

# グローバル・リート・ インデックスファンド (毎月決算型) (資産形成型) (愛称：世界のやどかり)

★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／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	2019年10月31日～2029年11月14日	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の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
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
分配方針	毎月決算型	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、当初設定から1年以内に分配を開始し、分配開始後は、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
	資産形成型	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

## 運用報告書（全体版）

毎月決算型

第38期（決算日 2022年12月14日）  
第39期（決算日 2023年1月16日）  
第40期（決算日 2023年2月14日）  
第41期（決算日 2023年3月14日）  
第42期（決算日 2023年4月14日）  
第43期（決算日 2023年5月15日）

資産形成型

第7期（決算日 2023年5月15日）

（作成対象期間 2022年11月15日～2023年5月15日）

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外のリート（不動産投資信託）に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況を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。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9：00～17：00）

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

<3407>

<3406>

毎月決算型

最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率	純資産額
	円 税込み 分配金	円 騰落	% 中率	円 騰落	% 中率				
14期末(2020年12月14日)	8,274	20	△ 0.6	8,495	△ 0.4	0.5	97.4	2.2	55
15期末(2021年 1月14日)	8,282	20	0.3	8,550	0.6	0.3	97.4	2.5	61
16期末(2021年 2月15日)	8,824	20	6.8	9,125	6.7	0.5	97.6	2.2	89
17期末(2021年 3月15日)	9,410	20	6.9	9,768	7.1	0.7	96.9	2.6	106
18期末(2021年 4月14日)	9,662	20	2.9	10,091	3.3	0.5	97.9	1.8	165
19期末(2021年 5月14日)	9,837	20	2.0	10,274	1.8	0.5	97.9	1.7	183
20期末(2021年 6月14日)	10,730	20	9.3	11,236	9.4	0.9	97.7	1.7	209
21期末(2021年 7月14日)	10,733	20	0.2	11,248	0.1	1.0	97.5	1.7	240
22期末(2021年 8月16日)	10,813	20	0.9	11,433	1.6	0.2	98.4	1.7	263
23期末(2021年 9月14日)	10,825	20	0.3	11,418	△ 0.1	1.5	96.7	2.0	309
24期末(2021年10月14日)	11,045	20	2.2	11,687	2.4	0.3	97.9	2.0	329
25期末(2021年11月15日)	11,599	20	5.2	12,308	5.3	1.2	96.9	2.1	360
26期末(2021年12月14日)	11,646	20	0.6	12,384	0.6	1.2	96.6	2.3	373
27期末(2022年 1月14日)	11,793	20	1.4	12,606	1.8	0.7	97.0	2.7	380
28期末(2022年 2月14日)	11,186	20	△ 5.0	12,038	△ 4.5	2.0	95.5	2.7	380
29期末(2022年 3月14日)	11,406	20	2.1	12,196	1.3	0.7	97.2	2.2	395
30期末(2022年 4月14日)	12,812	20	12.5	13,795	13.1	0.6	97.7	1.9	450
31期末(2022年 5月16日)	11,630	20	△ 9.1	12,517	△ 9.3	0.4	98.3	1.5	427
32期末(2022年 6月14日)	10,935	20	△ 5.8	11,808	△ 5.7	3.3	95.1	1.8	458
33期末(2022年 7月14日)	11,497	20	5.3	12,423	5.2	1.3	97.0	1.8	500
34期末(2022年 8月15日)	12,323	20	7.4	13,484	8.5	2.3	95.5	2.3	568
35期末(2022年 9月14日)	12,205	20	△ 0.8	13,309	△ 1.3	0.9	97.1	2.1	583
36期末(2022年10月14日)	10,572	25	△13.2	11,563	△13.1	3.1	94.8	2.4	515
37期末(2022年11月14日)	11,232	25	6.5	12,293	6.3	4.0	93.8	2.4	563
38期末(2022年12月14日)	11,022	25	△ 1.6	12,128	△ 1.3	5.2	92.5	2.5	568
39期末(2023年 1月16日)	10,547	25	△ 4.1	11,622	△ 4.2	6.0	91.1	3.1	559
40期末(2023年 2月14日)	11,264	25	7.0	12,555	8.0	6.4	90.3	3.5	606
41期末(2023年 3月14日)	10,284	25	△ 8.5	11,469	△ 8.6	7.2	89.6	3.5	591
42期末(2023年 4月14日)	10,367	30	1.1	11,576	0.9	4.3	93.1	2.8	608
43期末(2023年 5月15日)	10,639	30	2.9	11,894	2.7	4.4	93.2	2.7	630

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 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。
- \* 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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

#### ■ 基準価額・騰落率

第38期首：11,232円  
 第43期末：10,639円（既払分配金160円）  
 騰落率：△3.8%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市況の下落の影響を受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）

	年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指数先物率
		騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
第38期	(期首) 2022年11月14日	円 11,232	% -	12,293	% -	% 4.0	% 93.8	% 2.4
	11月末	11,086	△1.3	12,148	△1.2	4.6	92.9	2.5
	(期末) 2022年12月14日	11,047	△1.6	12,128	△1.3	5.2	92.5	2.5
第39期	(期首) 2022年12月14日	11,022	-	12,128	-	5.2	92.5	2.5
	12月末	10,364	△6.0	11,486	△5.3	5.8	91.2	3.0
	(期末) 2023年1月16日	10,572	△4.1	11,622	△4.2	6.0	91.1	3.1
第40期	(期首) 2023年1月16日	10,547	-	11,622	-	6.0	91.1	3.1
	1月末	11,030	4.6	12,214	5.1	6.3	90.8	2.9
	(期末) 2023年2月14日	11,289	7.0	12,555	8.0	6.4	90.3	3.5
第41期	(期首) 2023年2月14日	11,264	-	12,555	-	6.4	90.3	3.5
	2月末	11,103	△1.4	12,330	△1.8	6.6	90.0	3.4
	(期末) 2023年3月14日	10,309	△8.5	11,469	△8.6	7.2	89.6	3.5
第42期	(期首) 2023年3月14日	10,284	-	11,469	-	7.2	89.6	3.5
	3月末	10,311	0.3	11,431	△0.3	3.8	93.5	2.8
	(期末) 2023年4月14日	10,397	1.1	11,576	0.9	4.3	93.1	2.8
第43期	(期首) 2023年4月14日	10,367	-	11,576	-	4.3	93.1	2.8
	4月末	10,517	1.4	11,768	1.7	4.7	92.5	2.8
	(期末) 2023年5月15日	10,669	2.9	11,894	2.7	4.4	93.2	2.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.11.15～2023.5.15)

### ■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回り利上げペースが鈍化するとの期待が高まったことなどが好感され、上昇して始まりました。2023年2月に入ると、予想を上回る経済指標の発表が相次いだことで金利が再び上昇し市場に嫌気されたほか、3月には米国金融機関の経営破綻による金融不安がリートの資金調達コスト上昇につながるなどの懸念が広がったことから、下落に転じました。その後は、F R B（米国連邦準備制度理事会）による緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、金利が急低下したことなどが好感されて米国を中心に上昇し、当作成期末を迎えました。

### ■為替相場

為替相場はまちまちの動きとなりました。

米ドル円為替相場は、当作成期首より、米国のC P I（消費者物価指数）の結果を受け、インフレ率の減速期待などから長期を中心に米国金利が低下したことにより日米金利差の縮小が意識され、下落（円高）しました。その後も、日銀が想定外の政策修正を行ったことで日本の長期金利が大きく上昇し、金融緩和政策の転換などが意識されたこと、景気減速懸念やインフレ鈍化の兆しから米国金利が低下したことなどから、円高米ドル安基調が続きました。2023年2月に入ると、堅調な米国の経済指標から米国金利が大きく上昇したことで円安米ドル高に転じました。3月には、米国の地方銀行の経営破綻を受けて円高米ドル安となる場面もありましたが、その後は信用不安の後退や5月のF O M C（米国連邦公開市場委員会）での利上げが意識されたことにより、円安米ドル高基調で当作成期末を迎えました。資源国通貨であるオーストラリア・ドルは、資源価格の下落を背景に、対円で軟調な推移となりました。ユーロや英ポンドは、中央銀行による金融引き締めの継続等を背景に対円で上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## ポートフォリオについて

(2022.11.15~2023.5.15)

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）

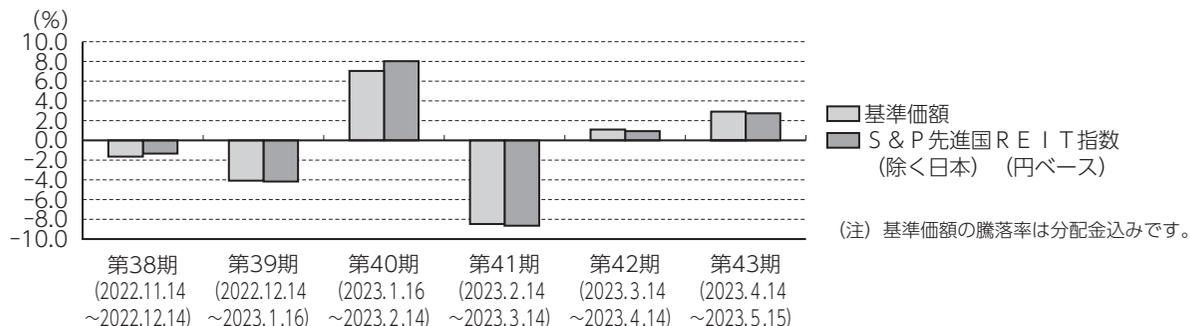
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△3.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.8%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期
	2022年11月15日 ～2022年12月14日	2022年12月15日 ～2023年1月16日	2023年1月17日 ～2023年2月14日	2023年2月15日 ～2023年3月14日	2023年3月15日 ～2023年4月14日	2023年4月15日 ～2023年5月15日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>30</b>	<b>30</b>
対基準価額比率（％）	0.23	0.24	0.22	0.24	0.29	0.28
当期の収益（円）	23	25	14	25	30	15
当期の収益以外（円）	1	－	10	－	－	14
翌期繰越分配対象額（円）	6,362	6,385	6,375	6,377	6,403	6,389

