



2023年2月期 (2022年8月11日～2023年2月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended February 2023 (August 11, 2022 – February 10, 2023)

2023年3月22日
 March 22, 2023

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 長坂 智 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: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2023年4月27日
 分配金支払開始日 2023年3月20日
 Scheduled date of submission of securities report: April 27, 2023
 Date of commencing dividend payment: March 20, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2023年2月期の運用状況 (2022年8月11日～2023年2月10日)

Management Status for Period ended February 2023 (from August 11, 2022 to February 10, 2023)

(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.	%
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	438,388	(98.2)	7,835	(1.8)	446,224	(100.0)
2022年8月期 FY ended Aug. 2022	466,870	(98.2)	8,649	(1.8)	475,520	(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
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	221,060	25,256	17,630	228,685
2022年8月期 FY ended Aug. 2022	211,153	29,703	19,796	221,060

(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
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	461,080	14,855	446,224	195,126
2022年8月期 FY ended Aug. 2022	489,054	13,534	475,520	215,109

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	1,790
2022年8月期 FY ended Aug. 2022	1,720

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 (2022年8月10日現在) Prior period As of August 10, 2022	当期 (2023年2月10日現在) Present period As of February 10, 2023
	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	13,826,794,464	13,404,800,254
投資証券 Investment securities	466,870,607,650	438,388,890,200
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	56,558,720	-
未収入金 Accounts receivable - other	3,841,066,656	4,089,542,347
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,015,243,267	4,269,658,762
未収利息 Accrued interest	254,421	171,006
その他未収収益 Other accrued revenue	11,838,965	43,103,764
差入委託証拠金 Margin deposits	431,801,600	884,614,400
流動資産合計 Total current assets	489,054,165,743	461,080,780,733
資産合計 Total assets	489,054,165,743	461,080,780,733
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	432,702,080
未払収益分配金 Unpaid dividends	3,802,232,860	4,093,465,742
未払受託者報酬 Trustee fees payable	39,320,195	39,078,408
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	163,675,361	162,633,409
未払利息 Accrued interest expenses	3,261	12,358
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	9,417,449,790	10,061,925,720
その他未払費用	111,454,587	66,116,340

Other accrued expenses		
流動負債合計 Total current liabilities	13,534,136,054	14,855,934,057
負債合計 Total liabilities	13,534,136,054	14,855,934,057
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	260,408,738,900	269,391,209,186
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	215,111,290,789	176,833,637,490
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	14,373,883	13,360,523
元本等合計 Total principal and other	475,520,029,689	446,224,846,676
純資産合計 Total net assets	475,520,029,689	446,224,846,676
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	489,054,165,743	461,080,780,733

(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 2022年2月11日 至 2022年8月10日 Prior period From February 11, 2022 to August 10, 2022	当期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日 Present period From August 11, 2022 to February 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	8,308,721,282	8,736,224,722
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	17,614,949,794	△42,913,508,915
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	479,655,680	△647,659,520
その他収益 Other revenue	124,912,827	86,623,971
営業収益合計 Total operating revenue	26,528,239,583	△34,738,319,742
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△3,794,676	58,913
受託者報酬 Trustee fees	76,050,856	79,235,133
委託者報酬 Investment trust management fees	316,542,296	329,753,053

その他費用 Other expenses	78,072,072	74,764,943
営業費用合計 Total operating expenses	466,870,548	483,812,042
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	26,061,369,035	△35,222,131,784
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	26,061,369,035	△35,222,131,784
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	26,061,369,035	△35,222,131,784
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	188,059,157,500	215,111,290,789
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	27,558,826,334	21,611,857,782
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	27,558,826,334	21,611,857,782
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	18,611,508,504	16,327,329,286
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	18,611,508,504	16,327,329,286
分配金 Dividends	7,956,553,576	8,340,050,011
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	215,111,290,789	176,833,637,490

(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った場合、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、2022年8月11日から2023年2月10日までとなっております。</p>

