



2021年8月期 (2021年2月11日～2021年8月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended August 2021 (February 11, 2021 – August 10, 2021)

2021年9月17日
 September 17, 2021

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 兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2021年10月27日
 分配金支払開始日 2021年9月17日
 Scheduled date of submission of securities report: October 27, 2021
 Date of commencing dividend payment: September 17, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年8月期の運用状況 (2021年2月11日～2021年8月10日)

Management Status for Period ended August 2021 (from February 11, 2021 to August 10, 2021)

(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.	%
2021年8月期 FY ended Aug. 2021	419,434	(97.9)	9,119	(2.1)	428,554	(100.0)
2021年2月期 FY ended Feb. 2021	381,289	(97.2)	11,132	(2.8)	392,421	(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
2021年8月期 FY ended Aug. 2021	193,715	25,377	31,258	187,834
2021年2月期 FY ended Feb. 2021	184,338	30,560	21,183	193,715

(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
2021年8月期 FY ended Aug. 2021	470,621	42,066	428,554	228,155
2021年2月期 FY ended Feb. 2021	432,663	40,241	392,421	202,577

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2021年8月期 FY ended Aug. 2021	1,610
2021年2月期 FY ended Feb. 2021	1,660

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 (2021年2月10日現在) Prior period As of February 10, 2021	当期 (2021年8月10日現在) Present period As of August 10, 2021
	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	43,176,552,618	44,579,805,049
投資証券 Investment securities	381,289,380,100	419,434,355,150
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	1,267,406,010	26,135,610
未収入金 Accounts receivable - other	3,299,697,993	2,978,589,096
未収配当金 Accrued dividends receivable	3,136,637,303	2,994,243,563
未収利息 Accrued interest	1,093,499	1,169,758
その他未収収益 Other accrued revenue	208,020,426	195,504,362
差入委託証拠金 Margin deposits	285,125,700	411,249,600
流動資産合計 Total current assets	432,663,913,649	470,621,052,188
資産合計 Total assets	432,663,913,649	470,621,052,188
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	21,824,000
未払金 Accounts payable - other	-	4,458,167,074
未払収益分配金 Unpaid dividends	3,215,675,108	3,024,138,267
未払受託者報酬 Trustee fees payable	32,689,975	37,490,103
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	135,738,302	155,827,973
未払利息 Accrued interest expenses	12,527	39,498
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities	36,806,564,979	34,270,350,345

lent		
その他未払費用 Other accrued expenses	51,290,461	98,960,884
流動負債合計 Total current liabilities	40,241,971,352	42,066,798,144
負債合計 Total liabilities	40,241,971,352	42,066,798,144
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	228,196,703,504	221,269,247,150
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	164,225,238,793	207,285,006,894
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	11,658,806	8,812,226
元本等合計 Total principal and other	392,421,942,297	428,554,254,044
純資産合計 Total net assets	392,421,942,297	428,554,254,044
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	432,663,913,649	470,621,052,188

(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 2020年8月11日 至 2021年2月10日 Prior period From August 11, 2020 to February 10, 2021	当期 自 2021年2月11日 至 2021年8月10日 Present period From February 11, 2021 to August 10, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	6,537,430,365	6,548,657,495
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	45,739,470,359	45,670,048,264
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	1,529,267,740	1,639,199,140
その他収益 Other revenue	613,299,233	504,373,885
営業収益合計 Total operating revenue	54,419,467,697	54,362,278,784
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△12,727,931	△10,844,668
受託者報酬 Trustee fees	63,818,074	71,352,207

委託者報酬 Investment trust management fees	264,912,680	296,557,528
その他費用 Other expenses	59,684,905	67,099,216
営業費用合計 Total operating expenses	375,687,728	424,164,283
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	54,043,779,969	53,938,114,501
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	54,043,779,969	53,938,114,501
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	54,043,779,969	53,938,114,501
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	111,135,622,595	164,225,238,793
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	20,503,923,971	26,508,107,193
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	20,503,923,971	26,508,107,193
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	14,682,417,694	30,754,739,916
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	14,682,417,694	30,754,739,916
分配金 Dividends	6,775,670,048	6,631,713,677
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	164,225,238,793	207,285,006,894

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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。</p>

4. その他	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。 当該財務諸表の特定期間は、2021年2月11日から2021年8月10日までとなっております。
--------	--

