

りそなＪリートインデックス (年４回決算型)

運用報告書（全体版）

第４期（決算日 2024年８月26日） 第５期（決算日 2024年11月25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Ｊリートインデックス（年４回決算型）」は、2024年11月25日に第５期の決算を行いましたので、第４期から第５期の運用状況ならびに決算をまとめてご報告申し上げます。
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	2023年９月11日から無期限です。	
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Ｊリートインデックス（年４回決算型）	・ 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Ｊリートインデックス（年４回決算型）	・ 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。	

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

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

＜運用報告書に関するお問い合わせ先＞

フリーダイヤル：0120-223351

（委託会社の営業日の午前９時～午後５時）

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

【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 (分配落)	税 込 金 期 騰 落 中 率			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	純 資 産 額
		分 配	騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円		円	%		%	%	%	百万円
2023年 9 月 11 日	10,000	—	—	—	4,565.71	—	—	—	1
1 期 (2023 年 11 月 27 日)	9,692		10	△3.0	4,428.27	△3.0	1.3	98.4	2
2 期 (2024 年 2 月 26 日)	9,151		30	△5.3	4,199.08	△5.2	1.8	97.9	27
3 期 (2024 年 5 月 27 日)	9,373		40	2.9	4,324.51	3.0	1.4	98.5	160
4 期 (2024 年 8 月 26 日)	9,434		90	1.6	4,399.56	1.7	1.8	98.0	165
5 期 (2024 年 11 月 25 日)	8,967		90	△4.0	4,228.52	△3.9	1.5	98.1	163

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(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 R E I T 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 (R E I T) 全銘柄を対象として算出した東証 R E I T 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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

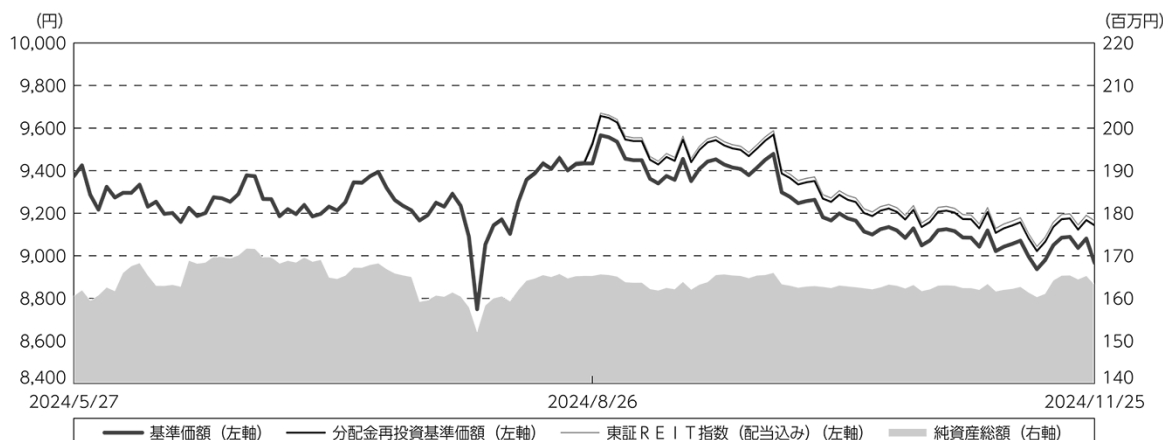
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		東 証 Ｒ Ｅ Ｉ Ｔ 指 数 （ 配 当 込 み ）		不 動 産 投 信 指 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落 率	（ベンチマーク）	騰 落 率		
第 4 期	（期 首） 2024年 5 月27日	円 9,373	% －	4,324.51	% －	% 1.4	% 98.5
	5 月末	9,324	△0.5	4,302.09	△0.5	1.3	98.5
	6 月末	9,266	△1.1	4,277.59	△1.1	1.1	98.6
	7 月末	9,291	△0.9	4,290.75	△0.8	1.3	98.5
	（期 末） 2024年 8 月26日	9,524	1.6	4,399.56	1.7	1.8	98.0
第 5 期	（期 首） 2024年 8 月26日	9,434	－	4,399.56	－	1.8	98.0
	8 月末	9,456	0.2	4,411.38	0.3	1.8	98.0
	9 月末	9,298	△1.4	4,339.32	△1.4	1.6	98.1
	10月末	9,086	△3.7	4,241.80	△3.6	1.5	98.2
	（期 末） 2024年11月25日	9,057	△4.0	4,228.52	△3.9	1.5	98.1

