

■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	2014年8月22日から2020年1月14日までです。	
運用方針	アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド受益証券に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	アムンディ・Jリート・インデックス・オープン	アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンドの受益証券
	アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド	日本の金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券
組入制限	アムンディ・Jリート・インデックス・オープン	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時(年1回、原則7月14日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。収益分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

アムンディ・Jリート・インデックス・オープン

償還 運用報告書 (全体版)

第6期 (償還日 2020年1月14日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、2020年1月14日に信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに、謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900(フリーダイヤル)
受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで
ホームページアドレス : <https://www.amundi.co.jp/>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	REIT 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)			
	円	円	%	ポイント	%	%	百万円
2期(2016年7月14日)	11,929	0	12.5	3,400.52	13.4	97.9	734
3期(2017年7月14日)	10,600	0	△11.1	3,041.74	△10.6	98.1	877
4期(2018年7月17日)	12,058	0	13.8	3,477.46	14.3	97.0	609
5期(2019年7月16日)	14,143	0	17.3	4,101.28	17.9	97.5	502
(償還時) 6期(2020年1月14日)	(償還価額) 15,276.67		8.0	4,431.78	8.1	—	624

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託証券組入比率」「REIT指数先物比率」は実質組入比率を記載しています。以下同じ。

(注2) REIT指数先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注3) ベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所(以下「東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利および東証REIT指数の商標に関するすべての権利は、東京証券取引所が有します。以下同じ。

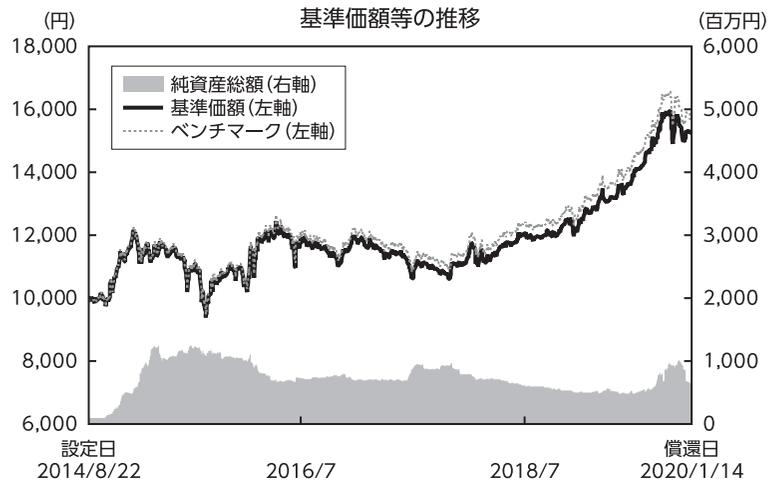
■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	REIT 指数 先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2019年7月16日	14,143	—	4,101.28	—	97.5	2.4
7月末	14,204	0.4	4,120.33	0.5	97.6	2.3
8月末	14,731	4.2	4,275.94	4.3	97.6	2.3
9月末	15,414	9.0	4,477.77	9.2	98.3	1.6
10月末	15,892	12.4	4,625.77	12.8	98.6	1.4
11月末	15,757	11.4	4,584.30	11.8	98.6	1.3
12月末	15,283	8.1	4,450.34	8.5	97.7	2.2
(償還時) 2020年1月14日	(償還価額) 15,276.67		8.0	4,431.78	8.1	—

(注) 騰落率は期首比です。

【設定以来の基準価額等の推移】

第1期首 (設定日)	10,000円
第6期末 (償還日)	15,276円67銭
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	52.8%



(注1) ベンチマーク(ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数)は、東証REIT指数(配当込み)です。
(注2) ベンチマークは、設定日(2014年8月22日)を10,000として指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① GPIF(年金積立金管理運用独立行政法人)や国内外投資家からの資金流入により需給が改善したこと(2015年前半)
- ② 金利が低下したことで不動産市況にとって良好な経済環境となったこと(特に、2016年1月)
- ③ オフィスビルの賃料収入の増加などファンダメンタルズ(基礎的条件)の改善がみられたこと(特に、2018年後半から2019年半ば)

下落要因

- ① 国内外の株式市場の下落などを背景にリート市場から資金が流出したこと(2015年後半)
- ② 英国によるEU(欧州連合)離脱や、米国政治情勢など政治リスクが台頭したこと(特に、2016年半ばから2017年)
- ③ 利益確定のための売りが増勢したこと(特に、2019年終盤)