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 2022年8月10日現在	当期 2023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 221,060,050 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 228,685,237 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 2,151.09円 (100口当たり純資産額) (215,109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 1,951.26円 (100口当たり純資産額) (195,126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 8,933,312,900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 9,507,055,900円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年2月11日 至 2022年8月10日	当期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日																																																																																																																								
<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2022年2月11日から2022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>4,389,443,331円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>4,163,898円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>4,393,607,229円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>230,367,022円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>4,163,240,207円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>4,154,320,716円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>8,919,491円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>213,042,088口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,950円</td></tr> </tbody> </table> <p>2022年5月11日から2022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>4,047,985,454円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>8,919,491円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>4,056,904,945円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>240,298,202円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>3,816,606,743円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>3,802,232,860円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>14,373,883円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>221,060,050口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,720円</td></tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち48,661,761円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	4,389,443,331円	分配準備積立金	B	4,163,898円	配当等収益合計額	C=A+B	4,393,607,229円	経費	D	230,367,022円	収益分配可能額	E=C-D	4,163,240,207円	収益分配金	F	4,154,320,716円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,919,491円	口数	H	213,042,088口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,950円	項目			当期配当等収益額	A	4,047,985,454円	分配準備積立金	B	8,919,491円	配当等収益合計額	C=A+B	4,056,904,945円	経費	D	240,298,202円	収益分配可能額	E=C-D	3,816,606,743円	収益分配金	F	3,802,232,860円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,373,883円	口数	H	221,060,050口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,720円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <p>2022年8月11日から2022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>4,486,080,446円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>14,373,883円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>4,500,454,329円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>245,134,915円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>4,255,319,414円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>4,246,584,269円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>8,735,145円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>225,882,142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> <p>2022年11月11日から2023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>4,336,709,334円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td>B</td><td>8,735,145円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>4,345,444,479円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>238,618,214円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td>E=C-D</td><td>4,106,826,265円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td>F</td><td>4,093,465,742円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>13,360,523円</td></tr> <tr><td>口数</td><td>H</td><td>228,685,237口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td>I=F/H×100</td><td>1,790円</td></tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち50,451,271円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	4,486,080,446円	分配準備積立金	B	14,373,883円	配当等収益合計額	C=A+B	4,500,454,329円	経費	D	245,134,915円	収益分配可能額	E=C-D	4,255,319,414円	収益分配金	F	4,246,584,269円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,735,145円	口数	H	225,882,142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	4,336,709,334円	分配準備積立金	B	8,735,145円	配当等収益合計額	C=A+B	4,345,444,479円	経費	D	238,618,214円	収益分配可能額	E=C-D	4,106,826,265円	収益分配金	F	4,093,465,742円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,360,523円	口数	H	228,685,237口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,790円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	4,389,443,331円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	4,163,898円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,393,607,229円																																																																																																																							
経費	D	230,367,022円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	4,163,240,207円																																																																																																																							
収益分配金	F	4,154,320,716円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,919,491円																																																																																																																							
口数	H	213,042,088口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,950円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	4,047,985,454円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	8,919,491円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,056,904,945円																																																																																																																							
経費	D	240,298,202円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	3,816,606,743円																																																																																																																							
収益分配金	F	3,802,232,860円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,373,883円																																																																																																																							
口数	H	221,060,050口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,720円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	4,486,080,446円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	14,373,883円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,500,454,329円																																																																																																																							
経費	D	245,134,915円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	4,255,319,414円																																																																																																																							
収益分配金	F	4,246,584,269円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,735,145円																																																																																																																							
口数	H	225,882,142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	4,336,709,334円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	8,735,145円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,345,444,479円																																																																																																																							
経費	D	238,618,214円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	4,106,826,265円																																																																																																																							
収益分配金	F	4,093,465,742円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,360,523円																																																																																																																							
口数	H	228,685,237口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,790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 2022年2月11日 至 2022年8月10日	当期 自 2022年8月11日 至 2023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	1. 金融商品に対する取組方針 同左

<p>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>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 2022年8月10日現在	当期 2023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 2022年2月11日 至 2022年8月10日	当期 自 2022年8月11日 至 2023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 2022年2月11日 至 2022年8月10日	当期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日
期首元本額 248,738,683,996円	期首元本額 260,408,738,900円

期中追加設定元本額	34,990,251,800円	期中追加設定元本額	29,751,685,800円
期中一部交換元本額	23,320,196,896円	期中一部交換元本額	20,769,215,514円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年2月11日 至 2022年8月10日	当期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日
	損益に含まれた評価差額 (円)	
投資証券	12,077,420,957	△27,955,186,292
合計	12,077,420,957	△27,955,186,292

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(2022年8月10日現在)				当期(2023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)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
REIT 指数先物取引								
買建	8,514,681,600	-	8,571,712,000	56,558,720	8,197,798,400	-	7,765,568,000	△432,702,080
合計	8,514,681,600	-	8,571,712,000	56,558,720	8,197,798,400	-	7,765,568,000	△432,702,080

(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(2023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(2023年2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	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	8,710	999,037,000	貸付有価証券 247口
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	13,727	1,220,330,300	貸付有価証券 950口
		S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	21,314	2,749,506,000	貸付有価証券 335口
		東海道リート投資法人 投資証券	7,126	823,765,600	貸付有価証券 839口 (361口)
		日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	14,796	8,833,212,000	貸付有価証券 20口
		森ヒルズリート投資法人 投資	50,388	7,432,230,000	貸付有価証券

