

平成26年8月期（平成26年2月11日～平成26年8月10日）決算短信

平成26年9月22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 投信ディスクロージャー部長 村山 治子 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成26年10月30日  
 分配金支払開始日 平成26年9月18日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年8月期の運用状況（平成26年2月11日～平成26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26年8月期	87,601	(98.5)	1,314	(1.5)	88,915	(100)
平成26年2月期	77,806	(98.2)	1,424	(1.8)	79,230	(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26年8月期	51,316	20,579	19,013	52,882
平成26年2月期	32,535	19,568	787	51,316

(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26年8月期	97,237	8,321	88,915	168,139
平成26年2月期	83,443	4,212	79,230	154,395

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成26年8月期	1,400.00
平成26年2月期	1,310.00

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26年2月10日現在)	当期 (平成26年8月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,151,469,632	8,706,512,639
投資証券	77,806,873,780	87,601,513,100
派生商品評価勘定	26,502,453	39,437,337
未収入金	664,690,078	96,376,608
未収配当金	738,258,664	786,630,903
未収利息	1,605	24,174
その他未収収益	650,426	1,548,295
差入委託証拠金	54,832,500	5,156,000
流動資産合計	83,443,279,138	97,237,199,056
資産合計	83,443,279,138	97,237,199,056
負債の部		
流動負債		
未払金	-	114,421,454
未払収益分配金	672,251,141	740,349,232
未払受託者報酬	9,998,643	13,957,249
未払委託者報酬	53,772,446	73,915,147
未払利息	39,354	62,280
有価証券貸借取引受入金	3,465,037,380	7,353,535,140
その他未払費用	11,237,464	25,314,431
流動負債合計	4,212,336,428	8,321,554,933
負債合計	4,212,336,428	8,321,554,933
純資産の部		
元本等		
元本	60,451,285,818	62,295,099,664
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,779,656,892	26,620,544,459
(分配準備積立金)	801,852	3,465,779
元本等合計	79,230,942,710	88,915,644,123
純資産合計	79,230,942,710	88,915,644,123
負債純資産合計	83,443,279,138	97,237,199,056

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成25年8月11日 至 平成26年2月10日	当期 自 平成26年2月11日 至 平成26年8月10日
営業収益		
受取配当金	1,245,669,568	1,617,609,675
受取利息	431,482	1,808,642
有価証券売買等損益	5,198,893,309	7,951,421,166

派生商品取引等損益	117,204,634	181,657,198
その他収益	1,872,282	19,466,379
営業収益合計	6,564,071,275	9,771,963,060
営業費用		
支払利息	80,252	1,007,704
受託者報酬	17,978,254	26,440,728
委託者報酬	96,862,288	140,436,883
その他費用	12,330,689	22,769,765
営業費用合計	127,251,483	190,655,080
営業利益又は営業損失(△)	6,436,819,792	9,581,307,980
経常利益又は経常損失(△)	6,436,819,792	9,581,307,980
当期純利益又は当期純損失(△)	6,436,819,792	9,581,307,980
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(△)	7,742,273,927	18,779,656,892
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,001,550,031	8,642,667,902
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,001,550,031	8,642,667,902
剰余金減少額又は欠損金増加額	280,110,134	8,937,522,626
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	280,110,134	8,937,522,626
分配金	1,120,876,724	1,445,565,689
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,779,656,892	26,620,544,459

