

平成28年2月期（平成27年8月11日～平成28年2月10日）決算短信

平成28年3月23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28年4月27日
 分配金支払開始日 平成28年3月18日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年2月期の運用状況（平成27年8月11日～平成28年2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28年2月期	156,624	(98.7)	2,087	(1.3)	158,712	(100)
平成27年8月期	132,118	(98.4)	2,106	(1.6)	134,224	(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28年2月期	72,110	16,978	2,760	86,328
平成27年8月期	61,558	21,574	11,022	72,110

(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/当特定期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年2月期	187,547	28,834	158,712	183,847
平成27年8月期	156,771	22,546	134,224	186,137

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成28年2月期	1,500.00
平成27年8月期	1,330.00

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8月10日現在)	当期 (平成28年2月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	22,516,839,775	27,819,747,925
投資証券	132,118,058,200	156,624,795,800
派生商品評価勘定	-	10,947,672
未収入金	949,033,800	1,737,097,089
未収配当金	1,055,909,899	1,288,769,404
未収利息	6,393	36,855
その他未収収益	3,267,425	4,067,176
差入委託証拠金	127,906,500	62,170,200
流動資産合計	156,771,021,992	187,547,632,121
資産合計	156,771,021,992	187,547,632,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,060,628	-
未払金	547,160	421,785,600
未払収益分配金	959,073,507	1,294,927,290
未払受託者報酬	21,422,747	23,584,083
未払委託者報酬	111,575,337	123,606,882
未払利息	187,620	236,785
有価証券貸借取引受入金	21,355,776,120	26,947,630,185
その他未払費用	35,553,561	23,121,552
流動負債合計	22,546,196,680	28,834,892,377
負債合計	22,546,196,680	28,834,892,377
純資産の部		
元本等		
元本	84,946,510,620	101,694,956,508
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	49,278,314,692	57,017,783,236
(分配準備積立金)	6,788,550	8,412,337
元本等合計	134,224,825,312	158,712,739,744
純資産合計	134,224,825,312	158,712,739,744
負債純資産合計	156,771,021,992	187,547,632,121

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成27年2月11日 至 平成27年8月10日	当期 自 平成27年8月11日 至 平成28年2月10日

営業収益		
受取配当金	2,051,430,756	2,518,496,911
受取利息	3,744,729	6,013,032
有価証券売買等損益	△3,936,550,244	△104,949,784
派生商品取引等損益	△34,983,477	10,442,688
その他収益	58,022,766	130,977,567
営業収益合計	△1,858,335,470	2,560,980,414
営業費用		
支払利息	2,797,610	3,536,038
受託者報酬	40,956,973	44,673,021
委託者報酬	214,149,199	234,066,773
その他費用	27,436,142	25,514,067
営業費用合計	285,339,924	307,789,899
営業利益又は営業損失(△)	△2,143,675,394	2,253,190,515
経常利益又は経常損失(△)	△2,143,675,394	2,253,190,515
当期純利益又は当期純損失(△)	△2,143,675,394	2,253,190,515
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(△)	45,256,477,793	49,278,314,692
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,092,204,835	9,504,600,041
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,092,204,835	9,504,600,041
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,100,423,198	1,672,248,188
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,100,423,198	1,672,248,188
分配金	1,826,269,344	2,346,073,824
期末剰余金又は期末欠損金(△)	49,278,314,692	57,017,783,236

(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 8 月 11 日から平成 28 年 2 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	当期
----	----

