

三井住友・ DC日本リート インデックスファンド

【運用報告書(全体版)】

(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

第 8 期


決算日 2024年2月26日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信／インデックス型
信託期間	無期限（設定日：2016年9月23日）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 Jリート・インデックス・マザーファンド 日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）
当ファンドの運用方法	■東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ■東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資します。
組入制限	当ファンド ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資は行いません。 Jリート・インデックス・マザーファンド ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	■年1回（原則として毎年2月25日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 証券組入 率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期 騰落率	騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期 (2020年2月25日)	13,458	0	23.2	4,616.86	23.9	1.1	98.9	3,042
5期 (2021年2月25日)	12,609	0	△6.3	4,330.11	△6.2	0.8	98.0	3,923
6期 (2022年2月25日)	12,269	0	△2.7	4,210.46	△2.8	0.5	98.4	4,687
7期 (2023年2月27日)	12,604	0	2.7	4,338.43	3.0	0.3	98.4	6,014
8期 (2024年2月26日)	12,200	0	△3.2	4,199.08	△3.2	0.3	100.1	6,556

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※東証REIT指数に関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）に帰属します。JPXは、東証REIT指数の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる商標または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

■ 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) 東証REIT指数 (配当込み)		REIT指数 先物比率 (買建-売建)	投資信託 証券組入 率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2023年2月27日	円	%		%	%	%
	12,604	—	4,338.43	—	0.3	98.4
2月末	12,581	△0.2	4,331.37	△0.2	0.3	98.3
3月末	12,219	△3.1	4,204.73	△3.1	0.3	98.2
4月末	12,837	1.8	4,420.34	1.9	0.3	98.9
5月末	12,918	2.5	4,448.91	2.5	0.3	99.0
6月末	12,837	1.8	4,421.28	1.9	0.3	99.0
7月末	12,985	3.0	4,472.88	3.1	0.3	98.8
8月末	13,175	4.5	4,539.20	4.6	0.3	98.3
9月末	12,968	2.9	4,468.30	3.0	0.3	98.6
10月末	12,701	0.8	4,372.14	0.8	0.3	98.6
11月末	12,944	2.7	4,455.46	2.7	0.3	99.1
12月末	12,730	1.0	4,382.85	1.0	0.3	98.8
2024年1月末	12,716	0.9	4,378.56	0.9	0.3	98.2
(期末) 2024年2月26日	12,200	△3.2	4,199.08	△3.2	0.3	100.1

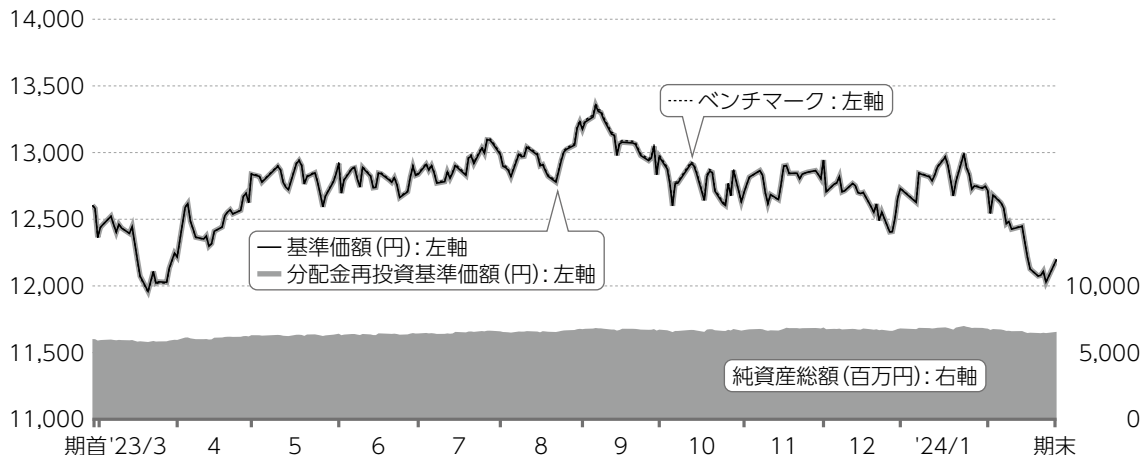
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	12,604円
期末	12,200円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-3.2% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドのベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。