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
（注）当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「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合わせるので、「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

（2024年５月28日～2024年11月25日）

作成期間中の基準価額等の推移



第４期首：9,373円

第５期末：8,967円（既払分配金（税引前）：180円）

騰落率：△2.4%（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、作成期首（2024年５月27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。
- （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

国内リート市場は、前作成期末と比較して下落しました。作成期前半は、日銀が追加利上げに前向きな姿勢を示したことなどから、国内長期金利は下げ渋り、国内リート市場は上値の重い展開となりました。その後は、国内外の株式市場の不安定化の影響を受け、国内リート市場も上下する場面がみられました。作成期末にかけては、日銀の利上げ観測を背景に国内の長期金利が再び上昇し、上値の重い展開となりました。

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み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

当作成期の基準価額の騰落率は－2.4％となり、ベンチマークの－2.2％を0.2％下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

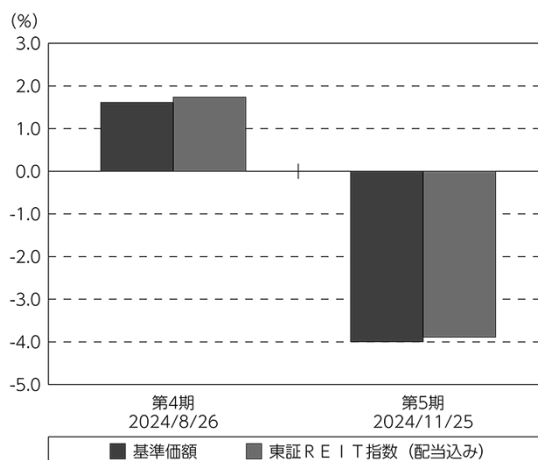
（マイナス要因）

- ・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

当作成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、次表のとお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４期	第５期
	2024年５月28日～ 2024年８月26日	2024年８月27日～ 2024年11月25日
当期分配金	90	90
（対基準価額比率）	0.945%	0.994%
当期の収益	90	90
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	71	78

（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み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

(2024年 5 月 28 日～2024年11月25日)

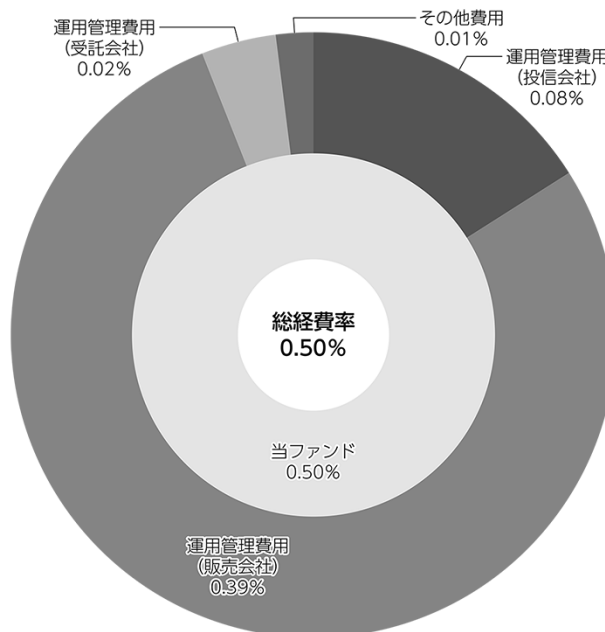
項 目	第 4 期～第 5 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 23	% 0. 244	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(4)	(0. 041)	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販 売 会 社)	(18)	(0. 192)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0. 000	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 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. 000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0. 003	(c)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	23	0. 247	
作成期間の平均基準価額は、9, 286円です。			