## (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 26 年 2 月 11 日から平成 26 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 26 年 2 月 10 日現在	当期 平成 26 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 51,316,881 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 52,882,088 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	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 (100口当たり純資産額)	1,543.95円 (154,395円)	1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,681.39円 (168,139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	3,328,277,220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	6,927,253,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自平成25年8月11日 至平成26年2月10日	当期 自平成26年2月11日 至平成26年8月10日																																																																																																																								
<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>平成25年8月11日から平成25年11月10日まで</p> <table border="1"> <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>504,337,707円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>956,727円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>505,294,434円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>56,394,567円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>448,899,867円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>448,625,583円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>274,284円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>42,726,246口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,050円</td></tr> </tbody> </table> <p>平成25年11月11日から平成26年2月10日まで</p> <table border="1"> <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>743,555,373円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>274,284円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>743,829,657円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>70,776,664円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>673,052,993円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>672,251,141円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>801,852円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>51,316,881口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,310円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	504,337,707円	分配準備積立金	B	956,727円	配当等収益合計額	C=A+B	505,294,434円	経費	D	56,394,567円	収益分配可能額	E=C-D	448,899,867円	収益分配金	F	448,625,583円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	274,284円	口数	H	42,726,246口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,050円	項目			当期配当等収益額	A	743,555,373円	分配準備積立金	B	274,284円	配当等収益合計額	C=A+B	743,829,657円	経費	D	70,776,664円	収益分配可能額	E=C-D	673,052,993円	収益分配金	F	672,251,141円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	801,852円	口数	H	51,316,881口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,310円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>平成26年2月11日から平成26年5月10日まで</p> <table border="1"> <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>798,938,775円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>801,852円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>799,740,627円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>92,753,727円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>706,986,900円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>705,216,457円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>1,770,443円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>64,110,587口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,100円</td></tr> </tbody> </table> <p>平成26年5月11日から平成26年8月10日まで</p> <table border="1"> <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>838,938,217円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>1,770,443円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>840,708,660円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>96,893,649円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>743,815,011円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>740,349,232円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>3,465,779円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>52,882,088口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,400円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	798,938,775円	分配準備積立金	B	801,852円	配当等収益合計額	C=A+B	799,740,627円	経費	D	92,753,727円	収益分配可能額	E=C-D	706,986,900円	収益分配金	F	705,216,457円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,770,443円	口数	H	64,110,587口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,100円	項目			当期配当等収益額	A	838,938,217円	分配準備積立金	B	1,770,443円	配当等収益合計額	C=A+B	840,708,660円	経費	D	96,893,649円	収益分配可能額	E=C-D	743,815,011円	収益分配金	F	740,349,232円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,465,779円	口数	H	52,882,088口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,400円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	504,337,707円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	956,727円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	505,294,434円																																																																																																																							
経費	D	56,394,567円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	448,899,867円																																																																																																																							
収益分配金	F	448,625,583円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	274,284円																																																																																																																							
口数	H	42,726,246口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,050円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	743,555,373円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	274,284円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	743,829,657円																																																																																																																							
経費	D	70,776,664円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	673,052,993円																																																																																																																							
収益分配金	F	672,251,141円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	801,852円																																																																																																																							
口数	H	51,316,881口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,310円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	798,938,775円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	801,852円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	799,740,627円																																																																																																																							
経費	D	92,753,727円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	706,986,900円																																																																																																																							
収益分配金	F	705,216,457円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,770,443円																																																																																																																							
口数	H	64,110,587口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,100円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	838,938,217円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	1,770,443円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	840,708,660円																																																																																																																							
経費	D	96,893,649円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	743,815,011円																																																																																																																							
収益分配金	F	740,349,232円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,465,779円																																																																																																																							
口数	H	52,882,088口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,400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25年8月11日 至平成26年2月10日	当期 自平成26年2月11日 至平成26年8月10日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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。	同左
--	----

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 平成26年2月10日現在	当期 平成26年8月10日現在
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。	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

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自平成25年8月11日 至平成26年2月10日	当期 自平成26年2月11日 至平成26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25年8月11日 至平成26年2月10日	当期 自平成26年2月11日 至平成26年8月10日
期首元本額	38,326,751,854円	60,451,285,818円
期中追加設定元本額	23,051,928,600円	24,242,179,800円
期中一部交換元本額	927,394,636円	22,398,365,954円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自平成25年8月11日 至平成26年2月10日	当期 自平成26年2月11日 至平成26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	1,448,154,624	4,461,976,287
合計	1,448,154,624	4,461,976,287

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 26 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 26 年 2 月 10 日現在)				当期(平成 26 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	1,389,145,500	—	1,415,709,000	26,502,453	1,267,008,500	—	1,306,512,500	39,437,337
合計	1,389,145,500	—	1,415,709,000	26,502,453	1,267,008,500	—	1,306,512,500	39,437,337

