



平成 29 年 8 月期 (平成 29 年 2 月 11 日～平成 29 年 8 月 10 日) 決算短信  
 Earnings Report for Fiscal Period ended August 2017 (February 11, 2017 - August 10, 2017)

平成 29 年 9 月 20 日  
 September 20, 2017

上場取引所 東証  
 Listed Exchange TSE

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

Fund name: NEXT FUNDS Tokyo Stock Exchange REIT Index Exchange Traded Fund  
 Code: 1343  
 Underlying index: Tokyo Stock Exchange REIT Index  
 Primary invested assets: REITs  
 Trading unit: 10 units  
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 Representative: Kunio Watanabe, President & CEO  
 Contact person: Akihiro Watanabe, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 平成 29 年 10 月 31 日  
 分配金支払開始日 平成 29 年 9 月 15 日  
 Scheduled date of submission of securities report: October 31, 2017  
 Date of commencing dividend payment: September 15, 2017

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 平成 29 年 8 月期の運用状況 (平成 29 年 2 月 11 日～平成 29 年 8 月 10 日)

Management Status for Period ended August 2017 (from February 11, 2017 to August 10, 2017)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
平成 29 年 8 月期 FY ended Aug. 2017	236,682	(96.9)	7,577	(3.1)	244,259	(100.0)
平成 29 年 2 月期 FY ended Feb. 2017	218,676	(97.1)	6,569	(2.9)	225,246	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前特定期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当特定期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
平成 29 年 8 月期 FY ended Aug. 2017	117,613	21,585	2,533	136,665
平成 29 年 2 月期 FY ended Feb. 2017	102,021	22,585	6,993	117,613

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	100口当り基準価額 ((③/当特定期間末発行済口数)×100) Net Asset Value per 100 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×100)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
平成 29 年 8 月期 FY ended Aug. 2017	279,404	35,144	244,259	178,728
平成 29 年 2 月期 FY ended Feb. 2017	266,607	41,361	225,246	191,514

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
平成 29 年 8 月期 FY ended Aug. 2017	1,430
平成 29 年 2 月期 FY ended Feb. 2017	1,640

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無  
Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無  
Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	前期 (平成 29 年 2 月 10 日現在) Prior period As of February 10, 2017	当期 (平成 29 年 8 月 10 日現在) Present period As of August 10, 2017
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	43,620,142,639	38,361,059,914
投資証券 Investment securities	218,676,974,750	236,682,905,800
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	110,691,520	-
未収入金 Accounts receivable - other	1,956,080,696	1,969,854,883
未収配当金 Accrued dividend receivable	1,724,058,271	1,861,905,094
未収利息 Accrued interest	1,150,203	983,159
その他未収収益 Other accrued revenue	273,384,587	209,856,400
差入委託証拠金 Customers' margin	245,303,000	317,689,500
流動資産合計 Total current assets	266,607,785,666	279,404,254,750
資産合計 Total assets	266,607,785,666	279,404,254,750
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	22,426,560	228,115,824
未払収益分配金 Unpaid dividends	1,928,861,531	1,954,320,124
未払受託者報酬 Trustee fee payable	34,440,051	35,825,115
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	179,921,957	188,284,378
未払利息 Accrued interest expenses	41,731	36,668
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction of securities	39,163,304,040	32,677,282,260
その他未払費用	32,358,970	60,396,245

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	41,361,354,840	35,144,260,614
負債合計 Total liabilities	41,361,354,840	35,144,260,614
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	138,548,712,424	160,992,245,254
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	86,697,718,402	83,267,748,882
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	983,757	9,109,372
元本等合計 Total principal and other	225,246,430,826	244,259,994,136
純資産合計 Total net assets	225,246,430,826	244,259,994,136
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	266,607,785,666	279,404,254,750

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	前期 自 平成 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日 Prior period From August 11, 2016 to February 10, 2017	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日 Present period From February 11, 2017 to August 10, 2017
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	3,405,187,212	3,720,835,247
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△3,116,573,088	△15,805,746,604
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△30,334,845	△316,405,192
その他収益 Other revenue	458,625,720	585,838,512
営業収益合計 Total operating revenue	716,904,999	△11,815,478,037
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△9,017,079	△9,609,469
受託者報酬 Trustee fee	66,014,382	70,871,152
委託者報酬 Investment trust management fee	345,540,338	370,841,171