(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（税込み）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（税込み）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。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 23.80円	✓ 48.02円	✓ 14.92円	✓ 25.69円	✓ 55.49円	✓ 15.92円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	4,500.61	4,552.78	4,601.92	4,716.97	4,753.82	4,770.04
(d) 分配準備積立金	✓ 1,862.97	1,810.05	✓ 1,784.09	1,660.02	1,624.62	✓ 1,633.99
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,387.39	6,410.87	6,400.94	6,402.69	6,433.94	6,419.95
(f) 分配金	25.00	25.00	25.00	25.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,362.39	6,385.87	6,375.94	6,377.69	6,403.94	6,389.95

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	第38期～第43期 (2022.11.15～2023.5.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	37円	0.341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,729円です。
（投 信 会 社）	(15)	(0.136)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(21)	(0.191)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(1)	(0.013)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.007	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.002)	
（投 資 証 券）	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.004	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(0)	(0.004)	
そ の 他 費 用	3	0.025	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0.014)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(0)	(0.002)	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）	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	40	0.376	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

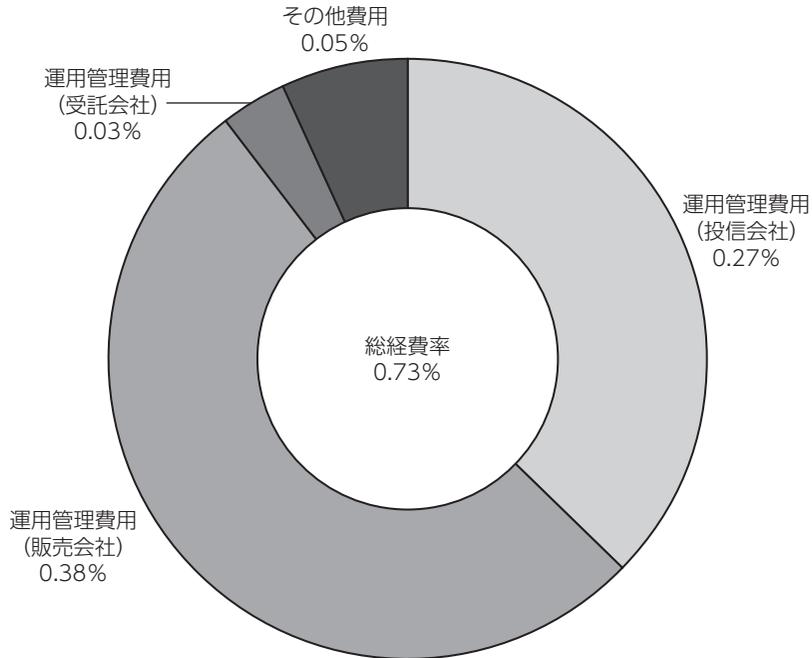
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## 参考情報

## ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.73%です。



(注1) 1万口当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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年11月15日から2023年5月15日まで)

決算期	第38期～第43期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	32,863	101,528	4,089	12,379

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	第37期末	第43期末	
	□数	□数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	178,223	206,998	632,544

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月14日)、(2023年1月16日)、(2023年2月14日)、(2023年3月14日)、(2023年4月14日)、(2023年5月15日)現在

項目	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末	第42期末	第43期末
<b>(A) 資産</b>	<b>570,229,052円</b>	<b>560,823,465円</b>	<b>608,218,966円</b>	<b>592,842,757円</b>	<b>611,072,754円</b>	<b>632,964,772円</b>
コール・ローン等	343,097	369,545	353,505	352,462	407,426	404,807
ダイワ・グローバル REITインデックス・ マザーファンド(評価額)	569,811,955	560,453,920	607,854,461	592,457,295	610,653,328	632,544,965
未収入金	74,000	-	11,000	33,000	12,000	15,000
<b>(B) 負債</b>	<b>1,608,676</b>	<b>1,672,635</b>	<b>1,673,808</b>	<b>1,771,960</b>	<b>2,120,246</b>	<b>2,159,288</b>
未払収益分配金	1,289,751	1,325,352	1,346,170	1,436,895	1,762,262	1,778,759
未払信託報酬	316,409	342,048	319,858	324,703	344,881	364,528
その他未払費用	2,516	5,235	7,780	10,362	13,103	16,001
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>568,620,376</b>	<b>559,150,830</b>	<b>606,545,158</b>	<b>591,070,797</b>	<b>608,952,508</b>	<b>630,805,484</b>
元本	515,900,533	530,140,980	538,468,311	574,758,152	587,420,890	592,919,944
次期繰越損益金	52,719,843	29,009,850	68,076,847	16,312,645	21,531,618	37,885,540
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>515,900,533口</b>	<b>530,140,980口</b>	<b>538,468,311口</b>	<b>574,758,152口</b>	<b>587,420,890口</b>	<b>592,919,944口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	11,022円	10,547円	11,264円	10,284円	10,367円	10,639円

\* 当作成期首における元本額は501,459,853円、当作成期間(第38期～第43期)中における追加設定元本額は100,663,964円、同解約元本額は9,203,873円です。

\* 第43期末の計算口数当りの純資産額は10,639円です。

■投資信託財産の構成

2023年5月15日現在

項目	第43期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	632,544	99.9
コール・ローン等、その他	419	0.1
投資信託財産総額	632,964	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、5月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.05円、1カナダ・ドル=100.29円、1オーストラリア・ドル=90.53円、1香港ドル=17.35円、1シンガポール・ドル=101.65円、1ニュージーランド・ドル=84.30円、1イギリス・ポンド=169.36円、1イスラエル・シケル=36.996円、100韓国ウォン=10.16円、1ユーロ=147.66円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産(29,402,007千円)の投資信託財産総額(29,868,902千円)に対する比率は、98.4%です。

■損益の状況

第38期 自2022年11月15日 至2022年12月14日 第41期 自2023年2月15日 至2023年3月14日  
 第39期 自2022年12月15日 至2023年1月16日 第42期 自2023年3月15日 至2023年4月14日  
 第40期 自2023年1月17日 至2023年2月14日 第43期 自2023年4月15日 至2023年5月15日

項目	第 38 期	第 39 期	第 40 期	第 41 期	第 42 期	第 43 期
(A) 配当等収益	△ 4円	△ 1円	△ 8円	△ 1円	△ 1円	△ 1円
支払利息	△ 4	△ 8	△ 8	△ 1	△ 1	△ 1
(B) 有価証券売買損益	△ 8,964,711	△ 22,816,094	△ 39,566,829	△ 54,065,031	△ 6,995,888	△ 18,161,693
売買益	20,735	22,703	39,663,889	14,187	6,998,057	18,173,684
売買損	△ 8,985,446	△ 22,838,797	△ 97,060	△ 54,079,218	△ 2,169	△ 11,991
(C) 信託報酬等	△ 318,925	△ 344,767	△ 322,403	△ 327,285	△ 347,622	△ 367,426
(D) 当期損益(A+B+C)	△ 9,283,640	△ 23,160,861	△ 39,244,418	△ 54,392,316	△ 6,648,266	△ 17,794,266
(E) 前期繰越損益金	33,357,595	22,762,623	△ 1,703,874	36,151,016	△ 19,674,572	△ 14,781,108
(F) 追加信託差損益金	29,935,639	30,733,440	31,882,473	35,990,840	36,320,186	36,651,141
(配当等相当額)	( 232,186,831)	( 241,361,666)	( 247,798,937)	( 271,112,093)	( 279,249,649)	( 282,825,472)
(売買損益相当額)	(△202,251,192)	(△210,628,226)	(△215,916,464)	(△235,121,253)	(△242,929,463)	(△246,174,331)
(G) 合計(D+E+F)	54,009,594	30,335,202	69,423,017	17,749,540	23,293,880	39,664,299
(H) 収益分配金	△ 1,289,751	△ 1,325,352	△ 1,346,170	△ 1,436,895	△ 1,762,262	△ 1,778,759
次期繰越損益金(G+H)	52,719,843	29,009,850	68,076,847	16,312,645	21,531,618	37,885,540
追加信託差損益金	29,935,639	30,733,440	31,882,473	35,990,840	36,320,186	36,651,141
(配当等相当額)	( 232,186,831)	( 241,361,666)	( 247,798,937)	( 271,112,093)	( 279,249,649)	( 282,825,472)
(売買損益相当額)	(△202,251,192)	(△210,628,226)	(△215,916,464)	(△235,121,253)	(△242,929,463)	(△246,174,331)
分配準備積立金	96,049,634	97,179,523	95,525,506	95,451,216	96,931,451	96,047,798
繰越損益金	△ 73,265,430	△ 98,903,113	△ 59,331,132	△115,129,411	△111,720,019	△ 94,813,399

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項目	第 38 期	第 39 期	第 40 期	第 41 期	第 42 期	第 43 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,228,327円	2,546,215円	803,789円	1,477,040円	3,260,068円	943,986円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	232,186,831	241,361,666	247,798,937	271,112,093	279,249,649	282,825,472
(d) 分配準備積立金	96,111,058	95,958,660	96,067,887	95,411,071	95,433,645	96,882,571
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	329,526,216	339,866,541	344,670,613	368,000,204	377,943,362	380,652,029
(f) 分配金	1,289,751	1,325,352	1,346,170	1,436,895	1,762,262	1,778,759
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	328,236,465	338,541,189	343,324,443	366,563,309	376,181,100	378,873,270
(h) 受益権総口数	515,900,533□	530,140,980□	538,468,311□	574,758,152□	587,420,890□	592,919,944□

グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
	第 38 期	第 39 期	第 40 期	第 41 期	第 42 期	第 43 期
1万口当り分配金（税込み）	25円	25円	25円	25円	30円	30円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

S & P 先進国 R E I T 指数は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup> および CDX<sup>®</sup> は、S&P Global, Inc. またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup> は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは S P D J I に付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）は、S P D J I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T 指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