【投資環境】

＜国内不動産投資信託市場＞

アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ポートフォリオ】

＜当ファンド＞

当ファンドは、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。信託期間を通じて、マザーファンドの組入比率は高位を維持しました。2020年1月上旬にマザーファンド受益証券をすべて売却し、以降は解約金、償還金の支払いに備えコール・ローン等の短期金融資産を中心とした安定運用に切り替えました。

＜アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド＞

アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ベンチマークとの差異】

設定来の当ファンドの騰落率は52.8%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の騰落率の58.1%を下回る結果となりましたが、おおむねベンチマークと連動した動きとなりました。

マイナス要因：信託報酬等の費用

【分配金】

基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、信託期間中分配は行いませんでした。

満期償還にあたり、受益者のみなさまのご愛顧に対し心からお礼申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 6 期 (2019年7月17日 ～2020年1月14日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	32円 (15) (15) (2)	0.213% (0.098) (0.098) (0.016)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	10 (10) (0)	0.068 (0.067) (0.000)	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用 (印 刷 費 用) (そ の 他)	5 (5) (1)	0.035 (0.030) (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 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	47	0.316	
期中の平均基準価額は15,213円です。			

(注1) 費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

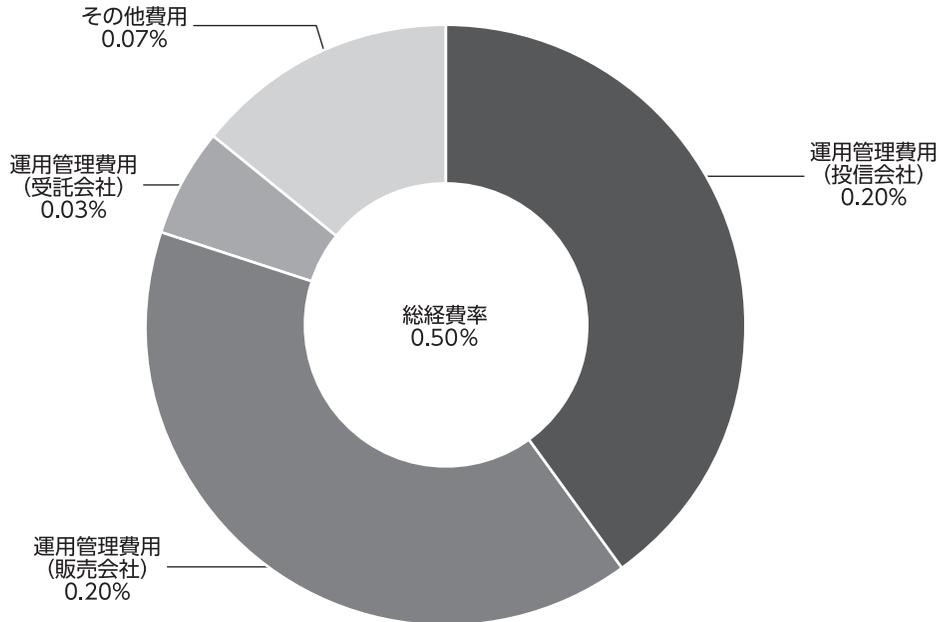
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.50%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買及び取引の状況（2019年7月17日から2020年1月14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
	千口	千円	千口	千円
アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド	623,612	984,573	969,728	1,519,615

(注) 単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等（2019年7月17日から2020年1月14日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細（2020年1月14日現在）

償還日現在、マザーファンドの組入はありません。

(前期末：2019年7月16日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首（前期末）
	口 数
	千口
アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド	346,115

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2020年1月14日現在）

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	660,403	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	660,403	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2020年1月14日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	660,403,906円
コール・ローン等	660,403,906
(B) 負 債	36,140,074
未 払 解 約 金	34,315,332
未 払 信 託 報 酬	1,562,468
未 払 利 息	1,592
そ の 他 未 払 費 用	260,682
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	624,263,832
元 本	408,638,684
償 還 差 益 金	215,625,148
(D) 受 益 権 総 口 数	408,638,684口
1万口当たり償還価額(C/D)	15,276円67銭

(注記事項)