その他費用 Other expenses	36,060,412	45,395,476
営業費用合計 Total operating expenses	438,598,053	477,498,330
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	278,306,946	△12,292,976,367
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	278,306,946	△12,292,976,367
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	278,306,946	△12,292,976,367
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(△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	78,374,934,888	86,697,718,402
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	16,702,751,357	14,388,291,791
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	16,702,751,357	14,388,291,791
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	5,225,847,220	1,704,235,130
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange	5,225,847,220	1,704,235,130
分配金 Dividends	3,432,427,569	3,821,049,814
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	86,697,718,402	83,267,748,882

### (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	<p>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。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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。</p>
4. その他	<p>当該財務諸表の特定期間は、平成 29 年 2 月 11 日から平成 29 年 8 月 10 日までと</p>

なっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 平成 29 年 2 月 10 日現在	当期 平成 29 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 117,613,508 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 136,665,743 口
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 1,915.14 円 (100 口当たり純資産額) (191,514 円)	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 1,787.28 円 (100 口当たり純資産額) (178,728 円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 37,214,078,050 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 30,996,182,200 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日																																																												
1. 分配金の計算過程 平成 28 年 8 月 11 日から平成 28 年 11 月 10 日まで	1. 分配金の計算過程 平成 29 年 2 月 11 日から平成 29 年 5 月 10 日まで																																																												
<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>1,713,314,565 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>8,196,447 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>1,721,511,012 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>214,377,049 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>1,507,133,963 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>1,503,566,038 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>3,567,925 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>115,658,926 口</td></tr> <tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,300 円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,713,314,565 円	分配準備積立金	B	8,196,447 円	配当等収益合計額	C=A+B	1,721,511,012 円	経費	D	214,377,049 円	収益分配可能額	E=C-D	1,507,133,963 円	収益分配金	F	1,503,566,038 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,567,925 円	口数	H	115,658,926 口	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,300 円	<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>2,113,489,555 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>983,757 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>2,114,473,312 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>242,968,536 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>1,871,504,776 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>1,866,729,690 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>4,775,086 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>124,448,646 口</td></tr> <tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,500 円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,113,489,555 円	分配準備積立金	B	983,757 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,114,473,312 円	経費	D	242,968,536 円	収益分配可能額	E=C-D	1,871,504,776 円	収益分配金	F	1,866,729,690 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,775,086 円	口数	H	124,448,646 口	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,500 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	1,713,314,565 円																																																											
分配準備積立金	B	8,196,447 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,721,511,012 円																																																											
経費	D	214,377,049 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1,507,133,963 円																																																											
収益分配金	F	1,503,566,038 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,567,925 円																																																											
口数	H	115,658,926 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,300 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,113,489,555 円																																																											
分配準備積立金	B	983,757 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	2,114,473,312 円																																																											
経費	D	242,968,536 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1,871,504,776 円																																																											
収益分配金	F	1,866,729,690 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,775,086 円																																																											
口数	H	124,448,646 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,500 円																																																											
平成 28 年 11 月 11 日から平成 29 年 2 月 10 日まで	平成 29 年 5 月 11 日から平成 29 年 8 月 10 日まで																																																												
<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>2,159,515,446 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>3,567,925 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>2,163,083,371 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>233,238,083 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>1,929,845,288 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>1,928,861,531 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>983,757 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>117,613,508 口</td></tr> <tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,640 円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,159,515,446 円	分配準備積立金	B	3,567,925 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,163,083,371 円	経費	D	233,238,083 円	収益分配可能額	E=C-D	1,929,845,288 円	収益分配金	F	1,928,861,531 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	983,757 円	口数	H	117,613,508 口	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,640 円	<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>2,202,793,673 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>4,775,086 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>2,207,568,759 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>244,139,263 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>1,963,429,496 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>1,954,320,124 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>9,109,372 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>136,665,743 口</td></tr> <tr><td>100 口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,430 円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,202,793,673 円	分配準備積立金	B	4,775,086 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,207,568,759 円	経費	D	244,139,263 円	収益分配可能額	E=C-D	1,963,429,496 円	収益分配金	F	1,954,320,124 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,109,372 円	口数	H	136,665,743 口	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,430 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,159,515,446 円																																																											
分配準備積立金	B	3,567,925 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	2,163,083,371 円																																																											
経費	D	233,238,083 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1,929,845,288 円																																																											
収益分配金	F	1,928,861,531 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	983,757 円																																																											
口数	H	117,613,508 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,640 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,202,793,673 円																																																											
分配準備積立金	B	4,775,086 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	2,207,568,759 円																																																											
経費	D	244,139,263 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1,963,429,496 円																																																											
収益分配金	F	1,954,320,124 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,109,372 円																																																											
口数	H	136,665,743 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,430 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