証券			254 口
産業ファンド投資法人 投資証券	64,034	9,022,390,600	貸付有価証券 2,532 口
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	42,844	13,967,144,000	貸付有価証券 572 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	31,424	6,181,100,800	貸付有価証券 544 口 (463 口)
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	22,622	8,607,671,000	貸付有価証券 269 口
GLP投資法人 投資証券	138,302	20,537,847,000	貸付有価証券 1,423 口
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	20,490	6,126,510,000	貸付有価証券 2,809 口 (2,752 口)
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	72,227	21,097,506,700	貸付有価証券 2,228 口
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	7,494	5,545,560,000	貸付有価証券 857 口 (117 口)
Oneリート投資法人 投資証券	7,474	1,800,486,600	貸付有価証券 291 口
イオンリート投資法人 投資証券	49,189	7,088,134,900	貸付有価証券 222 口
ヒューリックリート投資法人 投資証券	40,090	6,141,788,000	貸付有価証券 966 口 (741 口)
日本リート投資法人 投資証券	13,918	4,565,104,000	貸付有価証券 799 口
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	128,760	9,077,580,000	貸付有価証券 2,532 口
トーセイ・リート投資法人 投資証券	9,505	1,239,452,000	貸付有価証券 355 口
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	18,628	4,481,896,800	貸付有価証券 25 口
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	10,565	1,734,773,000	貸付有価証券 114 口
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	11,138	1,202,904,000	貸付有価証券 15 口
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	138,567	20,909,760,300	貸付有価証券 855 口
いちごホテルリート投資法人 投資証券	7,099	799,347,400	貸付有価証券 14 口
ラサールロジポート投資法人 投資証券	52,456	8,240,837,600	貸付有価証券 71 口
スターアジア不動産投資法人 投資証券	53,501	2,840,903,100	貸付有価証券 633 口
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	6,545	817,470,500	貸付有価証券 736 口
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	16,927	7,557,905,500	貸付有価証券 24 口
大江戸温泉リート投資法人 投	6,916	438,474,400	貸付有価証券

	資証券			225 口
	投資法人みらい 投資証券	52,058	2,285,346,200	貸付有価証券 2,226 口 (39 口)
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	10,054	1,323,106,400	貸付有価証券 72 口
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	14,721	5,910,481,500	貸付有価証券 410 口
	CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	16,595	2,857,659,000	貸付有価証券 35 口
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	6,950	799,250,000	貸付有価証券 15 口
	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	18,767	1,816,645,600	貸付有価証券 24 口
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	18,678	2,583,167,400	貸付有価証券 930 口 (270 口)
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	49,987	28,492,590,000	貸付有価証券 2,373 口
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	42,850	23,996,000,000	貸付有価証券 804 口
	日本都市ファンド投資法人 投資証券	216,200	22,052,400,000	貸付有価証券 299 口
	オリックス不動産投資法人 投資証券	85,378	15,487,569,200	貸付有価証券 350 口
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	29,304	10,315,008,000	貸付有価証券 263 口
	N T T都市開発リート投資法人	41,190	5,383,533,000	貸付有価証券 902 口
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	28,729	5,510,222,200	貸付有価証券 206 口
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	31,532	3,348,698,400	貸付有価証券 300 口
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	95,852	14,176,510,800	貸付有価証券 870 口
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	30,625	4,348,750,000	貸付有価証券 2,137 口 (1,865 口)
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	188,600	10,014,660,000	貸付有価証券 2,807 口
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	15,899	7,933,601,000	貸付有価証券 1,935 口
	平和不動産リート投資法人 投資証券	29,284	4,395,528,400	貸付有価証券 1,462 口
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	28,892	8,517,361,600	貸付有価証券 151 口
	福岡リート投資法人 投資証券	22,161	3,636,620,100	貸付有価証券 472 口
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	24,933	7,816,495,500	貸付有価証券 34 口
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	35,111	2,991,457,200	貸付有価証券 635 口

		大和証券オフィス投資法人 投資証券	8,877	5,450,478,000	貸付有価証券 141口
		阪急阪神リート投資法人 投資証券	19,355	2,729,055,000	貸付有価証券 32口
		スタートプロシード投資法人 投資証券	7,427	1,711,180,800	貸付有価証券 103口
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	64,590	18,175,626,000	貸付有価証券 594口
		ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	138,182	10,944,014,400	貸付有価証券 570口
		大和証券リング投資法人 投資証券	59,378	6,490,015,400	貸付有価証券 84口
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	39,308	4,815,230,000	貸付有価証券 1,485口
	小計	銘柄数：61 組入時価比率：98.2%	2,558,243	438,388,890,200 100.0%	
	合計			438,388,890,200	

(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。