(重要な会計上の見積りに関する注記)
 該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2021年2月10日現在	当期 2021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 193,715,368 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 187,834,675 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 2,025.77円 (100口当たり純資産額) (202,577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 2,281.55円 (100口当たり純資産額) (228,155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 35,252,206,880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 31,983,441,490円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自2020年8月11日 至2021年2月10日	当期 自2021年2月11日 至2021年8月10日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2020年8月11日から2020年11月10日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,751,342,785円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>12,286,984円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,763,629,769円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>190,200,093円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,573,429,676円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,559,994,940円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>13,434,736円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>189,361,433口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,880円</td></tr> </tbody> </table> 2020年11月11日から2021年2月10日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,412,114,744円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>13,434,736円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,425,549,480円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>198,215,566円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,227,333,914円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,215,675,108円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>11,658,806円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>193,715,368口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,660円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち39,620,501円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	3,751,342,785円	分配準備積立金	B	12,286,984円	配当等収益合計額	C=A+B	3,763,629,769円	経費	D	190,200,093円	収益分配可能額	E=C-D	3,573,429,676円	収益分配金	F	3,559,994,940円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,434,736円	口数	H	189,361,433口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,880円	項目			当期配当等収益額	A	3,412,114,744円	分配準備積立金	B	13,434,736円	配当等収益合計額	C=A+B	3,425,549,480円	経費	D	198,215,566円	収益分配可能額	E=C-D	3,227,333,914円	収益分配金	F	3,215,675,108円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,658,806円	口数	H	193,715,368口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,660円	1. 分配金の計算過程 2021年2月11日から2021年5月10日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,813,346,275円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>11,658,806円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,825,005,081円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>207,182,303円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,617,822,778円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,607,575,410円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>10,247,368円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>189,872,390口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,900円</td></tr> </tbody> </table> 2021年5月11日から2021年8月10日まで <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>3,250,529,773円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>10,247,368円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>3,260,777,141円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>227,826,648円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,032,950,493円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,024,138,267円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>8,812,226円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>187,834,675口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,610円</td></tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち44,615,076円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	3,813,346,275円	分配準備積立金	B	11,658,806円	配当等収益合計額	C=A+B	3,825,005,081円	経費	D	207,182,303円	収益分配可能額	E=C-D	3,617,822,778円	収益分配金	F	3,607,575,410円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,247,368円	口数	H	189,872,390口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900円	項目			当期配当等収益額	A	3,250,529,773円	分配準備積立金	B	10,247,368円	配当等収益合計額	C=A+B	3,260,777,141円	経費	D	227,826,648円	収益分配可能額	E=C-D	3,032,950,493円	収益分配金	F	3,024,138,267円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,812,226円	口数	H	187,834,675口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,610円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,751,342,785円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	12,286,984円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,763,629,769円																																																																																																																							
経費	D	190,200,093円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,573,429,676円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,559,994,940円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,434,736円																																																																																																																							
口数	H	189,361,433口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,880円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,412,114,744円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	13,434,736円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,425,549,480円																																																																																																																							
経費	D	198,215,566円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,227,333,914円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,215,675,108円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,658,806円																																																																																																																							
口数	H	193,715,368口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,660円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,813,346,275円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	11,658,806円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,825,005,081円																																																																																																																							
経費	D	207,182,303円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,617,822,778円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,607,575,410円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,247,368円																																																																																																																							
口数	H	189,872,390口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,900円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,250,529,773円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	10,247,368円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,260,777,141円																																																																																																																							
経費	D	227,826,648円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,032,950,493円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,024,138,267円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,812,226円																																																																																																																							
口数	H	187,834,675口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,610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2020年8月11日	当期 自2021年2月11日

至 2021年 2月 10日	至 2021年 8月 10日
<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>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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</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 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2021年 2月 10日現在	当期 2021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 2020年 8月 11日 至 2021年 2月 10日	当期 自 2021年 2月 11日 至 2021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 2020年 8月 11日 至 2021年 2月 10日	当期 自 2021年 2月 11日 至 2021年 8月 10日
期首元本額 217,150,570,410円	期首元本額 228,196,703,504円
期中追加設定元本額 36,000,622,400円	期中追加設定元本額 29,894,695,000円
期中一部交換元本額 24,954,489,306円	期中一部交換元本額 36,822,151,354円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年 8月 11日 至 2021年 2月 10日	当期 自 2021年 2月 11日 至 2021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	36,391,188,888	13,940,419,547
合計	36,391,188,888	13,940,419,547

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(2021年 2月 10日現在)				当期(2021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	9,744,305,700	-	11,012,354,000	1,267,406,010	9,102,908,100	-	9,107,691,500	4,311,610
合計	9,744,305,700	-	11,012,354,000	1,267,406,010	9,102,908,100	-	9,107,691,500	4,311,610

(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(2021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(2021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	エスコンジヤパンリート投資法人 投資証券	7,214	1,014,288,400	貸付有価証券 388口
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	8,766	1,142,209,800	貸付有価証券 125口
		S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	15,028	2,611,866,400	貸付有価証券 228口
		東海道リート投資法人 投資証券	2,743	304,747,300	貸付有価証券 62口