(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 26 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 26 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	4,738	1,871,510,000	貸付有価証券 310 口 (297 口)
		M I D リート投資法人 投資証券	1,885	452,023,000	貸付有価証券 118 口 (118 口)
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	16,031	2,465,567,800	貸付有価証券 2,324 口 (891 口)
		野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	1,651	903,097,000	貸付有価証券 333 口 (184 口)
		産業ファンド投資法人 投資証券	1,700	1,531,700,000	貸付有価証券 116 口 (106 口)
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,013	1,358,863,000	貸付有価証券 168 口 (168 口)
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	13,348	3,296,956,000	貸付有価証券 1,161 口 (836 口)
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,854	699,800,800	貸付有価証券 549 口 (314 口)
		アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,578	2,410,430,000	貸付有価証券 169 口 (161 口)
		G L P 投資法人 投資証券	21,539	2,446,830,400	貸付有価証券 1,650 口 (1,350 口)
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	4,134	780,085,800	貸付有価証券 720 口 (356 口)

日本プロジスリート投資法人 投資証券	16,057	3,781,423,500	貸付有価証券 1,092口(1,006口)
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	17,099	2,171,573,000	貸付有価証券 1,347口(1,072口)
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	441	415,422,000	貸付有価証券 34口(18口)
SIA不動産投資法人 投資証券	771	345,022,500	貸付有価証券 151口(48口)
イオンリート投資法人 投資証券	9,755	1,313,023,000	貸付有価証券 1,690口(1,669口)
ヒューリックリート投資法人 投資証券	6,695	1,144,845,000	貸付有価証券 255口(159口)
日本リート投資法人 投資証券	1,559	409,861,100	貸付有価証券 75口(37口)
インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人 投資証券	4,443	440,301,300	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	14,498	7,959,402,000	貸付有価証券 348口(341口)
ジャパンリアルエステイト投資 法人 投資証券	12,851	7,132,305,000	貸付有価証券 860口(851口)
日本リテールファンド投資法人 投資証券	23,701	5,294,803,400	貸付有価証券 1,010口(1,010口)
オリックス不動産投資法人 投資証券	20,189	2,814,346,600	貸付有価証券 1,174口(1,174口)
日本プライムリアルティ投資法 人 投資証券	8,471	3,024,147,000	貸付有価証券 196口(196口)
プレミア投資法人 投資証券	2,246	969,149,000	貸付有価証券 170口(140口)
東急リアル・エステート投資法 人 投資証券	10,038	1,387,251,600	貸付有価証券 1,919口(629口)
グローバル・ワン不動産投資法 人 投資証券	1,990	602,970,000	貸付有価証券 137口(124口)
野村不動産オフィスファンド投 資法人 投資証券	3,825	1,870,425,000	貸付有価証券 300口(239口)
ユナイテッド・アーバン投資法 人 投資証券	25,796	4,238,282,800	貸付有価証券 2,238口(2,144口)
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	13,554	2,403,124,200	貸付有価証券 1,749口(1,039口)
インヴィンシブル投資法人 投資証券	26,832	697,632,000	貸付有価証券 1,480口(1,396口)
フロンティア不動産投資法人 投資証券	5,093	2,811,336,000	貸付有価証券 256口(146口)
平和不動産リート投資法人 投資証券	9,051	761,189,100	貸付有価証券 637口(598口)
日本ロジスティクスファンド投 資法人 投資証券	8,522	1,994,148,000	貸付有価証券 536口(534口)
福岡リート投資法人 投資証券	7,085	1,311,433,500	貸付有価証券 710口(444口)
ケネディクス・オフィス投資法	3,645	2,001,105,000	貸付有価証券

	人 投資証券			735 口 (220 口)
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 投資証券	9,398	990,549,200	貸付有価証券 599 口 (545 口)
	いちご不動産投資法人 投資証券	10,538	751,359,400	貸付有価証券 660 口 (660 口)
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	4,528	2,408,896,000	貸付有価証券 577 口 (306 口)
	阪急リート投資法人 投資証券	1,227	684,666,000	貸付有価証券 120 口 (81 口)
	スターツプロシード投資法人 投資証券	1,489	262,808,500	貸付有価証券 93 口 (93 口)
	トップリート投資法人 投資証券	1,807	826,702,500	貸付有価証券 128 口 (113 口)
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,839	1,835,042,000	貸付有価証券 562 口 (251 口)
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	26,915	1,496,474,000	貸付有価証券 1,703 口 (1,687 口)
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	15,146	1,123,833,200	貸付有価証券 949 口 (949 口)
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	12,453	1,709,796,900	貸付有価証券 849 口 (849 口)
小計	銘柄数：46 組入時価比率：98.5%	415,018	87,601,513,100	100.0%
合計			87,601,513,100	

(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) 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。