※東証REIT指数に関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)に帰属します。J P Xは、東証REIT指数の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

基準価額の主な変動要因(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

上昇要因

- 日銀新総裁が就任記者会見で現行の金融緩和政策を継続する意向を示したことや各国金融当局が不安解消に向けて対応策を迅速に打ち出したこと

下落要因

- 米国の銀行破綻や欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なり、金融不安が広がったこと
- FRB(米連邦準備制度理事会)による金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利(10年国債利回り)が上昇したこと

投資環境について(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

Jリート市場は下落しました。

期初は、米国の銀行破綻に欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なったことで金融不安が広がり、リスク回避の動きが強まり急落しました。

3月下旬から9月上旬にかけて、日銀新総裁が就任記者会見で現行の金融緩和政策を継続する意向を示したことや各国金融当局が不安解消に向けて対応策を迅速に打ち出したことで上昇しました。

その後、F R Bによる金融引き締めが長

期化するとの見方から米国長期金利が上昇したことや、日銀の金融緩和政策見直しにより国内長期金利が上昇したことで、軟調に推移しました。

期末にかけては、国内長期金利の低位安定により反発する局面がありましたが、F R Bの早期利下げ期待の後退や、国内長期金利も上昇したことなどから、下落しました。

ポートフォリオについて(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

当ファンド

期を通じて「Jリート・インデックス・マザーファンド」を高位に組み入れました。

Jリート・インデックス・マザーファンド

●組入比率

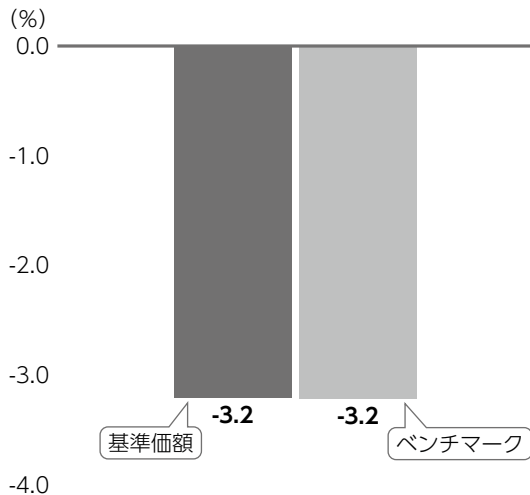
東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指し、期を通じてリートの組入比率は高位を保ちました。

●ポートフォリオの特性

主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。また、東証REIT指数先物を利用することで、実質組入比率を高位に維持しました。

ベンチマークとの差異について(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは、東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとしています。

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は-3.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率-3.2%を追いました。

分配金について(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

(単位:円、1万円当たり、税引前)

項目	第8期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	4,817

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「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(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き「Jリート・インデックス・マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

Jリート・インデックス・マザーファンド

引き続き、主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、東証REIT指数先物を含めたリートの実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

1万口当たりの費用明細(2023年2月28日から2024年2月26日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	35円	0.275%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 期中の平均基準価額は12,733円です。
(投信会社)	(18)	(0.137)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(14)	(0.110)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.027)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	5	0.037	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:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(5)	(0.037)	
(c) 有価証券取引税	-	-	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:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	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)	(-)	(-)	保管費用: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付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	40	0.318	

