

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信	
信託期間	無期限	
運用方針	<p>①主として日本の取引所に上場しているリート（不動産投資信託証券）に投資します。</p> <p>②東証REIT指数（配当込み）を運用上のベンチマークとし、中長期的にこれを上回る運用成果を目指します。</p> <p>③当社独自の割安度分析に基づき、価格が相対的に割安となっている銘柄を中心に投資します。</p>	
主要投資対象	SOMPO Jリートファンド	損保ジャパンJ-REITマザーファンド受益証券
	損保ジャパンJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場または店頭登録されている不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
主な組入制限	SOMPO Jリートファンド	マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
	損保ジャパンJ-REIT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。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

SOMPO Jリートファンド 〈愛称〉 リート名人

第6期（決算日 2022年11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。
さて、「SOMPO Jリートファンド」は、このたび第6期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



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

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		ベンチマーク		投資信託 組入比率	純資産額
		税金 分配	み 騰 落	東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率		
	円	円	%	%	%	百万円	
2期(2018年11月5日)	10,389	0	11.1	3,487.01	13.1	97.4	4
3期(2019年11月5日)	13,791	0	32.7	4,650.63	33.4	96.2	72
4期(2020年11月5日)	10,816	0	△21.6	3,653.41	△21.4	97.1	22
5期(2021年11月5日)	14,141	0	30.7	4,662.09	27.6	96.9	40
6期(2022年11月7日)	14,044	0	△0.7	4,472.79	△4.1	96.6	40

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額は1万口当たり(以下同じ)。

(注3) 投資信託証券組入比率は、マザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

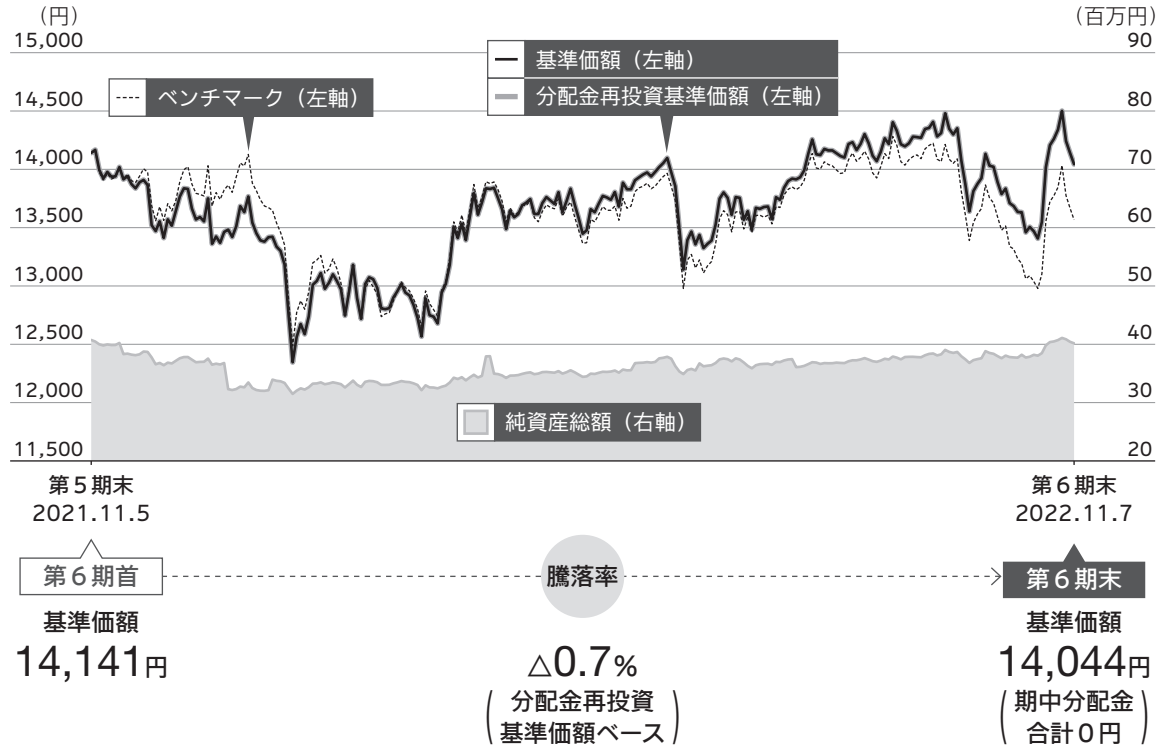
年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落率	
(期首) 2021年11月5日	円	%	%	%	%
	14,141	—	4,662.09	—	96.9
11月末	13,471	△4.7	4,470.13	△4.1	99.9
12月末	13,633	△3.6	4,624.94	△0.8	97.7
2022年1月末	13,111	△7.3	4,372.24	△6.2	97.2
2月末	12,900	△8.8	4,243.65	△9.0	97.0
3月末	13,716	△3.0	4,536.64	△2.7	97.2
4月末	13,635	△3.6	4,483.12	△3.8	97.1
5月末	13,931	△1.5	4,563.32	△2.1	97.2
6月末	13,755	△2.7	4,487.40	△3.7	97.3
7月末	14,132	△0.1	4,628.79	△0.7	97.5
8月末	14,330	1.3	4,683.62	0.5	96.8
9月末	13,874	△1.9	4,488.86	△3.7	96.8
10月末	14,340	1.4	4,564.72	△2.1	96.7
(期末) 2022年11月7日	円	%	%	%	%
	14,044	△0.7	4,472.79	△4.1	96.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 投資信託証券組入比率は、マザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の推移は、2021年11月5日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