## 資産形成型

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期騰落 率	(ベンチマーク)	期騰落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
3期末(2021年5月14日)	10,180	0	19.5	10,274	20.4	0.5	97.7	1.7	455
4期末(2021年11月15日)	12,135	0	19.2	12,308	19.8	1.2	96.8	2.1	721
5期末(2022年5月16日)	12,293	0	1.3	12,517	1.7	0.4	98.2	1.5	788
6期末(2022年11月14日)	12,009	0	△ 2.3	12,293	△ 1.8	4.0	93.6	2.4	1,030
7期末(2023年5月15日)	11,547	0	△ 3.8	11,894	△ 3.2	4.4	92.9	2.7	1,127

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)は、S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

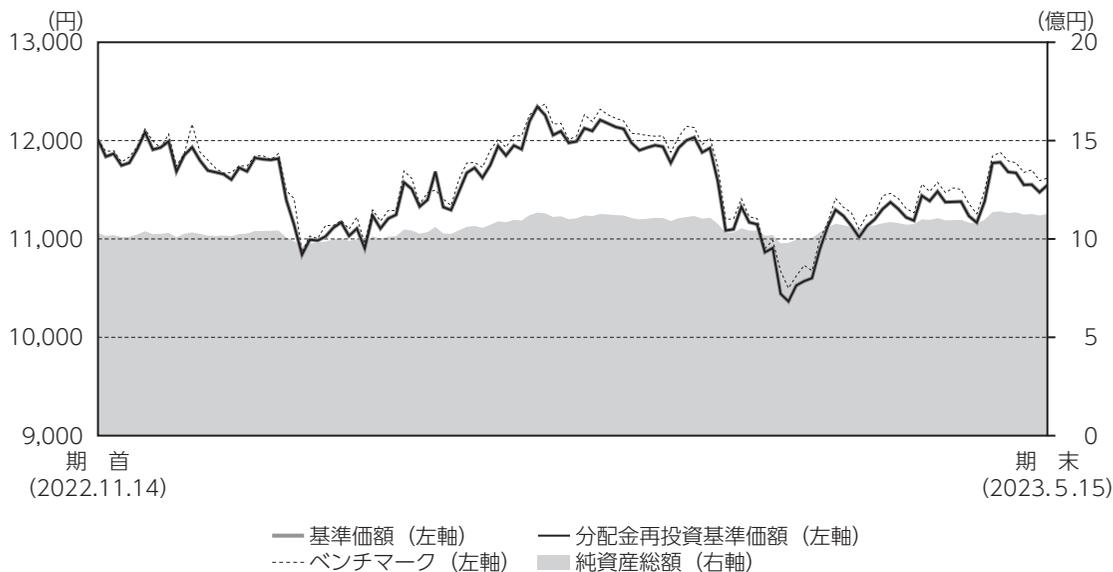
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 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。
- \* 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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：12,009円  
 期末：11,547円（分配金0円）  
 騰落率：△3.8%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市況の下落の影響を受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首) 2022年11月14日	円 12,009	% -	12,293	% -	% 4.0	% 93.6	% 2.4
11月末	11,852	△1.3	12,148	△1.2	4.6	92.9	2.5
12月末	11,106	△7.5	11,486	△6.6	5.8	91.2	3.0
2023年 1 月末	11,848	△1.3	12,214	△0.6	6.3	90.8	2.9
2 月末	11,953	△0.5	12,330	0.3	6.6	90.0	3.4
3 月末	11,127	△7.3	11,431	△7.0	3.8	93.5	2.8
4 月末	11,382	△5.2	11,768	△4.3	4.7	92.5	2.8
(期末) 2023年 5 月15日	11,547	△3.8	11,894	△3.2	4.4	92.9	2.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.11.15～2023.5.15)

## ■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回り利上げペースが鈍化するとの期待が高まったことなどが好感され、上昇して始まりました。2023年2月に入ると、予想を上回る経済指標の発表が相次いだことで金利が再び上昇し市場に嫌気されたほか、3月には米国金融機関の経営破綻による金融不安がリーートの資金調達コスト上昇につながるなどの懸念が広がったことから、下落に転じました。その後は、F R B（米国連邦準備制度理事会）による緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、金利が急低下したことなどが好感されて米国を中心に上昇し、当作成期末を迎えました。

## ■為替相場

為替相場はまちまちの動きとなりました。

米ドル円為替相場は、当作成期首より、米国のC P I（消費者物価指数）の結果を受け、インフレ率の減速期待などから長期を中心に米国金利が低下したことにより日米金利差の縮小が意識され、下落（円高）しました。その後も、日銀が想定外の政策修正を行ったことで日本の長期金利が大きく上昇し、金融緩和政策の転換などが意識されたこと、景気減速懸念やインフレ鈍化の兆しから米国金利が低下したことなどから、円高米ドル安基調が続きました。2023年2月に入ると、堅調な米国の経済指標から米国金利が大きく上昇したことで円安米ドル高に転じました。3月には、米国の地方銀行の経営破綻を受けて円高米ドル安となる場面もありましたが、その後は信用不安の後退や5月のF O M C（米国連邦公開市場委員会）での利上げが意識されたことにより、円安米ドル高基調で当作成期末を迎えました。資源国通貨であるオーストラリア・ドルは、資源価格の下落を背景に、対円で軟調な推移となりました。ユーロや英ポンドは、中央銀行による金融引き締めの継続等を背景に対円で上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

## ■ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## ポートフォリオについて

(2022.11.15~2023.5.15)

## ■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

## ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）

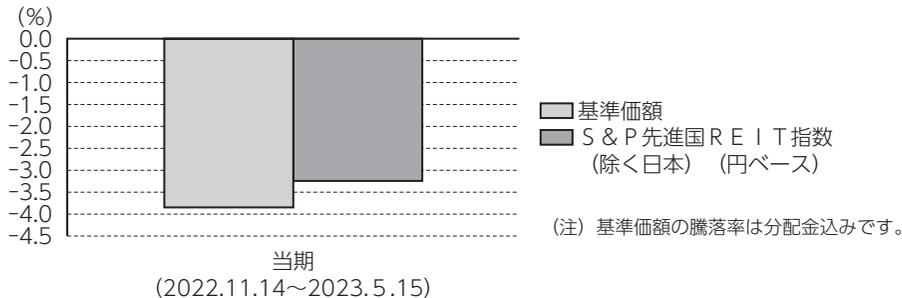
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 3.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 3.8\%$ となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年11月15日 ～2023年5月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,104

（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（税込み）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（税込み）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。

（注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.11.15~2023.5.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.343%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,533円です。
（投 信 会 社）	(16)	(0.137)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(22)	(0.192)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0.014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.007	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.002)	
（投 資 証 券）	(0)	(0.003)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.004	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(0)	(0.004)	
そ の 他 費 用	3	0.025	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0.014)	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および資金の送金・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）	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	44	0.379	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

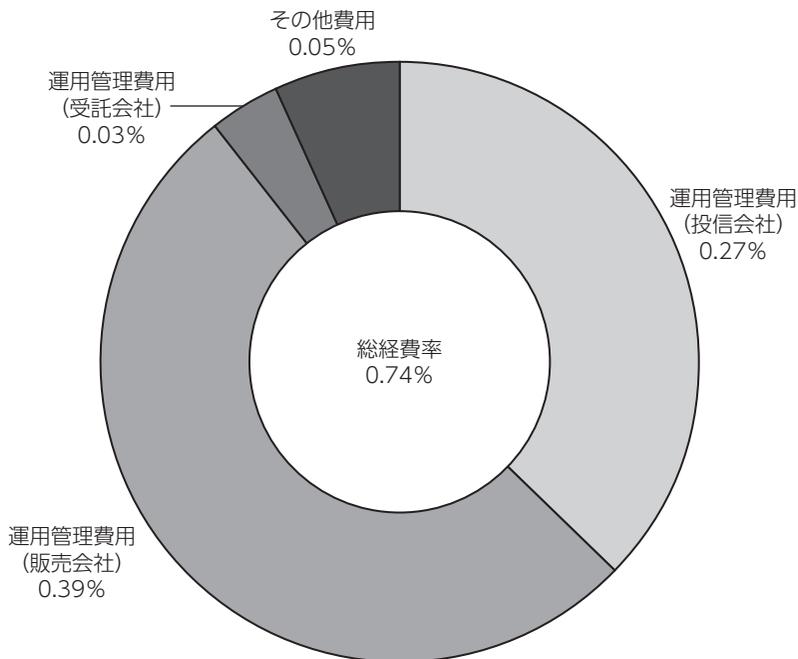
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.74%です。



(注1) 1万口当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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年11月15日から2023年5月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	47,638	143,962	3,967	12,316

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	325,253	368,924	1,127,359

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年5月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	1,127,359	99.7
コール・ローン等、その他	3,729	0.3
投資信託財産総額	1,131,088	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、5月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.05円、1カナダ・ドル=100.29円、1オーストラリア・ドル=90.53円、1香港ドル=17.35円、1シンガポール・ドル=101.65円、1ニュージーランド・ドル=84.30円、1イギリス・ポンド=169.36円、1イスラエル・シェケル=36.996円、100韓国ウォン=10.16円、1ユーロ=147.66円です。

(注3) ダイワ・グローバル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純資産（29,402,007千円）の投資信託財産総額（29,868,902千円）に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,131,088,563円
コール・ローン等	3,729,003
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド(評価額)	1,127,359,560
(B) 負債	3,659,358
未払信託報酬	3,630,409
その他未払費用	28,949
(C) 純資産総額(A - B)	1,127,429,205
元本	976,404,449
次期繰越損益金	151,024,756
(D) 受益権総口数	976,404,449口
1万口当り基準価額(C / D)	11,547円

\* 期首における元本額は857,864,711円、当作成期間中における追加設定元本額は145,952,890円、同解約元本額は27,413,152円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,547円です。

