

弊社ファンドの12月20日の基準価額の下落について

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

2022年12月20日、弊社ファンドの一部において、基準価額が前営業日比5%以上下落しました。該当ファンドおよび基準価額の下落要因について以下の通りご報告させていただきます。

1. 基準価額が前営業日比で5%以上下落した公募投資信託

ファンド名	基準価額	前営業日比	騰落率
りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	9,248円	-517円	-5.29%
J-REITリサーチ・アクティブファンド	9,402円	-541円	-5.44%
FWりそな国内リートインデックスオープン	12,144円	-680円	-5.30%
FWりそな国内リートインデックスファンド	12,141円	-680円	-5.30%
Smart-i Jリートインデックス	13,110円	-733円	-5.30%

※ 前営業日比はファンドの収益分配金(課税前)のお支払いを含めた表示となっておりますが、騰落率については収益分配金(課税前)を再投資したものとして計算した数値を用いて算出しています。

2. 基準価額の下落要因

12月20日の金融市場では、日銀の金融政策決定会合にて長短金利操作(イールドカーブコントロール)運用の一部見直しなど、金融政策の修正方針が決定されました。今回の決定について、市場では日銀による金融緩和政策の転換と見る向きが強まり、長期金利の指標となる10年国債金利の上昇や国内株式・リート市場の大幅下落につながりました。

3. 世界の主要市場の動き

参考指数・参考レート	前日終値	基準日	直近終値	基準日	前日比	騰落率
日経平均株価	27,237.64	12月19日	26,568.03	12月20日	-669.61	-2.46%
TOPIX(東証株価指数)	1,935.41	12月19日	1,905.59	12月20日	-29.82	-1.54%
ダウ工業株30種平均	32,920.46	12月16日	32,757.54	12月19日	-162.92	-0.49%
S&P500種指数	3,852.36	12月16日	3,817.66	12月19日	-34.70	-0.90%
米ドル(対円)	136.22	12月19日	134.54	12月20日	-1.68	-1.23%
ユーロ(対円)	144.35	12月19日	142.64	12月20日	-1.71	-1.18%

出所:ブルームバーグのデータをもとにリそなアセットマネジメントが作成。

<当資料についての留意事項>

- 当資料は、情報提供を目的として、リそなアセットマネジメント株式会社が作成したものです。
- 当資料は、投資勧誘に使用することを想定して作成したものではありません。
- 当資料は、当社が信頼できると判断した情報をもとに作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。
- 運用実績および市場環境の分析等の記載内容は過去の実績および将来の予測であり、将来の運用成果および市場環境等を示唆・保証するものではありません。また、将来の市場環境の変動等により、運用方針が変更される場合があります。
- 当資料に指数・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権、その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- 当資料の記載内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

商号等:リそなアセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2858号
加入協会:一般社団法人投資信託協会
一般社団法人日本投資顧問業協会