

平成27年8月期（平成27年2月11日～平成27年8月10日）決算短信

平成27年9月17日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信
 コード番号 (1343)
 連動対象指標 東証REIT指数
 主要投資資産 投資証券
 売買単位 10口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成27年10月29日
 分配金支払開始日 平成27年9月18日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年8月期の運用状況（平成27年2月11日～平成27年8月10日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成27年8月期	132,118	(98.4)	2,106	(1.6)	134,224	(100)
平成27年2月期	115,300	(97.9)	2,471	(2.1)	117,772	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成27年8月期	61,558	21,574	11,022	72,110
平成27年2月期	52,882	14,782	6,105	61,558

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当り基準価額 (③/①×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成27年8月期	156,771	22,546	134,224	186,137
平成27年2月期	130,734	12,962	117,772	191,318

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成27年8月期	1,330.00
平成27年2月期	1,320.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有 無
 ② ①以外の変更 有 無

II 財務諸表等

NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成27年2月10日現在)	当期 (平成27年8月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,122,413,045	22,516,839,775
投資証券	115,300,794,600	132,118,058,200
未収入金	1,346,866,798	949,033,800
未収配当金	901,261,156	1,055,909,899
未収利息	4,888	6,393
その他未収収益	2,330,676	3,267,425
差入委託証拠金	60,733,700	127,906,500
流動資産合計	130,734,404,863	156,771,021,992
資産合計	130,734,404,863	156,771,021,992
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	40,566,046	62,060,628
未払金	-	547,160
未払収益分配金	812,570,866	959,073,507
未払受託者報酬	16,881,568	21,422,747
未払委託者報酬	88,805,858	111,575,337
未払利息	100,293	187,620
有価証券貸借取引受入金	11,986,290,540	21,355,776,120
その他未払費用	16,917,877	35,553,561
流動負債合計	12,962,133,048	22,546,196,680
負債合計	12,962,133,048	22,546,196,680
純資産の部		
元本等		
元本	72,515,794,022	84,946,510,620
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	45,256,477,793	49,278,314,692
(分配準備積立金)	5,199,567	6,788,550
元本等合計	117,772,271,815	134,224,825,312
純資産合計	117,772,271,815	134,224,825,312
負債純資産合計	130,734,404,863	156,771,021,992

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成26年8月11日 至 平成27年2月10日	当期 自 平成27年2月11日 至 平成27年8月10日
営業収益		
受取配当金	1,638,892,023	2,051,430,756
受取利息	2,401,742	3,744,729

有価証券売買等損益	11,607,704,059	△3,936,550,244
派生商品取引等損益	188,513,357	△34,983,477
その他収益	34,529,297	58,022,766
営業収益合計	13,472,040,478	△1,858,335,470
営業費用		
支払利息	1,592,381	2,797,610
受託者報酬	30,614,211	40,956,973
委託者報酬	161,140,081	214,149,199
その他費用	18,789,095	27,436,142
営業費用合計	212,135,768	285,339,924
営業利益又は営業損失(△)	13,259,904,710	△2,143,675,394
経常利益又は経常損失(△)	13,259,904,710	△2,143,675,394
当期純利益又は当期純損失(△)	13,259,904,710	△2,143,675,394
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	26,620,544,459	45,256,477,793
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,869,465,058	16,092,204,835
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,869,465,058	16,092,204,835
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,031,482,928	8,100,423,198
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,031,482,928	8,100,423,198
分配金	1,461,953,506	1,826,269,344
期末剰余金又は期末欠損金(△)	45,256,477,793	49,278,314,692

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、平成 27 年 2 月 11 日から平成 27 年 8 月 10 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 平成 27 年 2 月 10 日現在	当期 平成 27 年 8 月 10 日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 61,558,399 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 72,110,790 口

<p>2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1,913.18円 (100口当たり純資産額) (191,318円)</p> <p>3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 10,983,624,500円</p>	<p>2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1,861.37円 (100口当たり純資産額) (186,137円)</p> <p>3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 20,167,271,300円</p>
--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

