



2018年8月期 (2018年2月11日～2018年8月10日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Period ended August 2018 (February 11, 2018 - August 10, 2018)

2018年9月19日
 September 19, 2018

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 執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

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: Kunio Watanabe, President & CEO
 Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2018年10月31日
 分配金支払開始日 2018年9月18日
 Scheduled date of submission of securities report: October 31, 2018
 Date of commencing dividend payment: September 18, 2018

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2018年8月期の運用状況 (2018年2月11日～2018年8月10日)

Management Status for Period ended August 2018 (from February 11, 2018 to August 10, 2018)

(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.	%
2018年8月期 FY ended Aug. 2018	287,573	(97.4)	7,814	(2.6)	295,388	(100.0)
2018年2月期 FY ended Feb. 2018	275,971	(97.4)	7,509	(2.6)	283,481	(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
2018年8月期 FY ended Aug. 2018	160,583	10,591	12,098	159,075
2018年2月期 FY ended Feb. 2018	136,665	29,367	5,449	160,583

(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
2018年8月期 FY ended Aug. 2018	320,147	24,759	295,388	185,690
2018年2月期 FY ended Feb. 2018	316,943	33,462	283,481	176,532

(4) 分配金

Dividend Payment

	100口当り分配金 Dividend per 100 units
	円 JPY
2018年8月期 FY ended Aug. 2018	1,570
2018年2月期 FY ended Feb. 2018	1,730

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 (2018年2月10日現在) Prior period As of February 10, 2018	当期 (2018年8月10日現在) Present period As of August 10, 2018
	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	35,266,507,213	27,412,352,947
投資証券 Investment securities	275,971,873,500	287,573,903,670
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	42,745,380	72,644,960
未収入金 Accounts receivable - other	2,802,853,100	2,497,549,723
未収配当金 Accrued dividend receivable	2,578,504,975	2,282,691,278
未収利息 Accrued interest	825,975	741,758
その他未収収益 Other accrued revenue	280,227,816	236,740,380
差入委託証拠金 Customers' margin	-	71,058,700
流動資産合計 Total current assets	316,943,537,959	320,147,683,416
資産合計 Total assets	316,943,537,959	320,147,683,416
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Derivative evaluation account	38,694,480	20,987,500
前受金 Advances received	13,589,600	-
未払収益分配金 Unpaid dividends	2,778,092,698	2,497,491,834
未払受託者報酬 Trustee fee payable	41,400,855	43,790,795
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	217,845,964	232,168,639
未払利息 Accrued interest expenses	71,962	37,273
有価証券貸借取引受入金 Cash received on debt credit transaction	30,333,726,779	21,890,440,425

of securities		
その他未払費用 Other accrued expenses	38,739,689	74,086,092
流動負債合計 Total current liabilities	33,462,162,027	24,759,002,558
負債合計 Total liabilities	33,462,162,027	24,759,002,558
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	189,167,236,954	187,391,425,514
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	94,314,138,978	107,997,255,344
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	2,672,489	15,906,624
元本等合計 Total principal and other	283,481,375,932	295,388,680,858
純資産合計 Total net assets	283,481,375,932	295,388,680,858
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	316,943,537,959	320,147,683,416

(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 2017年8月11日 至 2018年2月10日 Prior period From August 11, 2017 to February 10, 2018	当期 自 2018年2月11日 至 2018年8月10日 Present period From February 11, 2018 to August 10, 2018
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	4,902,141,657	5,060,024,617
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△3,181,543,056	14,350,316,988
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	26,302,716	476,220,084
その他収益 Other revenue	644,777,199	634,221,031
営業収益合計 Total operating revenue	2,391,678,516	20,520,782,720
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△8,006,056	△3,818,249
受託者報酬 Trustee fee	78,428,156	86,151,236