- (注) 作成期間の費用（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）を作成期間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

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.50%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 (2024年 5 月28日～2024年11月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第 4 期～第 5 期			
	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	18,758	26,089	14,402	20,094

○利害関係人との取引状況等 (2024年 5 月28日～2024年11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 (2024年 5 月28日～2024年11月25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 (2024年 5 月28日～2024年11月25日)

当作成期首残高 (元本)	当作成期設定 元本	当作成期解約 元本	当作成期末残高 (元本)	取 引 理 由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2024年11月25日現在)

親投資信託残高

銘柄	第3期末	第5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	113,716	118,072	162,715

○投資信託財産の構成

(2024年11月25日現在)

項目	第5期末	
	評価額	比率
	千円	%
RM国内リートマザーファンド	162,715	98.6
コール・ローン等、その他	2,286	1.4
投資信託財産総額	165,001	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

(2024年5月28日～2024年11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

項 目	第４期末	第５期末
	2024年８月26日現在	2024年11月25日現在
	円	円
(A) 資産	167,034,920	165,001,485
コール・ローン等	435,874	435,947
RM国内リートマザーファンド(評価額)	164,999,045	162,715,537
未収入金	1,600,000	1,850,000
未収利息	1	1
(B) 負債	1,780,437	1,842,291
未払収益分配金	1,576,555	1,637,619
未払信託報酬	201,168	199,279
その他未払費用	2,714	5,393
(C) 純資産総額(A－B)	165,254,483	163,159,194
元本	175,172,782	181,957,777
次期繰越損益金	△ 9,918,299	△ 18,798,583
(D) 受益権総口数	175,172,782口	181,957,777口
1万口当たり基準価額(C／D)	9,434円	8,967円

(注) 当ファンドの第４期首元本額は171,254,911円、第４～５期中追加設定元本額は31,037,791円、第４～５期中一部解約元本額は20,334,925円です。

(注) 第５期末の１口当たり純資産額は0.8967円です。

(注) 2024年11月25日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は18,798,583円です。

○損益の状況

項 目	第 4 期	第 5 期
	2024年 5 月 28 日～ 2024年 8 月 26 日	2024年 8 月 27 日～ 2024年11月25日
	円	円
(A) 配当等収益	26	70
受取利息	26	70
(B) 有価証券売買損益	3,152,747	△ 6,453,378
売買益	3,377,816	817
売買損	△ 225,069	△ 6,454,195
(C) 信託報酬等	△ 203,882	△ 201,958
(D) 当期損益金 (A + B + C)	2,948,891	△ 6,655,266
(E) 前期繰越損益金	△ 457,531	895,165
(F) 追加信託差損益金	△10,833,104	△11,400,863
(配当等相当額)	(267,880)	(398,638)
(売買損益相当額)	(△11,100,984)	(△11,799,501)
(G) 計 (D + E + F)	△ 8,341,744	△17,160,964
(H) 収益分配金	△ 1,576,555	△ 1,637,619
次期繰越損益金 (G + H)	△ 9,918,299	△18,798,583
追加信託差損益金	△10,833,104	△11,400,863
(配当等相当額)	(330,751)	(408,331)
(売買損益相当額)	(△11,163,855)	(△11,809,194)
分配準備積立金	914,805	1,013,437
繰越損益金	—	△ 8,411,157

- (注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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) 第4期計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,691,153円）、費用控除後の有価証券等損益額（791,695円）、信託約款に規定する収益調整金（330,751円）および分配準備積立金（8,512円）より分配対象収益は2,822,111円（1万口当たり161円）であり、うち1,576,555円（1万口当たり90円）を分配金額としております。
- (注) 第5期計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,755,891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（408,331円）および分配準備積立金（895,165円）より分配対象収益は3,059,387円（1万口当たり168円）であり、うち1,637,619円（1万口当たり90円）を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