■損益の状況

当期 自2022年11月15日 至2023年5月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 223円
支払利息	△ 223
(B) 有価証券売買損益	△ 33,730,610
売買益	794,197
売買損	△ 34,524,807
(C) 信託報酬等	△ 3,659,358
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 37,390,191
(E) 前期繰越損益金	66,857,593
(F) 追加信託差損益金	121,557,354
(配当等相当額)	( 212,973,888)
(売買損益相当額)	(△ 91,416,534)
(G) 合計(D + E + F)	151,024,756
次期繰越損益金(G)	151,024,756
追加信託差損益金	121,557,354
(配当等相当額)	( 212,973,888)
(売買損益相当額)	(△ 91,416,534)
分配準備積立金	90,133,583
繰越損益金	△ 60,666,181

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	212,973,888
(d) 分配準備積立金	90,133,583
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	303,107,471
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	303,107,471
(h) 受益権総口数	976,404,449口

S & P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

<補足情報>

当ファンド（グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）（資産形成型））が投資対象としている「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、2023年5月15日現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2022年11月15日から2023年5月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	218.1	2,438,339	11,179	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	194.9	2,121,435	10,884

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年11月15日から2023年5月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
PROLOGIS INC (アメリカ)	13.049	205,567	15,753	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI (カナダ)	15	35,338	2,355
EQUINIX INC (アメリカ)	1.386	128,137	92,451	SHAFTESBURY PLC (イギリス)	45.398	31,498	693
LINK REIT (香港)	105.1	93,702	891	PROLOGIS INC (アメリカ)	1.4	20,849	14,892
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	20.066	84,245	4,198	VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	1.4	6,191	4,422
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.012	79,362	39,444	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I (シンガポール)	153.9	5,648	36
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	9.34	77,793	8,329	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST (香港)	70.7	5,226	73
WELLTOWER INC (アメリカ)	7.322	67,491	9,217	CARE PROPERTY INV RIGHTS NV (ベルギー)	3.45	307	89
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	4.075	57,559	14,125	SHINHAN ALPHA REIT LTD (韓国)	1.839	32	17
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	3.32	54,929	16,545				
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	3.653	49,463	13,540				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2023年5月15日現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（9,753,841千円）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	2023年5月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF	116.2	9,531	1,296,813
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	116.2 9,531	1,296,813 <4.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年5月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	2023年5月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	49.4	20	2,755
MANULIFE US REAL ESTATE INV	265.962	37	5,138
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110.2	35	4,797
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	-	-
PRIME US REIT	92.2	19	2,634
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21.004	298	40,577
URBAN EDGE PROPERTIES	18.762	266	36,272
XENIA HOTELS & RESORTS INC	18.188	230	31,401
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22.35	4,027	547,876
SIMON PROPERTY GROUP INC	52.233	5,554	755,754
BOSTON PROPERTIES INC	22.79	1,103	150,130
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24.225	206	28,047
VORNADO REALTY TRUST	25.742	329	44,793
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14.508	202	27,554
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.5	518	70,491
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.633	150	20,527
EQUITY RESIDENTIAL	54.412	3,417	464,892
APPLE HOSPITALITY REIT INC	33.987	520	70,792
EPR PROPERTIES	11.985	491	66,804
CITY OFFICE REIT INC	6	25	3,526
GLOBAL NET LEASE INC	16.582	175	23,868
EQUINIX INC	14.784	10,928	1,486,860
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13.402	346	47,133
CHATHAM LODGING TRUST	7.231	71	9,759
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.813	830	113,030
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19.897	246	33,566
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.759	132	18,068
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	31	4,244
HOST HOTELS & RESORTS INC	114.233	1,912	260,163
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	49.037	1,717	233,702
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20.508	89	12,220
RLJ LODGING TRUST	25.89	277	37,724
FARMLAND PARTNERS INC	7.936	84	11,531
PHYSICIANS REALTY TRUST	36.467	524	71,344

銘柄	2023年5月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10.821	123	16,827
KIMCO REALTY CORP	98.809	1,805	245,602
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.06	80	10,933
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	60.818	1,224	166,644
WHITESTONE REIT	7.417	62	8,567
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	41.141	2,020	274,824
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19.721	125	17,064
PARK HOTELS & RESORTS INC	35.921	482	65,681
INVITATION HOMES INC	92.795	3,155	429,368
JBG SMITH PROPERTIES	15.816	234	31,846
ALEXANDER & BALDWIN INC	11.583	215	29,279
CLIPPER REALTY INC	1.89	9	1,357
GLADSTONE LAND CORP	5.156	80	10,921
AMERICOLD REALTY TRUST	43.039	1,295	176,307
VICI PROPERTIES INC	9	16	2,252
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	160.35	5,115	695,918
BRT APARTMENTS CORP	1.6	27	3,770
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.468	310	42,198
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	21.444	101	13,857
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.746	565	76,962
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6.229	130	17,796
BROADSTONE NET LEASE INC	27.657	445	60,617
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17.078	116	15,846
LIFE STORAGE INC	13.579	1,837	249,974
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8.342	156	21,313
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	35.761	612	83,390
PARAMOUNT GROUP INC	26.339	114	15,587
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21.017	116	15,898
NETSTREIT CORP	8.767	158	21,517
APARTMENT INCOME REIT CO	23.761	847	115,309
CTO REALTY GROWTH INC	3.211	52	7,077
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	30.213	1,678	228,378
STAG INDUSTRIAL INC	28.632	994	135,247
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.066	31	4,317
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	57	7,808
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.825	41	5,699

銘柄	2023年5月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	千円
	千口	千アメリカ・ドル	千円
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	18,712	552	75,176
ORION OFFICE REIT INC	9,048	50	6,893
VENTAS INC	63,903	2,970	404,184
CARETRUST REIT INC	15,898	315	42,869
INVENTRUST PROPERTIES CORP	10,772	234	31,875
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	47,914	988	134,545
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	48	6,555
SABRA HEALTH CARE REIT INC	36,901	426	58,085
UMH PROPERTIES INC	8,587	136	18,528
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,916	85	11,678
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	0,487	7	1,086
NEXPOCK DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,8	44	6,092
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	2,122	35	4,824
IRON MOUNTAIN INC	46,445	2,558	348,105
TERRENO REALTY CORP	11,656	724	98,541
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,312	857	116,625
SUN COMMUNITIES INC	19,793	2,665	362,698
ACADIA REALTY TRUST	15,17	199	27,201
ALEXANDER'S INC	0,343	57	7,878
PROLOGIS INC	147,471	18,458	2,511,339
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,164	3,006	408,978
BRANDYWINE REALTY TRUST	27,41	99	13,499
SAUL CENTERS INC	2,061	69	9,474
VERIS RESIDENTIAL INC	12,66	205	27,937
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,595	1,944	264,514
COUSINS PROPERTIES INC	24,209	483	65,773
SITE CENTERS CORP	29,307	342	46,610
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,962	1,164	158,472
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,321	2,222	302,346
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,11	1,125	153,078
FEDERAL REALTY INVTS TRUST	11,697	1,069	145,467
GETTY REALTY CORP	6,794	228	31,085
WELLTOWER INC	75,49	5,986	814,443
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,354	1,831	249,218
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,809	348	47,429
SERVICE PROPERTIES TRUST	26,433	216	29,470
EQUITY COMMONWEALTH	17,503	360	48,982
KILROY REALTY CORP	16,835	461	62,802
LTC PROPERTIES INC	6,471	217	29,633
LXP INDUSTRIAL TRUST	44,05	432	58,851
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,449	2,829	385,006
MACERICH CO/THE	34,387	323	43,976
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,95	1,923	261,694
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,932	371	50,568
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,99	1,278	173,934
REALTY INCOME CORP	100,194	6,215	845,555
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,961	421	57,302
PUBLIC STORAGE	25,254	7,474	1,016,964
REGENCY CENTERS CORP	24,605	1,440	195,929
RPT REALTY	13,619	121	16,546
SAFEHOLD INC	6,107	173	23,571
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,67	317	43,181
SL GREEN REALTY CORP	10,285	221	30,126
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,295	33	4,566
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,628	78	10,628