日本アコモデーションファンド 投資法人 投資証券	12,370	8,362,120,000	貸付有価証券 393口
森ヒルズリート投資法人 投資 証券	42,126	6,592,719,000	貸付有価証券 7,742口
産業ファンド投資法人 投資証 券	50,858	11,010,757,000	貸付有価証券 923口
アドバンス・レジデンス投資法 人 投資証券	35,819	13,360,487,000	貸付有価証券 1,282口
ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人 投資証 券	24,468	5,659,448,400	貸付有価証券 3,643口
アクティビア・プロパティーズ 投資法人 投資証券	17,951	8,311,313,000	貸付有価証券 1,124口
G L P投資法人 投資証券	116,022	23,146,389,000	貸付有価証券 1,749口
コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 投資証券	16,130	5,564,850,000	貸付有価証券 365口
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	56,756	21,482,146,000	貸付有価証券 2,535口
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	5,527	3,692,036,000	貸付有価証券 890口
O n eリート投資法人 投資証 券	5,584	1,887,392,000	貸付有価証券 187口
イオンリート投資法人 投資証 券	38,758	6,069,502,800	貸付有価証券 4,811口
ヒューリックリート投資法人 投資証券	31,492	5,914,197,600	貸付有価証券 1,278口
日本リート投資法人 投資証券	11,054	4,775,328,000	貸付有価証券 260口
インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人 投資証券	227,655	5,163,215,400	貸付有価証券 33,783口
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	105,368	10,031,033,600	貸付有価証券 5,132口
トーセイ・リート投資法人 投 資証券	7,485	1,050,894,000	貸付有価証券 765口
ケネディクス商業リート投資法 人 投資証券	14,303	4,147,870,000	貸付有価証券 364口
ヘルスケア&メディカル投資法 人 投資証券	7,641	1,133,924,400	貸付有価証券 117口
サムティ・レジデンシャル投資 法人 投資証券	8,114	971,245,800	貸付有価証券 238口
野村不動産マスターファンド投 資法人 投資証券	115,848	19,798,423,200	貸付有価証券 1,462口
いちごホテルリート投資法人 投資証券	5,935	515,751,500	貸付有価証券 232口
ラサールロジポート投資法人 投資証券	43,856	8,722,958,400	貸付有価証券 3,135口 (2,653口)
スターアジア不動産投資法人 投資証券	34,643	2,040,472,700	貸付有価証券 2,331口

マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	3,356	436,615,600	貸付有価証券 144口
三井不動産ロジスティクスパー ク投資法人 投資証券	13,316	8,322,500,000	貸付有価証券 267口
大江戸温泉リート投資法人 投 資証券	5,782	470,076,600	貸付有価証券 275口
投資法人みらい 投資証券	40,840	2,233,948,000	貸付有価証券 668口
森トラスト・ホテルリート投資 法人 投資証券	8,405	1,114,503,000	貸付有価証券 734口
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	9,104	4,615,728,000	貸付有価証券 377口 (245口)
CREロジスティクスファンド 投資法人 投資証券	12,288	2,597,683,200	貸付有価証券 461口
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	5,200	640,640,000	貸付有価証券 239口
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	11,363	1,463,554,400	貸付有価証券 460口
伊藤忠アドバンス・ロジスティ クス投資法人 投資証券	13,968	2,222,308,800	貸付有価証券 273口
日本ビルファンド投資法人 投 資証券	40,600	29,353,800,000	貸付有価証券 19,520口
ジャパンリアルエステイト投資 法人 投資証券	35,824	24,360,320,000	貸付有価証券 664口
日本都市ファンド投資法人 投 資証券	180,753	19,900,905,300	貸付有価証券 2,779口
オリックス不動産投資法人 投 資証券	71,379	14,432,833,800	貸付有価証券 2,237口
日本プライムリアルティ投資法 人 投資証券	23,543	9,711,487,500	貸付有価証券 1,524口
N T T都市開発リート投資法人	32,357	4,947,385,300	貸付有価証券 501口
東急リアル・エステート投資法 人 投資証券	24,019	4,707,724,000	貸付有価証券 6,139口
グローバル・ワン不動産投資法 人 投資証券	24,876	3,059,748,000	貸付有価証券 974口
ユナイテッド・アーバン投資法 人 投資証券	80,647	13,137,396,300	貸付有価証券 2,680口
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	25,603	3,924,939,900	貸付有価証券 926口
インヴィンシブル投資法人 投 資証券	157,677	6,236,125,350	貸付有価証券 11,337口
フロンティア不動産投資法人 投資証券	12,559	6,204,146,000	貸付有価証券 1,862口
平和不動産リート投資法人 投 資証券	23,208	3,859,490,400	貸付有価証券 557口
日本ロジスティクスファンド投 資法人 投資証券	23,407	7,911,566,000	貸付有価証券 1,133口
福岡リート投資法人 投資証券	18,528	3,340,598,400	貸付有価証券

				938 口
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	11,082	8,510,976,000	貸付有価証券 533 口
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	29,354	2,809,177,800	貸付有価証券 519 口
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	7,574	5,703,222,000	貸付有価証券 365 口
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	16,181	2,548,507,500	貸付有価証券 924 口
	スタートプロシード投資法人 投資証券	5,579	1,346,770,600	貸付有価証券 256 口
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	51,114	17,225,418,000	貸付有価証券 1,185 口
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	109,750	7,089,850,000	貸付有価証券 4,537 口
	大和証券リング投資法人 投資証券	46,857	5,636,897,100	貸付有価証券 1,072 口
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	33,242	4,879,925,600	貸付有価証券 939 口
小計	銘柄数：62 組入時価比率：97.9%	2,278,849	419,434,355,150	100.0%
合計			419,434,355,150	

(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。