	第 4 期	第 5 期
1 万口当たり分配金（税込み）	90円	90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8期（決算日 2024年1月25日）
（2023年1月26日～2024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、通常の状態では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 R E I T 指 数 (配 当 込 み)		不 動 産 投 信 指 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
8 期(2024年 1 月25日)	14, 277	2. 6	4, 381. 61	2. 5	1. 3	98. 6	50, 484

(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) 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。

○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)		不 動 産 投 信 指 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落	率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2023年 1 月25日	円	%		%	%	%
	13, 915	—	4, 275. 54	—	1. 2	98. 8
1 月末	13, 875	△0. 3	4, 263. 06	△0. 3	1. 3	98. 6
2 月末	14, 093	1. 3	4, 331. 37	1. 3	1. 7	98. 0
3 月末	13, 683	△1. 7	4, 204. 73	△1. 7	1. 6	98. 4
4 月末	14, 384	3. 4	4, 420. 34	3. 4	1. 7	98. 2
5 月末	14, 477	4. 0	4, 448. 91	4. 1	1. 2	98. 7
6 月末	14, 386	3. 4	4, 421. 28	3. 4	1. 1	98. 8
7 月末	14, 555	4. 6	4, 472. 88	4. 6	1. 2	98. 8
8 月末	14, 770	6. 1	4, 539. 20	6. 2	1. 6	98. 3
9 月末	14, 539	4. 5	4, 468. 30	4. 5	1. 7	98. 3
10月末	14, 239	2. 3	4, 372. 14	2. 3	1. 6	98. 3
11月末	14, 515	4. 3	4, 455. 46	4. 2	1. 2	98. 8
12月末	14, 279	2. 6	4, 382. 85	2. 5	1. 1	98. 8
(期 末) 2024年 1 月25日	14, 277	2. 6	4, 381. 61	2. 5	1. 3	98. 6

(注) 騰落率は期首比です。

(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

(2023年1月26日～2024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）による金融引き締めや国内金利の上昇が嫌気され、相場が不安定化する場面がみられました。その後は、国内株式などリスク性資産の底堅い推移が相場を下支えするなか、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）の政策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る展開となりました。

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+2.6%となり、ベンチマークの+2.5%を0.1%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

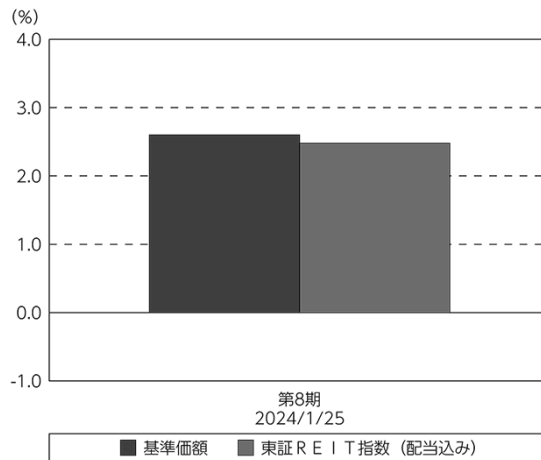
(マイナス要因)

- ・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

(2023年 1 月26日～2024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、14,316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