※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、簡便法により算出しています。

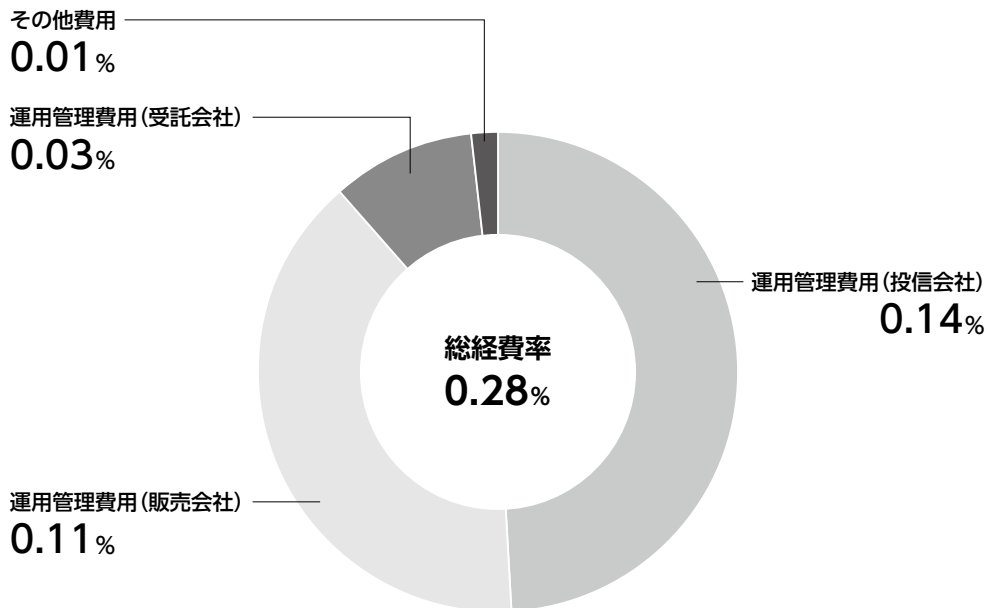
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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(年率換算)は0.28%です。

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年2月28日から2024年2月26日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
Jリート・インデックス・マザーファンド	千口 495,250	千円 1,279,922	千口 207,322	千円 538,441

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年2月28日から2024年2月26日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

Jリート・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	$\frac{D}{C}$

※平均保有割合 52.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

Jリート・インデックス・マザーファンド

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 109

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

三井住友・DC日本リートインデックスファンド

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	2,427千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	24千円
(c) (b) / (a)	1.0%

※売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年2月28日から2024年2月26日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2024年2月26日現在)

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)	期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
Jリート・インデックス・マザーファンド	千口 2,345,913	千口 2,633,842	千円 6,565,906

※Jリート・インデックス・マザーファンドの期末の受益権総口数は5,385,246,423口です。

■ 投資信託財産の構成

(2024年2月26日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
Jリート・インデックス・マザーファンド	千円 6,565,906	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,628	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	6,589,534	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年2月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	6,589,534,443円
コール・ローン等	23,628,381
Jリート・インデックス・マザーファンド(評価額)	6,565,906,062
(B) 負 債	33,088,001
未払解約金	23,616,704
未払信託報酬	9,285,629
その他未払費用	185,668
(C) 純資産総額(A-B)	6,556,446,442
元 本	5,374,356,219
次期繰越損益金	1,182,090,223
(D) 受益権総口数	5,374,356,219口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,200円

※当期における期首元本額4,771,582,886円、期中追加設定元本額1,645,906,804円、期中一部解約元本額1,043,133,471円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2023年2月28日 至2024年2月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,395円
受 取 利 息	541
支 払 利 息	△ 3,936
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 209,909,086
売 買 損 益	13,079,430
売 買 損 益	△ 222,988,516
(C) 信 託 報 酬 等	△ 18,220,965
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 228,133,446
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	122,441,392
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,287,782,277
(配当等相当額)	(1,867,517,480)
(売買損益相当額)	(△ 579,735,203)
(G) 合 計(D+E+F)	1,182,090,223
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,182,090,223
追 加 信 託 差 損 益 金	1,287,782,277
(配当等相当額)	(1,872,323,629)
(売買損益相当額)	(△ 584,541,352)
分 配 準 備 積 立 金	716,918,987
繰 越 損 益 金	△ 822,611,041

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	216,045,905円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,872,323,629
(d) 分配準備積立金	500,873,082
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,589,242,616
1万口当たり当期分配対象額	4,817.77
(f) 分配金	0
1万口当たり分配金	0

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	当 期
	0円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