<p>前期 自平成26年8月11日 至平成27年2月10日</p>	<p>当期 自平成27年2月11日 至平成27年8月10日</p>																																																																																																																								
<p>1. 分配金の計算過程 平成26年8月11日から平成26年11月10日まで</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>747,299,286円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>3,465,779円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>750,765,065円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>94,478,243円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>656,286,822円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>649,382,640円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>6,904,182円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>54,115,220口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,200円</td></tr> </tbody> </table> <p>平成26年11月11日から平成27年2月10日まで</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>926,931,395円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>6,904,182円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>933,835,577円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>116,065,144円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>817,770,433円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>812,570,866円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>5,199,567円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>61,558,399口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,320円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	747,299,286円	分配準備積立金	B	3,465,779円	配当等収益合計額	C=A+B	750,765,065円	経費	D	94,478,243円	収益分配可能額	E=C-D	656,286,822円	収益分配金	F	649,382,640円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,904,182円	口数	H	54,115,220口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,200円	項目			当期配当等収益額	A	926,931,395円	分配準備積立金	B	6,904,182円	配当等収益合計額	C=A+B	933,835,577円	経費	D	116,065,144円	収益分配可能額	E=C-D	817,770,433円	収益分配金	F	812,570,866円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,199,567円	口数	H	61,558,399口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,320円	<p>1. 分配金の計算過程 平成27年2月11日から平成27年5月10日まで</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>1,008,658,423円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>5,199,567円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>1,013,857,990円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>137,290,639円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>876,567,351円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>867,195,837円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>9,371,514円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>69,375,667口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,250円</td></tr> </tbody> </table> <p>平成27年5月11日から平成27年8月10日まで</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>当期配当等収益額</td><td>A</td><td>1,101,742,218円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>9,371,514円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>1,111,113,732円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>145,251,675円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>965,862,057円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>959,073,507円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>6,788,550円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>72,110,790口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,330円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,008,658,423円	分配準備積立金	B	5,199,567円	配当等収益合計額	C=A+B	1,013,857,990円	経費	D	137,290,639円	収益分配可能額	E=C-D	876,567,351円	収益分配金	F	867,195,837円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,371,514円	口数	H	69,375,667口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,250円	項目			当期配当等収益額	A	1,101,742,218円	分配準備積立金	B	9,371,514円	配当等収益合計額	C=A+B	1,111,113,732円	経費	D	145,251,675円	収益分配可能額	E=C-D	965,862,057円	収益分配金	F	959,073,507円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,788,550円	口数	H	72,110,790口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,330円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	747,299,286円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	3,465,779円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	750,765,065円																																																																																																																							
経費	D	94,478,243円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	656,286,822円																																																																																																																							
収益分配金	F	649,382,640円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,904,182円																																																																																																																							
口数	H	54,115,220口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,200円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	926,931,395円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	6,904,182円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	933,835,577円																																																																																																																							
経費	D	116,065,144円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	817,770,433円																																																																																																																							
収益分配金	F	812,570,866円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,199,567円																																																																																																																							
口数	H	61,558,399口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,320円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	1,008,658,423円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	5,199,567円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	1,013,857,990円																																																																																																																							
経費	D	137,290,639円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	876,567,351円																																																																																																																							
収益分配金	F	867,195,837円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,371,514円																																																																																																																							
口数	H	69,375,667口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,250円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	1,101,742,218円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	9,371,514円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	1,111,113,732円																																																																																																																							
経費	D	145,251,675円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	965,862,057円																																																																																																																							
収益分配金	F	959,073,507円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,788,550円																																																																																																																							
口数	H	72,110,790口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,330円																																																																																																																							

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

<p>前期 自平成26年8月11日 至平成27年2月10日</p>	<p>当期 自平成27年2月11日 至平成27年8月10日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、REIT指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とするREIT指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
--	--

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 平成27年2月10日現在	当期 平成27年8月10日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自平成26年8月11日 至平成27年2月10日	当期 自平成27年2月11日 至平成27年8月10日
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。</p>	<p>同左</p>

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自平成26年8月11日 至平成27年2月10日	当期 自平成27年2月11日 至平成27年8月10日
期首元本額 62,295,099,664円	期首元本額 72,515,794,022円
期中追加設定元本額 17,413,549,400円	期中追加設定元本額 25,415,232,200円
期中一部交換元本額 7,192,855,042円	期中一部交換元本額 12,984,515,602円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自平成26年8月11日 至平成27年2月10日	当期 自平成27年2月11日 至平成27年8月10日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,804,955,664	△5,130,383,993
合計	4,804,955,664	△5,130,383,993

3 デリバティブ取引関係

NEXT FUNDS 東証 REIT 指数連動型上場投信(1343) 平成 27 年 8 月期 決算短信
デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(平成 27 年 2 月 10 日現在)				当期(平成 27 年 8 月 10 日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1 年超				うち 1 年超		
市場取引								
REIT 指数先物取引								
買建	1,964,609,700	—	1,924,130,000	△40,566,046	2,153,923,500	—	2,091,991,500	△62,060,628
合計	1,964,609,700	—	1,924,130,000	△40,566,046	2,153,923,500	—	2,091,991,500	△62,060,628