委託者報酬 Investment trust management fee	412,629,402	455,405,253
その他費用 Other expenses	43,777,166	53,416,247
営業費用合計 Total operating expenses	526,828,668	591,154,487
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	1,864,849,848	19,929,628,233
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	1,864,849,848	19,929,628,233
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	1,864,849,848	19,929,628,233
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	83,267,748,882	94,314,138,978
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	17,621,299,769	7,047,087,599
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	17,621,299,769	7,047,087,599
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	3,413,232,450	8,203,742,440
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	3,413,232,450	8,203,742,440
分配金 Dividends	5,026,527,071	5,089,857,026
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	94,314,138,978	107,997,255,344

(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、2018年2月11日から2018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 2018年2月10日現在	当期 2018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 160,583,393口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 159,075,913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 1,765.32円 (100口当たり純資産額) (176,532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 1,856.90円 (100口当たり純資産額) (185,690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 28,893,835,400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 20,757,981,410円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2017年8月11日 至 2018年2月10日	当期 自 2018年2月11日 至 2018年8月10日																																																																																																																								
1. 分配金の計算過程 2017年8月11日から2017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;">2,497,072,787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;">9,109,372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;">2,506,182,159円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">252,603,340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;">2,253,578,819円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">2,248,434,373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;">5,144,446円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">142,305,973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;">1,580円</td> </tr> </tbody> </table> 2017年11月11日から2018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;">3,057,852,125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;">5,144,446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;">3,062,996,571円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">282,231,384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;">2,780,765,187円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">2,778,092,698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;">2,672,489円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">160,583,393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;">1,730円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,497,072,787円	分配準備積立金	B	9,109,372円	配当等収益合計額	C=A+B	2,506,182,159円	経費	D	252,603,340円	収益分配可能額	E=C-D	2,253,578,819円	収益分配金	F	2,248,434,373円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,144,446円	口数	H	142,305,973口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,580円	項目			当期配当等収益額	A	3,057,852,125円	分配準備積立金	B	5,144,446円	配当等収益合計額	C=A+B	3,062,996,571円	経費	D	282,231,384円	収益分配可能額	E=C-D	2,780,765,187円	収益分配金	F	2,778,092,698円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,672,489円	口数	H	160,583,393口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,730円	1. 分配金の計算過程 2018年2月11日から2018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;">2,885,438,090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;">2,672,489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;">2,888,110,579円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">294,091,391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;">2,594,019,188円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">2,592,365,192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;">1,653,996円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">163,041,836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;">1,590円</td> </tr> </tbody> </table> 2018年5月11日から2018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;">2,812,625,807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;">1,653,996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;">2,814,279,803円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">300,881,345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;">2,513,398,458円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">2,497,491,834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;">15,906,624円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">159,075,913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;">1,570円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,885,438,090円	分配準備積立金	B	2,672,489円	配当等収益合計額	C=A+B	2,888,110,579円	経費	D	294,091,391円	収益分配可能額	E=C-D	2,594,019,188円	収益分配金	F	2,592,365,192円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,653,996円	口数	H	163,041,836口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590円	項目			当期配当等収益額	A	2,812,625,807円	分配準備積立金	B	1,653,996円	配当等収益合計額	C=A+B	2,814,279,803円	経費	D	300,881,345円	収益分配可能額	E=C-D	2,513,398,458円	収益分配金	F	2,497,491,834円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	15,906,624円	口数	H	159,075,913口	100口当たり分配金	I=F/H×100	1,570円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	2,497,072,787円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	9,109,372円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	2,506,182,159円																																																																																																																							
経費	D	252,603,340円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2,253,578,819円																																																																																																																							
収益分配金	F	2,248,434,373円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,144,446円																																																																																																																							
口数	H	142,305,973口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,580円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	3,057,852,125円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	5,144,446円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	3,062,996,571円																																																																																																																							
経費	D	282,231,384円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2,780,765,187円																																																																																																																							
収益分配金	F	2,778,092,698円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,672,489円																																																																																																																							
口数	H	160,583,393口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,730円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	2,885,438,090円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	2,672,489円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	2,888,110,579円																																																																																																																							
経費	D	294,091,391円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2,594,019,188円																																																																																																																							
収益分配金	F	2,592,365,192円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,653,996円																																																																																																																							
口数	H	163,041,836口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,590円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	2,812,625,807円																																																																																																																							
分配準備積立金	B	1,653,996円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	2,814,279,803円																																																																																																																							
経費	D	300,881,345円																																																																																																																							
収益分配可能額	E=C-D	2,513,398,458円																																																																																																																							
収益分配金	F	2,497,491,834円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	15,906,624円																																																																																																																							
口数	H	159,075,913口																																																																																																																							
100口当たり分配金	I=F/H×100	1,570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 2017年8月11日 至 2018年2月10日	当期 自 2018年2月11日 至 2018年8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