リート・インデックス・マザーファンド

第38期（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

信託期間	無期限（設定日：2005年6月21日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）を主要投資対象とします。 東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		（ベンチマーク） 東証REIT指数（配当込み）		REIT指数 先物比率 （買建-売建）	投資信託 組入率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
34期（2022年2月25日）	24,907	△8.2	4,210.46	△8.5	0.5	98.3	8,187
35期（2022年8月25日）	27,322	9.7	4,623.32	9.8	0.4	99.1	9,741
36期（2023年2月27日）	25,673	△6.0	4,338.43	△6.2	0.3	98.3	11,580
37期（2023年8月25日）	26,570	3.5	4,486.82	3.4	0.3	98.9	13,212
38期（2024年2月26日）	24,929	△6.2	4,199.08	△6.4	0.3	99.9	13,425

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

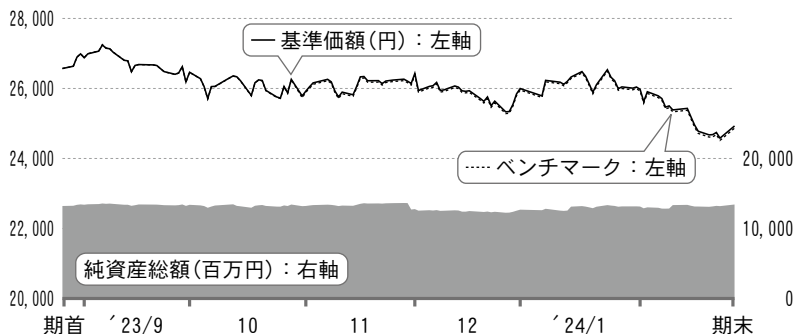
年月日	基準価額		（ベンチマーク） 東証REIT指数（配当込み）		REIT指数 先物比率 （買建-売建）	投資信託 組入率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
（期首） 2023年8月25日	円	%		%	%	%
8月末	26,877	1.2	4,539.20	1.2	0.3	98.3
9月末	26,463	△0.4	4,468.30	△0.4	0.3	98.6
10月末	25,924	△2.4	4,372.14	△2.6	0.3	98.6
11月末	26,428	△0.5	4,455.46	△0.7	0.3	99.0
12月末	25,998	△2.2	4,382.85	△2.3	0.3	98.7
2024年1月末	25,976	△2.2	4,378.56	△2.4	0.3	98.0
（期末） 2024年2月26日	24,929	△6.2	4,199.08	△6.4	0.3	99.9

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

基準価額等の推移



期首	26,570円
期末	24,929円
騰落率	-6.2%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

当ファンドは、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託（リート）に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

下落要因

- ・ F R B（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが長期化するとの見方から長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと

▶ 投資環境について（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

Ｊリート市場は、下落しました。

期初から年末にかけて、ＦＲＢによる金融引き締めが長期化するとの見方から米国長期金利が上昇したことや、日銀の金融緩和政策変更により国内長期金利が上昇したことで、Ｊリート市場は軟調に推移しました。

その後、国内長期金利の低位安定により反発する局面がありましたが、期末にかけては、ＦＲＢの早期利下げ期待の後退や国内長期金利が上昇したことなどから、下落しました。

▶ ポートフォリオについて（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

リート組入比率

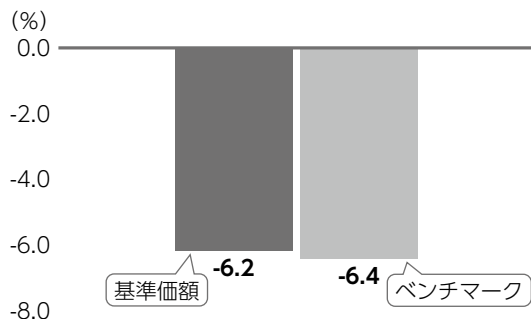
東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、リートの組入比率は高位を保ちました。

ポートフォリオの特性

主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。また、東証ＲＥＩＴ指数先物を利用することで、実質組入比率を高位に維持しました。

▶ ベンチマークとの差異について（2023年8月26日から2024年2月26日まで）

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとしています。

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-6.2%となり、ベンチマークの騰落率-6.4%を0.2%上方乖離しました。

上方乖離要因 ・ 現金などのキャッシュポジションが相場下落時にプラス寄与したこと

2 今後の運用方針

引き続き、主として日本の取引所に上場しているリートに投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。また、東証REIT指数先物を含めたリートの組入比率は、原則として高位を保ちます。