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 27 年 8 月 10 日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成 27 年 8 月 10 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	日本円	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	6,143	2,748,992,500	貸付有価証券 589 口 (307 口)
		MCUBS MidCity 投資法人 投資証券	3,322	1,043,108,000	貸付有価証券 330 口 (161 口)
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	19,906	2,830,633,200	貸付有価証券 2,456 口 (992 口)
		野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	2,039	1,372,247,000	貸付有価証券 486 口 (454 口)
		産業ファンド投資法人 投資証券	4,470	2,418,270,000	貸付有価証券 441 口 (213 口)
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	4,446	2,187,432,000	貸付有価証券 639 口 (188 口)
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	16,482	4,567,162,200	貸付有価証券 1,569 口 (836 口)
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	4,426	1,420,746,000	貸付有価証券 881 口 (220 口)
		アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,514	3,710,784,000	貸付有価証券 648 口 (363 口)
		GLP 投資法人 投資証券	30,311	3,588,822,400	貸付有価証券 5,031 口 (1,520 口)
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	6,007	1,442,280,700	貸付有価証券 996 口 (482 口)
		日本プロロジスリート投資法人	21,943	5,165,382,200	貸付有価証券 2,988

投資証券			口(1,659口)
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	21,113	3,251,402,000	貸付有価証券 2,101口(1,072口)
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	630	840,420,000	貸付有価証券 271口(193口)
SIA不動産投資法人 投資証券	952	443,156,000	貸付有価証券 225口(48口)
イオンリート投資法人 投資証券	13,822	2,015,247,600	貸付有価証券 1,931口(688口)
ヒューリックリート投資法人 投資証券	9,902	1,657,594,800	貸付有価証券 1,594口(1,104口)
日本リート投資法人 投資証券	4,967	1,386,289,700	貸付有価証券 674口
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	6,874	707,334,600	貸付有価証券 2,364口(736口)
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	771	173,475,000	貸付有価証券 360口(227口)
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,067	1,320,790,400	貸付有価証券 1,495口(283口)
トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,217	154,437,300	貸付有価証券 176口
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	3,306	920,059,800	貸付有価証券 358口(3口)
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,528	180,609,600	貸付有価証券 158口(50口)
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,071	189,703,600	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	17,902	9,702,884,000	貸付有価証券 2,319口(981口)
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	16,600	8,980,600,000	貸付有価証券 2,209口(965口)
日本リートファンド投資法人 投資証券	30,811	7,631,884,700	貸付有価証券 4,428口(3,069口)
オリックス不動産投資法人 投資証券	28,346	4,801,812,400	貸付有価証券 10,091口(3,710口)
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	11,068	4,416,132,000	貸付有価証券 1,713口(1,062口)
プレミア投資法人 投資証券	3,340	2,204,400,000	貸付有価証券 710口(166口)
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	12,395	1,786,119,500	貸付有価証券 2,870口(2,092口)
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,457	996,313,500	貸付有価証券 698口(124口)
野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	4,723	2,559,866,000	貸付有価証券 506口(275口)
ユニテッド・アーバン投資法人 投資証券	33,526	5,853,639,600	貸付有価証券 3,353口(2,247口)
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	16,736	3,849,280,000	貸付有価証券 2,466口(849口)
インヴィンシブル投資法人 投資	40,174	2,735,849,400	貸付有価証券

	証券			12,899口(1,708口)
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	6,289	3,345,748,000	貸付有価証券 689口(347口)
	平和不動産リート投資法人 投資証券	12,059	1,078,074,600	貸付有価証券 1,261口(673口)
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	10,523	2,472,905,000	貸付有価証券 1,111口(541口)
	福岡リート投資法人 投資証券	9,471	2,010,693,300	貸付有価証券 906口(474口)
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	5,133	2,920,677,000	貸付有価証券 621口(392口)
	積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 投資証券	12,908	1,525,725,600	貸付有価証券 1,930口(1,103口)
	いちご不動産投資法人 投資証券	17,957	1,564,054,700	貸付有価証券 3,919口(1,920口)
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	6,136	3,828,864,000	貸付有価証券 775口(550口)
	阪急リート投資法人 投資証券	7,575	999,900,000	貸付有価証券 768口(430口)
	スターツプロシード投資法人 投資証券	2,203	398,302,400	貸付有価証券 456口(111口)
	トップリート投資法人 投資証券	2,231	1,112,153,500	貸付有価証券 324口(113口)
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	9,480	2,465,748,000	貸付有価証券 1,576口(502口)
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	39,864	3,193,106,400	貸付有価証券 5,961口(1,784口)
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	20,794	1,709,266,800	貸付有価証券 2,512口(1,040口)
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	15,972	2,237,677,200	貸付有価証券 1,805口(849口)
小計	銘柄数：52	596,902	132,118,058,200	
	組入時価比率：98.4%		100.0%	
合計			132,118,058,200	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2)備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。