(2023年1月26日～2024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
国内		口	千円	口	千円
	エスコンジャパンリート投資法人	634	73,390	316	35,696
	サンケイリアルエステート投資法人	997	88,012	497	43,009
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,555	198,495	771	99,690
	東海道リート投資法人	642	78,439	320	38,246
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,074	669,720	534	330,770
	森ヒルズリート投資法人	3,658	533,426	1,821	269,498
	産業ファンド投資法人	4,838	703,704	2,353	343,134
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,203	1,065,887	1,732	574,739
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,579 (△ 2,926)	338,014 (△ 602,361)	1,054	226,258
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,636	648,369	827	329,270
	G L P 投資法人	10,860	1,545,326	5,092	727,952
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,603	522,254	748	241,738
	日本プロロジスリート投資法人	5,553	1,597,266	2,648	771,814
	星野リゾート・リート投資法人	595	377,412	276	185,431
	O n e リート投資法人	542	134,919	270	66,008
	イオンリート投資法人	4,134	611,390	1,827	270,243
	ヒューリックリート投資法人	2,909	450,642	1,448	224,772
	日本リート投資法人	1,007	337,266	499	166,814
	積水ハウス・リート投資法人	9,343	733,263	4,650	358,555
	トーセイ・リート投資法人	677	90,540	385	52,192
	ケネディクス商業リート投資法人	932 (△ 1,733)	242,681 (△ 439,136)	622	161,342
	ヘルスケア&メディカル投資法人	767	117,908	382	60,127
	サムティ・レジデンシャル投資法人	876	99,489	410	46,352
	野村不動産マスターファンド投資法人	10,055	1,608,786	5,005	794,167
	いちごホテルリート投資法人	517	54,967	258	28,609
	ラサールロジポート投資法人	4,101	631,059	1,927	293,264
	スターアジア不動産投資法人	5,477	310,267	2,112	119,338
	マリモ地方創生リート投資法人	486	61,581	241	30,328
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,341	642,544	623	296,568
	大江戸温泉リート投資法人	489	31,705	278	18,062
	投資法人みらい	4,587	207,460	1,929	88,855
	森トラスト・ホテルリート投資法人	18 (△ 783)	2,328 (△ 105,986)	3	406
	三菱地所物流リート投資法人	1,080	427,878	535	209,822
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,337	231,034	524	90,505
	ザイマックス・リート投資法人	505	57,542	252	28,442
	タカラレーベン不動産投資法人	1,589	151,021	730	68,190

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,368	179,676	676	88,931
	日本ビルファンド投資法人	3,623	2,121,429	1,801	1,044,422
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,266	1,815,095	1,572	881,421
	日本都市ファンド投資法人	15,363	1,504,675	8,703	850,591
	オリックス不動産投資法人	6,195	1,071,996	3,083	540,305
	日本ブライムリアルティ投資法人	2,126	748,933	1,058	377,398
	N T T都市開発リート投資法人	3,244	423,848	1,489	201,082
	東急リアル・エステート投資法人	2,086	380,309	1,039	191,035
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,304	254,768	1,143	125,406
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,955	1,024,810	3,461	517,098
	森トラストリート投資法人	6,044 (3,844)	438,878 (105,986)	2,908	208,760
	インヴィンシブル投資法人	16,086	909,884	7,083	407,823
	フロンティア不動産投資法人	1,156	538,012	577	273,653
	平和不動産リート投資法人	2,473	361,476	1,097	165,212
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,052	613,097	1,162	347,146
	福岡リート投資法人	1,603	262,874	795	130,142
	K D X不動産投資法人	3,998 (9,168)	850,902 (1,041,497)	1,157	323,455
	いちごオフィスリート投資法人	2,548	225,977	1,268	116,978
	大和証券オフィス投資法人	643	404,447	319	202,412
	阪急阪神リート投資法人	1,543	219,478	717	101,970
	スタートアップシード投資法人	540	118,102	269	60,248
	大和ハウスリート投資法人	4,690	1,287,763	2,336	633,279
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,666	774,390	5,036	378,099
	大和証券リビング投資法人	4,745	524,709	2,161	239,849
	ジャパンエクセレント投資法人	2,787	347,820	1,588	198,916
	合 計	199,300 (7,570)	33,079,363 (-)	96,397	16,295,869