Jリート・インデックス・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細 (2023年8月26日から2024年2月26日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託証券)	5円 (0) (5)	0.019% (0.000) (0.019)	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：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)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	5	0.019	

期中の平均基準価額は26,071円です。

※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、簡便法により算出しています。
※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。
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年8月26日から2024年2月26日まで)

(1) 投資信託証券

	買		付		売		付	
	口数	買付額	口数	買付額	口数	売付額	口数	売付額
		千円		千円		千円		千円
国内								
エスコンジャパンリート投資法人	57	6,745	29	3,430				
サンケイリアルエステート投資法人	95	8,635	54	4,921				
SOSILA物流リート投資法人	161	19,247	88	10,595				
東海道リート投資法人	68	7,544	18	2,269				
東海道リート投 新	△ 8 (8)	— (972)	— (—)	— (—)				
日本アコモデーションファンド投資法人	111	67,572	63	38,603				
森ヒルズリート投資法人	376	51,946	211	29,733				
産業ファンド投資法人	443	60,678	272	37,535				
産業ファンド新	— (228)	— (27,142)	— (—)	— (—)				
アドバンス・レジデンス投資法人	347	108,512	174	56,707				
アドバンスレジデンス新	△ 13 (13)	— (4,265)	— (—)	— (—)				
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	51 (△ 931)	11,555 (—)	19 (—)	4,338 (—)				
アクティブア・プロパティーズ投資法人	167	66,762	94	38,397				
GLP投資法人	1,067	142,864	603	83,761				
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	155	48,472	87	27,895				
日本プロロジスリート投資法人	548	148,732	310	85,291				
星野リゾート・リート投資法人	56	32,029	30	18,038				

Jリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	Oneリート投資法人	48	12,726	23	6,062
	イオンリート投資法人	394	55,147	222	31,647
	ヒューリックリート投資法人	298	45,694	169	26,051
	日本リート投資法人	99	33,793	53	18,492
	積水ハウス・リート投資法人	953	74,990	538	42,842
	トーセイ・リート投資法人	61	8,441	32	4,370
	ケネディクス商業リート投資法人	31 (△ 552)	8,946 (-)	12 (-)	3,505 (-)
	ヘルスケア&メディカル投資法人	72	9,926	38	5,371
	野村不動産マスターファンド投資法人	1,017	164,581	575	96,106
	いちごホテルリート投資法人	40	4,473	19	2,067
	ラサールロジポート投資法人	404	60,128	227	33,756
	スターアジア不動産投資法人	502	29,140	274	15,768
	マリモ地方創生リート投資法人	36	4,458	17	2,146
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	132	60,520	74	34,558
	大江戸温泉リート投資法人	34	2,390	20	1,316
	投資法人みらい	449	18,597	137	6,151
	投資法人みらい 新	△ 36 (36)	- (1,525)	- (-)	- (-)
	三菱地所物流リート投資法人	107	39,817	59	22,228
	CREロジスティクスファンド投資法人	140	21,834	77	12,328
	ザイマックス・リート投資法人	44	5,180	22	2,603
	タカラレーベン不動産投資法人	138	13,931	84	8,448
	タカラレーベン不動産投 新	- (45)	- (4,182)	- (-)	- (-)
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	142	17,911	79	10,045
	日本ビルファンド投資法人	361	216,696	199	120,951
	ジャパンリアルエステイト投資法人	321	182,356	181	103,539
	日本都市ファンド投資法人	1,510	147,850	853	83,578
	オリックス不動産投資法人	630	106,830	357	61,380
	日本プライムリアルティ投資法人	216	75,690	122	44,160
	NTT都市開発リート投資法人	385	44,682	177	22,779
	NTT都市開発リート投 新	△ 33 (33)	- (4,036)	- (-)	- (-)
	東急リアル・エステート投資法人	212	36,617	119	21,072
	グローバル・ワン不動産投資法人	238	26,373	133	14,744
ユナイテッド・アーバン投資法人	709	105,077	401	59,944	
森トラストリート投資法人	612	44,621	344	25,148	

