

野村世界REITインデックス (野村SMA・EW向け)

運用報告書(全体版)

第6期(決算日2020年12月7日)

作成対象期間(2019年12月7日～2020年12月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等につい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/内外/不動産投信/インデックス型 | |
| 信託期間 | 2015年4月1日以降、無期限とします。 | |
| 運用方針 | 世界REITインデックス マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として世界各国のREIT(不動産投資信託証券)に実質的に投資し、S&P先進国REIT指数(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。 実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 主な投資対象 | 野村世界REITインデックス(野村SMA・EW向け) | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | マザーファンド | 世界各国のREITを主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村世界REITインデックス(野村SMA・EW向け) | 投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。 | |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|---------|--------|--------------|-------|
| | | 税込 分配 金 | 期中 騰落 率 | 期 騰落 | 中 率 | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 2期(2016年12月6日) | 9,348 | 0 | △4.7 | 94.67 | △4.0 | 99.5 | 1,356 |
| 3期(2017年12月6日) | 10,168 | 5 | 8.8 | 103.95 | 9.8 | 99.2 | 1,663 |
| 4期(2018年12月6日) | 10,402 | 5 | 2.4 | 107.35 | 3.3 | 99.3 | 1,665 |
| 5期(2019年12月6日) | 11,705 | 5 | 12.6 | 121.75 | 13.4 | 99.3 | 2,034 |
| 6期(2020年12月7日) | 10,179 | 5 | △13.0 | 107.00 | △12.1 | 99.2 | 3,674 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*当ファンドはマザーファンド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。

*ベンチマーク（＝「S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）」）は、S&P先進国REIT指数（配当込み、ドルベース）をもとに、当社が独自に円換算したものです。算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で円換算しております。なお、設定時を100としています。

*S&P先進国REIT指数はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービシーズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しかなる意思表示等を行なうものではありません。

(出所) スタンダード・アンド・プアーズ

○当期中の基準価額と市況等の推移

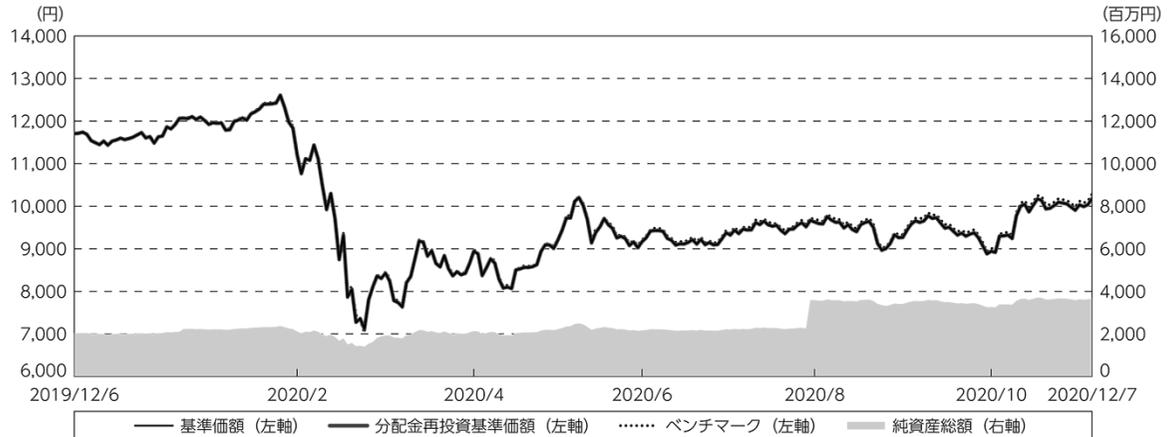
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--------|-------|--------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2019年12月6日 | 円 | % | | % | % |
| | 11,705 | — | 121.75 | — | 99.3 |
| 12月末 | 11,728 | 0.2 | 122.08 | 0.3 | 98.7 |
| 2020年1月末 | 11,955 | 2.1 | 124.53 | 2.3 | 99.0 |
| 2月末 | 11,209 | △4.2 | 117.46 | △3.5 | 99.2 |
| 3月末 | 8,426 | △28.0 | 87.99 | △27.7 | 98.4 |
| 4月末 | 8,942 | △23.6 | 93.32 | △23.3 | 98.7 |
| 5月末 | 9,089 | △22.3 | 94.79 | △22.1 | 98.8 |
| 6月末 | 9,166 | △21.7 | 95.78 | △21.3 | 99.0 |
| 7月末 | 9,323 | △20.4 | 97.38 | △20.0 | 98.9 |
| 8月末 | 9,631 | △17.7 | 100.76 | △17.2 | 99.1 |
| 9月末 | 9,263 | △20.9 | 97.10 | △20.2 | 99.0 |
| 10月末 | 8,942 | △23.6 | 93.77 | △23.0 | 99.2 |
| 11月末 | 9,979 | △14.7 | 104.73 | △14.0 | 99.2 |
| (期末) 2020年12月7日 | 10,184 | △13.0 | 107.00 | △12.1 | 99.2 |

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンド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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：11,705円

期 末：10,179円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：△ 13.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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。作成期首(2019年12月6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) 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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数(配当込み、円換算ベース)です。ベンチマークは、作成期首(2019年12月6日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まったことなどから下落したのち、各国で経済活動の再開が段階的に進んだことやワクチン開発への期待などから上昇しましたが、期を通じては下落となりました。

○投資環境

当運用期間中のREIT市場は、期首から米中貿易協議の進展への期待や市場予想を上回る米国の経済指標の発表などを受けて緩やかに上昇しました。2020年2月下旬以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて大きく下落しました。3月下旬以降は、欧米で新型コロナウイルスの感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方やFRB（米連邦準備制度理事会）の緊急資金供給策の発表、新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどを受けて上昇し、その後も各国で経済活動の再開が段階的に進んだことや、ワクチン開発への期待などを背景に上昇しました。6月中旬以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大に対する警戒感が高まる一方、新型コロナウイルスのワクチン開発進展への期待感などから、一進一退の展開となりました。11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験で高い有効性を発表したことや、米大統領選・議会選の結果を受けて再び上昇しました。

為替市場は、期首から米中貿易協議の進展への期待や、新型コロナウイルス感染拡大への懸念などを巡り、主要通貨は対円で一進一退となりました。2020年2月下旬から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などから一時的に大きく下落（円高）しました。その後、金融市場の動揺を背景に米ドル需要が強まったことや、米国で大型経済対策が成立したことから上昇（円安）に転じましたが、3月下旬以降は、市場予想を下回る米経済指標の発表や原油価格の急落などを受けて世界景気の先行き不透明感が意識される中、再び下落（円高）しました。4月以降は、新型コロナウイルス感染拡大の責任を巡る米中対立への懸念や、世界的な経済活動再開への期待などから一進一退となりましたが、6月中旬以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化するとの観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）】

主要投資対象である【世界REITインデックス マザーファンド】受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【世界REITインデックス マザーファンド】

「S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）」の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数」の中で、銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の資金流入出や「S&P先進国REIT指数」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、実質REIT組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-13.0%となり、ベンチマークの-12.1%を0.9ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

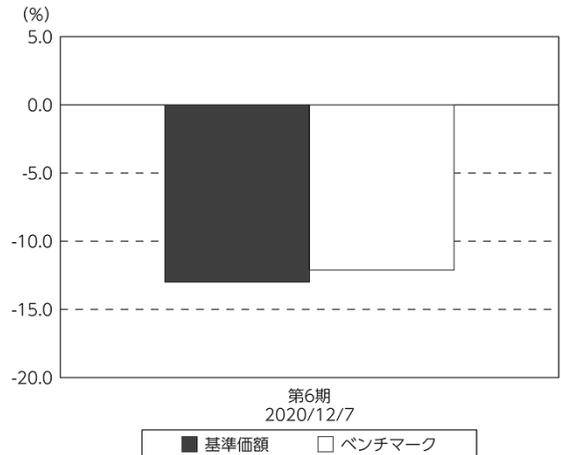
（マイナス要因）

- ①コスト負担（当ファンドにかかる信託報酬や、マザーファンドでかかる売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

（その他の要因）

- ①J-REITの評価時価による差異（ファンド評価に使用される価格とベンチマークの価格に日時差があり異なるため）
- ②為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）
- ③ファンドの実質的な保有キャッシュ部分はベンチマークの動きをとらえられないこと

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込みです。

（注）ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）です。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目 | 第6期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2019年12月7日～ 2020年12月7日 |
| 当期分配金 | 5 |
| （対基準価額比率） | 0.049% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,422 |

（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

[野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）]

主要投資対象である[世界REITインデックス マザーファンド]受益証券を高位に組み入れ、「S&P先進国REIT指数（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。

[世界REIT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（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。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2019年12月7日～2020年12月7日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 41 | 0.419 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (32) | (0.331) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 |
| （ 販 売 会 社 ） | (5) | (0.055) | 購入後の情報提供、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および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (3) | (0.033) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 2 | 0.021 | (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 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (2) | (0.019) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 2 | 0.016 | (c) 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 ※有価証券取引税は、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) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (2) | (0.016) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 4 | 0.039 | (d) 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 ） | (2) | (0.017) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 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 |
| （ そ の 他 ） | (2) | (0.019) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 49 | 0.495 | |
| 期中の平均基準価額は、9,804円です。 | | | |

* 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。

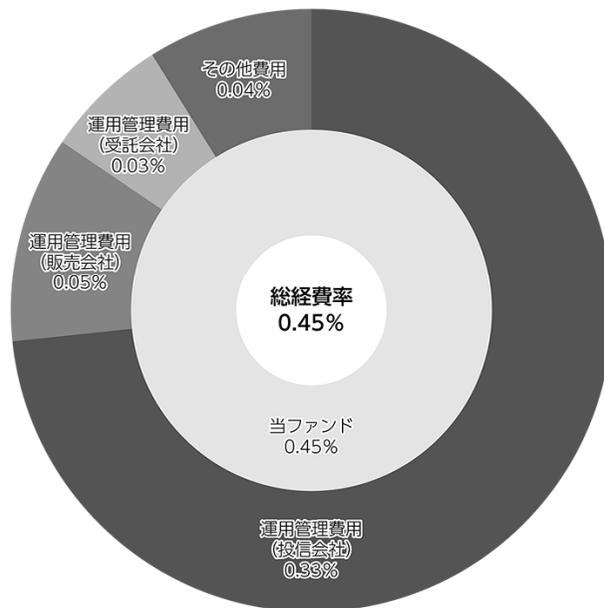
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、この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。

* 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総額（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0.45%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

(2019年12月7日～2020年12月7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 |
| 世界REITインデックス マザーファンド | 1,378,412 | 2,193,539 | 276,291 | 446,852 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年12月7日～2020年12月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | |
|---------------------|----------------------|--|
| | 世界REITインデックス マザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 3,225千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 3,257千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.98 | |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月7日～2020年12月7日)

利害関係人との取引状況

<野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）>

該当事項はございません。

<世界REITインデックス マザーファンド>

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 26,138 | 154 | 0.6 | 8,494 | 249 | 2.9 |
| 為替直物取引 | 22,669 | 293 | 1.3 | 8,875 | 109 | 1.2 |

平均保有割合 4.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2019年12月7日～2020年12月7日)

| 期首残高 (元 本) | 当期設定 元 本 | 当期解約 元 本 | 期末残高 (元 本) | 取 引 の 理 由 |
|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 百万円 0 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 0 | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2020年12月7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 |
| 世界REITインデックス マザーファンド | 千口 1,031,935 | 千口 2,134,057 | 千円 3,673,779 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年12月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 世界REITインデックス マザーファンド | 千円 3,673,779 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 12,219 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 3,685,998 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*世界REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(64,435,593千円)の投資信託財産総額(70,993,140千円)に対する比率は90.8%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国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。1米ドル=104.08円、1カナダドル=81.45円、1英ポンド=139.74円、1ユーロ=126.25円、1香港ドル=13.43円、1シンガポールドル=78.03円、1ウォン=0.0964円、1豪ドル=77.33円、1ニュージーランドドル=73.32円、1新シッケル=31.87円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年12月7日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,685,998,916 |
| コール・ローン等 | 7,354,194 |
| 世界REITインデックス マザーファンド(評価額) | 3,673,779,867 |
| 未収入金 | 4,864,855 |
| (B) 負債 | 11,857,451 |
| 未払収益分配金 | 1,804,815 |
| 未払解約金 | 3,887,809 |
| 未払信託報酬 | 6,116,594 |
| 未払利息 | 6 |
| その他未払費用 | 48,227 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,674,141,465 |
| 元本 | 3,609,630,975 |
| 次期繰越損益金 | 64,510,490 |
| (D) 受益権総口数 | 3,609,630,975口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,179円 |

(注) 期首元本額は1,738,234,598円、期中追加設定元本額は2,593,750,884円、期中一部解約元本額は722,354,507円、1口当たり純資産額は1.0179円です。

○損益の状況（2019年12月7日～2020年12月7日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 1,443 |
| 支払利息 | △ 1,443 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 24,880,546 |
| 売買益 | 78,385,066 |
| 売買損 | △103,265,612 |
| (C) 信託報酬等 | △ 10,541,201 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 35,423,190 |
| (E) 前期繰越損益金 | 185,963,273 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 84,224,778 |
| (配当等相当額) | (605,243,860) |
| (売買損益相当額) | (△689,468,638) |
| (G) 計(D+E+F) | 66,315,305 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,804,815 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 64,510,490 |
| 追加信託差損益金 | △ 84,224,778 |
| (配当等相当額) | (608,959,113) |
| (売買損益相当額) | (△693,183,891) |
| 分配準備積立金 | 265,362,688 |
| 繰越損益金 | △116,627,420 |

*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。

*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。

*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) 分配金の計算過程（2019年12月7日～2020年12月7日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2019年12月7日～ 2020年12月7日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 81,204,230円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 608,959,113円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 185,963,273円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 876,126,616円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,427円 |
| g. 分配金 | 1,804,815円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2020年12月7日現在）

