



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

2023年9月20日
 September 20, 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10月30日
 分配金支払開始日 2023年9月15日
 Scheduled date of submission of securities report: October 30, 2023
 Date of commencing dividend payment: September 15, 2023

I ファンドの運用状況

Fund Management

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

Management Status for Period ended August 2023 (from February 11, 2023 to August 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8月期 FY ended Aug. 2023	477,100	(98.3)	8,125	(1.7)	485,226	(100.0)
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	438,388	(98.2)	7,835	(1.8)	446,224	(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8月期 FY ended Aug. 2023	228,685	20,944	9,314	240,314
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	221,060	25,256	17,630	228,685

(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8月期 FY ended Aug. 2023	537,022	51,796	485,226	201,913
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	461,080	14,855	446,224	195,126

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2023年8月期 FY ended Aug. 2023	1,830
2023年2月期 FY ended Feb. 2023	1,790

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 (2023年2月10日現在) Prior period As of February 10, 2023	当期 (2023年8月10日現在) Present period As of August 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	13,404,800,254	49,942,173,695
投資証券 Investment securities	438,388,890,200	477,100,983,400
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	-	150,360,650
未収入金 Accounts receivable - other	4,089,542,347	4,865,442,307
未収配当金 Accrued dividends receivable	4,269,658,762	4,465,890,781
未収利息 Accrued interest	171,006	914,138
その他未収収益 Other accrued revenue	43,103,764	127,100,970
差入委託証拠金 Margin deposits	884,614,400	369,795,500
流動資産合計 Total current assets	461,080,780,733	537,022,661,441
資産合計 Total assets	461,080,780,733	537,022,661,441
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	-
未払金 Accounts payable - other	-	368,013,450
未払収益分配金 Unpaid dividends	4,093,465,742	4,397,760,547
未払受託者報酬 Trustee fees payable	39,078,408	41,631,395
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	162,633,409	173,120,138
未払利息 Accrued interest expenses	12,358	89,649
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities	10,061,925,720	46,699,770,074

lent		
その他未払費用 Other accrued expenses	66,116,340	115,718,270
流動負債合計 Total current liabilities	14,855,934,057	51,796,103,523
負債合計 Total liabilities	14,855,934,057	51,796,103,523
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	269,391,209,186	283,090,815,552
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	176,833,637,490	202,135,742,366
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	13,360,523	17,107,749
元本等合計 Total principal and other	446,224,846,676	485,226,557,918
純資産合計 Total net assets	446,224,846,676	485,226,557,918
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	461,080,780,733	537,022,661,441

(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8月11日 至 2023年2月10日 Prior period From August 11, 2022 to February 10, 2023	当期 自 2023年2月11日 至 2023年8月10日 Present period From February 11, 2023 to August 10, 2023
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	8,736,224,722	9,356,589,484
受取利息 Interest income	-	3,079
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△42,913,508,915	15,607,202,216
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	△647,659,520	424,313,290
その他収益 Other revenue	86,623,971	185,284,904
営業収益合計 Total operating revenue	△34,738,319,742	25,573,392,973
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	58,913	908,927

受託者報酬 Trustee fees	79,235,133	79,745,619
委託者報酬 Investment trust management fees	329,753,053	331,679,371
その他費用 Other expenses	74,764,943	73,880,008
営業費用合計 Total operating expenses	483,812,042	486,213,925
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	△35,222,131,784	25,087,179,048
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	△35,222,131,784	25,087,179,048
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	△35,222,131,784	25,087,179,048
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	215,111,290,789	176,833,637,490
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	21,611,857,782	16,695,347,060
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	21,611,857,782	16,695,347,060
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	16,327,329,286	7,428,504,916
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	16,327,329,286	7,428,504,916
分配金 Dividends	8,340,050,011	9,051,916,316
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	176,833,637,490	202,135,742,366

