートインデックスオープン	5,146,039,694円
・FWりそな国内リートインデックスファンド	4,464,840,281円
・J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,906,079,484円
・Smart-i Jリートインデックス	3,074,460,441円
・つみたてバランスファンド	2,019,538,183円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,305,154,145円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	1,158,752,348円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	1,128,301,118円
・りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	465,486,739円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	261,246,958円
・りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	230,367,106円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	198,734,904円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	165,518,647円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	164,774,822円
・J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	139,252,159円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	110,680,427円
・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	108,803,359円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	90,837,886円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	55,050,420円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	52,520,126円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	43,420,142円
・九州SDGs・グローバルバランス	43,301,546円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	37,218,471円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	36,339,007円
・DCりそな グローバルバランス	27,721,856円
・ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	21,425,915円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	19,897,581円
・ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	17,678,323円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	13,013,498円
・りそなFT マルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	12,761,994円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	8,610,911円
・ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	2,383,554円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	2,259,638円
・りそな つみたてラップ型ファンド(成長型)	39,772円
・りそな つみたてラップ型ファンド(安定成長型)	22,141円
・りそな つみたてラップ型ファンド(安定型)	21,787円
・りそな つみたてリスクコントロールファンド	11,247円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3915円です。

○損益の状況 (2022年1月26日～2023年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,123,631,185
受取配当金	1,123,957,949
その他収益金	36
支払利息	△ 326,800
(B) 有価証券売買損益	△ 983,032,870
売買益	1,675,125,786
売買損	△2,658,158,656
(C) 先物取引等取引損益	6,006,930
取引益	44,912,130
取引損	△ 38,905,200
(D) 保管費用等	△ 9,435
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	146,595,810
(F) 前期繰越損益金	7,825,776,146
(G) 追加信託差損益金	9,292,319,527
(H) 解約差損益金	△7,659,307,452
(I) 計(E+F+G+H)	9,605,384,031
次期繰越損益金(I)	9,605,384,031

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。