<世界REITインデックス マザーファンド>

下記は、世界REITインデックス マザーファンド全体(41,176,266千口)の内容です。

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 投資証券 | 92 | 149 | 16,613 | 0.0 |
| サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 132 | 179 | 17,022 | 0.0 |
| S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券 | — | 241 | 28,221 | 0.0 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 178 | 239 | 129,299 | 0.2 |
| MCUBS M i d C i t y 投資法人 投資証券 | 667 | 865 | 73,957 | 0.1 |
| 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 583 | 791 | 108,129 | 0.2 |
| 産業ファンド投資法人 投資証券 | 658 | 1,017 | 172,890 | 0.2 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 497 | 681 | 198,375 | 0.3 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 340 | 463 | 80,052 | 0.1 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 258 | 337 | 134,463 | 0.2 |
| GLP 投資法人 投資証券 | 1,412 | 2,114 | 333,800 | 0.5 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 219 | 301 | 84,009 | 0.1 |
| 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 877 | 1,205 | 369,935 | 0.5 |
| 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 80 | 108 | 52,974 | 0.1 |
| O n e リート投資法人 投資証券 | 90 | 121 | 29,403 | 0.0 |
| イオンリート投資法人 投資証券 | 561 | 747 | 90,685 | 0.1 |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 406 | 576 | 82,713 | 0.1 |
| 日本リート投資法人 投資証券 | 164 | 218 | 77,499 | 0.1 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 3,340 | 4,417 | 62,633 | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 1,498 | 2,114 | 159,395 | 0.2 |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 133 | 159 | 17,172 | 0.0 |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 194 | 258 | 60,939 | 0.1 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 121 | 146 | 18,264 | 0.0 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 208 | 292 | 30,017 | 0.0 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 1,695 | 2,310 | 313,929 | 0.4 |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券 | 100 | 141 | 9,870 | 0.0 |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 495 | 789 | 123,399 | 0.2 |
| スターアジア不動産投資法人 投資証券 | 203 | 816 | 39,249 | 0.1 |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券 | 35 | 63 | 7,093 | 0.0 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 127 | 246 | 117,957 | 0.2 |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券 | 93 | 131 | 9,209 | 0.0 |
| さくら総合リート投資法人 投資証券 | 129 | — | — | — |
| 投資法人みらい 投資証券 | 596 | 787 | 29,709 | 0.0 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券 | 130 | 160 | 18,256 | 0.0 |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券 | 111 | 173 | 67,383 | 0.1 |
| CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 89 | 182 | 27,354 | 0.0 |
| ガイマックス・リート投資法人 投資証券 | 81 | 109 | 10,017 | 0.0 |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券 | 155 | 221 | 19,558 | 0.0 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 125 | 231 | 29,013 | 0.0 |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 526 | 804 | 462,300 | 0.7 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 516 | 682 | 371,008 | 0.5 |
| 日本リテールファンド投資法人 投資証券 | 977 | 1,280 | 220,544 | 0.3 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|------------------------|---------------|-------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 口 | 口 | 千円 | % |
| オリックス不動産投資法人 投資証券 | 1,030 | 1,358 | 215,243 | 0.3 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 340 | 472 | 153,872 | 0.2 |
| プレミア投資法人 投資証券 | 494 | 653 | 77,511 | 0.1 |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 349 | 459 | 69,263 | 0.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 361 | 465 | 45,988 | 0.1 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 1,164 | 1,533 | 185,033 | 0.3 |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 362 | 464 | 59,484 | 0.1 |
| インヴェンシブル投資法人 投資証券 | 2,241 | 2,987 | 104,246 | 0.1 |
| フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 178 | 234 | 87,750 | 0.1 |
| 平和不動産リート投資法人 投資証券 | 331 | 428 | 49,947 | 0.1 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 331 | 445 | 128,204 | 0.2 |
| 福岡リート投資法人 投資証券 | 272 | 351 | 50,263 | 0.1 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 158 | 211 | 139,471 | 0.2 |
| いちごオフィスリート投資法人 投資証券 | 575 | 748 | 52,210 | 0.1 |
| 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 114 | 150 | 90,450 | 0.1 |
| 阪急阪神リート投資法人 投資証券 | 263 | 336 | 40,992 | 0.1 |
| スターツプロシード投資法人 投資証券 | 83 | 102 | 19,492 | 0.0 |
| 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 698 | 978 | 235,306 | 0.3 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 1,640 | 2,194 | 120,450 | 0.2 |
| 大和証券リビング投資法人 投資証券 | 596 | 1,007 | 92,744 | 0.1 |
| ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 466 | 637 | 77,013 | 0.1 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 口 数 | 6,399,258 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 62 | < 9.0% > | |