● 基準価額の主な変動要因

SOMPO Jリートファンド

当期は、投資している損保ジャパンJ-REITマザーファンドの基準価額が僅かに上昇したものの、当ファンドの基準価額は信託報酬等により僅かに下落しました。

損保ジャパンJ-REITマザーファンド

期中の騰落率は+0.4%となりました。

J-REIT市場は下落したものの、独自の割安度分析に基づき相対的に割安な銘柄を中心にポートフォリオを構築する方針が奏功し、当ファンドの基準価額は上昇しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

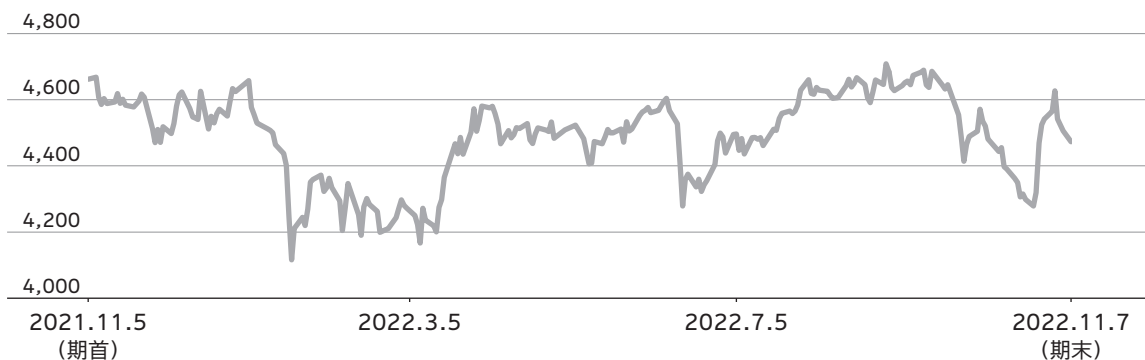
当期のJ-REIT市場は下落しました。

期初は、FRB（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締めスタンスを受けた内外長期金利上昇を背景とした大幅な下落に加えてウクライナ情勢の緊迫化が重しとなり低迷しました。

その後は、ウクライナ停戦期待などを背景としたセンチメントの回復や、バリュエーション指標の割安さが下支えした一方、FRBの積極的な金融引き締めスタンスが下押し圧力となり一進一退の推移となりました。

期末にかけては、公募増資の増加による需給悪化や長期金利上昇が嫌気される場面があったものの、外国人観光客受け入れ再開などのコロナ禍からの正常化が進んだことや相対的な利回り水準の高さを好感して底堅く推移しました。

東証REIT指数（配当込み）の推移



(出所：Bloomberg)

※ 東証REIT指数とは東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象にした時価総額加重平均の指数で、終値ベースの指数値（配当込みの指数値を含みます。）が公表されています。なお、東証REIT指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通して損保ジャパンJ-REITマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