前期 自 平成 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日
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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
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。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左

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。

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。

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。

### 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っております。

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

同左

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 平成 29 年 2 月 10 日現在	当期 平成 29 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日
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。	同左

## (その他の注記)

### 1 元本の移動

前期 自 平成 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日
期首元本額 120,181,407,104 円	期首元本額 138,548,712,424 円
期中追加設定元本額 26,605,365,600 円	期中追加設定元本額 25,427,483,400 円
期中一部交換元本額 8,238,060,280 円	期中一部交換元本額 2,983,950,570 円

### 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 28 年 8 月 11 日 至 平成 29 年 2 月 10 日	当期 自 平成 29 年 2 月 11 日 至 平成 29 年 8 月 10 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	
投資証券	6,250,744,520	△11,398,937,591
合計	6,250,744,520	△11,398,937,591

### 3 デリバティブ取引関係

#### 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 29 年 2 月 10 日現在)			当期(平成 29 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	
市場取引								
REIT 指数先物取引								
買建	6,438,083,000	—	6,526,740,000	88,264,960	7,774,657,500	—	7,547,028,000	△228,115,824
合計	6,438,083,000	—	6,526,740,000	88,264,960	7,774,657,500	—	7,547,028,000	△228,115,824

(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 29 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 29 年 8 月 10 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	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	10,391	4,696,732,000	貸付有価証券 908 口 (679 口)
		MCUBS MidCity 投資 法人 投資証券	6,329	2,069,583,000	貸付有価証券 543 口 (413 口)
		森ヒルズリート投資法人 投資 証券	33,591	4,618,762,500	貸付有価証券 3,165 口 (2,195 口)
		産業ファンド投資法人 投資証 券	8,495	4,171,045,000	貸付有価証券 1,299 口 (576 口)
		アドバンス・レジデンス投資法 人 投資証券	28,951	7,999,161,300	貸付有価証券 4,507 口 (1,892 口)
		ケネディクス・レジデンシャル 投資法人 投資証券	7,092	1,963,774,800	貸付有価証券 599 口 (463 口)
		アクティビア・プロパティーズ 投資法人 投資証券	13,515	6,507,472,500	貸付有価証券 1,246 口 (883 口)
		GLP 投資法人 投資証券	54,744	6,580,228,800	貸付有価証券



			4,713 口 (3,578 口)
コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 投資証券	11,404	2,629,762,400	貸付有価証券 1,089 口 (745 口)
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	39,331	9,112,992,700	貸付有価証券 6,246 口 (2,391 口)
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	3,888	2,173,392,000	貸付有価証券 380 口 (254 口)
One リート投資法人 投資証 券	3,419	747,735,300	貸付有価証券 315 口 (223 口)
イオンリート投資法人 投資証 券	27,434	3,264,646,000	貸付有価証券 1,818 口 (1,793 口)
ビューリックリート投資法人 投資証券	20,051	3,374,583,300	貸付有価証券 1,586 口 (1,586 口)
日本リート投資法人 投資証券	8,401	2,562,305,000	貸付有価証券 837 口 (594 口)
インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人 投資証券	17,489	1,862,578,500	貸付有価証券 1,770 口 (1,143 口)
日本ヘルスケア投資法人 投資 証券	1,516	247,866,000	貸付有価証券 259 口 (207 口)
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	19,614	2,626,314,600	貸付有価証券 4,401 口 (1,376 口)
トーセイ・リート投資法人 投 資証券	3,929	417,259,800	貸付有価証券 518 口 (256 口)
ケネディクス商業リート投資法 人 投資証券	11,370	2,694,690,000	貸付有価証券 869 口 (726 口)
ヘルスケア&メディカル投資法 人 投資証券	3,853	377,208,700	貸付有価証券 552 口 (404 口)
サムティ・レジデンシャル投資 法人 投資証券	5,430	461,007,000	貸付有価証券 868 口 (366 口)
ジャパン・シニアリビング投資 法人 投資証券	1,722	249,345,600	貸付有価証券 224 口 (151 口)
野村不動産マスターファンド投 資法人 投資証券	89,708	13,554,878,800	貸付有価証券 7,928 口 (5,863 口)
いちごホテルリート投資法人 投資証券	4,942	535,218,600	貸付有価証券 1,136 口 (323 口)
ラサールロジポート投資法人 投資証券	23,590	2,519,412,000	貸付有価証券 2,013 口 (1,542 口)
スターアジア不動産投資法人 投資証券	6,493	670,077,600	貸付有価証券 659 口 (444 口)
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	1,745	166,996,500	貸付有価証券 954 口 (120 口)
三井不動産ロジスティクスパー ク投資法人 投資証券	5,057	1,608,126,000	貸付有価証券 1,297 口 (337 口)
大江戸温泉リート投資法人 投 資証券	3,977	346,794,400	貸付有価証券 1,126 口 (318 口)
さくら総合リート投資法人 投 資証券	7,517	670,516,400	貸付有価証券 977 口 (473 口)
投資法人みらい 投資証券	3,979	683,194,300	貸付有価証券 2,060 口 (254 口)