*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

*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。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | 30,900 | 42,000 | 646 | 67,318 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 15,600 | 26,600 | 1,755 | 182,722 | 0.3 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | — | 33,000 | 560 | 58,285 | 0.1 |
| ALEXANDERS INC | 790 | 1,100 | 310 | 32,347 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 42,200 | 57,600 | 9,846 | 1,024,786 | 1.4 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 17,900 | 24,600 | 764 | 79,576 | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 50,700 | 68,100 | 2,903 | 302,225 | 0.4 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 39,000 | 51,000 | 404 | 42,146 | 0.1 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 95,200 | 130,700 | 3,860 | 401,840 | 0.6 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 71,500 | 99,800 | 3,405 | 354,410 | 0.5 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | — | 73,140 | 3,019 | 314,240 | 0.4 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 55,000 | — | — | — | — |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 78,000 | 102,000 | 1,354 | 140,982 | 0.2 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | — | 25,000 | 283 | 29,532 | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 35,000 | — | — | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 51,910 | 69,200 | 12,029 | 1,252,054 | 1.8 |
| BRT APARTMENTS CORP | 4,000 | 5,000 | 72 | 7,551 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 9,000 | 12,000 | 129 | 13,476 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES | 53,500 | 69,600 | 7,330 | 762,934 | 1.1 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 11,000 | — | — | — | — |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 65,000 | 83,000 | 985 | 102,540 | 0.1 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 111,100 | 147,000 | 2,421 | 251,987 | 0.4 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 24,300 | 26,000 | 415 | 43,243 | 0.1 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 71,000 | — | — | — | — |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | — | 5,000 | 57 | 5,984 | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 36,100 | 48,000 | 4,835 | 503,280 | 0.7 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 35,500 | 46,000 | 943 | 98,147 | 0.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 36,000 | — | — | — | — |
| CHATHAM LODGING TRUST | 18,000 | 24,000 | 285 | 29,725 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 19,000 | 21,000 | 207 | 21,572 | 0.0 |
| CLIPPER REALTY INC | 6,000 | 6,000 | 40 | 4,184 | 0.0 |
| COLONY CAPITAL INC | 181,000 | 238,000 | 1,137 | 118,405 | 0.2 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 43,500 | 56,000 | 832 | 86,669 | 0.1 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 6,900 | 10,700 | 496 | 51,662 | 0.1 |
| CORESITE REALTY CORP | 13,600 | 21,000 | 2,583 | 268,926 | 0.4 |
| CORECIVIC INC | 44,000 | 57,000 | 448 | 46,629 | 0.1 |
| COREPOINT LODGING INC | 16,000 | 20,000 | 148 | 15,487 | 0.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 41,600 | 55,100 | 1,459 | 151,857 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 54,800 | 73,400 | 2,528 | 263,179 | 0.4 |
| CUBESMART | 71,900 | 94,800 | 3,104 | 323,137 | 0.5 |
| CYRUSONE INC | 41,800 | 57,600 | 3,967 | 412,936 | 0.6 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 74,000 | 100,000 | 872 | 90,757 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 77,500 | 132,200 | 17,909 | 1,863,982 | 2.6 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | — | 117,000 | 558 | 58,086 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 比 率 |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| DOUGLAS EMMETT INC | 61,500 | 81,500 | 2,645 | 275,342 | 0.4 |
| DUKE REALTY CORP | 134,500 | 182,000 | 7,017 | 730,425 | 1.0 |
| EPR PROPERTIES | 28,600 | 36,500 | 1,222 | 127,225 | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 26,200 | 39,000 | 846 | 88,123 | 0.1 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 14,000 | 19,200 | 2,585 | 269,095 | 0.4 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 54,000 | 71,000 | 717 | 74,709 | 0.1 |
| EQUINIX INC | 31,520 | 43,480 | 30,798 | 3,205,475 | 4.5 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 45,400 | 59,800 | 1,581 | 164,624 | 0.2 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 67,800 | 83,500 | 5,007 | 521,180 | 0.7 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 129,600 | 168,000 | 10,646 | 1,108,052 | 1.6 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 30,300 | 49,900 | 1,070 | 111,402 | 0.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 24,440 | 32,040 | 8,097 | 842,784 | 1.2 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 47,800 | 63,400 | 7,249 | 754,558 | 1.1 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 11,300 | 15,000 | 123 | 12,864 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 26,000 | 33,700 | 3,137 | 326,547 | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 46,600 | 62,900 | 2,639 | 274,696 | 0.4 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 25,300 | 34,800 | 987 | 102,791 | 0.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 41,000 | 44,000 | 219 | 22,851 | 0.0 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 19,000 | 24,000 | 391 | 40,791 | 0.1 |
| GEO GROUP INC/THE | 45,000 | 58,000 | 580 | 60,426 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 76,000 | 102,200 | 4,303 | 447,923 | 0.6 |
| GETTY REALTY CORP | 12,500 | 17,600 | 510 | 53,104 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 11,300 | 16,200 | 296 | 30,855 | 0.0 |
| GLADSTONE LAND CORP | 6,000 | 10,000 | 148 | 15,476 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 33,100 | 44,000 | 770 | 80,141 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 11,000 | 21,000 | 298 | 31,080 | 0.0 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 48,100 | 67,200 | 1,993 | 207,517 | 0.3 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 76,600 | 108,200 | 2,795 | 290,996 | 0.4 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 182,700 | 264,500 | 8,091 | 842,117 | 1.2 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 14,400 | 19,000 | 178 | 18,588 | 0.0 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 38,600 | 51,300 | 2,089 | 217,523 | 0.3 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 271,700 | 346,000 | 5,414 | 563,582 | 0.8 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 57,600 | 75,700 | 2,045 | 212,886 | 0.3 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 33,000 | 46,000 | 615 | 64,011 | 0.1 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 24,000 | 31,400 | 715 | 74,512 | 0.1 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 4,300 | 10,700 | 1,636 | 170,289 | 0.2 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 4,300 | 6,400 | 465 | 48,406 | 0.1 |
| INVITATION HOMES INC | 199,500 | 275,400 | 8,328 | 866,788 | 1.2 |
| IRON MOUNTAIN INC | 107,000 | 141,100 | 4,114 | 428,234 | 0.6 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 43,400 | 55,400 | 1,808 | 188,260 | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP | 34,700 | 51,400 | 3,273 | 340,669 | 0.5 |
| KIMCO REALTY CORP | 157,400 | 212,000 | 3,309 | 344,434 | 0.5 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 31,000 | 40,000 | 606 | 63,114 | 0.1 |
| LTC PROPERTIES INC | 14,800 | 19,600 | 757 | 78,885 | 0.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 92,000 | 135,000 | 1,429 | 148,797 | 0.2 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 58,800 | — | — | — | — |
| LIFE STORAGE INC | 17,400 | 23,200 | 2,582 | 268,751 | 0.4 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|-------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| MACERICH CO /THE | 41,100 | 56,000 | 665 | 69,300 | 0.1 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 33,500 | 43,000 | 610 | 63,506 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 183,900 | 259,000 | 5,325 | 554,230 | 0.8 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 42,400 | 56,200 | 7,032 | 731,922 | 1.0 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 36,000 | 48,000 | 730 | 75,986 | 0.1 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 15,900 | 21,800 | 1,449 | 150,884 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 63,900 | 85,100 | 3,404 | 354,288 | 0.5 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 22,300 | 30,500 | 1,039 | 108,216 | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 32,000 | 35,000 | 208 | 21,747 | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 7,700 | 10,900 | 480 | 49,962 | 0.1 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME | 17,800 | 23,200 | 553 | 57,637 | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 80,800 | 111,300 | 4,202 | 437,415 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 5,600 | 8,032 | 159 | 16,602 | 0.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 7,360 | 9,800 | 1,359 | 141,502 | 0.2 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 75,000 | 81,000 | 783 | 81,522 | 0.1 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 88,400 | 116,000 | 2,104 | 219,009 | 0.3 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 48,600 | 64,000 | 1,278 | 133,022 | 0.2 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 24,000 | — | — | — | — |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 68,900 | 102,000 | 1,805 | 187,906 | 0.3 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 46,700 | 62,000 | 1,035 | 107,764 | 0.2 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 4,400 | 9,000 | 124 | 13,001 | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 16,300 | 26,000 | 221 | 23,028 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 234,500 | 362,700 | 35,783 | 3,724,396 | 5.3 |
| PUBLIC STORAGE | 55,810 | 74,790 | 16,790 | 1,747,540 | 2.5 |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 21,600 | 30,200 | 1,834 | 190,950 | 0.3 |
| RLJ LODGING TRUST | 64,000 | 81,000 | 1,139 | 118,616 | 0.2 |
| RPT REALTY | 29,000 | 37,000 | 305 | 31,847 | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | 118,300 | 169,800 | 10,401 | 1,082,634 | 1.5 |
| REGENCY CENTERS CORP | 62,400 | 77,400 | 3,798 | 395,378 | 0.6 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 42,300 | 57,000 | 817 | 85,132 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 80,000 | 103,000 | 957 | 99,698 | 0.1 |
| RETAIL VALUE INC | 5,519 | 8,000 | 119 | 12,481 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 40,400 | 60,500 | 2,910 | 302,878 | 0.4 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 19,200 | 27,100 | 1,798 | 187,172 | 0.3 |
| SL GREEN REALTY CORP | 30,800 | 36,200 | 2,313 | 240,755 | 0.3 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 70,600 | 101,000 | 1,843 | 191,845 | 0.3 |
| SAFEHOLD INC | 4,800 | 6,900 | 470 | 48,949 | 0.1 |
| SAUL CENTERS INC | 4,500 | 6,700 | 226 | 23,604 | 0.0 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 88,000 | — | — | — | — |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 12,300 | 18,000 | 350 | 36,438 | 0.1 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 60,700 | 81,000 | 1,094 | 113,895 | 0.2 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 114,500 | 159,600 | 14,988 | 1,559,954 | 2.2 |
| SITE CENTERS CORP | 55,000 | 75,000 | 795 | 82,743 | 0.1 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 36,900 | 50,900 | 1,991 | 207,244 | 0.3 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 47,300 | 73,700 | 2,191 | 228,049 | 0.3 |
| STORE CAPITAL CORP | 78,300 | 111,800 | 3,710 | 386,203 | 0.5 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 38,000 | 53,000 | 509 | 53,066 | 0.1 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|-----------|------------|-----------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % | |
| SUN COMMUNITIES INC | 33,700 | 48,200 | 7,123 | 741,461 | 1.0 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 84,000 | 105,000 | 1,190 | 123,928 | 0.2 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 34,000 | 44,000 | 467 | 48,680 | 0.1 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 22,700 | 30,300 | 1,299 | 135,258 | 0.2 | |
| TERRENO REALTY CORP | 24,100 | 33,800 | 1,950 | 203,018 | 0.3 | |
| UDR INC | 109,000 | 145,500 | 5,918 | 616,043 | 0.9 | |
| UMH PROPERTIES INC | 13,700 | 18,000 | 269 | 28,082 | 0.0 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 4,600 | 6,300 | 415 | 43,243 | 0.1 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 42,600 | 53,000 | 724 | 75,407 | 0.1 | |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 10,600 | 14,000 | 207 | 21,565 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 138,600 | 183,000 | 9,051 | 942,046 | 1.3 | |
| VEREIT INC | 393,000 | 529,000 | 4,041 | 420,645 | 0.6 | |
| VICI PROPERTIES INC | 171,600 | 262,100 | 6,791 | 706,808 | 1.0 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 59,000 | 76,700 | 3,193 | 332,329 | 0.5 | |
| WP CAREY INC | 63,300 | 85,400 | 5,991 | 623,612 | 0.9 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 72,000 | 100,000 | 115 | 11,969 | 0.0 | |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 29,700 | 40,700 | 967 | 100,648 | 0.1 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 45,000 | 59,000 | 1,328 | 138,227 | 0.2 | |
| WELLTOWER INC | 150,600 | 205,200 | 13,173 | 1,371,133 | 1.9 | |
| WHITESTONE REIT | 14,000 | 20,000 | 170 | 17,776 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 41,800 | 56,000 | 880 | 91,681 | 0.1 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | — | 330,000 | 235 | 24,557 | 0.0 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | — | 240,000 | 16 | 1,698 | 0.0 | |
| PRIME US REIT | — | 220,000 | 171 | 17,860 | 0.0 | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 190,000 | — | — | — | — | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 521,999 | 709,999 | 528 | 55,053 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 8,967,748 | 12,456,781 | 449,004 | 46,732,414 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 156 | 155 | — | < 65.9% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 20,700 | 29,700 | 1,231 | 100,342 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 23,000 | — | — | — | — | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | — | 36,000 | 408 | 33,309 | 0.0 | |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST | — | 9,000 | 97 | 7,975 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 8,900 | 10,800 | 379 | 30,884 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 28,000 | 26,000 | 393 | 32,061 | 0.0 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 28,700 | 41,000 | 2,067 | 168,408 | 0.2 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 58,969 | 80,969 | 1,101 | 89,756 | 0.1 | |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 33,000 | 43,000 | 382 | 31,170 | 0.0 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | 17,000 | 22,000 | 323 | 26,376 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 9,100 | 12,300 | 268 | 21,900 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 23,000 | 38,000 | 489 | 39,833 | 0.1 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | — | 52,000 | 785 | 63,996 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 9,400 | 14,700 | 1,105 | 90,050 | 0.1 | |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 51,000 | 69,000 | 1,009 | 82,221 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 22,000 | 35,000 | 489 | 39,881 | 0.1 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 18,000 | 25,300 | 439 | 35,773 | 0.1 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 5,000 | 8,200 | 157 | 12,836 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|--------------|-----------|---------|---------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 口 | 口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 7,100 | 9,100 | 145 | 11,814 | 0.0 | |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | 10,500 | — | — | — | — | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 26,000 | 41,000 | 509 | 41,475 | 0.1 | |
| PLAZA RETAIL REIT | — | 31,000 | 113 | 9,266 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 56,800 | 76,000 | 1,341 | 109,257 | 0.2 | |
| SLATE OFFICE REIT | 13,000 | 13,000 | 55 | 4,510 | 0.0 | |
| SLATE RETAIL REIT | 8,500 | — | — | — | — | |
| SLATE GROCERY REIT | — | 8,500 | 98 | 8,058 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 26,400 | 35,000 | 845 | 68,874 | 0.1 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 27,000 | 36,500 | 476 | 38,796 | 0.1 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 11,000 | 20,000 | 131 | 10,686 | 0.0 | |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | — | 19,000 | 338 | 27,530 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 542,069 | 842,069 | 15,187 | 1,237,054 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 24 | 27 | — | <1.7%> | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| BRITISH LAND | 348,000 | 463,000 | 2,361 | 329,968 | 0.5 | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 220,000 | — | — | — | — | |
| DERWENT LONDON PLC | 39,100 | 55,000 | 1,787 | 249,785 | 0.4 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 58,000 | 83,000 | 927 | 129,670 | 0.2 | |
| HAMMERSON PLC | 289,000 | — | — | — | — | |
| INTU PROPERTIES PLC | 335,000 | 335,000 | 5 | 831 | 0.0 | |
| UNITE GROUP PLC | 106,000 | 197,000 | 2,194 | 306,670 | 0.4 | |
| SHAFESBURY PLC | 83,000 | 121,000 | 699 | 97,731 | 0.1 | |
| STANDARD LIFE INV PROP INC | — | 200,000 | 123 | 17,188 | 0.0 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 200,000 | 300,000 | 114 | 15,930 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 210,000 | 270,000 | 214 | 29,995 | 0.0 | |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 166,000 | — | — | — | — | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 290,000 | 360,000 | 266 | 37,226 | 0.1 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 79,000 | 104,000 | 819 | 114,447 | 0.2 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 302,000 | 449,000 | 1,008 | 140,921 | 0.2 | |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | — | 370,000 | 318 | 44,465 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 405,000 | 587,000 | 5,310 | 742,019 | 1.0 | |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | — | 410,000 | 614 | 85,825 | 0.1 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 48,000 | 64,000 | 499 | 69,847 | 0.1 | |
| GCP STUDENT LIVING PLC | — | 230,000 | 328 | 45,960 | 0.1 | |
| NEWRIVER REIT PLC | 121,000 | 141,000 | 120 | 16,846 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 210,000 | 300,000 | 314 | 43,934 | 0.1 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 130,000 | 180,000 | 189 | 26,536 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | — | 340,000 | 363 | 50,837 | 0.1 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 99,000 | 123,000 | 824 | 115,159 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 640,869 | 843,000 | 1,340 | 187,303 | 0.3 | |
| RDI REIT PLC | 104,128 | 114,128 | 102 | 14,321 | 0.0 | |
| CUSTODIAN REIT PLC | — | 200,000 | 175 | 24,566 | 0.0 | |
| HAMMERSON PLC | — | 1,885,000 | 477 | 66,748 | 0.1 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 219,285 | 289,285 | 218 | 30,561 | 0.0 | |
| ASSURA PLC | 900,000 | 1,280,000 | 939 | 131,288 | 0.2 | |
| AEW UK REIT PLC | 50,000 | 70,000 | 53 | 7,531 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|---------------------------------|---------|---------------------------|-----------------|------------------|-------------|-----------------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | | 口 | 口 | 千英ポンド | 千円 | % |
| LXI REIT PLC | | 197,399 | 245,000 | 294 | 41,083 | 0.1 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | | 458,000 | 637,000 | 903 | 126,222 | 0.2 |
| REGIONAL REIT LTD | | 155,000 | 195,000 | 155 | 21,663 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 279,000 | 370,000 | 2,684 | 375,162 | 0.5 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | | — | 157,000 | 168 | 23,584 | 0.0 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 6,741,781 29 | 11,967,413 34 | 26,920 — | 3,761,836 < 5.3% > |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| HAMBORNER REIT AG | | 24,000 | 32,000 | 284 | 35,968 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 58,700 | 89,000 | 1,256 | 158,655 | 0.2 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 82,700 2 | 121,000 2 | 1,541 — | 194,623 < 0.3% > |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | | 20,563 | 27,563 | 99 | 12,579 | 0.0 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 20,563 1 | 27,563 1 | 99 — | 12,579 < 0.0% > |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| ICADE | | 10,500 | 15,200 | 1,036 | 130,875 | 0.2 |
| ALTAREA | | 1,390 | 1,700 | 236 | 29,832 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 76,700 | 99,200 | 2,014 | 254,362 | 0.4 |
| GECINA SA | | 20,280 | 26,600 | 3,476 | 438,923 | 0.6 |
| COVIVIO | | 16,515 | 23,915 | 1,840 | 232,332 | 0.3 |
| MERCIALYS | | 9,300 | 21,300 | 155 | 19,576 | 0.0 |
| CARMILA | | — | 23,000 | 292 | 36,935 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 51,300 | 67,600 | 4,231 | 534,259 | 0.8 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 185,985 7 | 278,515 8 | 13,283 — | 1,677,099 < 2.4% > |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA | | 15,100 | 17,000 | 272 | 34,425 | 0.0 |
| VASTNED RETAIL NV | | 6,570 | 9,270 | 222 | 28,088 | 0.0 |
| WERELDHAVE NV | | 16,000 | 20,000 | 241 | 30,426 | 0.0 |
| NSI NV | | 6,300 | 8,700 | 291 | 36,850 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 43,970 4 | 54,970 4 | 1,028 — | 129,790 < 0.2% > |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | 91,000 | 125,000 | 1,054 | 133,114 | 0.2 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 23,000 | 29,000 | 143 | 18,123 | 0.0 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 136,000 | 166,000 | 1,317 | 166,297 | 0.2 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 250,000 3 | 320,000 3 | 2,515 — | 317,535 < 0.4% > |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| BEFIMMO S. C. A. | | 8,600 | 12,400 | 477 | 60,271 | 0.1 |
| COFINIMMO | | 9,176 | 13,500 | 1,665 | 210,319 | 0.3 |
| RETAIL ESTATES | | 4,216 | 5,300 | 316 | 40,013 | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | | 8,500 | 11,200 | 255 | 32,239 | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 6,830 | — | — | — | — |
| MONTEA | | 3,954 | 4,954 | 460 | 58,166 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|--|---------|--------------|-----------|-----------|---------|-----------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | 口 | 口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| AEDIFICA | | 9,000 | 16,360 | 1,580 | 199,522 | 0.3 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | — | 63,800 | 1,749 | 220,861 | 0.3 |
| CARE PROPERTY INVEST | | — | 11,700 | 320 | 40,473 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | — | 6,600 | 323 | 40,829 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 50,276 | 145,814 | 7,150 | 902,696 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | 9 | — | < 1.3% > |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| HIBERNIA REIT PLC | | 241,000 | 340,000 | 388 | 49,106 | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 137,570 | 208,570 | 288 | 36,443 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 378,570 | 548,570 | 677 | 85,549 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 0.1% > |
| (ユーロ…シンガポール) | | | | | | |
| CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE | | — | 640,000 | 300 | 37,976 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | — | 640,000 | 300 | 37,976 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | — | 1 | — | < 0.1% > |
| ユ ー ロ 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 1,012,064 | 2,136,432 | 26,596 | 3,357,851 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 26 | 30 | — | < 4.7% > |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | | 782,000 | 1,018,000 | 72,074 | 967,959 | 1.4 |
| PROSPERITY REIT | | 470,000 | 580,000 | 1,409 | 18,928 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 520,000 | 740,000 | 2,841 | 38,162 | 0.1 |
| CHAMPION REIT | | 740,000 | 970,000 | 4,462 | 59,924 | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | | 390,000 | 480,000 | 1,824 | 24,496 | 0.0 |
| FORTUNE REIT | | 530,000 | 700,000 | 5,033 | 67,593 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 3,432,000 | 4,488,000 | 87,644 | 1,177,064 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 6 | — | < 1.7% > |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポールドル | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | | 1,063,000 | 2,240,028 | 4,435 | 346,082 | 0.5 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 1,125,040 | 1,555,582 | 4,620 | 360,504 | 0.5 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 1,040,040 | — | — | — | — |
| SUNTEC REIT | | 870,000 | 1,050,000 | 1,554 | 121,258 | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 1,080,000 | 1,290,040 | 2,502 | 195,283 | 0.3 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 520,000 | 670,000 | 321 | 25,094 | 0.0 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | | 420,000 | — | — | — | — |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | | 260,000 | — | — | — | — |
| KEPPEL REIT | | 700,000 | 850,000 | 892 | 69,641 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 259,975 | 487,907 | 1,170 | 91,371 | 0.1 |
| ESR REIT | | 754,037 | 1,140,037 | 467 | 36,472 | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 290,040 | 370,040 | 481 | 37,536 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | | 271,750 | 470,050 | 587 | 45,847 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST RTS | | — | 20,162 | 1 | 125 | 0.0 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | | 228,100 | 268,100 | 107 | 8,367 | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | | 148,000 | 187,000 | 718 | 56,031 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | | 740,000 | 740,000 | 62 | 4,850 | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | | 572,000 | 829,000 | 2,387 | 186,298 | 0.3 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 795,424 | 1,060,024 | 2,183 | 170,390 | 0.2 |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | | 310,612 | 440,012 | 264 | 20,600 | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---|--------------|------------|------------|-----------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 口 | 口 | 千シンガポールドル | 千円 | % | |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 170,000 | 200,000 | 240 | 18,727 | 0.0 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 310,038 | 410,038 | 145 | 11,358 | 0.0 | |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 800,000 | 1,030,000 | 947 | 73,941 | 0.1 | |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 320,000 | — | — | — | — | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 347,600 | 430,000 | 275 | 21,473 | 0.0 | |
| SPH REIT | 316,100 | 480,000 | 398 | 31,087 | 0.0 | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 330,400 | 480,400 | 242 | 18,930 | 0.0 | |
| EC WORLD REIT | — | 120,000 | 86 | 6,741 | 0.0 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 190,000 | 260,000 | 209 | 16,331 | 0.0 | |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | — | 910,044 | 955 | 74,561 | 0.1 | |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 944,067 | 1,159,967 | 446 | 34,847 | 0.0 | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | — | 450,000 | 315 | 24,579 | 0.0 | |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 240,000 | 310,000 | 167 | 13,062 | 0.0 | |
| IREIT GLOBAL | — | 226,320 | 145 | 11,390 | 0.0 | |
| KEPPEL DC REIT | 448,883 | 630,983 | 1,728 | 134,905 | 0.2 | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 580,000 | 1,299,990 | 1,780 | 138,970 | 0.2 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 16,445,106 | 22,065,724 | 30,842 | 2,406,667 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 32 | — | < 3.4% > | |
| (韓国) | | | 千ウォン | | | |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | — | 45,000 | 183,150 | 17,655 | 0.0 | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 11,000 | 21,365 | 156,178 | 15,055 | 0.0 | |
| LOTTE REIT CO LTD | — | 40,000 | 210,000 | 20,244 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 11,000 | 106,365 | 549,328 | 52,955 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 3 | — | < 0.1% > | |
| (オーストラリア) | | | 千豪ドル | | | |
| BWP TRUST | 181,000 | 235,000 | 1,017 | 78,687 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 1,476,000 | 1,950,000 | 5,167 | 399,602 | 0.6 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 709,230 | 909,230 | 813 | 62,928 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 129,000 | 257,000 | 974 | 75,321 | 0.1 | |
| GPT GROUP | 708,000 | 953,000 | 4,450 | 344,157 | 0.5 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | — | 213,333 | 546 | 42,232 | 0.1 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 134,520 | 166,520 | 524 | 40,562 | 0.1 | |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 894,000 | 1,175,000 | 5,322 | 411,608 | 0.6 | |
| DEXUS | 402,000 | 541,000 | 5,269 | 407,478 | 0.6 | |
| GOODMAN GROUP | 598,000 | 817,000 | 15,065 | 1,165,013 | 1.6 | |
| CHARTER HALL GROUP | 169,000 | 228,000 | 3,312 | 256,181 | 0.4 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 104,609 | 133,000 | 481 | 37,231 | 0.1 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 84,225 | 153,000 | 732 | 56,672 | 0.1 | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 331,000 | 520,000 | 1,331 | 102,941 | 0.1 | |
| ARENA REIT | 107,550 | 166,550 | 477 | 36,963 | 0.1 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | — | 213,000 | 653 | 50,566 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 134,360 | 207,000 | 1,008 | 77,955 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 278,378 | 470,000 | 897 | 69,419 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 59,250 | 87,250 | 273 | 21,118 | 0.0 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 192,730 | 262,730 | 302 | 23,364 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 95,000 | 160,000 | 497 | 38,479 | 0.1 | |
| APN INDUSTRIA REIT | 41,425 | 60,411 | 180 | 13,968 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|---------------------------------|--------------|------------|-------------|---------|------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 口 | 口 | 千豪ドル | 千円 | % |
| HOME CONSORTIUM | — | 81,000 | 315 | 24,428 | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP | 127,000 | 160,000 | 400 | 30,932 | 0.0 |
| INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY | — | 270,000 | 346 | 26,829 | 0.0 |
| CENTURIA OFFICE REIT | — | 178,000 | 391 | 30,282 | 0.0 |
| WAYPOINT REIT LTD | — | 379,000 | 1,046 | 80,890 | 0.1 |
| SCENTRE GROUP | 1,988,000 | 2,538,000 | 7,360 | 569,164 | 0.8 |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | — | 40,500 | 52 | 4,040 | 0.0 |
| CENTURIA METROPOLITAN REIT | 115,000 | — | — | — | — |
| VICINITY CENTRES | 1,193,000 | 1,870,000 | 3,216 | 248,724 | 0.4 |
| AVENTUS GROUP | — | 181,000 | 479 | 37,091 | 0.1 |
| VIVA ENERGY REIT | 175,000 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 10,427,277 | 15,575,524 | 62,910 | 4,864,838 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 25 | 31 | — | < 6.9% > |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 410,000 | 530,000 | 922 | 67,615 | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 124,000 | 167,000 | 496 | 36,427 | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 400,000 | 540,000 | 1,285 | 94,230 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 320,000 | 410,000 | 629 | 46,143 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 590,000 | 770,000 | 935 | 68,594 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,844,000 | 2,417,000 | 4,269 | 313,012 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 5 | 5 | — | < 0.4% > |
| (イスラエル) | | | 千新シェケル | | |
| REIT 1 LTD | 70,000 | 84,000 | 1,326 | 42,271 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 70,000 | 84,000 | 1,326 | 42,271 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.1% > |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 49,493,045 | 72,139,308 | — | 63,945,965 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 304 | 324 | — | < 90.2% > |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 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 | REIT先物取引 | 東証REIT指数 | 百万円 |
| | | 47 | — |
| 外国 | REIT先物取引 | DJREA | 百万円 |
| | | 458 | — |