損保ジャパンJ-REITマザーファンド

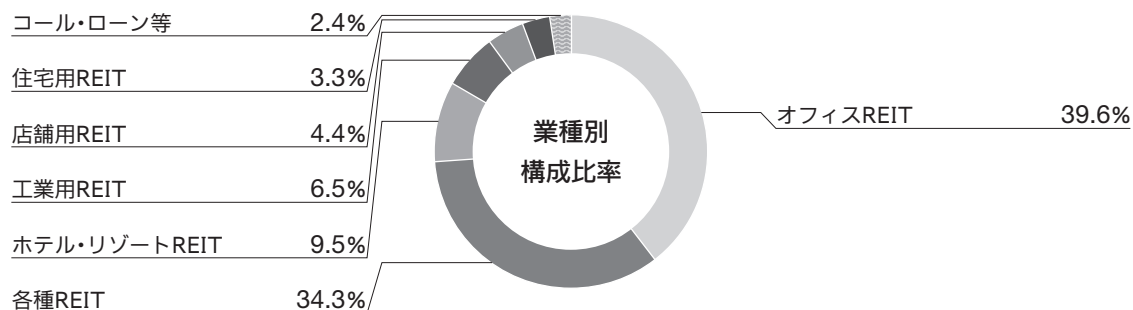
期を通してREITの組入比率は概ね高位に維持しました。期末のREIT組入比率は97.6%です。

・主な購入銘柄

割安度の高い銘柄を中心に購入しました。具体的には、積水ハウス・リート投資法人、日本リート投資法人などです。

・主な売却銘柄

割安度の低下した銘柄を中心に売却しました。具体的には、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人などです。

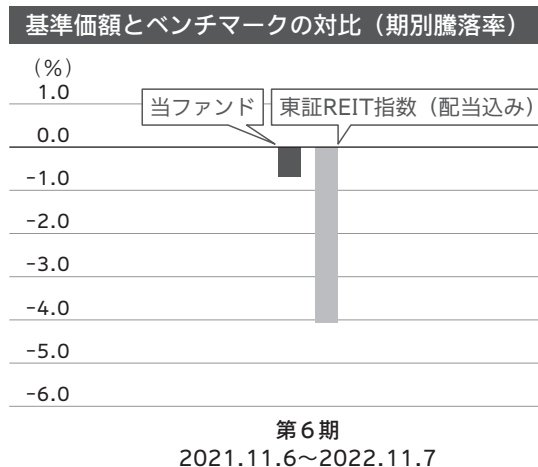


注1. 比率は、第6期末における純資産総額に対する割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%とならない場合があります。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの騰落率（分配金再投資基準価額ベース、信託報酬控除後）は、ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の騰落率（-4.1%）を3.4%上回りました。期を通じて「損保ジャパンJ-REITマザーファンド」を高位に組み入れておりましたので、以下ではマザーファンドとベンチマークとの差異についてご説明します。



損保ジャパンJ-REITマザーファンドとベンチマークとの差異

マザーファンドの騰落率は、東証REIT指数（配当込み）の騰落率（-4.1%）を4.4%上回りました。

東急リアル・エステート投資法人のアンダーウェイト、ジャパンリアルエステイト投資法人のオーバーウェイト等がマイナス要因となった一方、ジャパン・ホテル・リート投資法人、ザイマックス・リート投資法人のオーバーウェイトがプラス要因となりました。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本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・税引前)

項目	第6期 2021.11.6~2022.11.7
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,044

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

● 今後の運用方針

SOMPO Jリートファンド

今後の運用におきましても、損保ジャパンJ-REITマザーファンド受益証券への投資を通じて、安定的な配当収入の確保と、中長期的な信託財産の成長を目指します。

損保ジャパンJ-REITマザーファンド

当ファンドは主として、わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している不動産投資信託（REIT）を投資対象とし、相対的に割安な銘柄を中心にポートフォリオを構築することで、安定的な配当収入の確保と、中長期的な信託財産の成長を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

項目	第6期 2021.11.6~2022.11.7		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	126円	0.918%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,735円です。
(投信会社)	(61)	(0.442)	ファンドの運用の対価
(販売会社)	(61)	(0.442)	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等の対価
(受託会社)	(5)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	13	0.097	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(13)	(0.097)	
(c) その他費用	2	0.015	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(監査費用)	(2)	(0.015)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	141	1.030	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