期首元本額	355,111,293円
期中追加設定元本額	903,507,589円
期中一部解約元本額	849,980,198円

■損益の状況

当期 (自2019年7月17日 至2020年1月14日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,254円
支 払 利 息	△ 3,254
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,133,411
売 買 益	21,008,218
売 買 損	△ 18,874,807
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,823,396
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	306,761
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,899,494
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	205,418,893
(配 当 等 相 当 額)	(110,603,859)
(売 買 損 益 相 当 額)	(94,815,034)
償 還 差 益 金(D+E+F)	215,625,148

(注1) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年 8 月 22 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2020年 1 月 14 日		資産総額	660,403,906円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	36,140,074円
受益権口数	100,000,000口	408,638,684口	308,638,684口	純資産総額	624,263,832円
元本額	100,000,000円	408,638,684円	308,638,684円	受益権口数	408,638,684口
				1万口当たり償還金	15,276.67円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,116,155,046円	1,183,639,810円	10,605円	0円	0.0000%
第2期	615,762,349	734,561,089	11,929	0	0.0000
第3期	827,862,862	877,524,451	10,600	0	0.0000
第4期	505,184,175	609,153,892	12,058	0	0.0000
第5期	355,111,293	502,216,934	14,143	0	0.0000

■償還金のお知らせ

償還決算日	2020年1月14日
1万口当たりの償還金(税込み)	15,276円67銭

アムンディ・Jリート・インデックス・マザーファンド

償還 運用報告書

《第6期》

償還日：2020年1月10日

(計算期間：2019年7月17日～2020年1月10日)

当ファンドはこの度、上記の償還を行いました。ここに期中の運用状況と償還内容についてご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2014年8月22日から2020年1月10日（当初：無期限）までです。
運用方針	当ファンドは、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本の金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	REIT 指数 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	(ベンチマーク) ポイント	期中 騰落率			
2期 (2016年7月14日)	12,038	13.1%	3,400.52	13.4%	97.9%	2.0%	734 百万円
3期 (2017年7月14日)	10,752	△10.7	3,041.74	△10.6	98.1	1.8	877
4期 (2018年7月17日)	12,296	14.4	3,477.46	14.3	97.0	2.9	608
5期 (2019年7月16日)	14,499	17.9	4,101.28	17.9	97.6	2.4	501
(償還時)	(償還価額)						
6期 (2020年1月10日)	15,701.37	8.3	4,431.78	8.1	—	—	660

(注1) REIT指数先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注2) ベンチマークは東証REIT指数です。東証REIT指数の数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利および東証REIT指数の商標に関するすべての権利は、東京証券取引所が有します。以下同じ。

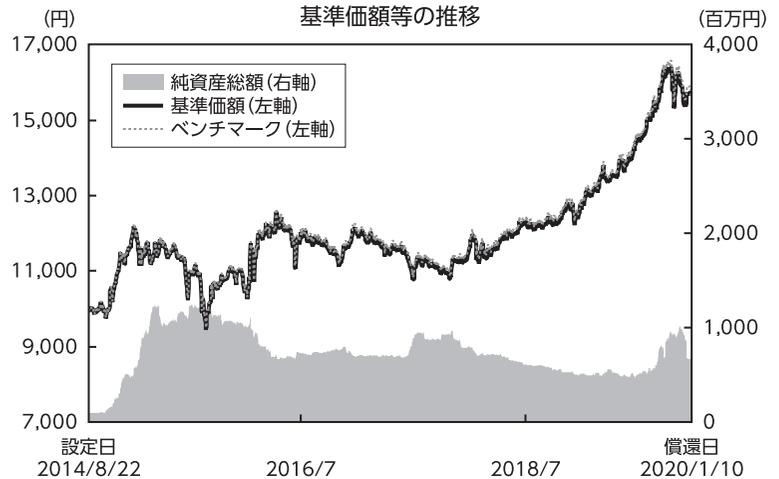
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	REIT 指数 先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク) ポイント	騰落率		
(期首) 2019年7月16日	14,499	—	4,101.28	—	97.6%	2.4%
7月末	14,565	0.5	4,120.33	0.5	97.7	2.3
8月末	15,112	4.2	4,275.94	4.3	97.7	2.3
9月末	15,819	9.1	4,477.77	9.2	98.3	1.6
10月末	16,317	12.5	4,625.77	12.8	98.6	1.4
11月末	16,184	11.6	4,584.30	11.8	98.6	1.3
12月末	15,704	8.3	4,450.34	8.5	97.7	2.2
(償還時)	(償還価額)					
2020年1月10日	15,701.37	8.3	4,431.78	8.1	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