平成 27 年 8 月 10 日現在	平成 28 年 2 月 10 日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 72, 110, 790 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 86, 328, 486 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, 861. 37 円 (100 口当たり純資産額) (186, 137 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, 838. 47 円 (100 口当たり純資産額) (183, 847 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 20, 167, 271, 300 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 24, 480, 036, 600 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成 27 年 2 月 11 日 至 平成 27 年 8 月 10 日	当期 自 平成 27 年 8 月 11 日 至 平成 28 年 2 月 10 日																																																												
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	1. 分配金の計算過程 平成 27 年 8 月 11 日から平成 27 年 11 月 10 日まで																																																												
<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>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>	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	<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>1, 197, 032, 402 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>6, 788, 550 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1, 203, 820, 952 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>143, 430, 631 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>1, 060, 390, 321 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>1, 051, 146, 534 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, 243, 787 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>82, 120, 823 口</td> </tr> <tr> <td>100 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×100</td> <td>1, 280 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1, 197, 032, 402 円	分配準備積立金	B	6, 788, 550 円	配当等収益合計額	C=A+B	1, 203, 820, 952 円	経費	D	143, 430, 631 円	収益分配可能額	E=C-D	1, 060, 390, 321 円	収益分配金	F	1, 051, 146, 534 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9, 243, 787 円	口数	H	82, 120, 823 口	100 口当たり分配金	I=F/H×100	1, 280 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, 197, 032, 402 円																																																											
分配準備積立金	B	6, 788, 550 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1, 203, 820, 952 円																																																											
経費	D	143, 430, 631 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1, 060, 390, 321 円																																																											
収益分配金	F	1, 051, 146, 534 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9, 243, 787 円																																																											
口数	H	82, 120, 823 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1, 280 円																																																											
平成 27 年 5 月 11 日から平成 27 年 8 月 10 日まで	平成 27 年 11 月 11 日から平成 28 年 2 月 10 日まで																																																												
<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>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, 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	<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>1, 454, 919, 070 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>9, 243, 787 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1, 464, 162, 857 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>160, 823, 230 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>1, 303, 339, 627 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>1, 294, 927, 290 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8, 412, 337 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>86, 328, 486 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	1, 454, 919, 070 円	分配準備積立金	B	9, 243, 787 円	配当等収益合計額	C=A+B	1, 464, 162, 857 円	経費	D	160, 823, 230 円	収益分配可能額	E=C-D	1, 303, 339, 627 円	収益分配金	F	1, 294, 927, 290 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8, 412, 337 円	口数	H	86, 328, 486 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, 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	1, 454, 919, 070 円																																																											
分配準備積立金	B	9, 243, 787 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1, 464, 162, 857 円																																																											
経費	D	160, 823, 230 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	1, 303, 339, 627 円																																																											
収益分配金	F	1, 294, 927, 290 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8, 412, 337 円																																																											
口数	H	86, 328, 486 口																																																											
100 口当たり分配金	I=F/H×100	1, 500 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 27 年 2 月 11 日 至 平成 27 年 8 月 10 日	当期 自 平成 27 年 8 月 11 日 至 平成 28 年 2 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。 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。	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 27 年 8 月 10 日現在	当期 平成 28 年 2 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 27 年 2 月 11 日 至 平成 27 年 8 月 10 日	当期 自 平成 27 年 8 月 11 日 至 平成 28 年 2 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 27 年 2 月 11 日 至 平成 27 年 8 月 10 日	当期 自 平成 27 年 8 月 11 日 至 平成 28 年 2 月 10 日
期首元本額 72,515,794,022 円	期首元本額 84,946,510,620 円
期中追加設定元本額 25,415,232,200 円	期中追加設定元本額 20,000,084,000 円
期中一部交換元本額 12,984,515,602 円	期中一部交換元本額 3,251,638,112 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 平成 27 年 2 月 11 日 至 平成 27 年 8 月 10 日	当期 自 平成 27 年 8 月 11 日 至 平成 28 年 2 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	△5,130,383,993	2,681,177,524
合計	△5,130,383,993	2,681,177,524

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 27 年 8 月 10 日現在)			当期(平成 28 年 2 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)
市場取引						
REIT 指数先物取引						
買建	2,153,923,500	2,091,991,500	△62,060,628	2,050,544,700	2,061,621,000	10,947,672
合計	2,153,923,500	2,091,991,500	△62,060,628	2,050,544,700	2,061,621,000	10,947,672

(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 28 年 2 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 28 年 2 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	7,165	3,034,377,500	貸付有価証券 735 口 (515 口)
		MCUBS MidCity 投資法人 投資証券	3,934	1,201,837,000	貸付有価証券 403 口 (282 口)
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	25,760	3,943,856,000	貸付有価証券 5,428 口 (1,669 口)
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,214	2,700,852,000	貸付有価証券 968 口 (432 口)
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,186	2,328,514,000	貸付有価証券 535 口 (372 口)
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	19,224	5,107,816,800	貸付有価証券 2,289 口 (1,382 口)
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	5,162	1,425,744,400	貸付有価証券 791 口 (371 口)
		アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	8,867	4,885,717,000	貸付有価証券 1,722 口 (1,102 口)
		GLP 投資法人 投資証券	38,355	4,472,193,000	貸付有価証券 5,231 口 (2,757 口)
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	7,565	1,565,198,500	貸付有価証券 2,241 口 (503 口)