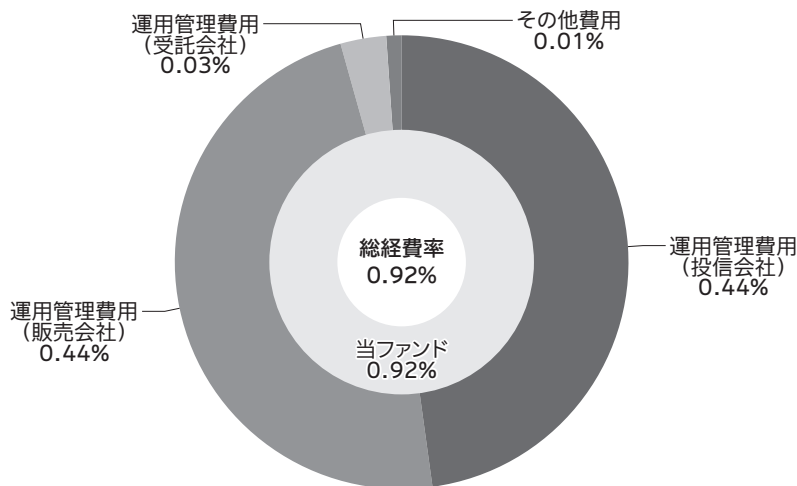
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.92%**です。



注1. 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2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 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5. 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

(2021年11月6日～2022年11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
損保ジャパンJ-REITマザーファンド	千口 5,561	千円 15,821	千口 5,810	千円 16,418

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2021年11月6日～2022年11月7日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年11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
損保ジャパンJ-REITマザーファンド	千口 13,820	千口 13,571	千円 39,748

(注) 単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
損保ジャパンJ-REITマザーファンド	千円 39,748	% 97.9
コール・ローン等、その他	843	2.1
投資信託財産総額	40,591	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	40,591,168
コール・ローン等	842,434
損保ジャパンJ-REITマザーファンド(評価額)	39,748,734
(B) 負債	428,641
未払解約金	253,629
未払信託報酬	172,250
未払利息	2
その他未払費用	2,760
(C) 純資産総額(A-B)	40,162,527
元本	28,596,762
次期繰越損益金	11,565,765
(D) 受益権総口数	28,596,762口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,044円

(注1) 信託財産に係る期首元本額28,811,213円、期中追加設定元本額13,957,537円、期中一部解約元本額14,171,988円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.4044円

○損益の状況 (2021年11月6日～2022年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 367
支払利息	△ 367
(B) 有価証券売買損益	531,825
売買益	886,158
売買損	△ 354,333
(C) 信託報酬等	△ 336,373
(D) 当期損益金(A+B+C)	195,085
(E) 前期繰越損益金	1,490,043
(F) 追加信託差損益金	9,880,637
(配当等相当額)	(6,791,582)
(売買損益相当額)	(3,089,055)
(G) 計(D+E+F)	11,565,765
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	11,565,765
追加信託差損益金	9,880,637
(配当等相当額)	(6,811,758)
(売買損益相当額)	(3,068,879)
分配準備積立金	2,447,632
繰越損益金	△ 762,504

(注1) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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4) 分配金の計算過程(2021年11月6日～2022年11月7日)は以下の通りです。

項 目	2021年11月6日～ 2022年11月7日
a. 配当等収益(費用控除後)	957,589円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	9,118,133円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,490,043円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	11,565,765円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,044円
g. 分配金	0円

損保ジャパンJ-REITマザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年5月23日）

＜計算期間 2021年5月22日～2022年5月23日＞

損保ジャパンJ-REITマザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限
運用方針	①わが国の金融商品取引所に上場している不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指します。 ②東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、同インデックスを上回る運用成果を目指します。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場している不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
主な組入制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。 ③株式への直接投資は行いません。 ④外貨建資産への直接投資は行いません。 ⑤デリバティブの直接利用は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産額
	期騰落	中率	東証REIT指数（配当込み）	期騰落		
	円	%		%	%	百万円
11期(2018年5月21日)	19,821	4.0	3,399.23	4.2	98.8	1,910
12期(2019年5月21日)	22,732	14.7	3,929.49	15.6	98.1	2,061
13期(2020年5月21日)	19,769	△13.0	3,393.84	△13.6	97.8	1,438
14期(2021年5月21日)	28,055	41.9	4,498.49	32.5	98.3	1,622
15期(2022年5月23日)	28,651	2.1	4,511.75	0.3	98.4	1,609

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 東証REIT指数[®]は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象にした時価総額加重平均の指数です。