<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。</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 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 2018年2月10日現在	当期 2018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 2017年8月11日 至 2018年2月10日	当期 自 2018年2月11日 至 2018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 2017年8月11日 至 2018年2月10日	当期 自 2018年2月11日 至 2018年8月10日
期首元本額 160,992,245,254 円	期首元本額 189,167,236,954 円
期中追加設定元本額 34,594,679,400 円	期中追加設定元本額 12,476,669,200 円

期中一部交換元本額 6,419,687,700円 期中一部交換元本額 14,252,480,640円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2017年8月11日 至 2018年2月10日	当期 自 2018年2月11日 至 2018年8月10日
	損益に含まれた評価差額 (円)	
投資証券	7,938,762,665	1,873,004,789
合計	7,938,762,665	1,873,004,789

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(2018年2月10日現在)				当期(2018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	7,473,022,900	—	7,477,562,500	4,050,900	7,738,578,700	—	7,790,720,000	51,657,460
合計	7,473,022,900	—	7,477,562,500	4,050,900	7,738,578,700	—	7,790,720,000	51,657,460

(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(2018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(2018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	日本アコモデーションファンド 投資法人 投資証券	11,342	5,909,182,000	貸付有価証券 981口 (432口)
		MCUBS MidCity投資 法人 投資証券	38,462	2,973,112,600	貸付有価証券 2,815口 (1,449口)
		森ヒルズリート投資法人 投資 証券	39,145	5,507,701,500	貸付有価証券 6,044口 (2,235口)
		産業ファンド投資法人 投資証 券	39,766	4,716,247,600	貸付有価証券 2,208口 (1,421口)
		アドバンス・レジデンス投資法 人 投資証券	33,264	9,463,608,000	貸付有価証券 2,330口 (1,205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	20,249	3,377,533,200	貸付有価証券 2,275口 (660口)

券			
アクティビア・プロパティーズ 投資法人 投資証券	16,355	8,063,015,000	貸付有価証券 901口(589口)
GLP投資法人 投資証券	75,458	8,919,135,600	貸付有価証券 4,027口(2,680口)
コンフォリア・レジデンシャル 投資法人 投資証券	13,017	3,379,213,200	貸付有価証券 750口(475口)
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	45,782	10,140,713,000	貸付有価証券 2,076口(1,638口)
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	5,193	2,949,624,000	貸付有価証券 316口(197口)
Oneリート投資法人 投資証 券	3,965	1,018,212,000	貸付有価証券 287口(142口)
イオンリート投資法人 投資証 券	35,035	4,193,689,500	貸付有価証券 2,049口(1,236口)
ヒューリックリート投資法人 投資証券	24,615	4,155,012,000	貸付有価証券 1,288口(884口)
日本リート投資法人 投資証券	11,018	3,784,683,000	貸付有価証券 643口(441口)
インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人 投資証券	202,323	3,204,796,320	貸付有価証券 11,884口(7,558 口)
日本ヘルスケア投資法人 投資 証券	1,563	268,679,700	貸付有価証券 463口(71口)
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	88,063	6,243,666,700	貸付有価証券 5,008口(3,189口)
トーセイ・リート投資法人 投 資証券	5,487	620,031,000	貸付有価証券 365口(209口)
ケネディクス商業リート投資法 人 投資証券	12,510	2,989,890,000	貸付有価証券 702口(473口)
ヘルスケア&メディカル投資法 人 投資証券	4,520	505,788,000	貸付有価証券 888口(287口)
サムティ・レジデンシャル投資 法人 投資証券	6,188	582,290,800	貸付有価証券 410口(226口)
野村不動産マスターファンド投 資法人 投資証券	101,164	15,670,303,600	貸付有価証券 5,786口(3,737口)
いちごホテルリート投資法人 投資証券	5,968	831,342,400	貸付有価証券 678口(267口)
ラサールロジポート投資法人 投資証券	25,749	2,806,641,000	貸付有価証券 1,594口(982口)
スターアジア不動産投資法人 投資証券	9,277	1,001,916,000	貸付有価証券 607口(304口)
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	2,935	333,122,500	貸付有価証券 376口(138口)
三井不動産ロジスティクスパー ク投資法人 投資証券	5,827	1,896,688,500	貸付有価証券 546口(332口)
大江戸温泉リート投資法人 投 資証券	5,509	477,079,400	貸付有価証券 408口(218口)
さくら総合リート投資法人 投	7,385	674,250,500	貸付有価証券