【設定以来の基準価額等の推移】

第1期首 (設定日)	10,000円
第6期末 (償還日)	15,701円37銭
騰落率	57.0%



(注1) ベンチマーク (ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数) は、東証REIT指数 (配当込み) です。
 (注2) ベンチマークは、設定日 (2014年8月22日) を10,000として指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① G P I F (年金積立金管理運用独立行政法人) や国内外投資家からの資金流入により需給が改善したこと (2015年前半)
- ② 金利が低下したことで不動産市況にとって良好な経済環境となったこと (特に、2016年1月)
- ③ オフィスビルの賃料収入の増加などファンダメンタルズ (基礎的条件) の改善がみられたこと (特に、2018年後半から2019年半ば)

下落要因

- ① 国内外の株式市場の下落などを背景にリート市場から資金が流出したこと (2015年後半)
- ② 英国によるEU (欧州連合) 離脱や、米国政治情勢など政治リスクが台頭したこと (特に、2016年半ばから2017年)
- ③ 利益確定のための売りが増勢したこと (特に、2019年終盤)

【投資環境】

＜国内不動産投資信託市場＞

当ファンドの設定日である2014年8月22日以来、東証REIT指数はしばらくの間は上下に変動しつつ推移した後、2019年に入って大きく上昇する展開となりました。

ファンドの運用開始当初においては、GPIFが日本株運用の見直しによりJリークの運用を開始したことや長期金利が低位で安定して推移していたことが市場の上昇要因となりましたが、その一方で中国政府が人民元を切り下げたことによる内外株式市場の下落やギリシャ債務問題などの懸念がマイナス要因となりました。2016年1月に日銀がマイナス金利導入を決定すると、不動産市況の改善に対する期待が膨らみリート市場も上昇しました。しかし、英国のEU離脱など反EU勢力の拡大が欧州各地で見られるようになったことや米国大統領選挙の行方に対する懸念など政治リスクが強く意識されるようになり、リート市場は精彩を欠いた展開となりました。2018年頃からリート市場は回復に転じ、2019年に入ると最高値を更新する強い地合いとなりました。時において、利益確定の売りが増勢したことによって短期的に調整する局面もみられましたが、総じて世界的な金利先安観が強まったことや日本国内のオフィスビルの空室率低下に伴う賃料収入の増加などファンダメンタルズの改善が進んだことからリート市場に対する国内外の投資家からの資金流入が活発となり好調に推移しました。期末にかけては米中貿易協議における両国の歩み寄りや長期金利の上昇を受け、株式や他の資産に資金を移す動きが広がり、利益確定の売りが再び増勢となりやや軟調に推移しました。

【ポートフォリオ】

ポートフォリオの構築・運用は、東証REIT指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。2020年1月上旬には、ファンドの償還に備えポジションをすべて売却しました。

【ベンチマークとの差異】

設定来の当ファンドの騰落率は57.0%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の騰落率の57.8%を下回る結果となりましたが、おおむねベンチマークと連動した動きとなりました。

マイナス要因：追加設定・一部解約に伴う売買手数料等

プラス要因：追加設定・一部解約時の売買タイミング効果

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第6期 (2019年7月17日 ～2020年1月10日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券) (先物・オプション)	14円 (14) (0)	0.092% (0.092) (0.000)	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 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 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	14	0.092	

期中の平均基準価額は15,616円です。

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況 (2019年7月17日から2020年1月10日まで)

(1) 投資信託証券

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
	口	千円	口	千円	
国	エスコンジャパンリート投資法人	10	1,245	15	1,928
	サンケイリアルエステート投資法人	10	1,210	15	1,900
	日本アコモデーションファンド投資法人	28	19,017	44	29,835
	MCUBS MidCity投資法人	111	13,261	165	19,498
	森ヒルズリート投資法人	103	17,850	159	27,925
	産業ファンド投資法人	109	17,609	168	27,471
	アドバンス・レジデンス投資法人	84	29,644	131	45,215
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	59	12,477	89	18,418
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	43	23,987	69	37,589
	GLP投資法人	223	31,323	343	46,887
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	35	12,111	55	18,867
	日本プロロジスリート投資法人	128	37,697	198	56,132
	星野リゾート・リート投資法人	17	9,958	24	13,800
	ONEリート投資法人	14	4,533	21	7,196
	イオンリート投資法人	100	14,689	150	22,182
	ヒューリックリート投資法人	75	15,034	114	22,547
	内	日本リート投資法人	30	13,778	46
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		596	12,498	893	19,340
日本ヘルスケア投資法人		7	1,329	9	1,778
積水ハウスリート投資法人		259	24,902	401	36,922
トーセイ・リート投資法人		21	2,846	30	3,996
ケネディクス商業リート投資法人	38	10,706	56	15,415	