銘柄	2023年5月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	千円
	千口	千アメリカ・ドル	千円
UDR INC	49,406	2,044	278,143
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,029	91	12,430
WP CAREY INC	33,649	2,408	327,689
ELME	13,982	229	31,273
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,7	17	2,391
AGREE REALTY CORP	14,15	945	128,674
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,424	1,105	150,353
CUBESMART	35,878	1,655	225,169
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,614	346	47,149
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,935	4,460	606,822
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,395	3,284	446,922
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	27	3,759
CENTERSPACE	2,407	143	19,517
KITE REALTY GROUP TRUST	35,003	714	97,148
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,592	51	6,978
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,328	71	9,694
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,45	269	36,725
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,694	731	99,466
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	20	2,781
DOUGLAS EMMETT INC	28,084	304	41,494
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	4,095,323 145銘柄	154,656 <70.6%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	7	800
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	16	1,698
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	18	1,877
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5.6	53	5,374
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7.841	101	10,159
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.4	24	2,435
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2.758	48	4,829
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9.8	69	6,978
SLATE GROCERY REIT	4.7	61	6,137
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9.8	173	17,435
SLATE OFFICE REIT	5.1	10	1,053
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	42	4,282
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20.1	160	16,066
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6.1	15	1,596
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	31	3,138
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5.4	439	44,034
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	21.8	305	30,630
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11.8	159	16,011
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18.1	275	27,664
CHOICE PROPERTIES REIT	27.4	394	39,597
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3.3	56	5,715
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9.1	142	14,337
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12.1	314	31,551
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14.5	713	71,532
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	22,266	238	23,893
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25.7	529	53,121
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	47	4,739
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.8	237	23,860
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8.9	138	13,852
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10.7	243	24,434
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	293,465 30銘柄	5,073 <1.7%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2023年5月15日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千口	千円	千円
DEXUS/AU	188.008	1,517	137,354	
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	52	4,779	
HMC CAPITAL LTD	34.174	146	13,303	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	36	3,318	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	57.979	172	15,641	
CROMWELL PROPERTY GROUP	247.199	142	12,867	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	92.172	299	27,119	
RURAL FUNDS GROUP	67.167	128	11,644	
WAYPOINT REIT	117.959	312	28,298	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	113.735	498	45,098	
CENTURIA OFFICE REIT	68.959	98	8,958	
CENTURIA CAPITAL GROUP	120.539	215	19,533	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	269.082	325	29,475	
REGION GROUP	200.826	510	46,179	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50.422	166	15,063	
NATIONAL STORAGE REIT	208.797	530	48,012	
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	35.122	104	9,475	
GDI PROPERTY GROUP	87.347	62	5,653	
SCENTRE GROUP	907.275	2,558	231,622	
ARENA REIT	60.571	225	20,453	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31.154	110	10,012	
BWP TRUST	84.216	322	29,200	
GPT GROUP	334.842	1,480	133,984	
CHARTER HALL RETAIL REIT	90.423	346	31,352	
MIRVAC GROUP	689.734	1,620	146,737	
STOCKLAND	417.276	1,869	169,236	
ABACUS PROPERTY GROUP	70.207	190	17,224	
GOODMAN GROUP	299.121	6,030	545,921	
VICINITY CENTRES	676.374	1,373	124,301	
CHARTER HALL GROUP	81.938	924	83,673	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	63.546	282	25,542	
オーストラリア・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	5,858.464 31銘柄	22,655	2,051,039 < 6.9%>
<b>(香港)</b>	千口	千香港ドル	千円	千円
YUXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398	764	13,258	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	160	500	8,688	
FORTUNE REIT	254	1,582	27,454	
PROSPERITY REIT	205	389	6,757	
LINK REIT	442.1	21,906	380,070	
CHAMPION REIT	331	1,049	18,204	
香 港 ド ル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,790.1 6銘柄	26,192	454,434 < 1.5%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円	千円
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84.7	48	4,907	
KEPPEL DC REIT	231.283	501	51,016	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	210.276	53	5,450	
AIMS APAC REIT	89.1	119	12,136	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	506.09	642	65,333	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	87.9	65	6,656	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	327.84	221	22,494	
EC WORLD REIT	36.5	10	1,094	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	587.477	1,680	170,790	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	880.122	1,813	184,296	
SUNTEC REIT	393.6	531	54,012	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	559	967	98,302	

銘柄	2023年5月15日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円	千円
KEPPEL REIT	343.6	297	30,211	
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	353.056	384	39,118	
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,042.402	349	35,496	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	145.7	174	17,772	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	187.576	416	42,328	
STARHILL GLOBAL REIT	247.6	128	13,087	
CAPITALAND CHINA TRUST	196.542	214	21,776	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66.1	252	25,666	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	346.769	807	82,130	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	399.084	674	68,558	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	169	100	10,221	
PARAGON REIT	177	166	16,912	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	412.463	136	13,835	
シンガポール・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	8,080.78 25銘柄	10,758	1,093,610 < 3.7%>
<b>(ニュージーランド)</b>	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	千円
STRIDE PROPERTY GROUP	92.477	119	10,056	
ARGOSY PROPERTY LTD	144.609	159	13,409	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	261.44	237	20,055	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	80.882	185	15,614	
GOODMAN PROPERTY TRUST	179.742	386	32,577	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	230.216	283	23,870	
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	989.366 6銘柄	1,371	115,584 < 0.4%>
<b>(イギリス)</b>	千口	千イギリス・ポンド	千円	千円
WAREHOUSE REIT PLC	70.605	72	12,292	
EDISON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31.488	19	3,327	
ASSURA PLC	490.928	248	42,112	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101.879	91	15,546	
ABRON PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67.467	34	5,815	
CLS HOLDINGS PLC	57.322	73	12,445	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	135.056	70	12,008	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	86.237	64	10,997	
REGIONAL REIT LTD	71.837	37	6,411	
NEWRIVER REIT PLC	51.721	42	7,252	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	307.101	347	58,824	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98.025	78	13,347	
CUSTODIAN REIT PLC	69.425	65	11,017	
PRS REIT PLC/THE	86.496	73	12,495	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	69.968	70	11,873	
LXI REIT PLC	284.295	291	49,448	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51.24	28	4,807	
AEW UK REIT PLC	21.93	21	3,654	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	134.976	107	18,150	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	206.054	176	29,906	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	78.434	104	17,773	
HOME REIT PLC	117.587	44	7,577	
LAND SECURITIES GROUP PLC	126.863	779	132,007	
SEGRE PLC	204.206	1,641	278,057	
HAMMERSON PLC	663.583	168	28,500	
UNITE GROUP PLC/THE	67.59	616	104,397	
BRITISH LAND CO PLC	158.38	587	99,541	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	42.097	205	34,820	
DERWENT LONDON PLC	18.961	411	69,683	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	221.618	230	39,109	

銘柄	2023年5月15日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
WORKSPACE GROUP PLC	千口	千イギリス・ポンド	千円	
	22.88	106	17,995	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36.736	341	57,860	
BIG YELLOW GROUP PLC	29.558	342	58,018	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	162.943	304	51,494	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93.799	41	6,973	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	315.559	459	77,866	
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	4,854.844 8,404	1,423,414 < 4.8%>	
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シェケル	千円	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105.526	169	6,277	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	37.152 33.128	293 561	10,873 20,774	
イスラエル・シェケル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	175,806 3銘柄	1,025 < 0.1%>	
(韓国)	千口	千韓国ウォン	千円	
SK REITS LTD	11.423	58,599	5,953	
D&D PLATFORM REIT LTD	8	26,920	2,735	
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3.93	13,912	1,413	
NH ALL ONE REIT LTD	6.454	23,137	2,350	
E KOCREF CR	3.584	18,493	1,878	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12.235	72,675	7,383	
LOTTE REIT CO LTD	20.132	76,300	7,752	
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	15.855	66,194	6,725	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	26,348	2,676	
JR REIT XXVII	25.282	111,114	11,289	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.99	32,106	3,262	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27.294	108,903	11,064	
韓国ウォン 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	145,779 12銘柄	634,705 < 0.2%>	
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64.959	64	9,591	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	64.959 1銘柄	64 < 0.0%>	
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6.463	135	20,040	
WERELDHAVE NV	6.098	81	12,011	
NSI NV	2.733	55	8,171	
VASTNED RETAIL NV	2.739	55	8,129	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	18.033 4銘柄	327 < 0.2%>	
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	
AEDIFICA	6.035	422	62,334	
COFINIMMO	4.63	384	56,846	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSE RETAIL ESTATES	3.984 1.706	63 112	9,435 16,600	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	23.476	623	92,138	
CARE PROPERTY INVEST	5.601	74	10,966	
XIOR STUDENT HOUSING NV	3.526	100	14,864	
MONTEA NV	2.047	159	23,576	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	51,005 8銘柄	1,942 < 1.0%>	
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16.18	720	106,412	
ICADE	4.849	193	28,554	
CARMILA	8.705	126	18,663	

銘柄	2023年5月15日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ALTAREA	千口	千ユーロ	千円	
	0.71	82	12,203	
GECINA SA	8.238	788	116,472	
KLEPIERRE	29.539	622	91,988	
COVIVIO	7.033	334	49,349	
MERCIALYS	11.658	91	13,513	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	86,912 8銘柄	2,960 < 1.5%>	
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.82	10	1,539	
HAMBORNER REIT AG	10.717	73	10,887	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	12,537 2銘柄	84 < 0.0%>	
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8.842	41	6,149	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44.944	244	36,069	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50.509	378	55,861	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	104,295 3銘柄	664 < 0.3%>	
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.93	17	2,650	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	6.93 1銘柄	17 < 0.0%>	
ユーロ (その他)	千口	千ユーロ	千円	
CROMWELL REIT EUR	54.52	83	12,397	
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	54.52 1銘柄	83 < 0.0%>	
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	399,191 28銘柄	6,145 < 3.0%>	
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	26,683,118 322銘柄	27,697,708 < 92.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年5月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2023年5月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
外	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE(アメリカ)	616	-
国	193	-
STOXX 600 REAL(ドイツ)	-	-

(注1) 外貨建の評価額は、2023年5月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド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。

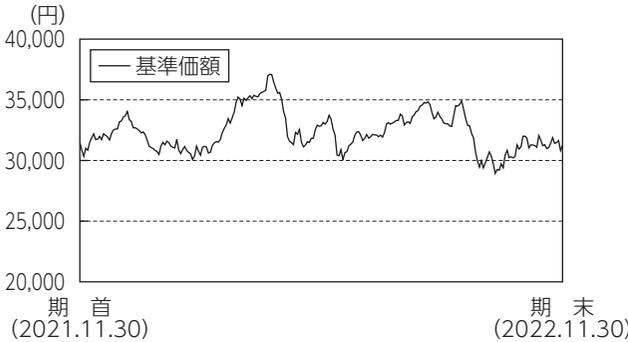
運用方針	S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場 (上場予定を含みます。) および店頭登録 (登録予定を含みます。) の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券 組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託証券 受託証券 組入比率		投資信託証券 組入比率		不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	
	円	騰落率	円	騰落率	%	%	%	%	%	%
(期首)2021年11月30日	31,508	-	36,274	-	0.9	97.0	2.3			
12月末	33,585	6.6	38,720	6.7	1.7	95.8	2.6			
2022年1月末	31,183	△ 1.0	35,945	△ 0.9	1.5	95.8	2.7			
2月末	31,178	△ 1.0	36,082	△ 0.5	0.7	96.5	2.7			
3月末	35,049	11.2	40,404	11.4	0.9	96.9	2.1			
4月末	35,608	13.0	40,997	13.0	-	98.6	1.5			
5月末	32,909	4.4	37,898	4.5	2.0	96.2	1.8			
6月末	32,075	1.8	37,190	2.5	0.9	97.2	1.9			
7月末	33,816	7.3	39,114	7.8	2.1	96.3	1.9			
8月末	33,072	5.0	38,402	5.9	0.6	97.3	2.2			
9月末	29,392	△ 6.7	33,992	△ 6.3	2.2	95.4	2.5			
10月末	31,993	1.5	36,940	1.8	4.1	93.7	2.4			
(期末)2022年11月30日	31,268	△ 0.8	36,159	△ 0.3	4.6	93.0	2.5			