(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。</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、2023年2月11日から2023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 2023年2月10日現在	当期 2023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 228,685,237 口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 240,314,784 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 1,951.26 円 (100口当たり純資産額) (195,126 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 2,019.13 円 (100口当たり純資産額) (201,913 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	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 44,783,926,000 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年8月11日 至 2023年2月10日	当期 自 2023年2月11日 至 2023年8月10日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2022年8月11日から2022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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">4,486,080,446 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: center;">B</td><td style="text-align: right;">14,373,883 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td style="text-align: center;">C=A+B</td><td style="text-align: right;">4,500,454,329 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">245,134,915 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td style="text-align: center;">E=C-D</td><td style="text-align: right;">4,255,319,414 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">4,246,584,269 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td style="text-align: center;">G=E-F</td><td style="text-align: right;">8,735,145 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">225,882,142 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">1,880 円</td></tr> </tbody> </table> 2022年11月11日から2023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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">4,336,709,334 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: center;">B</td><td style="text-align: right;">8,735,145 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td style="text-align: center;">C=A+B</td><td style="text-align: right;">4,345,444,479 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">238,618,214 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td style="text-align: center;">E=C-D</td><td style="text-align: right;">4,106,826,265 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">4,093,465,742 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td style="text-align: center;">G=E-F</td><td style="text-align: right;">13,360,523 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">228,685,237 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">1,790 円</td></tr> </tbody> </table>	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	1. 分配金の計算過程 2023年2月11日から2023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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">4,885,145,558 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: center;">B</td><td style="text-align: right;">13,360,523 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td style="text-align: center;">C=A+B</td><td style="text-align: right;">4,898,506,081 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">232,190,597 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td style="text-align: center;">E=C-D</td><td style="text-align: right;">4,666,315,484 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">4,654,155,769 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td style="text-align: center;">G=E-F</td><td style="text-align: right;">12,159,715 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">237,456,927 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">1,960 円</td></tr> </tbody> </table> 2023年5月11日から2023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 style="text-align: center;">A</td><td style="text-align: right;">4,655,822,982 円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: center;">B</td><td style="text-align: right;">12,159,715 円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td style="text-align: center;">C=A+B</td><td style="text-align: right;">4,667,982,697 円</td></tr> <tr><td>経費</td><td style="text-align: center;">D</td><td style="text-align: right;">253,114,401 円</td></tr> <tr><td>収益分配可能額</td><td style="text-align: center;">E=C-D</td><td style="text-align: right;">4,414,868,296 円</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: center;">F</td><td style="text-align: right;">4,397,760,547 円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td style="text-align: center;">G=E-F</td><td style="text-align: right;">17,107,749 円</td></tr> <tr><td>口数</td><td style="text-align: center;">H</td><td style="text-align: right;">240,314,784 口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金</td><td style="text-align: center;">I=F/H×100</td><td style="text-align: right;">1,830 円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,885,145,558 円	分配準備積立金	B	13,360,523 円	配当等収益合計額	C=A+B	4,898,506,081 円	経費	D	232,190,597 円	収益分配可能額	E=C-D	4,666,315,484 円	収益分配金	F	4,654,155,769 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	12,159,715 円	口数	H	237,456,927 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,960 円	項目			当期配当等収益額	A	4,655,822,982 円	分配準備積立金	B	12,159,715 円	配当等収益合計額	C=A+B	4,667,982,697 円	経費	D	253,114,401 円	収益分配可能額	E=C-D	4,414,868,296 円	収益分配金	F	4,397,760,547 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	17,107,749 円	口数	H	240,314,784 口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,830 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																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	4,885,145,558 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	13,360,523 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,898,506,081 円																																																																																																																							
経費	D	232,190,597 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	4,666,315,484 円																																																																																																																							
収益分配金	F	4,654,155,769 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	12,159,715 円																																																																																																																							
口数	H	237,456,927 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,960 円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	4,655,822,982 円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	12,159,715 円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	4,667,982,697 円																																																																																																																							
経費	D	253,114,401 円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	4,414,868,296 円																																																																																																																							
収益分配金	F	4,397,760,547 円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	17,107,749 円																																																																																																																							
口数	H	240,314,784 口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,830 円																																																																																																																							
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。	2. その他費用 その他費用のうち49,878,986円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																																																																																								

(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8月11日	当期 自 2023年2月11日

至 2023年 2月 10日	至 2023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 2023年 2月 10日現在	当期 2023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 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日	当期 自 2023年 2月 11日 至 2023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 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日		当期 自 2023年 2月 11日 至 2023年 8月 10日	
期首元本額	260,408,738,900円	期首元本額	269,391,209,186円
期中追加設定元本額	29,751,685,800円	期中追加設定元本額	24,672,149,800円
期中一部交換元本額	20,769,215,514円	期中一部交換元本額	10,972,543,434円

2 有価証券関係
 売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年 8月 11日 至 2023年 2月 10日	当期 自 2023年 2月 11日 至 2023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	△27,955,186,292	5,314,634,837
合計	△27,955,186,292	5,314,634,837

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(2023年 2月 10日現在)				当期(2023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	8,197,798,400	—	7,765,568,000	△432,702,080	7,872,830,500	—	8,023,662,500	150,360,650
合計	8,197,798,400	—	7,765,568,000	△432,702,080	7,872,830,500	—	8,023,662,500	150,360,650

(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 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(2023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	9,089	1,050,688,400	貸付有価証券 2,274口 (72口)
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	14,324	1,366,509,600	貸付有価証券 77口
		S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	22,309	2,860,013,800	貸付有価証券 438口 (314口)
		東海道リート投資法人 投資証券	6,654	797,814,600	貸付有価証券 10口