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	口	千円	口	千円
ヘルスケア&メディカル投資法人	15	2,041	25	3,376
サムティ・レジデンシャル投資法人	17	2,068	27	3,170
野村不動産マスターファンド投資法人	280	54,979	431	81,020
いちごホテルリート投資法人	13	1,693	22	2,959
ラサールロジポート投資法人	85	13,399	125	19,756
スターアジア不動産投資法人	31	3,618	46	5,355
マリモ地方創生リート投資法人	4	513	8	1,036
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	21	9,367	33	15,393
大江戸温泉リート投資法人	14	1,307	22	2,054
さくら総合リート投資法人	18	1,756	28	2,715
投資法人みらい	100	6,143	153	9,277
森トラスト・ホテルリート投資法人	22	3,145	33	4,850
三菱地所物流リート投資法人	19	6,583	24	8,530
CREロジスティクスファンド投資法人	11	1,481	16	2,152
ザイマックス・リート投資法人	14	1,863	19	2,593
タカラレーベン不動産投資法人	27	3,250	34	4,221
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	10	1,179	17	2,028
日本ビルファンド投資法人	85	69,002	132	106,033
ジャパンリアルエステイト投資法人	89	64,420	138	99,345
日本リートファンド投資法人	169	39,420	261	60,891
オリックス不動産投資法人	177	41,259	274	63,948
日本プライムリアルティ投資法人	61	30,749	92	44,719
プレミアム投資法人	83	13,284	129	20,018
東急リアル・エステート投資法人	60	12,330	92	18,762
グローバル・ワン不動産投資法人	62	9,002	96	13,483
ユナイテッド・アーバン投資法人	199	41,701	308	63,474
森トラスト総合リート投資法人	61	11,938	96	18,604
インヴィンシブル投資法人	432	28,175	600	37,769
フロンティア不動産投資法人	35	16,441	52	24,057
平和不動産リート投資法人	52	7,206	82	11,158
日本ロジスティクスファンド投資法人	60	16,368	92	25,178
福岡リート投資法人	47	8,619	72	13,262
ケネディクス不動産投資法人	28	23,354	43	35,657
いちご不動産投資法人	67	7,389	107	11,803
DAオフィス投資法人	20	16,497	31	25,449
阪急リート投資法人	44	7,416	66	11,148
スタートアップリート投資法人	13	2,637	21	4,225
大和ハウスリート投資法人	117	35,244	182	52,391
ジャパンホテルリート投資法人	289	24,669	445	37,138
日本賃貸住宅投資法人	97	9,889	152	15,764
ジャパンエクセレント投資法人	79	14,023	122	21,633
合 計	5,227	993,153	7,943	1,502,772

(注1) 金額は受渡し代金です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
REIT指数先物取引	27	40	—	—

■主要な売買銘柄 (2019年7月17日から2020年1月10日まで)

投資信託証券

買 付			売 付		
銘 柄	口数	金額	銘 柄	口数	金額
	口	千円		口	千円
日本ビルファンド投資法人	85	69,002	日本ビルファンド投資法人	132	106,033
ジャパンリアルエステイト投資法人	89	64,420	ジャパンリアルエステイト投資法人	138	99,345
野村不動産マスターファンド投資法人	280	54,979	野村不動産マスターファンド投資法人	431	81,020
ユナイテッド・アーバン投資法人	199	41,701	オリックス不動産投資法人	274	63,948
オリックス不動産投資法人	177	41,259	ユナイテッド・アーバン投資法人	308	63,474
日本リテールファンド投資法人	169	39,420	日本リテールファンド投資法人	261	60,891
日本プロロジスリート投資法人	128	37,697	日本プロロジスリート投資法人	198	56,132
大和ハウスリート投資法人	117	35,244	大和ハウスリート投資法人	182	52,391
GLP投資法人	223	31,323	GLP投資法人	343	46,887
日本プライムリアルティ投資法人	61	30,749	アドバンス・レジデンス投資法人	131	45,215

(注) 金額は受渡し代金です。(償還分は含まれておりません。)