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注5) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,508円 期末：31,268円 騰落率：△0.8%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、好調な決算発表などから上昇して始まりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC (米国連邦公開市場委員会) 議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月から3月にかけては、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言や、ロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから一進一退の展開となりましたが、4月

以降については、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避姿勢が強まり、リートも米国を中心に大きく下落しました。7月以降は過度な金融引き締め観測の後退を受け、持ち直す展開となりましたが、その後はFRB (米国連邦準備制度理事会) 議長が景気を犠牲にしてもインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇で欧米の金利が上昇したこと、英国の財政悪化懸念から英国債が急落したことなどが嫌気され、10月半ばにかけて下落しました。10月下旬以降からは、英国発の混乱が収束し欧米の金利上昇が一服したことなどからリートは反発し、当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は対円でおおむね上昇 (円安) しました。

対円為替相場は、当作成期首よりおおむねレンジ内での推移が続きましたが、米国の利上げ回数の増加観測などを受けて米ドルを中心に上昇しました。2022年に入ってからは、米国で大幅な利上げが行われたことなどから、米ドルを中心にさらに上昇しました。7月後半に米国金利が低下に転じると、日米金利差の縮小が意識され、円が買い戻されたことで円高となりました。8月は、米国金利の上昇により日米金利差が再度拡大したことなどから、円安が進行しました。9月に入ると、FRB (米国連邦準備制度理事会) が大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和政策の維持を決定したことで米ドルを中心に急速に円安が進行しました。これを受け、日本政府・日銀は円買い介入を実施したものの影響は限定的なものにとどまり、円安基調のまま当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) および不動産投信指数先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.8%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

\*ベンチマークはS & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) です。

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション)	8円 (1)
(投資信託受益証券)	(1)
(投資信託証券)	(5)
有価証券取引税 (投資信託受益証券)	3 (0)
(投資信託証券)	(3)
その他費用 (保管費用)	23 (10)
(その他)	(13)
合計	33

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	買		売	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	540.13 (-)	53,098 (-)	464.88 (-)	47,007 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、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。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	買		売		
	口数	金額	口数	金額	
外 国	アメリカ	千口 646,937 (△ 153,622)	千アメリカ・ドル 24,475 (△ 6,181)	千口 3,164.84 (-)	千アメリカ・ドル 151,648 (-)
	カナダ	千口 48,558 (9,541)	千カナダ・ドル 928 (-)	千口 251.79 (-)	千カナダ・ドル 5,344 (-)
	オーストラリア	千口 852,348 (132,841)	千オーストラリア・ドル 3,559 (△ 31)	千口 4,374.24 (-)	千オーストラリア・ドル (-)
	香港	千口 313.7 (163.54)	千香港ドル 3,670 (-)	千口 1,373.84 (-)	千香港ドル 22,138 (-)
	シンガポール	千口 1,519.5 (36.54)	千シンガポール・ドル 1,775 (△ 65)	千口 6,335.324 (-)	千シンガポール・ドル 9,245 (-)
	ニュージーランド	千口 197.638 (-)	千ニュージーランド・ドル 347 (△ 1)	千口 655.907 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,113 (-)
	イギリス	千口 1,062,225 (-)	千イギリス・ポンド 1,899 (△ 3)	千口 3,415.576 (-)	千イギリス・ポンド 8,865 (-)
	イスラエル	千口 136.596 (-)	千イスラエル・シェケル 524 (-)	千口 22.74 (-)	千イスラエル・シェケル 492 (-)
	韓国	千口 43,383 (12,142)	千韓国ウォン 237,929 (83,628)	千口 81.402 (-)	千韓国ウォン 406,773 (-)
	国	ユーロ (アイルランド)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 206.35 (-)
ユーロ (オランダ)		千口 0.73 (0.067)	千ユーロ 15 (0)	千口 12.88 (-)	千ユーロ 302 (-)
ユーロ (ベルギー)		千口 4.02 (-)	千ユーロ 289 (-)	千口 40.312 (-)	千ユーロ 2,307 (-)
ユーロ (フランス)		千口 11,654 (△ 0.01)	千ユーロ 328 (△ 53)	千口 68.648 (-)	千ユーロ 3,136 (-)
ユーロ (ドイツ)		千口 - (-)	千ユーロ - (△ 7)	千口 50.25 (-)	千ユーロ 865 (-)
ユーロ (スペイン)		千口 11,665 (-)	千ユーロ 83 (△ 17)	千口 78.43 (-)	千ユーロ 711 (-)
ユーロ (イタリア)		千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 11.5 (-)	千ユーロ 73 (-)
ユーロ (その他)		千口 - (-)	千ユーロ - (△ 3)	千口 37.4 (-)	千ユーロ 85 (-)
ユーロ (ユーロ通貨計)		千口 28,069 (0.057)	千ユーロ 715 (△ 81)	千口 505.77 (-)	千ユーロ 7,777 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、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。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 4,595	百万円 4,948	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当					期				
買 付					売 付				
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		540.13	6,798,680	12,587	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		464.88	5,899,115	12,689

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当					期				
買 付					売 付				
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)		62.165	240,519	3,869	PROLOGIS INC (アメリカ)		92.9	1,800,011	19,375
PROLOGIS INC (アメリカ)		10.9	181,927	16,690	EQUINIX INC (アメリカ)		11.349	1,000,952	88,197
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		17.715	155,247	8,763	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		19.155	867,049	45,264
EQUINIX INC (アメリカ)		1.547	137,970	89,185	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		41.873	680,182	16,243
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2.997	129,071	43,066	WELLTOWER INC (アメリカ)		53.1	601,983	11,336
WELLTOWER INC (アメリカ)		12.168	125,689	10,329	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		35.301	599,910	16,994
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (アメリカ)		30.469	119,513	3,922	REALTY INCOME CORP (アメリカ)		69.1	570,729	8,259
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN (アメリカ)		32.437	99,667	3,072	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		17.681	525,112	29,699
GOODMAN GROUP (オーストラリア)		52.378	98,742	1,885	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		43.712	470,278	10,758
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		4.605	81,488	17,695	GOODMAN GROUP (オーストラリア)		225.52	464,787	2,060

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘	柄	期 首	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF		33.95	109.2	9,403	1,305,824
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	33.95 1銘柄	109.2 1銘柄	9,403	1,305,824 <4.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	-	49.4	-	4,047
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364.562	265.962	99	13,850
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	193.4	110.2	60	8,340
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	90	-	-
PRIME US REIT	147	92.2	43	6,017
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33.2	19.596	317	44,085
URBAN EDGE PROPERTIES	28.682	17.277	270	37,524
XENIA HOTELS & RESORTS INC	28.8	16.4	247	34,321
AVALONBAY COMMUNITIES INC	36	20.571	3,513	487,894
SIMON PROPERTY GROUP INC	84.847	48.158	5,656	785,537
BOSTON PROPERTIES INC	36.7	20.983	1,483	205,984
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	36.789	22.688	183	25,426
VORNADO REALTY TRUST	41.064	23.721	600	83,374
EASTERLY GOVERNMENT PROPTI	21.2	13.078	209	29,112
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	21.1	12.5	481	66,883
NEXPOINT RESIDENTIAL	5.5	3.326	155	21,583
EQUITY RESIDENTIAL	88	49.799	3,166	439,693
APPLE HOSPITALITY REIT INC	54.8	31.7	533	74,044
EPR PROPERTIES	18.9	11.184	455	63,320
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7.1	-	-	-
CITY OFFICE REIT INC	10.9	6	58	8,148
GLOBAL NET LEASE INC	25.933	14.833	195	27,190
EQUINIX INC	23.2	13.398	9,899	1,248,374
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19.829	11.929	318	44,197
CHATHAM LODGING TRUST	10.8	6.665	87	12,124
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	8.8	-	-	-
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14.2	8.114	728	101,152
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	31.4	18.5	280	38,896
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6	3.5	120	16,768
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13.1	7.8	28	3,910
HOST HOTELS & RESORTS INC	184.3	105.17	1,962	272,528
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	70.708	44.506	1,446	200,929
CORESITRE REALTY CORP	11.4	-	-	-
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39.4	18.964	213	29,600
RLJ LODGING TRUST	41.871	23.943	284	39,567
FARMLAND PARTNERS INC	6.7	7.101	93	12,977
PHYSICIANS REALTY TRUST	56.1	33.5	483	67,176
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15.7	9.961	118	16,447
CYRUSONE INC	32	-	-	-
KIMCO REALTY CORP	158.362	90.987	2,067	287,075
GLOBAL MEDICAL REIT INC	15.6	9.06	89	12,367
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56.55	56.003	1,116	154,998
WHITESTONE REIT	11.2	6.4	61	8,514
GAMING AND LEISURE PROPTIE	57.437	37.584	1,938	269,158
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	32.3	17.7	181	25,268
PARK HOTELS & RESORTS INC	61.08	33.077	409	56,820
DIGITALBRIDGE GROUP INC	126.711	-	-	-
INVITATION HOMES INC	148.797	85.302	2,722	378,120
JBG SMITH PROPERTIES	29.932	14.641	294	40,867
ALEXANDER & BALDWIN INC	18.7	10.4	202	28,090
CLIPPER REALTY INC	1.4	1.89	13	1,923
GLADSTONE LAND CORP	6.4	4.68	94	13,115