* 単位未満は切り捨て。

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

世界REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日2020年1月20日）

作成対象期間（2019年1月22日～2020年1月20日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等につい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。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主として世界の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託証券（REIT）に投資し、S&P先進国REIT指数（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。 |
| 主な投資対象 | 世界各国のREITを主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|--------|--------|--------|--------------|--------|
| | 円 | 騰落率 | 154.88 | 騰落率 | | |
| 8期(2016年1月20日) | 14,925 | △10.4% | 154.88 | △10.0% | 99.4% | 51,951 |
| 9期(2017年1月20日) | 16,345 | 9.5% | 170.25 | 9.9% | 99.3% | 64,078 |
| 10期(2018年1月22日) | 16,550 | 1.3% | 173.30 | 1.8% | 99.2% | 52,293 |
| 11期(2019年1月21日) | 16,982 | 2.6% | 179.01 | 3.3% | 99.1% | 54,250 |
| 12期(2020年1月20日) | 20,333 | 19.7% | 215.12 | 20.2% | 98.9% | 65,647 |

*ベンチマーク (=「S&P先進国REIT指数(配当込み、円換算ベース)」)は、S&P先進国REIT指数(配当込み、ドルベース)をもとに、当社が独自に円換算した指数です。算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。なお、設定時を100としています。

*S&P先進国REIT指数はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスーズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

(出所) スタンダード・アンド・プアーズ

○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 | | 投資信託 組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--------|-------|--------------|
| | 円 | 騰落率 | 179.01 | 騰落率 | |
| (期首) 2019年1月21日 | 16,982 | — | 179.01 | — | 99.1% |
| 1月末 | 17,585 | 3.6% | 184.88 | 3.3% | 99.3% |
| 2月末 | 17,970 | 5.8% | 189.52 | 5.9% | 99.3% |
| 3月末 | 18,628 | 9.7% | 196.60 | 9.8% | 99.1% |
| 4月末 | 18,566 | 9.3% | 195.94 | 9.5% | 99.4% |
| 5月末 | 18,127 | 6.7% | 191.31 | 6.9% | 99.4% |
| 6月末 | 18,195 | 7.1% | 192.06 | 7.3% | 99.1% |
| 7月末 | 18,687 | 10.0% | 197.26 | 10.2% | 99.3% |
| 8月末 | 18,630 | 9.7% | 196.84 | 10.0% | 99.2% |
| 9月末 | 19,425 | 14.4% | 205.31 | 14.7% | 99.1% |
| 10月末 | 20,088 | 18.3% | 212.10 | 18.5% | 99.3% |
| 11月末 | 20,010 | 17.8% | 211.63 | 18.2% | 99.2% |
| 12月末 | 19,757 | 16.3% | 208.94 | 16.7% | 98.7% |
| (期末) 2020年1月20日 | 20,333 | 19.7% | 215.12 | 20.2% | 98.9% |

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首16,982円から期末20,333円に3,351円の値上がりとなりました。

米中貿易協議の進展への期待や世界的に低金利が長期化するとの見方が広がったこと、米株式市場の上昇などを背景に主要投資国のREIT市場が上昇し、基準価額は上昇しました。

○投資環境

主要投資国のREIT市場は、期首より、米長期金利の低下や米中貿易協議の進展への期待などを背景に上昇しました。2019年4月以降は、国内外の長期金利の動向や米中貿易摩擦を巡る不透明感などから一進一退の展開となりましたが、6月以降は米利下げ観測が高まったことや米中貿易協議再開への期待などを受けて上昇しました。11月には、10月の米雇用統計の結果を受け米金利が上昇したことなどから軟調に推移し、12月には、FOMC（米連邦公開市場委員会）後の声明で更なる利下げ期待が後退したことなどから下落しました。その後は米株式市場の上昇などを背景に上昇しました。

為替市場は、期首から米景気減速への警戒感が和らいだことや、米中貿易協議の進展への期待などを背景に投資家のリスク回避姿勢が弱まる中、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。2019年5月以降は、米中貿易摩擦への警戒感から投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米利下げ観測が高まったことなどを受けて下落（円高）しました。8月上旬に米大統領による対中追加関税の発動表明を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから主要通貨は対円で下落（円高）しました。9月以降は、米中貿易協議の進展への期待などを受け投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

「S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）」の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数」の中で、銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の資金流出入や「S&P先進国REIT指数」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、実質REIT組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+19.7%となり、ベンチマークの+20.2%を0.5ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

- ①コスト負担（当ファンドでかかる売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

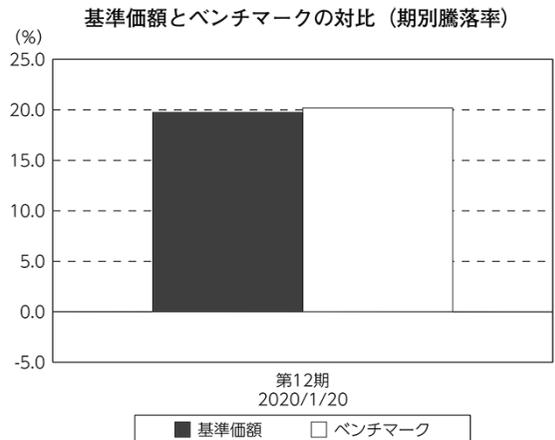
(その他の要因)

- ①J-REITの評価時価による差異（ファンド評価に使用される価格とベンチマークの価格に日時差があり異なるため）
- ②為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）
- ③ファンドの実質的な保有キャッシュ部分はベンチマークの動きをとらえられないこと

◎今後の運用方針

引き続き、「S&P先進国REIT指数（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。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



(注) ベンチマークは、S&P 先進国 REIT 指数（配当込み、円換算ベース）です。

○1万口当たりの費用明細

(2019年1月22日～2020年1月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|-----------------------------|---|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 円 2 (0) (2) (0) | % 0.010 (0.000) (0.009) (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) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 1 (0) (1) | 0.007 (0.000) (0.007) | (b) 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 ※有価証券取引税は、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) | 4 (2) (1) | 0.019 (0.013) (0.006) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 7 | 0.036 | |
| 期中の平均基準価額は、18,805円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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

(2019年1月22日～2020年1月20日)

株式

| 外 国 | 買 付 | 買 付 | | 売 付 | |
|------|------|------|--------|------|-----|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| アメリカ | 百株 | 千米ドル | 百株 | 千米ドル | |
| | — | — | 1 | 2 | |
| | (64) | (40) | (0.01) | (—) | |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

*（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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 投資証券 | 92 | 10,000 | — | — |
| サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 132 | 15,945 | — | — |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 12 | 8,219 | 16 | 10,109 |
| MCUBS MidCity投資法人 投資証券 | 83 | 9,694 | 25 | 2,920 |
| 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 126 | 20,741 | 129 | 20,455 |
| 産業ファンド投資法人 投資証券 | 158 | 22,292 | 133 | 18,300 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 45 | 15,319 | 39 | 13,358 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 54 | 9,994 | 63 | 11,724 |
| アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 33 | 17,165 | 38 | 19,401 |
| GLP投資法人 投資証券 | 130 | 17,542 | 150 | 19,952 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 33 | 10,519 | 38 | 12,839 |
| 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 166 | 43,382 | 124 | 33,068 |
| 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 16 | 9,293 | 11 | 6,189 |
| Oneリート投資法人 投資証券 | — | — | 6 | 1,848 |
| イオンリート投資法人 投資証券 | 94 | 13,495 | 107 | 14,540 |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 79 | 14,700 | 83 | 15,384 |
| 日本リート投資法人 投資証券 | 38 | 16,884 | 37 | 16,288 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 342 | 6,350 | 515 | 9,627 |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 437 | 35,958 | 353 | 30,723 |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 29 | 3,913 | — | — |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 33 | 9,440 | 20 | 5,691 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 55 | 6,268 | — | — |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 115 | 14,039 | 48 | 4,969 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 320 | 55,359 | 297 | 52,605 |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 197 | 28,265 | 99 | 13,317 |
| スターアジア不動産投資法人 投資証券 | — | — | 14 | 1,635 |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券 | 3 | 376 | 18 | 2,397 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 54 | 19,109 | 23 | 8,769 |
| 投資法人みらい 投資証券 | 52 | 2,797 | 57 | 4,877 |
| | (441) | (—) | | |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券 | 46 | 16,230 | 25 | 7,639 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 13 | 1,782 | — | — |
| ザイマックス・リート投資法人 投資証券 | — | — | 9 | 1,206 |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券 | 50 | 5,852 | 21 | 2,717 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 138 | 15,425 | — | — |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 71 | 55,559 | 83 | 64,045 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 72 | 49,845 | 91 | 62,388 |
| 日本リートリアルファンド投資法人 投資証券 | 137 | 31,211 | 177 | 39,753 |
| オリックス不動産投資法人 投資証券 | 100 | 22,478 | 132 | 28,834 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 26 | 12,572 | 32 | 15,802 |
| プレミアム投資法人 投資証券 | 81 | 11,803 | 83 | 11,920 |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 15 | 2,807 | 58 | 10,944 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 35 | 4,459 | 18 | 2,703 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 155 | 30,325 | 160 | 30,510 |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | — | — | 17 | 3,366 |
| インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 526 | 31,733 | 423 | 24,573 |
| フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 29 | 13,233 | 35 | 15,891 |
| 平和不動産リート投資法人 投資証券 | — | — | 67 | 8,897 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|------------------------------|--------------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|-------------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 26 | 7,172 | 38 | 9,458 |
| | 福岡リート投資法人 投資証券 | — | — | 42 | 7,530 |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 10 | 8,369 | 14 | 11,218 |
| | いちごオフィスリート投資法人 投資証券 | — | — | 47 | 4,851 |
| | 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 9 | 7,232 | 9 | 7,149 |
| | 阪急阪神リート投資法人 投資証券 | 19 | 2,872 | 33 | 4,841 |
| | スターツプロシード投資法人 投資証券 | — | — | 8 | 1,601 |
| | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 123 | 32,778 | 80 | 22,640 |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 240 | 19,317 | 156 | 13,158 |
| | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券 | 79 | 8,308 | 96 | 9,207 |
| ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 69 | 11,747 | 96 | 16,048 | |
| 合計 | | 4,997 (441) | 840,191 (—) | 4,493 | 789,891 |
| 外国 | アメリカ | | 千米ドル | | 千米ドル |
| | ACADIA REALTY TRUST | 4,800 | 126 | 3,500 | 98 |
| | AGREE REALTY CORP | 4,400 | 299 | 1,500 | 105 |
| | ALEXANDERS INC | 60 | 22 | 770 | 266 |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9,600 | 1,477 | 5,000 | 726 |
| | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5,200 | 240 | 1,200 | 56 |
| | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 5,400 | 255 | 6,700 | 317 |
| | AMERICAN FINANCE TRUST INC | 22,000 | 302 | 2,000 | 22 |
| | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 10,500 | 263 | 14,100 | 347 |
| | AMERICOLD REALTY TRUST | 58,300 | 1,821 | 7,700 | 263 |
| | APARTMENT INVT&MGMT CO-A | — | — | 2,300 | 112 |
| | | (△ 60,000) | (△ 2,819) | | |
| | APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 6,815 (60,029) | 345 (2,911) | 9,244 | 474 |
| | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 13,800 | 221 | 17,500 | 280 |
| | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — | — | — | — |
| | | | | (—) | (2) |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 6,760 | 1,395 | 7,610 | 1,549 |
| | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | — | — | 2,000 | 24 |
| | BOSTON PROPERTIES | 6,500 | 874 | 12,200 | 1,603 |
| | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | — | — | 2,000 | 23 |
| | | | | (—) | (1) |
| | BRANDYWINE REALTY TRUST | 8,000 | 123 | 11,000 | 166 |
| | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 8,800 | 182 | 12,600 | 243 |
| | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 41,000 | 821 | 16,700 | 317 |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 6,000 | 621 | 5,600 | 583 |
| | CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 8,000 | 178 | 4,000 | 92 |
| | CHESAPEAKE LODGING TRUST | 900 | 25 | 2,200 (23,200) | 61 (628) |
| CITY OFFICE REIT INC | 5,000 | 65 | — | — | |
| COLONY CAPITAL INC | 25,000 | 125 | 28,000 | 153 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 3,400 | 71 | 4,700 | 100 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 700 | 29 | — | — | |
| CORESITE REALTY CORP | 1,900 | 218 | 1,900 | 219 | |
| CORECIVIC INC | 4,900 | 96 | 5,900 | 107 | |
| COREPOINT LODGING INC | 23,000 | 236 | 9,000 | 91 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 4,800 | 136 | 4,800 | 131 | |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------------|-----------------------|------------------|----------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| COUSINS PROPERTIES INC | 2,000 (△ 163,000) | 18 (△ 1,399) | 6,000 | 53 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 4,900 (56,693) | 193 (1,863) | 4,693 | 176 |
| CUBESMART | 10,200 | 333 | 9,900 | 324 |
| CYRUSONE INC | 6,400 | 386 | 5,000 | 326 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 6,000 | 64 | 12,000 | 124 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 9,700 | 1,153 | 10,900 | 1,298 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | — (94,000) | — (1,159) | — | — |
| DOUGLAS EMMETT INC | 6,900 | 293 | 7,200 | 296 |
| DUKE REALTY CORP | 17,600 | 582 | 17,900 | 571 |
| EPR PROPERTIES | 3,400 | 247 | 2,800 | 209 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 10,000 | 207 | 4,300 | 90 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 1,800 | 225 | 1,200 | 141 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 6,900 | 96 | 4,400 | 65 |
| EQUINIX INC | 33,930 | 19,284 | 820 | 450 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 3,500 | 115 | 4,900 | 161 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 5,200 (34,200) | 447 (—) | 4,500 | 477 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 17,100 | 1,358 | 28,400 | 2,307 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 24,200 | 513 | 4,600 | 69 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,500 | 1,045 | 4,210 | 1,260 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 5,700 | 598 | 5,900 | 623 |
| FARMLAND PARTNERS INC | — | — | 2,000 | 12 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 2,800 | 362 | 5,100 | 682 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 4,800 | 194 | 5,700 | 221 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 3,500 | 97 | 3,700 | 104 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 3,000 | 26 | 4,000 | 34 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | — | — | 1,000 | 10 |
| GEO GROUP INC/THE | 5,200 | 99 | 5,700 | 108 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 8,100 | 329 | 9,200 | 361 |
| GETTY REALTY CORP | 1,900 | 60 | 2,000 | 65 |
| GLADSTONE LAND CORP | 3,000 | 35 | 5,000 | 58 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 8,000 | 155 | 3,500 | 68 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 11,000 | 125 | 7,000 | 66 |
| HCP INC | 13,400 (△ 184,800) | 432 (△ 5,545) | 19,400 | 624 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 7,200 | 231 | 5,600 | 181 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 7,400 | 217 | 9,300 | 265 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 10,800 (184,800) | 364 (5,545) | 3,200 | 110 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | — | — | 1,400 | 20 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 2,700 | 127 | 4,100 | 182 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | — | — | 4,300 | 111 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 28,000 | 510 | 45,400 | 807 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 5,900 | 209 | 8,300 | 280 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 3,000 | 41 | 2,000 | 29 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 1,800 | 39 | 1,700 | 36 |
| INFREIT INC | — | — | — (15,400) | — (323) |