森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	6,772	1,017,154,400	貸付有価証券 2,729 口 (494 口)
日本ビルファンド投資法人 投資証券	30,280	17,804,640,000	貸付有価証券 7,769 口 (1,978 口)
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	29,556	16,728,696,000	貸付有価証券 6,752 口 (1,851 口)
日本リートファンド投資法人 投資証券	60,154	12,572,186,000	貸付有価証券 6,666 口 (3,815 口)
オリックス不動産投資法人 投資証券	60,328	9,833,464,000	貸付有価証券 7,798 口 (3,825 口)
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	19,742	7,965,897,000	貸付有価証券 1,729 口 (1,289 口)
プレミアム投資法人 投資証券	28,243	3,086,959,900	貸付有価証券 2,844 口 (1,846 口)
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	20,965	2,821,889,000	貸付有価証券 1,866 口 (1,370 口)
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	5,020	1,937,720,000	貸付有価証券 471 口 (317 口)
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	68,965	11,179,226,500	貸付有価証券 5,908 口 (4,296 口)
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	22,348	4,002,526,800	貸付有価証券 2,142 口 (1,461 口)
インヴィンシブル投資法人 投資証券	69,723	3,235,147,200	貸付有価証券 5,949 口 (4,557 口)
フロンティア不動産投資法人 投資証券	10,637	4,972,797,500	貸付有価証券 969 口 (695 口)
平和不動産リート投資法人 投資証券	19,473	1,770,095,700	貸付有価証券 2,798 口 (2,085 口)
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	19,865	4,459,692,500	貸付有価証券 1,699 口 (1,244 口)
福岡リート投資法人 投資証券	15,176	2,551,085,600	貸付有価証券 1,303 口 (992 口)
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	9,140	5,557,120,000	貸付有価証券 838 口 (572 口)
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	23,708	2,716,936,800	貸付有価証券 2,061 口 (1,549 口)
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	24,213	1,811,132,400	貸付有価証券 3,931 口 (2,529 口)
大和証券オフィス投資法人 投資証券	6,743	3,674,935,000	貸付有価証券 620 口 (440 口)
阪急リート投資法人 投資証券	12,813	1,764,350,100	貸付有価証券 880 口 (837 口)
スターツプロシード投資法人 投資証券	4,927	744,469,700	貸付有価証券 850 口 (694 口)
大和ハウスリート投資法人 投資証券	32,160	8,795,760,000	貸付有価証券 4,301 口 (2,267 口)
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	90,248	7,021,294,400	貸付有価証券 7,829 口 (5,813 口)
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	35,171	2,887,539,100	貸付有価証券

		券			7,229 口 (6,099 口)
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	28,001	3,606,528,800	貸付有価証券 2,443 口 (1,830 口)
	小計	銘柄数 : 58 組入時価比率 : 96.9%	1,243,338	236,682,905,800 100.0%	
	合計			236,682,905,800	

(注 1) 投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注 2) 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 3) 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証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。