■利害関係人との取引状況等 (2019年7月17日から2020年1月10日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細 (2020年1月10日現在)

償還日現在、有価証券の組入はありません。

(前期末：2019年7月16日現在)

(1) 投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)	
	口	数
	口	
エスコンジャパンリート投資法人	5	
サンケイリアルエステイト投資法人	5	
日本アコモデーションファンド投資法人	16	
MCUBS Midcity投資法人	54	
森ヒルズリート投資法人	56	
産業ファンド投資法人	59	
アドバンス・レジデンス投資法人	47	

銘 柄	期首(前期末)	
	口	数
	口	
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	30	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	26	
GLP投資法人	120	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	20	
日本プロロジスリート投資法人	70	
星野リゾート・リート投資法人	7	
ONEリート投資法人	7	

銘柄	期首(前期末)	
	口	数
		口
イオンリート投資法人		50
ビューリックリート投資法人		39
日本リート投資法人		16
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		297
日本ヘルスケア投資法人		2
積水ハウスリート投資法人		142
トーセイ・リート投資法人		9
ケネディクス商業リート投資法人		18
ヘルスケア&メディカル投資法人		10
サムティ・レジデンシャル投資法人		10
野村不動産マスターファンド投資法人		151
いちごホテルリート投資法人		9
ラサールロジポート投資法人		40
スターアジア不動産投資法人		15
マリモ地方創生リート投資法人		4
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		12
大江戸温泉リート投資法人		8
さくら総合リート投資法人		10
投資法人みらい		53
森トラスト・ホテルリート投資法人		11
三菱地所物流リート投資法人		5
CREロジスティクスファンド投資法人		5
ザイマックス・リート投資法人		5
タカラレーベン不動産投資法人		7
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		7
日本ビルファンド投資法人		47

銘柄	期首(前期末)	
	口	数
		口
ジャパンリアルエステイト投資法人		49
日本リートファンド投資法人		92
オリックス不動産投資法人		97
日本プライムリアルティ投資法人		31
プレミア投資法人		46
東急リアル・エステート投資法人		32
グローバル・ワン不動産投資法人		34
ユナイテッド・アーバン投資法人		109
森トラスト総合リート投資法人		35
インヴェンシブル投資法人		168
フロンティア不動産投資法人		17
平和不動産リート投資法人		30
日本ロジスティクスファンド投資法人		32
福岡リート投資法人		25
ケネディクス不動産投資法人		15
いちご不動産投資法人		40
DAオフィス投資法人		11
阪急リート投資法人		22
スターツプロシード投資法人		8
大和ハウスリート投資法人		65
ジャパンホテルリート投資法人		156
日本賃貸住宅投資法人		55
ジャパンエクセレント投資法人		43
合 計	口	数
	銘	柄
		2,716
		63

(注) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	期首(前期末)	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
国内 東証REIT指数先物	11	—

(注) —印は組入れなしです。

■投資信託財産の構成 (2020年1月10日現在)

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	660,132	100.0
投資信託財産総額	660,132	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2020年1月10日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	660,132,811円
コール・ローン等	660,132,811
(B) 負 債	7,450
未 払 利 息	7,450
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	660,125,361
元 本	420,425,452
償 還 差 益 金	239,699,909
(D) 受 益 権 総 口 数	420,425,452口
1万口当たり償還価額(C/D)	15,701円37銭

(注記事項)

期首元本額	346,115,687円
期中追加設定元本額	623,612,376円
期中一部解約元本額	549,302,611円

(償還時元本の内訳)

アムンディ・Jリート・インデックス・オープン	420,425,452円
------------------------	--------------

■損益の状況

当期 (自2019年7月17日 至2020年1月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	12,266,208円
受 取 配 当 金	12,287,899
そ の 他 収 益 金	1
支 払 利 息	△ 21,692
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,937,333
売 買 益	35,274,363
売 買 損	△ 15,337,030
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,008,104
取 引 益	1,150,044
取 引 損	△ 141,940
(D) そ の 他 費 用 等	△ 525
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	33,211,120
(F) 前期繰越損益金	155,715,554
(G) 追加信託差損益金	360,960,624
(H) 解約差損益金	△310,187,389
償還差益金(E+F+G+H)	239,699,909

(注1) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注2) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

《お知らせ》

当該親投資信託を投資対象とするすべての投資信託が、投資信託契約を解約し信託終了することとなったため、2020年1月10日付で信託終了日を繰り上げ、信託契約を解約いたしました。