日本プロロジスリート投資法人 投資証券	25,593	5,947,813,200	貸付有価証券 2,739 口(1,840 口)
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,154	1,397,494,000	貸付有価証券 324 口 (107 口)
S I A 不動産投資法人 投資証券	1,111	461,065,000	貸付有価証券 391 口 (79 口)
イオンリート投資法人 投資証券	19,209	2,449,147,500	貸付有価証券 9,622 口(1,159 口)
ヒューリックリート投資法人 投 資証券	11,549	1,912,514,400	貸付有価証券 1,949 口(1,332 口)
日本リート投資法人 投資証券	5,793	1,567,585,800	貸付有価証券 680 口 (416 口)
インベスコ・オフィス・ジェイリ ート投資法人 投資証券	8,018	779,349,600	貸付有価証券 1,070 口(794 口)
日本ヘルスケア投資法人 投資証 券	1,104	185,803,200	貸付有価証券 475 口 (188 口)
積水ハウス・リート投資法人 投 資証券	11,741	1,420,661,000	貸付有価証券 1,206 口(844 口)
トーセイ・リート投資法人 投資 証券	2,381	255,957,500	貸付有価証券 383 口 (171 口)
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	5,253	1,344,768,000	貸付有価証券 862 口 (701 口)
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,782	173,210,400	貸付有価証券 711 口 (128 口)
サムティ・レジデンシャル投資法 人 投資証券	2,415	198,030,000	貸付有価証券 934 口 (173 口)
ジャパン・シニアリビング投資法 人 投資証券	1,253	163,892,400	貸付有価証券 129 口 (90 口)
野村不動産マスターファンド投資 法人 投資証券	55,039	8,255,850,000	貸付有価証券 15,851 口(14,157 口)
いちごホテルリート投資法人 投 資証券	2,048	252,518,400	貸付有価証券 669 口 (347 口)
日本ビルファンド投資法人 投資 証券	20,880	12,173,040,000	貸付有価証券 2,660 口(2,076 口)
ジャパンリアルエステイト投資法 人 投資証券	19,361	11,790,849,000	貸付有価証券 3,903 口(1,416 口)
日本リテールファンド投資法人 投資証券	37,740	9,465,192,000	貸付有価証券 5,038 口(2,809 口)
オリックス不動産投資法人 投資 証券	34,317	5,641,714,800	貸付有価証券 3,612 口(2,467 口)
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	12,909	5,421,780,000	貸付有価証券 2,078 口(1,252 口)
プレミア投資法人 投資証券	19,475	2,529,802,500	貸付有価証券 2,143 口(1,540 口)
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	14,456	2,123,586,400	貸付有価証券 1,470 口(1,039 口)
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,866	1,190,823,000	貸付有価証券 543 口 (408 口)
ユナイテッド・アーバン投資法人	40,686	6,684,709,800	貸付有価証券 5,736

	投資証券			口(2,925 口)
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	19,519	3,679,331,500	貸付有価証券 2,177 口(1,403 口)
	インヴィンシブル投資法人 投資 証券	47,226	3,135,806,400	貸付有価証券 4,227 口(3,395 口)
	フロンティア不動産投資法人 投 資証券	7,335	3,480,457,500	貸付有価証券 753 口 (527 口)
	平和不動産リート投資法人 投資 証券	15,007	1,241,078,900	貸付有価証券 1,744 口(1,079 口)
	日本ロジスティクスファンド投資 法人 投資証券	13,013	3,114,010,900	貸付有価証券 954 口 (935 口)
	福岡リート投資法人 投資証券	11,046	2,085,484,800	貸付有価証券 1,195 口(794 口)
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	5,987	3,682,005,000	貸付有価証券 684 口 (489 口)
	積水ハウス・S I レジデンシャル 投資法人 投資証券	15,055	1,564,214,500	貸付有価証券 1,825 口(1,261 口)
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	20,944	1,713,219,200	貸付有価証券 3,907 口(1,531 口)
	大和証券オフィス投資法人 投資 証券	7,157	4,659,207,000	貸付有価証券 844 口 (605 口)
	阪急リート投資法人 投資証券	8,835	1,120,278,000	貸付有価証券 1,122 口(635 口)
	スターツプロシード投資法人 投 資証券	2,570	408,887,000	貸付有価証券 288 口 (184 口)
	トップリート投資法人 投資証券	2,603	1,067,230,000	貸付有価証券 266 口 (187 口)
	大和ハウス・レジデンシャル投資 法人 投資証券	11,057	2,585,126,600	貸付有価証券 1,815 口(794 口)
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	49,009	4,234,377,600	貸付有価証券 9,946 口(4,116 口)
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	24,252	1,940,160,000	貸付有価証券 2,561 口(1,743 口)
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	18,698	2,460,656,800	貸付有価証券 1,923 口(1,344 口)
小計	銘柄数：52 組入時価比率：98.7%	763,878	156,624,795,800	100.0%
合計			156,624,795,800	

(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。