※東証REIT指数は、東京証券取引所の知的財産であり、同指数の算出、数値の公表、利用などその他一切の権利は東京証券取引所に帰属します（以下同じ）。

○当期中の基準価額と市況等の推移

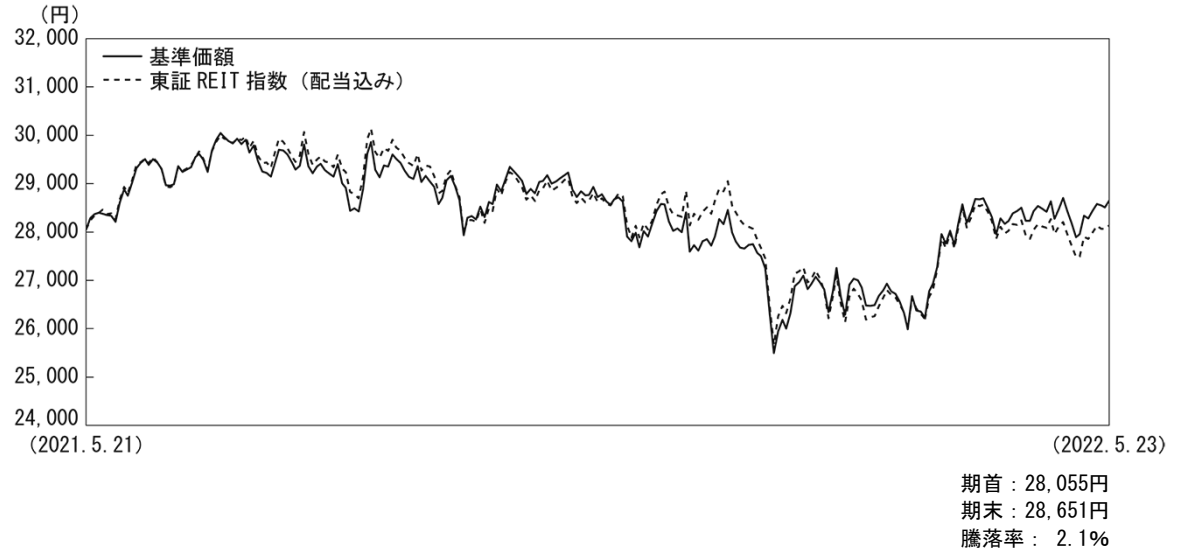
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベ ン チ マ ー ク 東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率	投 資 信 託 組 入 比 率
(期 首) 2021年 5月21日	28,055	—	4,498.49	—	98.3
5月末	28,339	1.0	4,551.00	1.2	98.4
6月末	29,493	5.1	4,732.24	5.2	98.8
7月末	29,606	5.5	4,767.40	6.0	98.9
8月末	29,285	4.4	4,755.00	5.7	97.9
9月末	28,663	2.2	4,605.71	2.4	98.0
10月末	29,173	4.0	4,660.54	3.6	97.9
11月末	27,808	△0.9	4,470.13	△0.6	98.3
12月末	28,164	0.4	4,624.94	2.8	98.5
2022年 1月末	27,099	△3.4	4,372.24	△2.8	98.2
2月末	26,679	△4.9	4,243.65	△5.7	98.1
3月末	28,407	1.3	4,536.64	0.8	98.0
4月末	28,276	0.8	4,483.12	△0.3	98.2
(期 末) 2022年 5月23日	28,651	2.1	4,511.75	0.3	98.4

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

(2021年5月22日～2022年5月23日)

■基準価額の推移



・ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の推移は、2021年5月21日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。

■基準価額の主な変動要因

期中の騰落率は+2.1%となりました。

J-REIT市場がほぼ横ばいとなる中、個別銘柄選択がプラス要因となり、当ファンドの基準価格は上昇しました。

■投資環境

当期のJ-REIT市場はほぼ横ばいで推移しました。

期初は、長期金利が低位で推移する中、分配金の底堅さや相対的な利回り水準の高さが評価された一方、利益確定売りによる下押し圧力もあり、J-REIT市場は横ばい圏で推移しました。

その後は、緊急事態宣言後の経済再開期待の買いが下支えになった一方、FRB（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締めスタンスを背景とした内外金利の上昇やロシアによるウクライナ侵攻を受けたセンチメントの悪化を背景に下落しました。

期末にかけては、ウクライナ停戦期待などを背景にセンチメントは回復し、J-REIT市場も値を戻しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