日本アコモデーションファンド 投資法人 投資証券	15,439	9,927,277,000	貸付有価証券 278口 (265口)
森ヒルズリート投資法人 投資 証券	52,579	7,618,697,100	貸付有価証券 716口
産業ファンド投資法人 投資証 券	68,222	9,858,079,000	貸付有価証券 2,576口 (394口)
アドバンス・レジデンス投資法 人 投資証券	42,471	14,270,256,000	貸付有価証券 2,642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	32,825	7,241,195,000	貸付有価証券 235口
アクティビア・プロパティーズ 投資法人 投資証券	23,457	9,617,370,000	貸付有価証券 299口
G L P投資法人 投資証券	151,036	20,797,657,200	貸付有価証券 186口
コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 投資証券	21,410	7,129,530,000	貸付有価証券 8,845口 (479口)
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	77,892	22,588,680,000	貸付有価証券 4,352口
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	8,249	5,287,609,000	貸付有価証券 448口 (136口)
O n eリート投資法人 投資証 券	7,799	2,009,802,300	貸付有価証券 38口
イオンリート投資法人 投資証 券	54,847	8,150,264,200	貸付有価証券 6,378口
ヒューリックリート投資法人 投資証券	41,834	6,973,727,800	貸付有価証券 52口
日本リート投資法人 投資証券	14,523	4,966,866,000	貸付有価証券 1,923口 (103口)
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	134,359	11,366,771,400	貸付有価証券 4,843口
トーセイ・リート投資法人 投 資証券	9,415	1,272,908,000	貸付有価証券 39口
ケネディクス商業リート投資法 人 投資証券	19,438	5,469,853,200	貸付有価証券 1,194口 (1,194口)
ヘルスケア&メディカル投資法 人 投資証券	11,024	1,629,347,200	貸付有価証券 1,011口 (1,010口)
サムティ・レジデンシャル投資 法人 投資証券	12,183	1,379,115,600	貸付有価証券 2,090口 (165口)
野村不動産マスターファンド投 資法人 投資証券	144,592	24,898,742,400	貸付有価証券 182口
いちごホテルリート投資法人 投資証券	7,407	822,177,000	貸付有価証券 362口
ラサールロジポート投資法人 投資証券	57,156	8,516,244,000	貸付有価証券 40口
スターアジア不動産投資法人 投資証券	55,827	3,187,721,700	貸付有価証券 35,464口 (836口)
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	6,892	887,000,400	

三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	18,597	9,177,619,500	貸付有価証券 10,164口 (104口)
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	6,837	441,670,200	貸付有価証券 14口
投資法人みらい 投資証券	57,181	2,664,634,600	貸付有価証券 5,426口
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	15,439	6,121,563,500	貸付有価証券 711口 (338口)
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	19,249	3,303,128,400	貸付有価証券 687口
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	7,253	858,029,900	貸付有価証券 30口
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	21,200	2,071,240,000	貸付有価証券 697口
アドバンス・ロジスティクス投資法人	19,592	2,564,592,800	貸付有価証券 1,058口
日本ビルファンド投資法人 投資証券	52,161	32,079,015,000	貸付有価証券 21,125口 (4,622口)
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	45,929	26,868,465,000	貸付有価証券 3,235口 (2,390口)
日本都市ファンド投資法人 投資証券	214,322	21,496,496,600	貸付有価証券 1,216口
オリックス不動産投資法人 投資証券	89,090	16,499,468,000	貸付有価証券 106口
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	30,579	11,115,466,500	貸付有価証券 4,009口 (608口)
N T T都市開発リート投資法人	42,981	5,879,800,800	貸付有価証券 658口 (122口)
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	29,978	5,575,908,000	貸付有価証券 4,787口 (62口)
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	33,016	3,869,475,200	貸付有価証券 470口
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	100,020	15,543,108,000	貸付有価証券 129口
森トラストリート投資法人 投資証券	86,185	6,377,690,000	貸付有価証券 848口 (725口)
インヴィンシブル投資法人 投資証券	216,484	12,989,040,000	貸付有価証券 58,485口
フロンティア不動産投資法人 投資証券	16,590	7,730,940,000	貸付有価証券 3,423口 (133口)
平和不動産リート投資法人 投資証券	33,407	4,747,134,700	貸付有価証券 4,144口
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	28,641	8,620,941,000	貸付有価証券 1,010口 (250口)
福岡リート投資法人 投資証券	23,125	3,806,375,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	26,017	8,832,771,500	貸付有価証券 4,109口 (2,355口)
いちごオフィスリート投資法人	36,638	3,260,782,000	貸付有価証券

		投資証券			5,636口(369口)
		大和証券オフィス投資法人 投資証券	9,263	6,058,002,000	貸付有価証券 19口
		阪急阪神リート投資法人 投資証券	21,318	3,003,706,200	貸付有価証券 482口
		スターツプロシード投資法人 投資証券	7,750	1,680,200,000	貸付有価証券 42口
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	67,399	19,006,518,000	貸付有価証券 242口
		ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	144,191	10,900,839,600	貸付有価証券 4,215口(1,619口)
		大和証券リング投資法人 投資証券	62,033	6,811,223,400	貸付有価証券 92口(13口)
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	38,859	5,203,220,100	貸付有価証券 11,162口(1,906口)
	小計	銘柄数：60 組入時価比率：98.3%	2,744,576	477,100,983,400	100.0%
	合計			477,100,983,400	

(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。