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AMERICOLD REALTY TRUST	67.4	39.627	1,169	162,393
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	16.9	9	35	4,986
VICI PROPERTIES INC	157.4	141.684	4,770	662,479
RETAIL VALUE INC	4.49	-	-	-
BRT APARTMENTS CORP	2.9	1.6	32	4,490
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6.1	4.189	493	68,556
SAFEHOLD INC	3.3	2.562	73	10,193
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	29.6	19.143	126	17,518
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	30.5	20.776	470	65,406
COREPOINT LODGING INC	10.7	-	-	-
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7.4	5.372	108	15,039
STORE CAPITAL CORP	63.1	39.097	1,243	172,687
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	5.9	-	-	-
BROADSTONE NET LEASE INC	41	25.2	418	58,057
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25.3	15.726	133	18,475
LIFE STORAGE INC	20.25	12.414	1,284	178,375
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13.2	7.574	215	29,934
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	26.582	32.919	578	80,274
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12.2	-	-	-
PARAMOUNT GROUP INC	40.2	24.493	156	21,734
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	36.5	19.5	148	20,688
NETSTREIT CORP	9.9	7.406	144	20,034
APARTMENT INCOME REIT CO	40.489	22.683	842	117,022
CTO REALTY GROWTH INC	1.2	2.58	54	7,577
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	35.6	25.166	1,360	188,998
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	29.7	-	-	-
STAG INDUSTRIAL INC	41.8	26.365	841	116,832
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.6	1.5	28	3,995
INDUS REALTY TRUST INC	1.1	0.861	54	7,633
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3.2	2.3	35	4,890
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	-	16.969	541	75,219
ORION OFFICE REIT INC	14.223	7.823	71	9,940
VENTAS INC	101.629	58.803	2,669	370,735
CARETRUST REIT INC	24.503	14.404	282	39,165
GEO GROUP INC/THE	31.6	-	-	-
INVENTRUST PROPERTIES CORP	-	9.92	246	34,191
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	76.7	44.085	1,016	141,114
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11.8	7.128	108	15,095
SABRA HEALTH CARE REIT INC	56.987	34.343	443	61,522
UMH PROPERTIES INC	10.6	7.244	127	17,644
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	-	3.6	104	14,573
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	-	0.487	12	1,690
IRON MOUNTAIN INC	74.7	42.755	2,302	319,787
TERRENO REALTY CORP	18.2	9.78	562	78,093
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	30.72	19.993	813	113,000
SUN COMMUNITIES INC	29.9	18.143	2,627	364,851
ACADIA REALTY TRUST	22.811	13.611	206	28,730
ALEXANDER'S INC	0.5	0.3	73	10,189
PROLOGIS INC	190.919	135.822	15,457	2,146,638
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35.8	21.844	3,331	462,665
BRANDYWINE REALTY TRUST	43.3	24.642	167	23,201
SAUL CENTERS INC	3.2	1.8	76	10,598
VERIS RESIDENTIAL INC	20.1	11.9	188	26,126
CAMDEN PROPERTY TRUST	26	15.672	1,845	256,267

銘柄	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
COUSINS PROPERTIES INC	38.406	22.155	575	79,931		
SITE CENTERS CORP	46.278	27.078	364	50,576		
DUKE REALTY CORP	97.7	-	-	-		
EASTGROUP PROPERTIES INC	10.4	6.409	974	135,291		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16.767	9.581	2,055	285,381		
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	33.3	19.429	958	133,097		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	18.1	10.71	1,178	163,691		
GETTY REALTY CORP	9.803	6.256	204	28,374		
WELLTOWER INC	109.1	68.168	4,717	655,081		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139.2	79.379	2,035	282,638		
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26.9	15.7	459	63,859		
SERVICE PROPERTIES TRUST	41.7	24.6	187	26,065		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37.6	-	-	-		
EQUITY COMMONWEALTH	31.475	16.365	437	60,701		
KILROY REALTY CORP	27.1	15.609	654	90,866		
LTC PROPERTIES INC	9.6	5.959	232	32,298		
LXP INDUSTRIAL TRUST	70.1	41.176	430	59,811		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	29.928	16.983	2,749	381,876		
MACERICH CO/THE	54.979	31.979	414	57,598		
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	44.1	25.715	1,682	233,653		
NATL HEALTH INVESTORS INC	11.9	6.569	360	50,090		
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	45.3	26.056	1,180	163,913		
REALTY INCOME CORP	142.239	90.854	5,660	786,032		
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28.5	16.71	457	63,512		
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17	-	-	-		
PUBLIC STORAGE	39.4	23.242	6,754	937,945		
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5.1	-	-	-		
REGENCY CENTERS CORP	39.52	22.656	1,491	207,085		
RPT REALTY	21.1	12.53	139	19,349		
ISTAR INC	-	12.56	124	17,267		
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	26.3	15.016	292	40,621		
SL GREEN REALTY CORP	17.357	9.538	396	55,127		
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.5	32.9	33	4,614		
URSTADT BIDDLE - CLASS A	7.6	4.1	76	10,664		
UDR INC	72	44.932	1,830	254,268		
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.1	1.8	93	12,948		
WVP CAREY INC	47.6	30.533	2,388	331,662		
ELME	21.6	12.6	242	33,647		
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7	4.7	29	4,131		
AGREE REALTY CORP	17.8	11.744	810	112,596		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	61.648	34.441	1,035	143,867		
CUBESMART	52.1	33.02	1,306	181,493		
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56.326	31.234	336	46,757		
DIGITAL REALTY TRUST INC	72.978	42.282	4,598	638,547		
CEDAR REALTY TRUST INC	3.1	-	-	-		
EXTRA SPACE STORAGE INC	34.5	19.7	3,024	419,990		
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	4.575	43	6,029		
CENTERSPACE	3.66	2.261	143	19,969		
KITE REALTY GROUP TRUST	55.741	32.569	732	101,719		
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	24.9	-	-	-		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3.633	2.2	52	7,243		
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	35.9	-	-	-		
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8.8	5.521	102	14,229		
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	54.342	31.03	284	39,514		

銘柄	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	153.8	88.121	1,143	158,840		
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	13.105	38	5,368		
DOUGLAS EMMETT INC	45.3	26.186	442	61,419		
アメリカ・ドル 通貨計	6,511.212 157銘柄	3,839.687 145銘柄	146,165	20,297,943 <71.6%>		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	4.2	2.3	10	1,050		
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	9.4	5.1	19	1,979		
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	11.4	6.2	20	2,058		
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	4.3	45	4,603		
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	-	7.841	119	12,215		
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	-	4.4	27	2,854		
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	-	2.758	52	5,373		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17.1	8.4	78	7,997		
SLATE GROCERY REIT	7	4	62	6,403		
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14.7	9.1	152	15,553		
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	23	2,360		
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	2.8	40	4,159		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	28	18.7	189	19,352		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	22.2	15	337	34,479		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	6.1	36	3,751		
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	2.7	30	3,138		
GRANITE REAL ESTATE INVESTIME	8.5	5.1	408	41,764		
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	27	19.9	240	24,578		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17.5	11	136	13,912		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	27.6	16.7	286	29,293		
CHOICE PROPERTIES REIT	43.2	25.3	369	37,710		
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	2.7	44	4,537		
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14.1	8.4	131	13,455		
PLAZA RETAIL REIT	11.1	-	-	-		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19.1	11.3	311	31,873		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	22.8	13.5	584	59,717		
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	-	-	-		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	38.166	20.866	260	26,603		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	42	23.7	504	51,498		
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7.2	3.3	50	5,208		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5.9	3.6	180	18,414		
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12.3	8.2	133	13,671		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16.8	10.1	267	27,363		
カナダ・ドル 通貨計	482.156 30銘柄	288.465 31銘柄	5,157	526,934 <1.9%>		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
DEXUS/AU	284.343	171.638	1,349	125,180		
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	-	38.4	61	5,665		
HMC CAPITAL LTD	-	31.078	160	14,937		
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	-	53.9	39	3,701		
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93.38	46.82	156	14,553		
CROMWELL PROPERTY GROUP	371.284	199.444	140	13,047		
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	144.87	88	280	26,048		
AVENTUS GROUP	103	-	-	-		
RURAL FUNDS GROUP	108.595	53.875	137	12,797		
WAYPOINT REIT	202.491	113.781	312	29,033		
CHARTER HALL LONG WALE REIT	149.458	99.512	437	40,628		
CENTURIA OFFICE REIT	118.83	62.25	98	9,184		

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千口	千口		
CENTURIA CAPITAL GROUP	166.05	105.967	199	18,485		
IRONGATE GROUP	149.63	-	-	-		
HOME CONSORTIUM	48	-	-	-		
HOMECO DAILY NEEDS REIT	130.34	234.898	306	28,444		
REGION GROUP	291.52	178.136	488	45,290		
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	79.167	41.377	133	12,362		
NATIONAL STORAGE REIT	288.195	167.575	402	37,318		
DEXUS INDUSTRIAL REIT STAPLED UNIT	54.67	31.51	91	8,449		
GDI PROPERTY GROUP	123.31	71.46	54	5,039		
SCENTRE GROUP	1,372.159	828.278	2,435	225,956		
ARENA REIT	93.89	56.81	219	20,400		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	47.12	27.16	90	8,366		
BWP TRUST	123.87	77.951	319	29,655		
GPT GROUP	506.413	305.687	1,335	123,953		
CHARTER HALL RETAIL REIT	139.51	83.41	338	31,422		
MIRVAC GROUP	1,042.307	629.679	1,397	129,709		
STOCKLAND	631.087	380.944	1,447	134,321		
ABACUS PROPERTY GROUP	107.93	65.96	178	16,525		
GOODMAN GROUP	444.441	271.299	5,070	470,498		
VICINITY CENTRES	1,022.946	617.483	1,253	116,311		
CHARTER HALL GROUP	123.136	73.759	1,002	93,011		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	94.74	59.59	254	23,610		
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	8,656.682 31銘柄	5,267.631 31銘柄	20,195 < 6.6%>	1,873,911 < 6.6%>	
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398	321	593	10,558		
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250	142	424	7,549		
FORTUNE REIT	378	233	1,293	22,992		
PROSPERITY REIT	300	174	306	5,444		
LINK REIT	564.6	337	17,726	315,171		
CHAMPION REIT	481	268	728	12,960		
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	2,371.6 6銘柄	1,475 6銘柄	21,072 < 1.3%>	374,677 < 1.3%>	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	-	84.7	54	5,477		
KEPPEL DC REIT	331.683	204.483	380	38,429		
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	419.876	170.976	41	4,232		
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	583.9	-	-	-		
AIMS APAC REIT	119	81.1	99	10,079		
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	783.99	460.09	515	52,065		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134	73.8	56	5,667		
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	291.14	211	21,327		
EC WORLD REIT	57	36.5	16	1,641		
IREIT GLOBAL	175.124	-	-	-		
CAPITALAND ASCENDAS REIT	905.877	536.277	1,480	149,551		
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,346.522	803.522	1,671	168,870		
SUNTEC REIT	565.4	357.6	493	49,862		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	770.8	501.8	807	81,630		
KEPPEL REIT	501.4	317.6	285	28,881		
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	505.456	312.656	295	29,853		
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	709.902	894.402	313	31,629		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	191.6	127.7	153	15,483		
FRASERS CENTREPOINT TRUST	281.176	166.176	338	34,252		
STARHILL GLOBAL REIT	383.8	198.4	110	11,125		