期を通してREITの組入比率は概ね高位に維持しました。期末のREIT組入比率は98.4%です。

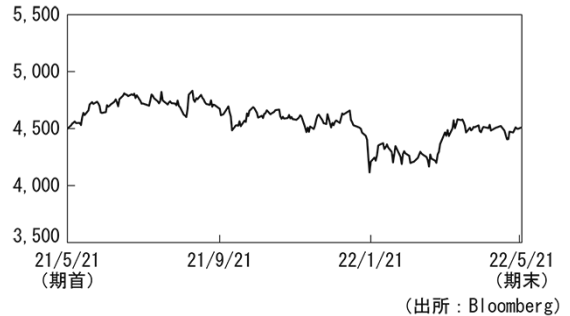
・主な購入銘柄

割安度の高い銘柄を中心に購入しました。具体的には、積水ハウス・リート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人などです。

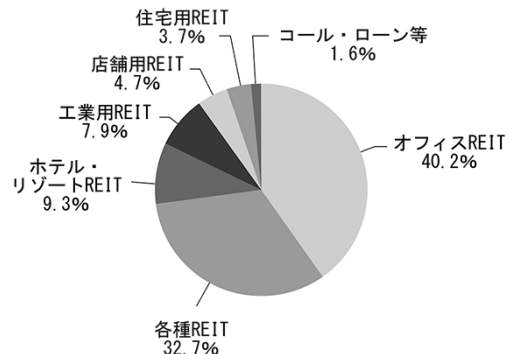
・主な売却銘柄

割安度の低下した銘柄を中心に売却しました。具体的にはSOS i LA物流リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人などです。

東証REIT指数（配当込み）の推移



業種別構成比率



(注1) 比率は、第15期末における純資産総額に対する割合。

(注2) 端数処理の関係上、構成比合計が100%とならない場合があります。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの騰落率は、ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の騰落率（+0.3%）を1.8%上回りました。

伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、SOS i LA物流リート投資法人のオーバーウェイトなどがプラス要因となりました。

■今後の運用方針

当ファンドは主として、わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している不動産投資信託（REIT）を投資対象とし、相対的に割安な銘柄を中心にポートフォリオを構築することで、安定的な配当収入の確保と、中長期的な信託財産の成長を目指します。

○1万口当たりの費用明細

（2021年5月22日～2022年5月23日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 23 (23)	% 0.082 (0.082)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	23	0.082	
期中の平均基準価額は28,416円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2021年5月22日～2022年5月23日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	口	千円	口	千円
SOSILA物流リート投資法人	—	—	315	53,221
日本アコモデーションファンド投資法人	52	32,547	30	20,200
森ヒルズリート投資法人	23	3,407	17	2,656
産業ファンド投資法人	1	168	1	200
アドバンス・レジデンス投資法人	2	648	47	17,711
アクティビア・プロパティーズ投資法人	64	28,373	9	4,115
GLP投資法人	7	1,253	36	6,685
コンフォリア・レジデンシャル	76	24,930	19	5,859
日本プロロジスリート投資法人	42	14,919	47	17,586
ヒューリックリート投資法人	139	22,450	159	29,789
日本リート投資法人	63	22,419	—	—
積水ハウス・リート投資法人	716	55,155	142	12,981
野村不動産マスターファンド投資法人	383	65,936	186	30,498
ラサールロジポート投資法人	—	—	131	24,958
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	—	—	22	13,128
森トラスト・ホテルリート投資法人	300	39,409	69	8,814
三菱地所物流リート投資法人	26	12,744	26	13,062
ザイマックス・リート投資法人	32	3,689	364	44,112
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	—	—	381	62,782
日本ビルファンド投資法人	27	18,811	28	20,038
ジャパンリアルエステイト投資法人	34	22,781	21	14,137
日本都市ファンド投資法人	390	39,980	477	50,286
オリックス不動産投資法人	271	45,574	116	21,663
日本プライムリアルティ投資法人	82	30,807	88	34,269
東急リアル・エステート投資法人	—	—	110	21,314
グローバル・ワン不動産投資法人	250	30,198	88	10,517
ユナイテッド・アーバン投資法人	201	28,431	20	3,037
森トラスト総合リート投資法人	26	3,673	21	3,153
フロンティア不動産投資法人	44	21,373	61	30,259
日本ロジスティクスファンド投資法人	—	—	19	6,317
ケネディクス・オフィス投資法人	23	16,836	—	—
阪急阪神リート投資法人	100	15,000	82	13,783
大和ハウスリート投資法人	61	20,205	77	26,033
ジャパン・ホテル・リート投資法人	266	15,509	414	27,029
ジャパンエクセレント投資法人	182	24,374	9	1,274
合 計	3,883	661,614	3,632	651,483