(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 3,048	百万円 15,109	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月26日～2024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 (2023年1月26日～2024年1月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024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	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	665	983	119,237	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	1,049	1,549	141,423	0.3
S O S i L A物流リート投資法人	1,628	2,412	287,751	0.6
東海道リート投資法人	397	719	92,032	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	1,130	1,670	1,017,030	2.0
森ヒルズリート投資法人	3,849	5,686	793,197	1.6
産業ファンド投資法人	4,892	7,377	1,023,927	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人	3,273	4,744	1,558,404	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,401	—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,728	2,537	1,035,096	2.1
G L P投資法人	10,565	16,333	2,182,088	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,523	2,378	752,637	1.5
日本プロロジスリート投資法人	5,518	8,423	2,292,740	4.5
星野リゾート・リート投資法人	573	892	469,192	0.9
O n e リート投資法人	571	843	228,200	0.5
イオンリート投資法人	3,624	5,931	839,236	1.7
ヒューリックリート投資法人	3,063	4,524	708,458	1.4
日本リート投資法人	1,063	1,571	536,496	1.1
積水ハウス・リート投資法人	9,836	14,529	1,133,262	2.2
トーセイ・リート投資法人	726	1,018	142,520	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	1,423	—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人	807	1,192	162,588	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	851	1,317	145,923	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	10,586	15,636	2,501,760	5.0
いちごホテルリート投資法人	542	801	96,360	0.2
ラサールロジポート投資法人	4,007	6,181	922,205	1.8
スターアジア不動産投資法人	4,087	7,452	444,884	0.9
マリモ地方創生リート投資法人	500	745	92,529	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,293	2,011	929,082	1.8
大江戸温泉リート投資法人	528	739	54,759	0.1
投資法人みらい	3,977	6,635	299,570	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人	768	—	—	—
三菱地所物流リート投資法人	1,125	1,670	627,920	1.2
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,268	2,081	318,184	0.6
ザイマックス・リート投資法人	531	784	93,688	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	1,434	2,293	238,930	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,427	2,119	269,748	0.5
日本ビルファンド投資法人	3,819	5,641	3,333,831	6.6
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,273	4,967	2,791,454	5.5
日本都市ファンド投資法人	16,516	23,176	2,315,282	4.6
オリックス不動産投資法人	6,522	9,634	1,628,146	3.2
日本プライムリアルティ投資法人	2,239	3,307	1,162,410	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	%
N T T都市開発リート投資法人		3, 147	4, 902	618, 142	1. 2
東急リアル・エステート投資法人		2, 195	3, 242	573, 509	1. 1
グローバル・ワン不動産投資法人		2, 409	3, 570	391, 272	0. 8
ユナイテッド・アーバン投資法人		7, 322	10, 816	1, 623, 481	3. 2
森トラストリート投資法人		2, 340	9, 320	689, 680	1. 4
インヴィンシブル投資法人		14, 408	23, 411	1, 430, 412	2. 8
フロンティア不動産投資法人		1, 215	1, 794	787, 566	1. 6
平和不動産リート投資法人		2, 237	3, 613	496, 787	1. 0
日本ロジスティクスファンド投資法人		2, 207	3, 097	873, 044	1. 7
福岡リート投資法人		1, 693	2, 501	430, 422	0. 9
K D X不動産投資法人		1, 905	13, 914	2, 277, 721	4. 5
いちごオフィスリート投資法人		2, 682	3, 962	325, 280	0. 6
大和証券オフィス投資法人		678	1, 002	619, 236	1. 2
阪急阪神リート投資法人		1, 479	2, 305	330, 998	0. 7
スターツプロシード投資法人		567	838	169, 359	0. 3
大和ハウスリート投資法人		4, 934	7, 288	1, 848, 965	3. 7
ジャパン・ホテル・リート投資法人		10, 556	16, 186	1, 218, 805	2. 4
大和証券リビング投資法人		4, 536	7, 120	758, 992	1. 5
ジャパンエクセレント投資法人		3, 003	4, 202	510, 543	1. 0
合 計	口 数 ・ 金 額	195, 110	305, 583	49, 756, 411	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	58	< 98. 6% >	