| 銘 柄 | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------------|-----------|--------|-----------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 1,300 | 138 | 200 | 26 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | — | — | 300 | 21 |
| INVITATION HOMES INC | 105,100 | 2,952 | 14,800 | 390 |
| IRON MOUNTAIN INC | 9,500 | 302 | 12,800 | 432 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 8,800 | 358 | 6,300 | 249 |
| KILROY REALTY CORP | 6,100 | 488 | 8,700 | 670 |
| KIMCO REALTY CORP | 13,200 | 259 | 18,600 | 355 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 3,300 | 60 | 3,400 | 57 |
| LTC PROPERTIES INC | 2,000 | 88 | 2,300 | 110 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 16,000 | 167 | 4,000 | 38 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 6,500 | 354 | 4,300 | 215 |
| LIFE STORAGE INC | 1,900 | 202 | 2,300 | 238 |
| MACERICH CO /THE | 2,400 | 72 | 1,600 | 69 |
| MAC-KALI REALTY CORP | 3,300 | 73 | 3,400 | 73 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | — | — | (11,910) | (129) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 74,500 | 1,433 | 19,300 | 358 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 5,200 | 640 | 6,300 | 750 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 7,000 | 96 | 6,000 | 83 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 2,200 | 179 | 1,900 | 159 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 8,000 | 434 | 5,300 | 288 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 2,700 | 84 | 2,200 | 64 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 3,000 | 23 | 4,000 | 29 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 1,300 | 56 | 600 | 27 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 1,600 | 26 | 6,500 | 109 |
| | | | (15,600) | (255) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME | 1,200 | 38 | 1,075 | 33 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 10,502 | 412 | 9,100 | 364 |
| | (2,798) | (105) | | |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 980 | 167 | 1,180 | 201 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 10,000 | 140 | 13,000 | 182 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 23,800 | 613 | 25,569 | 677 |
| | (14,569) | (375) | | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 4,300 | 122 | 4,400 | 129 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 3,000 | 20 | 5,000 | 28 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 6,500 | 116 | 7,100 | 125 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 5,900 | 124 | 7,600 | 155 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 4,400 | 81 | — | — |
| PROLOGIS INC | 30,000 | 2,472 | 36,200 | 2,852 |
| PUBLIC STORAGE | 7,020 | 1,567 | 8,440 | 1,934 |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 5,400 | 266 | 3,000 | 143 |
| RLJ LODGING TRUST | 2,700 | 48 | 5,800 | 102 |
| RPT REALTY | 3,000 | 44 | 2,000 | 29 |
| REALTY INCOME CORP | 23,600 | 1,706 | 15,100 | 1,095 |
| REGENCY CENTERS CORP | 7,800 | 507 | 10,700 | 711 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 3,000 | 51 | 4,700 | 84 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 6,000 | 81 | 8,000 | 104 |
| RETAIL VALUE INC | — | — | 600 | 22 |
| | (376) | (12) | | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 12,500 | 507 | 6,400 | 260 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2,500 | 217 | 2,000 | 163 |

外

国

| 銘柄 | 買付額 | | 売付額 | |
|--|------------|----------|------------|-----------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| SL GREEN REALTY CORP | 3,800 | 336 | 6,300 | 546 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 14,200 | 300 | 10,700 | 231 |
| SAFEHOLD INC | 3,600 | 119 | 2,600 | 78 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 6,000 | 47 | 7,000 | 76 |
| | | | (94,000) | (1,196) |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 2,400 | 98 | — | — |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 3,200 | 77 | 600 | 14 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 14,860 | 2,356 | 19,230 | 3,175 |
| SITE CENTERS CORP | 7,000 | 101 | 8,000 | 112 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 9,100 | 433 | 4,400 | 196 |
| SPIRIT MTA REIT | — | — | 16,500 | 142 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 15,000 | 448 | 6,700 | 197 |
| STORE CAPITAL CORP | 12,600 | 444 | 5,800 | 195 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 4,000 | 49 | 3,000 | 37 |
| SUN COMMUNITIES INC | 5,100 | 712 | 3,500 | 473 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 10,000 | 138 | 13,000 | 178 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 3,000 | 45 | 3,100 | 56 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 3,100 | 117 | 3,300 | 148 |
| TERRENO REALTY CORP | 5,700 | 272 | 3,200 | 145 |
| TIER REIT INC | 1,000 | 27 | 900 | 25 |
| | (△ 21,400) | (△ 463) | | |
| UDR INC | 13,200 | 606 | 9,300 | 422 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 400 | 46 | 300 | 34 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 5,700 | 108 | 5,800 | 114 |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 1,500 | 36 | 1,200 | 28 |
| VENTAS INC | 23,600 | 1,520 | 21,100 | 1,387 |
| VEREIT INC | 75,000 | 711 | 49,000 | 439 |
| VICI PROPERTIES INC | 49,300 | 1,120 | 13,900 | 313 |
| VORNADO REALTY TRUST | 5,800 | 382 | 13,700 | 887 |
| WP CAREY INC | 12,000 | 961 | 9,400 | 776 |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 1,800 | 52 | 2,500 | 67 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 3,700 | 111 | 4,100 | 117 |
| WELLTOWER INC | 28,300 | 2,315 | 20,500 | 1,706 |
| WHITESTONE REIT | 2,000 | 26 | 2,000 | 27 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 5,800 | 122 | 6,900 | 142 |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 240,000 | 130 | — | — |
| PRIME US REIT | 110,000 | 107 | — | — |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 190,000 | 168 | — | — |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 100,000 | 90 | 80,000 | 70 |
| | (25,802) | (8) | | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV RTS | — | — | — | — |
| | (25,802) | (22) | (25,802) | (0.92487) |
| 小計 | 2,056,727 | 73,955 | 1,169,541 | 48,817 |
| | (69,869) | (1,776) | (185,912) | (2,537) |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN | — | — | — | — |
| | | | (4,850) | (69) |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 5,200 | 257 | 2,900 | 144 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 5,000 | 58 | 6,000 | 74 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 15,000 | 222 | 14,000 | 212 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|------------------------------|--|---------------------|---------------------|----------------|--------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8,300 | 425 | 4,100 | 205 |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 8,000 | 110 | 2,000 | 27 |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 3,000 | 42 | 6,000 | 80 |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 2,800 | 87 | 2,700 | 78 |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 9,000 | 102 | 7,000 | 74 |
| | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | — | — | 38,000 | 635 |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | 43,000 | 871 | — | — |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 2,000 | 130 | — | — |
| | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 5,000 | 106 | 4,000 | 91 |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 2,000 | 28 | — | — |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 7,000 | 132 | 4,000 | 74 |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 5,200 | 110 | — | — |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 14,000 | 164 | 11,000 | 123 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7,400 | 199 | 5,300 | 139 |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 21,000 | 269 | 16,000 | 203 |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | — | — | — | — |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | (Δ 11,000) | (Δ 68) | — | — |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | — | — | — | — | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | (11,000) | (68) | — | — | |
| 小計 | 162,900 | 3,320 | 123,000 (4,850) | 2,165 (69) | |
| 国 | イギリス | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| | BRITISH LAND | 42,000 | 246 | 63,000 | 360 |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | — | — | — | — |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | (Δ 220,000) | (Δ 65) | — | — |
| | DERWENT LONDON PLC | 3,700 | 138 | 6,500 | 214 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 15,000 | 158 | 17,000 | 169 |
| | HAMMERSON PLC | 34,000 | 116 | 35,000 | 119 |
| | UNITE GROUP PLC | 50,000 | 590 | 14,000 | 141 |
| | SHAFTESBURY PLC | 4,000 | 37 | 10,000 | 87 |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 70,000 | 39 | 90,000 | 51 |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 210,000 | 186 | — | — |
| | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 140,000 | 120 | 50,000 | 43 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 33,000 | 219 | 39,000 | 252 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 105,000 | 225 | 41,000 | 90 |
| | SEGRO PLC | 75,000 | 582 | 51,000 | 391 |
| | WORKSPACE GROUP PLC | — | — | 2,000 | 19 |
| | RDI REIT PLC | — | — | — | — |
| | RDI REIT PLC | (Δ 520,640) | (Δ 151) | — | — |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 50,000 | 45 | 43,000 | 36 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 5,000 | 38 | 23,206 | 172 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 163,000 | 236 | 166,000 | 233 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | (74,869) | (103) | — | — | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC-RTS | — | — | — | — | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC-RTS | (74,869) | (97) | (74,869) | (6) | |
| RDI REIT PLC | — | — | — | — | |
| RDI REIT PLC | (104,128) | (151) | — | — | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | — | — | — | — | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | (22,000) | (65) | — | — | |

| 銘 柄 | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------|-------------|------------|------------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| イギリス | 口 | 千英ポンド | 口 | 千英ポンド |
| ASSURA PLC | 220,000 | 143 | 250,000 | 156 |
| AEW UK REIT PLC | 50,000 | 46 | — | — |
| LXI REIT PLC | 60,000 | 76 | 40,000 | 50 |
| LXI REIT PLC-RTS | (34,335) | (43) | — | — |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | (34,335) | (40) | (34,335) | (3) |
| REGIONAL REIT LTD | 243,000 | 322 | 98,000 | 124 |
| REGIONAL REIT LTD - RTS | 40,000 | 42 | — | — |
| REGIONAL REIT LTD - RTS | (—) | (0.22288) | — | — |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | (14,375) | (15) | (14,375) | (0.22288) |
| 小 計 | 22,000 | 206 | 31,000 | 270 |
| | 1,634,700 | 3,822 | 1,069,706 | 2,986 |
| | (△ 381,729) | (300) | (123,579) | (9) |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| ドイツ | | | | |
| HAMBORNER REIT AG | — | — | 7,000 | 65 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 7,900 | 118 | 9,100 | 128 |
| | (—) | (△ 31) | — | — |
| 小 計 | 7,900 | 118 | 16,100 | 193 |
| | (—) | (△ 31) | — | — |
| イタリア | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | — | — | — | — |
| | (—) | (△0.26953) | — | — |
| 小 計 | — | — | — | — |
| | (—) | (△0.26953) | — | — |
| フランス | | | | |
| ICADE | 2,500 | 205 | 9,500 | 761 |
| ALTAREA | — | — | — | — |
| | (—) | (△ 16) | — | — |
| KLEPIERRE | 9,900 | 317 | 11,200 | 347 |
| GECINA SA | 1,460 | 225 | 1,950 | 273 |
| COVIVIO | 3,700 | 356 | 11,400 | 1,086 |
| | (3,215) | (277) | — | — |
| MERCIALYS | 2,600 | 34 | 14,000 | 173 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 6,600 | 918 | 8,340 | 1,175 |
| COVIVIO | — | — | — | — |
| | — | — | (3,215) | (277) |
| 小 計 | 26,760 | 2,057 | 56,390 | 3,816 |
| | (3,215) | (261) | (3,215) | (277) |
| オランダ | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA | 1,500 | 35 | 3,000 | 78 |
| VASTNED RETAIL NV | 2,100 | 58 | — | — |
| NSI NV | — | — | 800 | 31 |
| 小 計 | 3,600 | 93 | 3,800 | 109 |
| スペイン | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 15,000 | 157 | 28,421 | 289 |
| | (—) | (△ 13) | — | — |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 4,000 | 32 | 7,705 | 61 |
| | (—) | (△ 1) | — | — |