Jリート・インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	インヴィンシブル投資法人	1,533	92,081	868	52,180
	フロンティア不動産投資法人	116	50,877	64	28,620
	平和不動産リート投資法人	242	33,400	135	18,702
	日本ロジスティクスファンド投資法人	205	57,397	115	33,066
	福岡リート投資法人	165	27,635	91	15,170
	KDX不動産投資法人	753 (2,911)	125,952 (-)	460 (-)	78,974 (-)
	いちごオフィスリート投資法人	265	22,002	146	12,341
	大和証券オフィス投資法人	41	25,912	9	6,084
	阪急阪神リート投資法人	155	21,882	86	12,195
	スターツプロシード投資法人	46	9,370	23	4,733
	大和ハウスリート投資法人	477	122,975	270	71,015
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,212	81,769	600	42,581
	ジャパン・ホテル・リート新	△ 78 (78)	- (5,618)	- (-)	- (-)
	大和証券リビング投資法人	436	47,045	107	11,524
	ジャパンエクセレント投資法人	278	34,836	155	20,194

※金額は受渡し代金。

※（ ）内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(2) 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 R E I T 指 数 先 物 取 引	百万円 73	百万円 74	百万円 —	百万円 —

※金額は受渡し代金。

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年8月26日から2024年2月26日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	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 3,261	百万円 487	% 15.0	百万円 1,792	百万円 853	% 47.6

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投 資 信 託 証 券	百万円 42

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年8月26日から2024年2月26日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2024年2月26日現在)

(1) 国内投資信託証券

銘柄	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
		口		口		千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			247		275	31,570	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			392		433	38,320	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人			611		684	77,634	0.6
東海道リート投資法人			180		230	28,198	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			422		470	277,770	2.1
森ヒルズリート投資法人		1,440		1,605		209,773	1.6
産業ファンド投資法人		1,871		2,042		255,250	1.9
産業ファンド新		—		228		28,500	0.2
アドバンス・レジデンス投資法人		1,164		1,337		415,807	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			899		—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人			642		715	279,565	2.1
GLP投資法人		4,137		4,601		559,021	4.2
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			602		670	194,970	1.5
日本プロロジスリート投資法人		2,134		2,372		609,129	4.5
星野リゾート・リート投資法人			225		251	136,293	1.0
One リート投資法人			211		236	62,044	0.5
イオンリート投資法人		1,502		1,674		222,809	1.7
ヒューリックリート投資法人		1,147		1,276		192,293	1.4
日本リート投資法人			397		443	145,304	1.1
積水ハウス・リート投資法人		3,682		4,097		303,997	2.3
トーセイ・リート投資法人			256		285	39,130	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			533		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人			300		334	43,386	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			326		326	33,741	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		3,961		4,403		670,136	5.0
いちごホテルリート投資法人			200		221	24,663	0.2
ラサールロジポート投資法人		1,567		1,744		253,577	1.9
スターアジア不動産投資法人		1,877		2,105		118,932	0.9
マリモ地方創生リート投資法人			186		205	24,579	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			509		567	244,377	1.8
大江戸温泉リート投資法人			186		200	15,320	0.1
投資法人みらい		1,568		1,880		83,472	0.6
三菱地所物流リート投資法人			423		471	167,205	1.2
CREロジスティクスファンド投資法人			527		590	85,019	0.6
ザイマックス・リート投資法人			195		217	25,323	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			581		635	61,912	0.5
タカラレーベン不動産投 新			—		45	4,267	0.0
アドバンス・ロジスティクス投資法人			538		601	72,420	0.5
日本ビルファンド投資法人		1,427		1,589		931,154	6.9
ジャパンリアルエステイト投資法人		1,258		1,398		757,716	5.6
日本都市ファンド投資法人		5,872		6,529		599,362	4.5
オリックス不動産投資法人		2,441		2,714		441,025	3.3
日本プライムリアルティ投資法人			838		932	308,958	2.3