資証券			828口 (277口)
投資法人みらい 投資証券	7,940	1,526,862,000	貸付有価証券 875口 (165口)
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	8,008	1,190,789,600	貸付有価証券 429口 (282口)
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	3,164	848,901,200	貸付有価証券 553口 (329口)
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,417	376,553,400	貸付有価証券 776口 (129口)
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	3,148	357,927,600	貸付有価証券 193口 (118口)
日本ビルファンド投資法人 投資証券	33,052	20,558,344,000	貸付有価証券 2,956口 (1,261口)
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	34,131	19,761,849,000	貸付有価証券 3,385口 (1,231口)
日本リートファンド投資法人 投資証券	64,508	13,004,812,800	貸付有価証券 5,152口 (2,505口)
オリックス不動産投資法人 投資証券	68,006	11,812,642,200	貸付有価証券 4,075口 (2,513口)
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	21,606	8,642,400,000	貸付有価証券 1,258口 (822口)
プレミアム投資法人 投資証券	32,451	3,621,531,600	貸付有価証券 1,782口 (1,176口)
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	22,884	3,510,405,600	貸付有価証券 4,076口 (873口)
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	21,823	2,439,811,400	貸付有価証券 1,258口 (836口)
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	75,277	12,925,060,900	貸付有価証券 3,806口 (2,872口)
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	24,394	3,915,237,000	貸付有価証券 1,813口 (930口)
インヴィンシブル投資法人 投資証券	119,437	5,715,060,450	貸付有価証券 8,449口 (3,572口)
フロンティア不動産投資法人 投資証券	11,610	5,131,620,000	貸付有価証券 693口 (443口)
平和不動産リート投資法人 投資証券	21,255	2,280,661,500	貸付有価証券 1,796口 (811口)
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	22,792	4,902,559,200	貸付有価証券 1,529口 (867口)
福岡リート投資法人 投資証券	17,652	3,037,909,200	貸付有価証券 1,060口 (632口)
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	10,558	7,253,346,000	貸付有価証券 599口 (380口)
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	28,317	2,554,193,400	貸付有価証券 1,971口 (1,144口)
大和証券オフィス投資法人 投資証券	7,878	5,238,870,000	貸付有価証券 495口 (280口)
阪急リート投資法人 投資証券	14,159	1,952,526,100	貸付有価証券 785口 (533口)

小計	スタートプロシード投資法人 投資証券	5,378	896,512,600	貸付有価証券 382口 (205口)
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	42,733	11,452,444,000	貸付有価証券 2,842口 (1,495口)
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	98,827	8,153,227,500	貸付有価証券 5,679口 (3,759口)
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	38,390	3,432,066,000	貸付有価証券 4,385口 (1,465口)
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	30,564	4,422,610,800	貸付有価証券 1,793口 (1,166口)
	銘柄数：59 組入時価比率：97.4%	1,790,493	287,573,903,670	100.0%
合計		287,573,903,670		

(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証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。