| 銘 柄 | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|------------|-----------|------------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| スペイン | 口 | 千ユーロ | 口 | 千ユーロ |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 11,000 | 139 | 16,000 | 195 |
| | (-) | (△ 13) | | |
| 小 計 | 30,000 | 329 | 52,126 | 546 |
| | (-) | (△ 29) | | |
| ベルギー | | | | |
| BEFIMMO S. C. A. | 700 | 35 | 1,600 | 84 |
| COFINIMMO | 2,100 | 254 | 1,000 | 123 |
| RETAIL ESTATES | 1,300 | 115 | - | - |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 1,000 | 21 | 2,002 | 42 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 850 | 139 | 360 | 60 |
| | (△ 7,290) | (△ 929) | | |
| MONTEA | 2,700 | 212 | 1,800 | 133 |
| | (554) | (34) | | |
| MONTEA-RTS | - | - | - | - |
| | (2,500) | (-) | (2,500) | (2) |
| AEDIFICA | 1,200 | 121 | 1,200 | 116 |
| | (2,300) | (178) | | |
| AEDIFICA RIGHTS | - | - | - | - |
| | (6,900) | (-) | (6,900) | (22) |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | - | - | - | - |
| | (51,030) | (929) | | |
| 小 計 | 9,850 | 900 | 7,962 | 560 |
| | (55,994) | (212) | (9,400) | (25) |
| アイルランド | | | | |
| GREEN REIT PLC | 34,000 | 60 | 78,000 | 132 |
| | | | (234,000) | (346) |
| HIBERNIA REIT PLC | 29,000 | 41 | 40,000 | 54 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 31,000 | 54 | - | - |
| 小 計 | 94,000 | 155 | 118,000 | 187 |
| | | | (234,000) | (346) |
| ユ ー ロ 計 | 172,110 | 3,655 | 254,378 | 5,415 |
| | (59,209) | (413) | (246,615) | (649) |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 88,000 | 7,736 | 125,000 | 11,052 |
| PROSPERITY REIT | 120,000 | 393 | 150,000 | 485 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 80,000 | 424 | - | - |
| CHAMPION REIT | 80,000 | 407 | 40,000 | 203 |
| FORTUNE REIT | 50,000 | 516 | 80,000 | 777 |
| 小 計 | 418,000 | 9,478 | 395,000 | 12,519 |
| シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| CAPITALAND MALL TRUST | 101,000 | 253 | 107,000 | 269 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 133,000 | 399 | 144,000 | 427 |
| | (151,040) | (424) | | |
| ASCENDAS REAL ESTATE-RTS | - | - | - | - |
| | (151,040) | (397) | (151,040) | (47) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 100,000 | 203 | 80,000 | 161 |
| SUNTEC REIT | 150,000 | 287 | 110,000 | 212 |
| | (-) | (△ 10) | | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 430,000 | 703 | 170,000 | 268 |
| | (-) | (△ 16) | | |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---------|---|--------------|-----------|-------------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| シンガポール | | 口 | 千シンガポールドル | 口 | 千シンガポールドル |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | — | — | — | — |
| | | (724,144) | (806) | — | — |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 360,000 | 196 | — | — |
| | | (584,067) | (282) | — | — |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | — | — | 60,000 | 44 |
| | | (—) | (△ 8) | — | — |
| | KEPPEL DC REIT | 100,000 | 176 | 60,000 | 86 |
| | | (38,853) | (75) | — | — |
| | KEPPEL DC REIT-RIGHTS | — | — | — | — |
| | | (38,853) | (66) | (38,853) | (9) |
| | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | — | — | 70,000 | 80 |
| | | (—) | (△ 14) | — | — |
| 小計 | | 2,586,600 | 3,900 | 1,710,000 | 2,626 |
| | | (1,995,205) | (2,326) | (1,563,496) | (1,180) |
| 韓国 | | | 千ウォン | | 千ウォン |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 11,000 | 66,832 | — | — |
| 小計 | | 11,000 | 66,832 | — | — |
| オーストラリア | | | 千豪ドル | | 千豪ドル |
| | BWP TRUST | 16,000 | 59 | 36,000 | 135 |
| | MIRVAC GROUP | 234,000 | 746 | 170,000 | 505 |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 100,000 | 120 | 60,000 | 72 |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 12,000 | 53 | 18,000 | 80 |
| | GPT GROUP | 173,000 | 1,041 | 145,000 | 870 |
| | ABACUS PROPERTY GROUP | 8,000 | 33 | — | — |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 66,000 | 317 | 91,000 | 392 |
| | DEXUS | 57,000 | 707 | 38,000 | 465 |
| | GOODMAN GROUP | 65,000 | 907 | 86,000 | 1,155 |
| | ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | — | — | — | — |
| | | — | — | (23,830) | (—) |
| | CHARTER HALL GROUP | 20,000 | 226 | 20,000 | 214 |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 15,000 | 72 | — | — |
| | | (8,865) | (35) | — | — |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP RIGHTS | — | — | — | — |
| | | (8,865) | (34) | (8,865) | (0.70185) |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 99,000 | 257 | 85,000 | 215 |
| | ARENA REIT | 26,000 | 71 | 14,000 | 39 |
| | PROPERTYLINK GROUP | — | — | 170,000 | 197 |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 104,000 | 538 | 28,000 | 138 |
| | | (16,768) | (93) | — | — |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT RTS | — | — | — | — |
| | | (23,612) | (126) | (23,612) | (4) |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 110,000 | 202 | 30,000 | 52 |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 42,000 | 152 | 32,000 | 114 |
| | SCENTRE GROUP | 328,000 | 1,287 | 396,000 | 1,558 |
| | CENTURIA METROPOLITAN REIT | 158,000 | 474 | — | — |
| | VICINITY CENTRES | 87,000 | 225 | 111,000 | 284 |
| 小計 | | 1,720,000 | 7,498 | 1,530,000 | 6,495 |
| | | (58,110) | (289) | (56,307) | (5) |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | | |
|-----|---------------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 | |
| 外 国 | ニュージーランド | 口 | 千ニュージーランドドル | 口 | 千ニュージーランドドル |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 40,000 | 60 | 50,000 | 74 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | — | — | 16,000 | 43 |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 50,000 | 111 | — | — |
| | STRIDE STAPLED GROUP | — | — | 141,080 | 318 |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 180,000 | 286 | 150,000 | 230 |
| 小 計 | 270,000 | 458 | 357,080 | 667 | |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、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 REIT先物取引 | 百万円 160 | 百万円 161 | 百万円 — | 百万円 — |
| 外国 REIT先物取引 | 2,472 | 2,365 | — | — |

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2019年1月22日～2020年1月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 257千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 260千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.98 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月22日～2020年1月20日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
|--------|---------------|--------------------|----------|--------------|--------------------|----------|
| | | | | | | |
| 投資信託証券 | 百万円 11,213 | 百万円 41 | % 0.4 | 百万円 8,296 | 百万円 36 | % 0.4 |
| 為替直物取引 | 7,996 | 83 | 1.0 | 7,064 | 86 | 1.2 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2020年1月20日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|-----------------------------|---------|-------|-------|--------|-------------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外貨建金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| FIVE STAR SENIOR LIVING INC | — | 63 | 32 | 3,572 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 合 計 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 評 価 額 | |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | — | 63 | 32 | 3,572 | |
| | — | 1 | — | <0.0%> | |

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

*邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

*株数・評価額の単位未満は切り捨て。

*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。

国内投資信託証券

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|-------------------------|------|---------|-------|---------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| エスコンジャパンリート投資法人 | 投資証券 | — | 92 | 12,199 | 0.0 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 投資証券 | — | 132 | 17,292 | 0.0 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 投資証券 | 194 | 190 | 129,200 | 0.2 |
| MCUBS Midcity投資法人 | 投資証券 | 642 | 700 | 85,050 | 0.1 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 投資証券 | 630 | 627 | 112,734 | 0.2 |
| 産業ファンド投資法人 | 投資証券 | 680 | 705 | 117,382 | 0.2 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 投資証券 | 536 | 542 | 185,093 | 0.3 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 投資証券 | 349 | 340 | 71,978 | 0.1 |
| アクティブア・プロパティーズ投資法人 | 投資証券 | 280 | 275 | 147,675 | 0.2 |
| GLP投資法人 | 投資証券 | 1,520 | 1,500 | 202,800 | 0.3 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 投資証券 | 235 | 230 | 80,960 | 0.1 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 投資証券 | 876 | 918 | 262,548 | 0.4 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 投資証券 | 84 | 89 | 52,777 | 0.1 |
| Oneリート投資法人 | 投資証券 | 96 | 90 | 31,590 | 0.0 |
| イオンリート投資法人 | 投資証券 | 604 | 591 | 89,300 | 0.1 |
| ヒューリックリート投資法人 | 投資証券 | 445 | 441 | 87,141 | 0.1 |
| 日本リート投資法人 | 投資証券 | 177 | 178 | 85,529 | 0.1 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 投資証券 | 3,513 | 3,340 | 75,884 | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 投資証券 | 1,515 | 1,599 | 145,349 | 0.2 |
| トーセイ・リート投資法人 | 投資証券 | 104 | 133 | 17,941 | 0.0 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 投資証券 | 200 | 213 | 58,170 | 0.1 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 投資証券 | 66 | 121 | 16,891 | 0.0 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 投資証券 | 141 | 208 | 24,232 | 0.0 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 投資証券 | 1,731 | 1,754 | 326,419 | 0.5 |
| いちごホテルリート投資法人 | 投資証券 | 100 | 100 | 13,710 | 0.0 |
| ラサールレジポート投資法人 | 投資証券 | 440 | 538 | 87,048 | 0.1 |
| スターアジア不動産投資法人 | 投資証券 | 217 | 203 | 23,629 | 0.0 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 投資証券 | 53 | 38 | 4,886 | 0.0 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 投資証券 | 96 | 127 | 63,500 | 0.1 |

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------------|---------|--------|-----------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 口 | 口 | 千円 | % |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 投資証券 | 93 | 93 | 8,732 | 0.0 |
| さくら総合リート投資法人 | 投資証券 | 129 | 129 | 12,422 | 0.0 |
| 投資法人みらい | 投資証券 | 160 | 596 | 36,832 | 0.1 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 投資証券 | 130 | 130 | 19,942 | 0.0 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 投資証券 | 102 | 123 | 44,587 | 0.1 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 投資証券 | 86 | 99 | 14,355 | 0.0 |
| ザイマックス・リート投資法人 | 投資証券 | 90 | 81 | 11,340 | 0.0 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 投資証券 | 126 | 155 | 19,654 | 0.0 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 投資証券 | — | 138 | 17,067 | 0.0 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 投資証券 | 562 | 550 | 454,850 | 0.7 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 投資証券 | 554 | 535 | 398,040 | 0.6 |
| 日本リートリアルエステイト投資法人 | 投資証券 | 1,049 | 1,009 | 237,619 | 0.4 |
| オリックス不動産投資法人 | 投資証券 | 1,096 | 1,064 | 251,423 | 0.4 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 投資証券 | 368 | 362 | 175,389 | 0.3 |
| プレミア投資法人 | 投資証券 | 521 | 519 | 80,704 | 0.1 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 投資証券 | 392 | 349 | 72,801 | 0.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 投資証券 | 344 | 361 | 50,467 | 0.1 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 投資証券 | 1,224 | 1,219 | 248,188 | 0.4 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 投資証券 | 379 | 362 | 70,807 | 0.1 |
| インヴェンシブル投資法人 | 投資証券 | 2,288 | 2,391 | 148,481 | 0.2 |
| フロンティア不動産投資法人 | 投資証券 | 198 | 192 | 87,552 | 0.1 |
| 平和不動産リート投資法人 | 投資証券 | 398 | 331 | 45,280 | 0.1 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 投資証券 | 369 | 357 | 100,459 | 0.2 |
| 福岡リート投資法人 | 投資証券 | 314 | 272 | 51,054 | 0.1 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 投資証券 | 172 | 168 | 140,952 | 0.2 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 投資証券 | 622 | 575 | 66,067 | 0.1 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 投資証券 | 120 | 120 | 100,920 | 0.2 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 投資証券 | 277 | 263 | 44,657 | 0.1 |
| スターツプロシード投資法人 | 投資証券 | 91 | 83 | 16,956 | 0.0 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 投資証券 | 688 | 731 | 205,337 | 0.3 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 投資証券 | 1,666 | 1,750 | 143,150 | 0.2 |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 投資証券 | 667 | 650 | 68,900 | 0.1 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 投資証券 | 517 | 490 | 90,503 | 0.1 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 31,316 | 32,261 | 6,164,411 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 59 | 62 | < 9.4% > | |