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月22日～2022年5月23日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年5月23日現在)

国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
SOSILA物流リート投資法人	342	27	27	4,209	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	—	22	22	14,212	0.9
森ヒルズリート投資法人	471	477	477	71,550	4.4
産業ファンド投資法人	87	87	87	16,251	1.0
アドバンス・レジデンス投資法人	120	75	75	26,137	1.6
アクティビア・プロパティーズ投資法人	171	226	226	94,355	5.9
GLP投資法人	238	209	209	35,112	2.2
コンフォリア・レジデンシャル	—	57	57	18,753	1.2
日本プロロジスリート投資法人	127	122	122	43,249	2.7
ヒューリックリート投資法人	361	341	341	54,560	3.4
日本リート投資法人	—	63	63	23,467	1.5
積水ハウス・リート投資法人	367	941	941	73,115	4.5
野村不動産マスターファンド投資法人	527	724	724	119,025	7.4
ラサールロジポート投資法人	131	—	—	—	—
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	34	12	12	6,564	0.4
森トラスト・ホテルリート投資法人	265	496	496	63,438	3.9
三菱地所物流リート投資法人	26	26	26	12,168	0.8
ザイマックス・リート投資法人	578	246	246	30,627	1.9
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	381	—	—	—	—
日本ビルファンド投資法人	212	211	211	148,122	9.2
ジャパンリアルエステイト投資法人	203	216	216	140,400	8.7
日本都市ファンド投資法人	813	726	726	75,213	4.7
オリックス不動産投資法人	271	426	426	78,554	4.9
日本プライムリアルティ投資法人	127	121	121	49,428	3.1
東急リアル・エステート投資法人	110	—	—	—	—
グローバル・ワン不動産投資法人	—	162	162	17,755	1.1
ユナイテッド・アーバン投資法人	371	552	552	81,033	5.0
森トラスト総合リート投資法人	524	529	529	75,382	4.7
フロンティア不動産投資法人	17	—	—	—	—
日本ロジスティクスファンド投資法人	51	32	32	10,208	0.6
ケネディクス・オフィス投資法人	—	23	23	15,180	0.9
阪急阪神リート投資法人	82	100	100	14,890	0.9
大和ハウスリート投資法人	125	109	109	34,607	2.2
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,434	1,286	1,286	85,904	5.3
ジャパンエクセレント投資法人	225	398	398	50,546	3.1
合 計	8,791	9,042	9,042	1,584,021	
	口 数・金 額	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	30	31	31	<98.4%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年5月23日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	1,584,021	98.4
コール・ローン等、その他	25,199	1.6
投資信託財産総額	1,609,220	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,609,220,323
コール・ローン等	11,507,186
投資証券(評価額)	1,584,021,700
未収配当金	13,691,437
(B) 負債	286
未払利息	34
その他未払費用	252
(C) 純資産総額(A-B)	1,609,220,037
元本	561,663,305
次期繰越損益金	1,047,556,732
(D) 受益権総口数	561,663,305口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,651円

(注1) 信託財産に係る期首元本額578,210,766円、期中追加設定元本額27,007,393円、期中一部解約元本額43,554,854円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用) 195,580,705円
 損保ジャパン・グローバルREITファンド(毎月分配型) 353,816,351円
 SOMPO Jリートファンド 12,266,249円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 2.8651円

○損益の状況 (2021年5月22日~2022年5月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	57,111,562
受取配当金	57,125,078
支払利息	△ 13,516
(B) 有価証券売買損益	△ 20,496,257
売買益	49,800,739
売買損	△ 70,296,996
(C) 保管費用等	△ 252
(D) 当期損益金(A+B+C)	36,615,053
(E) 前期繰越損益金	1,043,943,808
(F) 追加信託差損益金	49,229,537
(G) 解約差損益金	△ 82,231,666
(H) 計(D+E+F+G)	1,047,556,732
次期繰越損益金(H)	1,047,556,732

(注1) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 追加信託差損益金とは、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3) 解約差損益金とは、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。