銘柄	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千口	千口		
CAPITALAND CHINA TRUST	269.442	178.942	187	18,984		
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	98.3	62.6	241	24,414		
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	513.769	310.269	701	70,850		
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	354.5	-	-	-		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	579.884	367.484	635	64,235		
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248.1	147.8	90	9,184		
SPH REIT	275.6	163	146	14,822		
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651.063	337.763	118	11,944		
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	11,966.064 27銘柄	7,186.78 25銘柄	9,446 < 3.4%>	954,496 < 3.4%>	
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円		
STRIDE PROPERTY GROUP	-	82.638	122	10,534		
ARGOSY PROPERTY LTD	224.47	119.25	138	11,914		
KIWI PROPERTY GROUP LTD	423.8	261.44	237	20,491		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	102.92	71.483	165	14,222		
GOODMAN PROPERTY TRUST	299.22	172.8	347	29,915		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	328.82	213.35	258	22,234		
ニュージーランド・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,379.23 5銘柄	920.961 6銘柄	1,269 < 0.4%>	109,312 < 0.4%>	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
WAREHOUSE REIT PLC	-	63.302	71	11,953		
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	-	31.488	20	3,433		
ASSURA PLC	707.1	456.627	251	41,861		
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159.57	83.32	73	12,146		
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	56.2	30	5,063		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	220.71	118.46	70	11,736		
PICTON PROPERTY INCOME LTD	146.11	75.64	65	10,825		
REGIONAL REIT LTD	111.31	59.84	35	5,968		
NEWWRIVER REIT PLC	69.33	42.86	32	5,464		
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	224.81	132.59	137	22,855		
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155.49	85.98	52	8,704		
CUSTODIAN REIT PLC	109.42	60.9	55	9,303		
GCP STUDENT LIVING PLC	112.86	-	-	-		
PRS REIT PLC/THE	119.64	75.872	64	10,720		
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	90.9	53.28	54	9,140		
LXI REIT PLC	180.188	255.448	297	49,427		
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98.2	51.24	35	5,826		
AEW UK REIT PLC	49.61	21.93	21	3,517		
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201.12	128.42	116	19,426		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207	194.253	208	34,712		
URBAN LOGISTICS REIT PLC	-	70.322	98	16,307		
HOME REIT PLC	60	117.587	65	10,906		
LAND SECURITIES GROUP PLC	198.461	115.934	719	119,600		
SEGRO PLC	317.05	186.572	1,508	250,716		
HAMMERSON PLC	1,076.984	545.564	135	22,490		
UNITE GROUP PLC/THE	105.39	61.739	584	97,138		
BRITISH LAND CO PLC	247.76	144.736	585	97,368		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	67.061	36.781	186	30,967		
DERWENT LONDON PLC	29.63	17.327	414	68,953		
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	346.37	205.675	233	38,804		
WORKSPACE GROUP PLC	32.26	20.759	87	14,624		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	54.57	32.544	295	49,202		
SHAFTESBURY PLC	75.77	41.75	152	25,275		
BIG YELLOW GROUP PLC	45.64	26.76	293	48,842		

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	千口	千口	千円	千円
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	237.15	149.787	271	45,142
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121.6	78.138	35	5,825
イギリス・ポンド 通貨計	454.53	280.618	410	68,244
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シヤカ	千円
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	-	105.526	186	7,529
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	48.84	26.1	488	19,717
イスラエル・シヤカ 通貨計	48.84	162.696	947	38,208
(韓国)	千口	千口	千韓国ウォン	千円
ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	13.16	-	-	-
SK REITS LTD	-	11,423	52,488	5,500
D&D PLATFORM REIT LTD	-	8	27,360	2,867
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	-	3.93	14,835	1,554
NH ALL ONE REIT LTD	-	6,454	20,265	2,123
E KOCREF CR	-	3,584	19,389	2,032
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11.44	8.26	56,663	5,938
LOTTE REIT CO LTD	34.375	17.135	67,340	7,057
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25.06	13.09	54,061	5,665
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	5.6	25,452	2,667
JR REIT XXVII	31.29	22.64	97,352	10,202
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8.5	5.99	29,650	3,107
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27	24.442	97,768	10,246
韓国ウォン 通貨計	156.425	130.548	562,627	58,963
ユーロ (アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102.05	54.94	63	9,087
HIBERNIA REIT PLC	159.24	-	-	-
国小計	261.29	54.94	63	9,087
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9.887	5.854	137	19,684
WERELDHAVE NV	8.97	5.16	70	10,053
NSI NV	4.131	2.271	55	7,939
VASTNED RETAIL NV	4.7	2.32	50	7,211
国小計	27.688	15.605	312	44,890
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA	8.886	5.376	407	58,547
COFINIMMO	6.88	4.064	341	49,102
BEFIMMO	5.86	-	-	-
INTERVEST OFFICES & WAREHOU RETAIL ESTATES	5.48	3.03	63	9,092
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2.54	1,457	90	12,949
CARE PROPERTY INVEST	34.45	19,268	495	71,154
XIOR STUDENT HOUSING NV	6.1	3.45	57	7,529
MONTEA NV	4.58	2.67	76	10,925
国小計	77.276	40,984	1,635	234,853
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALTAREA RIGHTS	0.01	-	-	-
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28.68	14.478	752	108,053

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
ICADE	千口	千口	千ユーロ	千円
CARMILA	7.67	4,098	165	23,818
ALTAREA	11.8	7,789	108	15,567
CECINA SA	1.01	0.55	76	11,008
KLEPIERRE	13.391	7,453	706	101,392
COVIVIO	48.64	26,957	600	86,234
MERCIALYS	11.652	6,222	350	50,340
国小計	134.983	77,979	2,860	410,651
ユーロ (ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43.86	1.82	13	1,907
HAMBORNER REIT AG	17.28	9.07	67	9,701
国小計	61.14	10.89	80	11,609
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14.53	7.5	33	4,781
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	63.533	40,217	240	34,501
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	82.17	45,751	414	59,514
国小計	160.233	93,468	688	98,797
ユーロ (イタリア)	千口	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	5.19	-	-	-
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBU Z	13.24	6.93	22	3,238
国小計	18.43	6.93	22	3,238
ユーロ (その他)	千口	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	80.92	43.52	67	9,747
国小計	80.92	43.52	67	9,747
ユーロ通貨計	821.96	344,316	5,731	822,875
合計	38,927.763	23,796.327	-	26,349,822

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円	百万円
		493	-
国	STOXX 600 REAL (ドイツ)	208	-

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,305,824	4.6
投資信託証券	26,349,822	92.3
コール・ローン等、その他	885,130	3.1
投資信託財産総額	28,540,777	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝138.87円、1カナダ・ドル＝102.16円、1オーストラリア・ドル＝92.79円、1香港ドル＝17.78円、1シンガポール・ドル＝101.04円、1ニュージーランド・ドル＝86.13円、1イギリス・ポンド＝166.23円、1イスラエル・シケル＝40.334円、100韓国ウォン＝10.48円、1ユーロ＝143.58円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (27,997,680千円) の投資信託財産総額 (28,540,777千円) に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>28,892,444,962円</b>
コール・ローン等	574,697,288
投資信託受益証券(評価額)	1,305,824,050
投資信託証券(評価額)	26,349,822,166
未収入金	356,657,924
未収配当金	43,173,851
差入委託証拠金	262,269,683
<b>(B) 負債</b>	<b>544,093,403</b>
未払金	528,017,403
未払解約金	16,076,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>28,348,351,559</b>
元本	9,066,118,780
次期繰越損益金	19,282,232,779
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>9,066,118,780口</b>
1万口当り基準価額(C / D)	31,268円

\* 期首における元本額は15,433,680,362円、当作成期間中における追加設定元本額は3,053,614,153円、同解約元本額は9,421,175,735円です。

\* 当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の元本額：

ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	1,224,238,742円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	253,344,510円
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	1,829,770円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2050	12,799,703円
i F r e e 外国 R E I T インデックス	751,541,670円
i F r e e 8 資産バランス	1,876,522,826円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型)	328,188,529円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型)	179,838,342円
D C ダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	3,948,646,182円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	7,043,305円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	6,531,985円
ダイワ海外 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用)	820,015円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	149,216,410円
ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T	250,077,120円
ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド	71,541,533円
ダイワ外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワ S M A 専用)	3,938,138円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,268円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>1,254,932,311円</b>
受取配当金	1,254,027,617
受取利息	282,365
その他収益金	830,605
支払利息	△ 208,276
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>235,073,693</b>
売買益	8,126,209,009
売買損	△ 7,891,135,316
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>△ 210,406,239</b>
取引益	105,531,907
取引損	△ 315,938,146
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 23,316,693</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>1,256,283,072</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>33,195,260,573</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 21,830,237,413</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>6,660,926,547</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>19,282,232,779</b>
次期繰越損益金(I)	19,282,232,779

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

S & P先進国REIT指数（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。