*評価額の単位未満は切り捨て。

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*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。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | 32,700 | 34,000 | 866 | 95,459 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 13,600 | 16,500 | 1,196 | 131,887 | 0.2 |
| ALEXANDERS INC | 1,500 | 790 | 275 | 30,408 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 43,000 | 47,600 | 7,754 | 854,417 | 1.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 14,800 | 18,800 | 880 | 97,011 | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 54,500 | 53,200 | 2,464 | 271,591 | 0.4 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 22,000 | 42,000 | 555 | 61,158 | 0.1 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 102,300 | 98,700 | 2,659 | 293,101 | 0.4 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 23,700 | 74,300 | 2,631 | 289,987 | 0.4 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 62,300 | — | — | — | — |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | — | 57,600 | 3,038 | 334,801 | 0.5 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 85,700 | 82,000 | 1,309 | 144,298 | 0.2 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 35,000 | 35,000 | 95 | 10,567 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 55,180 | 54,330 | 11,739 | 1,293,529 | 2.0 |
| BRT APARTMENTS CORP | 4,000 | 4,000 | 71 | 7,863 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 9,000 | 7,000 | 84 | 9,317 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES | 61,700 | 56,000 | 7,815 | 861,174 | 1.3 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 13,000 | 11,000 | 98 | 10,811 | 0.0 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 72,000 | 69,000 | 1,091 | 120,281 | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 119,200 | 115,400 | 2,392 | 263,601 | 0.4 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | — | 24,300 | 481 | 53,097 | 0.1 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 71,000 | 71,000 | 73 | 8,136 | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 37,300 | 37,700 | 4,145 | 456,833 | 0.7 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 33,600 | 37,600 | 801 | 88,290 | 0.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 36,000 | 36,000 | 100 | 11,107 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 18,000 | 18,000 | 325 | 35,840 | 0.1 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 24,500 | — | — | — | — |
| CITY OFFICE REIT INC | 16,000 | 21,000 | 292 | 32,187 | 0.0 |
| CLIPPER REALTY INC | 6,000 | 6,000 | 64 | 7,100 | 0.0 |
| COLONY CAPITAL INC | 194,000 | 191,000 | 928 | 102,284 | 0.2 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 47,100 | 45,800 | 1,012 | 111,582 | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 6,900 | 7,600 | 343 | 37,885 | 0.1 |
| CORESITE REALTY CORP | 14,600 | 14,600 | 1,716 | 189,111 | 0.3 |
| CORECIVIC INC | 47,600 | 46,600 | 754 | 83,184 | 0.1 |
| COREPOINT LODGING INC | — | 14,000 | 147 | 16,290 | 0.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 43,600 | 43,600 | 1,307 | 144,080 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 167,000 | — | — | — | — |
| COUSINS PROPERTIES INC | — | 56,900 | 2,373 | 261,513 | 0.4 |
| CUBESMART | 74,700 | 75,000 | 2,361 | 260,158 | 0.4 |
| CYRUSONE INC | 42,400 | 43,800 | 2,780 | 306,423 | 0.5 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 84,000 | 78,000 | 822 | 90,589 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 82,400 | 81,200 | 10,104 | 1,113,417 | 1.7 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | — | 94,000 | 786 | 86,695 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 64,100 | 63,800 | 2,697 | 297,233 | 0.5 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| DUKE REALTY CORP | 143,300 | 143,000 | 5,100 | 562,058 | 0.9 |
| EPR PROPERTIES | 29,800 | 30,400 | 2,205 | 242,992 | 0.4 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 23,600 | 29,300 | 689 | 75,968 | 0.1 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 14,300 | 14,900 | 2,020 | 222,599 | 0.3 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 56,500 | 59,000 | 830 | 91,472 | 0.1 |
| EQUINIX INC | — | 33,110 | 19,468 | 2,145,253 | 3.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 48,800 | 47,400 | 1,556 | 171,471 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 35,900 | 70,800 | 4,992 | 550,158 | 0.8 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 147,100 | 135,800 | 11,203 | 1,234,513 | 1.9 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 15,000 | 34,600 | 892 | 98,364 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 26,390 | 25,680 | 7,931 | 874,003 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 50,600 | 50,400 | 5,622 | 619,556 | 0.9 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 13,300 | 11,300 | 75 | 8,330 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 29,500 | 27,200 | 3,523 | 388,223 | 0.6 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 50,100 | 49,200 | 2,109 | 232,467 | 0.4 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 27,200 | 27,000 | 771 | 85,058 | 0.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 42,000 | 41,000 | 326 | 35,961 | 0.1 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 20,000 | 19,000 | 228 | 25,186 | 0.0 |
| GEO GROUP INC/THE | 48,500 | 48,000 | 772 | 85,154 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 80,000 | 78,900 | 3,593 | 396,011 | 0.6 |
| GETTY REALTY CORP | 13,700 | 13,600 | 442 | 48,733 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 11,300 | 11,300 | 252 | 27,853 | 0.0 |
| GLADSTONE LAND CORP | 8,000 | 6,000 | 80 | 8,879 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 30,700 | 35,200 | 720 | 79,357 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 12,000 | 16,000 | 236 | 26,092 | 0.0 |
| HCP INC | 190,800 | — | — | — | — |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 50,300 | 51,900 | 1,793 | 197,586 | 0.3 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 82,200 | 80,300 | 2,494 | 274,826 | 0.4 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | — | 192,400 | 6,974 | 768,520 | 1.2 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 14,400 | 13,000 | 180 | 19,911 | 0.0 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 41,600 | 40,200 | 2,029 | 223,608 | 0.3 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 65,600 | — | — | — | — |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 296,500 | 279,100 | 4,990 | 549,882 | 0.8 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 62,500 | 60,100 | 2,228 | 245,559 | 0.4 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 35,000 | 36,000 | 533 | 58,748 | 0.1 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 25,700 | 25,800 | 583 | 64,334 | 0.1 |
| INFREIT INC | 15,400 | — | — | — | — |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 3,700 | 4,800 | 396 | 43,635 | 0.1 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 4,600 | 4,300 | 316 | 34,887 | 0.1 |
| INVITATION HOMES INC | 119,000 | 209,300 | 6,381 | 703,183 | 1.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | 114,400 | 111,100 | 3,486 | 384,157 | 0.6 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 43,300 | 45,800 | 1,859 | 204,896 | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP | 40,300 | 37,700 | 3,102 | 341,887 | 0.5 |
| KIMCO REALTY CORP | 168,800 | 163,400 | 3,312 | 364,962 | 0.6 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 33,200 | 33,100 | 604 | 66,563 | 0.1 |
| LTC PROPERTIES INC | 16,000 | 15,700 | 733 | 80,824 | 0.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 85,000 | 97,000 | 1,058 | 116,610 | 0.2 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|-------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 58,800 | 61,000 | 3,876 | 427,157 | 0.7 |
| LIFE STORAGE INC | 18,500 | 18,100 | 2,062 | 227,226 | 0.3 |
| MACERICH CO /THE | 42,100 | 42,900 | 1,105 | 121,771 | 0.2 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 35,700 | 35,600 | 838 | 92,420 | 0.1 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 11,910 | — | — | — | — |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 146,400 | 201,600 | 4,493 | 495,156 | 0.8 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 45,500 | 44,400 | 5,949 | 655,537 | 1.0 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 37,000 | 38,000 | 557 | 61,384 | 0.1 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 16,800 | 17,100 | 1,434 | 158,088 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 63,700 | 66,400 | 3,674 | 404,901 | 0.6 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 22,900 | 23,400 | 817 | 90,116 | 0.1 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 33,000 | 32,000 | 253 | 27,961 | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 8,300 | 9,000 | 424 | 46,828 | 0.1 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 20,500 | — | — | — | — |
| OFFICE PROPERTIES INCOME | 18,875 | 19,000 | 650 | 71,727 | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 80,300 | 84,500 | 3,655 | 402,796 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 5,600 | 5,600 | 157 | 17,339 | 0.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 8,000 | 7,800 | 1,332 | 146,842 | 0.2 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 81,000 | 78,000 | 1,095 | 120,757 | 0.2 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 79,900 | 92,700 | 2,296 | 253,015 | 0.4 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 50,900 | 50,800 | 1,308 | 144,139 | 0.2 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 26,000 | 24,000 | 121 | 13,355 | 0.0 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 72,700 | 72,100 | 1,385 | 152,697 | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 50,700 | 49,000 | 1,140 | 125,641 | 0.2 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | — | 4,400 | 81 | 8,935 | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 16,300 | 16,300 | 218 | 24,031 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 251,500 | 245,300 | 23,124 | 2,548,081 | 3.9 |
| PUBLIC STORAGE | 59,850 | 58,430 | 12,898 | 1,421,277 | 2.2 |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 20,200 | 22,600 | 1,250 | 137,837 | 0.2 |
| RLJ LODGING TRUST | 69,800 | 66,700 | 1,132 | 124,797 | 0.2 |
| RPT REALTY | 31,000 | 32,000 | 469 | 51,692 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 117,900 | 126,400 | 9,650 | 1,063,404 | 1.6 |
| REGENCY CENTERS CORP | 67,700 | 64,800 | 4,095 | 451,267 | 0.7 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 45,600 | 43,900 | 756 | 83,371 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 86,000 | 84,000 | 1,102 | 121,438 | 0.2 |
| RETAIL VALUE INC | 5,960 | 5,736 | 203 | 22,393 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 36,900 | 43,000 | 2,053 | 226,247 | 0.3 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 20,600 | 21,100 | 1,831 | 201,764 | 0.3 |
| SL GREEN REALTY CORP | 34,100 | 31,600 | 2,883 | 317,698 | 0.5 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 71,700 | 75,200 | 1,656 | 182,546 | 0.3 |
| SAFEHOLD INC | — | 4,800 | 201 | 22,219 | 0.0 |
| SAFETY INCOME & GROWTH INC | 3,800 | — | — | — | — |
| SAUL CENTERS INC | 4,500 | 4,500 | 241 | 26,617 | 0.0 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 95,000 | — | — | — | — |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 10,900 | 13,300 | 538 | 59,353 | 0.1 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | — | 63,900 | 1,528 | 168,424 | 0.3 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 123,570 | 119,200 | 17,614 | 1,940,906 | 3.0 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|-----------|-----------|-----------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % | |
| SITE CENTERS CORP | 59,000 | 58,000 | 772 | 85,128 | 0.1 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 34,000 | 38,700 | 1,989 | 219,273 | 0.3 | |
| SPIRIT MTA REIT | 16,500 | — | — | — | — | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 43,300 | 51,600 | 1,674 | 184,561 | 0.3 | |
| STORE CAPITAL CORP | 75,900 | 82,700 | 3,133 | 345,280 | 0.5 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 41,000 | 42,000 | 508 | 56,044 | 0.1 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 34,400 | 36,000 | 5,577 | 614,542 | 0.9 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 91,000 | 88,000 | 1,196 | 131,875 | 0.2 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 37,100 | 37,000 | 568 | 62,663 | 0.1 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 24,300 | 24,100 | 770 | 84,872 | 0.1 | |
| TERRENO REALTY CORP | 23,600 | 26,100 | 1,491 | 164,332 | 0.3 | |
| TIER REIT INC | 21,300 | — | — | — | — | |
| UDR INC | 110,100 | 114,000 | 5,409 | 596,050 | 0.9 | |
| UMH PROPERTIES INC | 13,700 | 13,700 | 224 | 24,712 | 0.0 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 4,900 | 5,000 | 604 | 66,587 | 0.1 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 45,100 | 45,000 | 874 | 96,394 | 0.1 | |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 11,800 | 12,100 | 292 | 32,252 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 142,300 | 144,800 | 8,515 | 938,343 | 1.4 | |
| VEREIT INC | 387,000 | 413,000 | 3,948 | 435,060 | 0.7 | |
| VICI PROPERTIES INC | 144,200 | 179,600 | 4,718 | 519,886 | 0.8 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 69,200 | 61,300 | 4,119 | 453,912 | 0.7 | |
| WP CAREY INC | 64,400 | 67,000 | 5,570 | 613,800 | 0.9 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 72,000 | 72,000 | 267 | 29,513 | 0.0 | |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 32,200 | 31,500 | 965 | 106,350 | 0.2 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 47,400 | 47,000 | 1,456 | 160,443 | 0.2 | |
| WELLTOWER INC | 150,000 | 157,800 | 13,632 | 1,502,147 | 2.3 | |
| WHITESTONE REIT | 16,000 | 16,000 | 217 | 24,012 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 45,100 | 44,000 | 905 | 99,779 | 0.2 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | — | 240,000 | 128 | 14,148 | 0.0 | |
| PRIME US REIT | — | 110,000 | 106 | 11,757 | 0.0 | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | — | 190,000 | 164 | 18,109 | 0.0 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 506,197 | 551,999 | 546 | 60,216 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 8,992,832 | 9,763,975 | 392,665 | 43,267,851 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 157 | 158 | — | < 65.9% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN | 4,850 | — | — | — | — | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 20,800 | 23,100 | 1,258 | 106,101 | 0.2 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 29,000 | 28,000 | 336 | 28,338 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 8,900 | 8,900 | 429 | 36,255 | 0.1 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 20,000 | 21,000 | 343 | 28,993 | 0.0 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 28,500 | 32,700 | 1,820 | 153,505 | 0.2 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 52,969 | 58,969 | 870 | 73,457 | 0.1 | |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 36,000 | 33,000 | 483 | 40,802 | 0.1 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | 17,000 | 17,000 | 278 | 23,456 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 11,800 | 11,900 | 385 | 32,548 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 21,000 | 23,000 | 319 | 26,963 | 0.0 | |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 38,000 | — | — | — | — | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|--------------|---------|---------|---------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 口 | 口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | — | 43,000 | 915 | 77,210 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 8,800 | 10,800 | 752 | 63,442 | 0.1 | |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 55,000 | 56,000 | 1,204 | 101,545 | 0.2 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 20,000 | 22,000 | 363 | 30,633 | 0.0 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 15,000 | 18,000 | 355 | 29,982 | 0.0 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 3,000 | 8,200 | 196 | 16,611 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 7,100 | 7,100 | 135 | 11,395 | 0.0 | |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | 10,500 | 10,500 | 327 | 27,594 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 23,000 | 26,000 | 318 | 26,840 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 59,200 | 61,300 | 1,681 | 141,814 | 0.2 | |
| SLATE OFFICE REIT | 13,000 | 13,000 | 76 | 6,446 | 0.0 | |
| SLATE RETAIL REIT | 8,500 | 8,500 | 113 | 9,599 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 26,400 | 26,400 | 853 | 71,985 | 0.1 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 22,000 | 27,000 | 333 | 28,100 | 0.0 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 11,000 | — | — | — | — | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | — | 11,000 | 82 | 6,939 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 571,319 | 606,369 | 14,234 | 1,200,565 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 26 | 25 | — | < 1.8% > | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| BRITISH LAND | 388,000 | 367,000 | 2,157 | 309,127 | 0.5 | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 220,000 | — | — | — | — | |
| DERWENT LONDON PLC | 44,000 | 41,200 | 1,724 | 247,053 | 0.4 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 64,000 | 62,000 | 718 | 102,936 | 0.2 | |
| HAMMERSON PLC | 306,000 | 305,000 | 808 | 115,825 | 0.2 | |
| INTU PROPERTIES PLC | 335,000 | 335,000 | 76 | 10,970 | 0.0 | |
| UNITE GROUP PLC | 106,000 | 142,000 | 1,813 | 259,760 | 0.4 | |
| SHAFTESBURY PLC | 93,000 | 87,000 | 803 | 115,031 | 0.2 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 220,000 | 200,000 | 112 | 16,158 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | — | 210,000 | 211 | 30,323 | 0.0 | |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 166,000 | 166,000 | 193 | 27,726 | 0.0 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 260,000 | 350,000 | 304 | 43,669 | 0.1 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 85,000 | 79,000 | 611 | 87,535 | 0.1 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 269,000 | 333,000 | 779 | 111,623 | 0.2 | |
| SEGR0 PLC | 401,000 | 425,000 | 3,841 | 550,244 | 0.8 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 50,000 | 48,000 | 562 | 80,517 | 0.1 | |
| RDI REIT PLC | 520,640 | — | — | — | — | |
| NEWRRIVER REIT PLC | 121,000 | 121,000 | 234 | 33,557 | 0.1 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 253,000 | 260,000 | 263 | 37,691 | 0.1 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 130,000 | 130,000 | 131 | 18,901 | 0.0 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 114,206 | 96,000 | 893 | 128,058 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 601,000 | 672,869 | 952 | 136,389 | 0.2 | |
| RDI REIT PLC | — | 104,128 | 140 | 20,196 | 0.0 | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | — | 22,000 | 52 | 7,563 | 0.0 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 219,285 | 219,285 | 221 | 31,663 | 0.0 | |
| ASSURA PLC | 970,000 | 940,000 | 733 | 105,030 | 0.2 | |
| AEW UK REIT PLC | — | 50,000 | 50 | 7,269 | 0.0 | |
| LXI REIT PLC | 143,064 | 197,399 | 266 | 38,117 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | 比 率 | |
|---------------------------------|---------|--------------|-----------|-----------|---------|-----------|--|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | | 口 | 口 | 千英ポンド | 千円 | % | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | | 313,000 | 458,000 | 733 | 105,104 | 0.2 | |
| REGIONAL REIT LTD | | 115,000 | 155,000 | 179 | 25,711 | 0.0 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 301,000 | 292,000 | 2,862 | 410,007 | 0.6 | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 6,808,195 | 6,867,881 | 22,434 | 3,213,772 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 27 | 29 | — | < 4.9% > | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | | |
| HAMBORNER REIT AG | | 31,000 | 24,000 | 241 | 29,560 | 0.0 | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 63,600 | 62,400 | 1,065 | 130,206 | 0.2 | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 94,600 | 86,400 | 1,306 | 159,766 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | | 20,563 | 20,563 | 128 | 15,684 | 0.0 | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 20,563 | 20,563 | 128 | 15,684 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | | |
| ICADE | | 18,100 | 11,100 | 1,091 | 133,447 | 0.2 | |
| ALTAREA | | 1,390 | 1,390 | 281 | 34,407 | 0.1 | |
| KLEPIERRE | | 82,700 | 81,400 | 2,652 | 324,281 | 0.5 | |
| GECINA SA | | 21,800 | 21,310 | 3,545 | 433,461 | 0.7 | |
| COVIVIO | | 21,700 | 17,215 | 1,816 | 222,010 | 0.3 | |
| MERCIALYS | | 20,700 | 9,300 | 110 | 13,551 | 0.0 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 55,040 | 53,300 | 7,147 | 873,714 | 1.3 | |
| COVIVIO | | 3,215 | — | — | — | — | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 224,645 | 195,015 | 16,646 | 2,034,872 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 7 | — | < 3.1% > | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA | | 16,600 | 15,100 | 356 | 43,598 | 0.1 | |
| VASTNED RETAIL NV | | 6,170 | 8,270 | 208 | 25,525 | 0.0 | |
| WERELDHAVE NV | | 16,000 | 16,000 | 296 | 36,241 | 0.1 | |
| NSI NV | | 7,100 | 6,300 | 279 | 34,154 | 0.1 | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 45,870 | 45,670 | 1,141 | 139,520 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | 110,421 | 97,000 | 1,147 | 140,271 | 0.2 | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 26,705 | 23,000 | 157 | 19,230 | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 148,000 | 143,000 | 1,813 | 221,650 | 0.3 | |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 285,126 | 263,000 | 3,118 | 381,152 | |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.6% > | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | | |
| BEFIMMO S. C. A. | | 9,500 | 8,600 | 462 | 56,558 | 0.1 | |
| COFINIMMO | | 8,376 | 9,476 | 1,292 | 157,998 | 0.2 | |
| RETAIL ESTATES | | 2,916 | 4,216 | 362 | 44,321 | 0.1 | |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | | 9,502 | 8,500 | 229 | 28,002 | 0.0 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 6,800 | — | — | — | — | |
| MONTEA | | 2,500 | 3,954 | 335 | 41,035 | 0.1 | |
| AEDIFICA | | 7,400 | 9,700 | 1,158 | 141,575 | 0.2 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|-------------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | 口 | 口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | — | — | 51,030 | 1,239 | 151,487 | 0.2 |
| 小 計 | 口 数・金 額 | 46,994 | 95,476 | 5,079 | 620,978 | |
| | 銘柄 数<比 率> | 7 | 7 | — | <0.9%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| GREEN REIT PLC | 278,000 | — | — | — | — | — |
| HIBERNIA REIT PLC | 271,000 | 260,000 | 362 | 44,304 | 0.1 | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 137,570 | 168,570 | 262 | 32,104 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数・金 額 | 686,570 | 428,570 | 625 | 76,408 | |
| | 銘柄 数<比 率> | 3 | 2 | — | <0.1%> | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数・金 額 | 1,404,368 | 1,134,694 | 28,046 | 3,428,385 | |
| | 銘柄 数<比 率> | 28 | 26 | — | <5.2%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | 851,000 | 814,000 | 70,207 | 995,542 | 1.5 | |
| PROSPERITY REIT | 500,000 | 470,000 | 1,438 | 20,393 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 520,000 | 600,000 | 3,192 | 45,262 | 0.1 | |
| CHAMPION REIT | 780,000 | 820,000 | 4,157 | 58,951 | 0.1 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 390,000 | 390,000 | 2,008 | 28,480 | 0.0 | |
| FORTUNE REIT | 560,000 | 530,000 | 4,939 | 70,043 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数・金 額 | 3,601,000 | 3,624,000 | 85,943 | 1,218,674 | |
| | 銘柄 数<比 率> | 6 | 6 | — | <1.9%> | |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポールドル | | |
| CAPITALAND MALL TRUST | 1,117,000 | 1,111,000 | 2,888 | 236,200 | 0.4 | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 1,029,000 | 1,169,040 | 3,670 | 300,160 | 0.5 | |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,100,040 | 1,120,040 | 2,396 | 195,993 | 0.3 | |
| SUNTEC REIT | 880,000 | 920,000 | 1,729 | 141,429 | 0.2 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 920,000 | 1,180,000 | 2,135 | 174,644 | 0.3 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 560,000 | 520,000 | 384 | 31,465 | 0.0 | |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 500,000 | — | — | — | — | |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 290,000 | 260,000 | 436 | 35,717 | 0.1 | |
| KEPPEL REIT | 740,000 | 770,000 | 970 | 79,333 | 0.1 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 225,000 | 283,975 | 815 | 66,643 | 0.1 | |
| ESR REIT | 749,968 | 754,037 | 422 | 34,528 | 0.1 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 290,040 | 340,040 | 564 | 46,156 | 0.1 | |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 260,000 | 291,750 | 484 | 39,601 | 0.1 | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 228,100 | 228,100 | 228 | 18,651 | 0.0 | |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 148,000 | 148,000 | 500 | 40,904 | 0.1 | |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 740,000 | 740,000 | 166 | 13,614 | 0.0 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 507,000 | 603,000 | 1,700 | 139,046 | 0.2 | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 740,014 | 845,024 | 2,070 | 169,289 | 0.3 | |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 400,612 | 340,612 | 250 | 20,471 | 0.0 | |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 230,000 | 170,000 | 246 | 20,156 | 0.0 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 310,038 | 310,038 | 145 | 11,915 | 0.0 | |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 860,000 | 800,000 | 992 | 81,115 | 0.1 | |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 269,000 | — | — | — | — | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 347,600 | 347,600 | 271 | 22,170 | 0.0 | |
| SPH REIT | 246,100 | 316,100 | 347 | 28,432 | 0.0 | |
| QUE HOSPITALITY TRUST | 429,999 | — | — | — | — | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|---|--------------|------------|------------|-------------|-----------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | 口 | 口 | 千シンガポールドル | 千円 | % |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 280,000 | 330,400 | 178 | 14,589 | 0.0 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | — | 190,000 | 174 | 14,293 | 0.0 | |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | — | 724,144 | 984 | 80,530 | 0.1 | |
| OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I | — | 944,067 | 528 | 43,229 | 0.1 | |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 300,000 | 240,000 | 172 | 14,129 | 0.0 | |
| KEPPEL DC REIT | 390,030 | 468,883 | 1,073 | 87,799 | 0.1 | |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 650,000 | 580,000 | 707 | 57,860 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 15,737,541 | 17,045,850 | 27,639 | 2,260,073 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 30 | 30 | — | < 3.4% > | |
| (韓国) | | | | 千ウォン | | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | — | 11,000 | 82,720 | 7,858 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | — | 11,000 | 82,720 | 7,858 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | — | 1 | — | < 0.0% > | |
| (オーストラリア) | | | | 千豪ドル | | |
| BWP TRUST | 201,000 | 181,000 | 742 | 56,243 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 1,475,000 | 1,539,000 | 5,063 | 383,748 | 0.6 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 669,230 | 709,230 | 861 | 65,309 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 135,000 | 129,000 | 590 | 44,778 | 0.1 | |
| GPT GROUP | 722,000 | 750,000 | 4,425 | 335,370 | 0.5 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 126,520 | 134,520 | 507 | 38,436 | 0.1 | |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 972,000 | 947,000 | 4,744 | 359,583 | 0.5 | |
| DEXUS | 402,000 | 421,000 | 5,249 | 397,887 | 0.6 | |
| GOODMAN GROUP | 642,000 | 621,000 | 9,097 | 689,510 | 1.1 | |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 23,830 | — | — | — | — | |
| CHARTER HALL GROUP | 182,000 | 182,000 | 2,311 | 175,181 | 0.3 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 104,609 | 104,609 | 464 | 35,201 | 0.1 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 75,360 | 99,225 | 476 | 36,097 | 0.1 | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 362,000 | 376,000 | 1,064 | 80,646 | 0.1 | |
| ARENA REIT | 95,550 | 107,550 | 320 | 24,290 | 0.0 | |
| PROPERTYLINK GROUP | 170,000 | — | — | — | — | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 78,549 | 171,317 | 955 | 72,451 | 0.1 | |
| INDUSTRIA REIT | 41,425 | — | — | — | — | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 248,378 | 328,378 | 673 | 51,019 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 59,250 | 59,250 | 197 | 14,953 | 0.0 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 192,730 | 192,730 | 300 | 22,786 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 85,000 | 95,000 | 321 | 24,336 | 0.0 | |
| APN INDUSTRIA REIT | — | 41,425 | 122 | 9,261 | 0.0 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 127,000 | 127,000 | 245 | 18,576 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 2,132,000 | 2,064,000 | 8,317 | 630,415 | 1.0 | |
| CENTURIA METROPOLITAN REIT | — | 158,000 | 477 | 36,163 | 0.1 | |
| VICINITY CENTRES | 1,279,000 | 1,255,000 | 3,212 | 243,498 | 0.4 | |
| VIVA ENERGY REIT | 175,000 | 175,000 | 474 | 35,943 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 10,776,431 | 10,968,234 | 51,216 | 3,881,692 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 26 | 25 | — | < 5.9% > | |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランドドル | | |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 420,000 | 410,000 | 770 | 56,191 | 0.1 | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 140,000 | 124,000 | 353 | 25,762 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|-------------------------|---------|--------------|------------|-------------|--------|------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ニュージーランド) | | 口 | 口 | 千ニュージーランドドル | 千円 | % |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | | 400,000 | 450,000 | 1,023 | 74,631 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | | 320,000 | 320,000 | 457 | 33,359 | 0.1 |
| STRIDE STAPLED GROUP | | 141,080 | — | — | — | — |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | | 580,000 | 610,000 | 966 | 70,483 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 2,001,080 | 1,914,000 | 3,572 | 260,427 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 5 | — | <0.4%> |
| (イスラエル) | | | | 千新シケル | | |
| REIT 1 LTD | | 70,000 | 70,000 | 1,480 | 47,198 | 0.1 |
| 小 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 70,000 | 70,000 | 1,480 | 47,198 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.1%> |
| 合 計 | | 口 数 ・ 金 額 | 49,962,766 | 52,006,003 | — | 58,786,499 |
| | | 銘柄 数 < 比 率 > | 307 | 306 | — | <89.5%> |