(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 R E I T 指数	百万円 百万円
			648 ー

○投資信託財産の構成

(2024年 1 月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	49,756,411	96.3
コール・ローン等、その他	1,897,966	3.7
投資信託財産総額	51,654,377	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

(2023年 1 月26日～2024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 (2024年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,653,033,623
コール・ローン等	1,508,818,921
投資証券(評価額)	49,756,411,050
未収入金	1,977,200
未収配当金	352,332,338
差入委託証拠金	33,494,114
(B) 負債	1,168,558,122
未払金	380,430
未払解約金	1,168,173,600
未払利息	4,092
(C) 純資産総額(A－B)	50,484,475,501
元本	35,360,404,912
次期繰越損益金	15,124,070,589
(D) 受益権総口数	35,360,404,912口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,277円

(注) 当ファンドの期首元本額は24,532,566,630円、期中追加設定元本額は24,224,409,175円、期中一部解約元本額は13,396,570,893円です。

(注) 2024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	8,280,182,868円
・FWりそな国内リートインデックスファンド	7,587,604,403円
・Smart-i Jリートインデックス	3,279,141,464円
・J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,969,850,664円
・つみたてバランスファンド	2,948,671,698円
・りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	2,630,988,762円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	1,790,814,999円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,277,042,223円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	828,798,328円
・りそなFT グローバルリートファンド202307(適格機関投資家専用)	489,477,796円
・りそなDAAファンド202205(適格機関投資家専用)	402,895,432円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	370,574,947円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	310,531,575円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	263,823,648円
・りそなマルチアセットファンド202310(適格機関投資家専用)	250,869,839円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	238,216,315円
・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	192,358,703円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	166,333,907円
・J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	133,840,674円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	131,268,307円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	87,270,876円
・ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	84,590,123円
・ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	83,806,666円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	79,218,671円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	78,601,072円

○損益の状況 (2023年1月26日～2024年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,739,778,625
受取配当金	1,740,188,601
その他収益金	1
支払利息	△ 409,977
(B) 有価証券売買損益	△ 744,065,820
売買益	949,975,900
売買損	△ 1,694,041,720
(C) 先物取引等取引損益	6,552,470
取引益	41,701,660
取引損	△ 35,149,190
(D) 保管費用等	△ 24,049
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,002,241,226
(F) 前期繰越損益金	9,605,384,031
(G) 追加信託差損益金	10,161,690,589
(H) 解約差損益金	△ 5,645,245,257
(I) 計(E+F+G+H)	15,124,070,589
次期繰越損益金(I)	15,124,070,589

(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。

・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	59,580,643円
・九州SDGs・グローバルバランス	54,989,214円
・りそな つみたてラップ型ファンド（成長型）	53,031,452円
・りそな つみたてラップ型ファンド（安定成長型）	49,718,283円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	34,076,321円
・DCりそな グローバルバランス	30,717,803円
・りそな つみたてラップ型ファンド（安定型）	27,999,320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）	24,692,670円
・りそなDAAファンドII（適格機関投資家専用）	17,894,606円
・りそなマルチアセットファンド（適格機関投資家専用）	12,060,625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）	10,834,218円
・りそな つみたてリスクコントロールファンド	8,277,781円
・ラップ型ファンド・プラスESG（安定型）	6,016,932円
・りそなJリートインデックス（年4回決算型）	5,494,953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）	2,715,554円
・ターゲットリターンバランスファンド（目標6%）	2,130,460円
・ターゲットリターンバランスファンド（目標4%）	1,216,530円
・りそなJリートインデックス（年1回決算型）	671,068円
・ターゲットリターンバランスファンド（目標5%）	642,062円
・ターゲットリターンバランスファンド（目標2%）	415,903円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2065	235,839円
・ターゲットリターンバランスファンド（目標3%）	190,669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）	28,046円

（注）当期末の1口当たり純資産額は1,4277円です。

〇お知らせ

該当事項はございません。