Jリート・インデックス・マザーファンド

銘	柄	期首 (前期末)		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額	組 入 比 率
NTT都市開発リート投資法人			1,177	1,385	166,615		1.2
東急リアル・エステート投資法人			822	915	149,602		1.1
グローバル・ワン不動産投資法人			905	1,010	108,171		0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人			2,741	3,049	436,007		3.2
森トラストリート投資法人			2,363	2,631	188,642		1.4
インヴィンシブル投資法人			5,933	6,598	418,973		3.1
フロンティア不動産投資法人			454	506	214,038		1.6
平和不動産リート投資法人			915	1,022	137,254		1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人			784	874	226,453		1.7
福岡リート投資法人			633	707	119,907		0.9
KDX不動産投資法人			713	3,917	587,550		4.4
いちごオフィスリート投資法人			1,004	1,123	89,166		0.7
大和証券オフィス投資法人			250	282	167,508		1.2
阪急阪神リート投資法人			584	653	90,048		0.7
スタートアップリート投資法人			210	233	45,318		0.3
大和ハウスリート投資法人			1,846	2,053	507,091		3.8
ジャパン・ホテル・リート投資法人			3,951	4,563	338,118		2.5
大和証券リビング投資法人			1,674	2,003	205,708		1.5
ジャパンエクセレント投資法人			1,064	1,187	144,339		1.1
合 計	口 数	金 額	75,497	86,341	13,414,443		99.9
	銘 柄 数	<比 率>	60銘柄	60銘柄	<99.9%>		

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※外国籍の投資信託証券を含む場合があります。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※期末時点の保有銘柄のうち、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、ラサールロジポート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、星野リゾート・リート投資法人、日本プロロジスリート投資法人、GLP投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、大和ハウスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、KDX不動産投資法人、福岡リート投資法人、フロンティア不動産投資法人、日本ビルファンド投資法人につきましては、委託会社の利害関係人等である株式会社三井住友銀行が一般事務受託会社になっています。（当該投資法人で開示されている直近の有価証券報告書等より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	期		末	
			買 建	額	売 建	額
国内	東 証	R E I T		百万円 34		百万円 -

■ 投資信託財産の構成

(2024年2月26日現在)

項 目	期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 信 託 財 産 総 額				
投 資 信 託 財 産	13,414,443	98.2	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	242,638	1.8		
投 資 信 託 財 産 総 額	13,657,081	100.0		

Jリート・インデックス・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年2月26日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	13,657,081,676円
コー ル ・ ロ ー ン 等	134,701,171
投 資 証 券 (評 価 額)	13,414,443,660
未 収 配 当 金	103,859,241
差 入 委 託 証 拠 金	4,077,604
(B) 負 債	231,990,457
未 払 金	231,990,124
そ の 他 未 払 費 用	333
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	13,425,091,219
元 本	5,385,246,423
次 期 繰 越 損 益 金	8,039,844,796
(D) 受 益 権 総 口 数	5,385,246,423口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	24,929円

※当期における期首元本額4,972,524,941円、期中追加設定元本額1,400,861,815円、期中一部解約元本額988,140,333円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	203,635,295円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	301,170,920円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	135,681,821円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,633,842,538円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,782,481円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,853,288円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	45,264,181円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	205,362,615円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	132,990,353円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	103,930,403円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,482,845円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,491,911円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	284,267,565円
日興FWS・Jリートインデックス	842,368,209円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	78,185,560円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	1,773,057円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,204,302円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,026,313円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	660,176円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	427,747円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	237,890円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,395,629円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	50,453,223円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	38,171,689円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	17,693,867円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,929,952円
SMAM・年金Wリスコントロールファンド<適格機関投資家限定>	72,413,478円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	38,310,122円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	61,238,993円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2023年8月26日 至2024年2月26日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	282,932,633円
受 取 配 当 金	276,614,864
受 取 利 息	541
そ の 他 収 益 金	6,334,781
支 払 利 息	△ 17,553
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,121,620,154
売 買 益	45,638,811
売 買 損	△1,167,258,965
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 2,401,600
取 引 益	635,600
取 引 損	△ 3,037,200
(D) そ の 他 費 用 等	△ 1,692
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 841,090,813
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	8,239,507,046
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,595,092,099
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,236,520,662
(I) 合 計 (E + F + G + H)	8,039,844,796
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	8,039,844,796

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※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。

※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

<約款変更について>

該当事項はございません。