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*金額の単位未満は切り捨て。

*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 | REIT先物取引 | 東証REIT指数 | 百万円 |
| | | 43 | — |
| 外国 | REIT先物取引 | DJREA | 百万円 |
| | | 577 | — |

*単位未満は切り捨て。

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

○投資信託財産の構成

(2020年1月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 | % |
| | 3,572 | 0.0 |
| 投資証券 | 64,950,911 | 98.7 |
| コール・ローン等、その他 | 846,982 | 1.3 |
| 投資信託財産総額 | 65,801,465 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(59,270,837千円)の投資信託財産総額(65,801,465千円)に対する比率は90.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国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。1米ドル=110.19円、1カナダドル=84.34円、1英ポンド=143.25円、1ユーロ=122.24円、1香港ドル=14.18円、1シンガポールドル=81.77円、1ウォン=0.095円、1豪ドル=75.79円、1ニュージーランドドル=72.90円、1新シケル=31.88円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 65,916,087,356 |
| コール・ローン等 | 561,800,483 |
| 株式(評価額) | 3,572,162 |
| 投資証券(評価額) | 64,950,911,083 |
| 未収入金 | 133,574,153 |
| 未収配当金 | 122,237,071 |
| 差入委託証拠金 | 143,992,404 |
| (B) 負債 | 268,425,851 |
| 未払金 | 236,581,964 |
| 未払解約金 | 31,327,071 |
| 未払利息 | 116 |
| その他未払費用 | 516,700 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 65,647,661,505 |
| 元本 | 32,286,191,723 |
| 次期繰越損益金 | 33,361,469,782 |
| (D) 受益権総口数 | 32,286,191,723口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 20,333円 |

(注) 期首元本額は31,946,175,003円、期中追加設定元本額は5,571,579,416円、期中一部解約元本額は5,231,562,696円、1口当たり純資産額は2,0333円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| ・野村世界REITインデックスファンド(確定拠出年金向け) | 11,339,045,533円 |
| ・野村世界REITインデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 8,623,989,447円 |
| ・のむらっぴ・ファンド(普通型) | 6,176,179,396円 |
| ・のむらっぴ・ファンド(積極型) | 2,219,275,275円 |
| ・のむらっぴ・ファンド(保守型) | 1,494,360,412円 |
| ・野村世界REITインデックス(野村SMA・EW向け) | 1,098,691,231円 |
| ・マイ・ロード | 928,515,320円 |
| ・のむらっぴ・ファンド(やや保守型) | 209,902,122円 |
| ・のむらっぴ・ファンド(やや積極型) | 196,232,987円 |

○損益の状況 (2019年1月22日～2020年1月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 2,231,919,320 |
| 受取配当金 | 2,227,508,914 |
| 受取利息 | 1,712,951 |
| その他収益金 | 2,761,490 |
| 支払利息 | △ 64,035 |
| (B) 有価証券売買損益 | 8,293,510,732 |
| 売買益 | 9,710,622,257 |
| 売買損 | △ 1,417,111,525 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 72,066,350 |
| 取引益 | 81,852,104 |
| 取引損 | △ 9,785,754 |
| (D) 保管費用等 | △ 11,401,329 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 10,586,095,073 |
| (F) 前期繰越損益金 | 22,304,237,389 |
| (G) 追加信託差損益金 | 5,024,017,252 |
| (H) 解約差損益金 | △ 4,552,879,932 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 33,361,469,782 |
| 次期繰越損益金(I) | 33,361,469,782 |

*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。

*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。

*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。

<お申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

(2020年12月7日現在)

| 年 月 | 日 |
|----------|-------|
| 2020年12月 | 24、25 |
| 2021年1月 | 15、18 |
| 2月 | 12、15 |
| 3月 | — |
| 4月 | 1、2 |
| 5月 | 28、31 |
| 6月 | — |
| 7月 | 2、5 |
| 8月 | — |
| 9月 | 3、6 |
| 10月 | — |
| 11月 | 24、25 |
| 12月 | 23、24 |

※2021年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。