

野村J-REITインデックス (野村SMA・EW向け)

運用報告書(全体版)

第9期(決算日2023年12月6日)

作成対象期間(2022年12月7日~2023年12月6日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/不動産投信/インデックス型	
信託期間	2015年3月12日以降、無期限とします。	
運用方針	J-REITインデックス マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主としてわが国の不動産投資信託証券(以下「J-REIT」といいます。)に実質的に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。	
主な投資対象	野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、J-REITに直接投資する場合があります。
	マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
主な投資制限	野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
	マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないません。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉営業日の午前9時~午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み配分	期騰落率	東証REIT指数(配当込み)	期騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
5期(2019年12月6日)	14,200	5	24.8	4,509.49	25.0	97.7	5,461
6期(2020年12月7日)	11,410	5	△19.6	3,624.83	△19.6	97.0	4,607
7期(2021年12月6日)	14,120	5	23.8	4,497.93	24.1	97.0	5,708
8期(2022年12月6日)	14,119	5	0.0	4,506.35	0.2	97.0	4,309
9期(2023年12月6日)	13,798	5	△2.2	4,412.32	△2.1	97.5	3,877

*基準価額の騰落率は分配込み。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

- ①東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。
- ②J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数（配当込み）に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行なうことができる。
- ③J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証REIT指数（配当込み）の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

○当期中の基準価額と市況等の推移

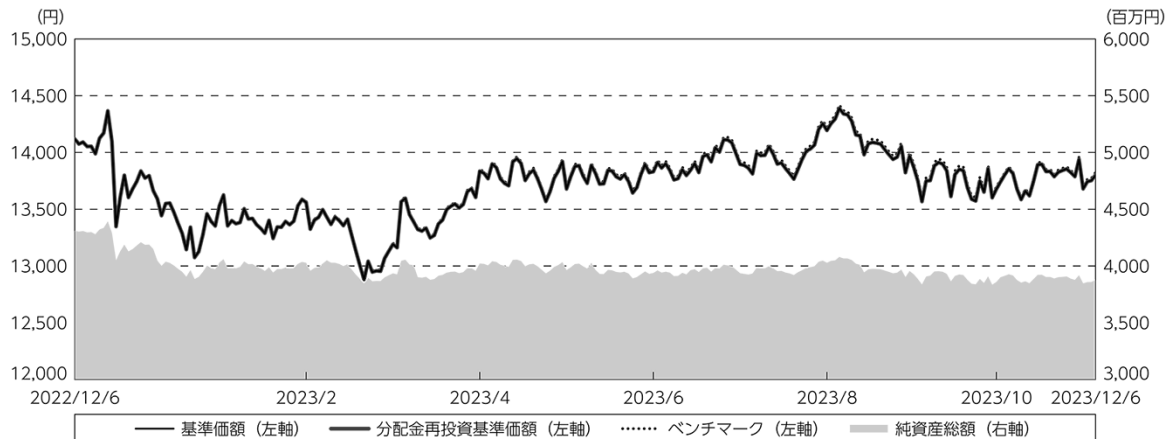
年 月 日	基 準 価 額	ベンチマーク		投 資 信 託 組 入 比 率	
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年12月6日	円 14,119	% -	東証REIT指数 (配当込み) 4,506.35	% -	% 97.0
12月末	13,795	△2.3	4,403.82	△2.3	96.1
2023年1月末	13,354	△5.4	4,263.06	△5.4	97.1
2月末	13,560	△4.0	4,331.37	△3.9	97.0
3月末	13,162	△6.8	4,204.73	△6.7	97.1
4月末	13,835	△2.0	4,420.34	△1.9	95.8
5月末	13,920	△1.4	4,448.91	△1.3	97.4
6月末	13,831	△2.0	4,421.28	△1.9	97.5
7月末	13,991	△0.9	4,472.88	△0.7	96.1
8月末	14,195	0.5	4,539.20	0.7	96.7
9月末	13,969	△1.1	4,468.30	△0.8	97.1
10月末	13,677	△3.1	4,372.14	△3.0	97.0
11月末	13,939	△1.3	4,455.46	△1.1	97.3
(期 末) 2023年12月6日	13,803	△2.2	4,412.32	△2.1	97.5

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：14,119円

期 末：13,798円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：△ 2.2% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2022年12月6日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。ベンチマークは、作成期首(2022年12月6日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

国内REITの価格の変動

○投資環境

国内REIT市場は、期首から2023年3月上旬にかけては、日銀が金融緩和策を修正したことで国内の長期金利が上昇し、REITの業績や不動産市況の先行きに対する警戒感が広がったことなどから下落しました。3月中旬には米金融機関の経営破綻を契機とした金融システム不安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどからさらに下落しました。4月中旬以降は植田日銀新総裁が就任会見で現状の大規模な金融緩和を継続する姿勢を示したことや、好調な米金融大手の決算を受け金融不安への過度な懸念が後退したことなどから上昇しました。9月以降は国内外の金利が上昇したことを受け不動産調達費用の増加による業績悪化懸念などから下落しました。その後は中東情勢の緊迫化などによる地政学的リスクや国内外の金利動向などを巡り一進一退の展開となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）]

主要投資対象である「J-REITインデックス マザーファンド」受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。

[J-REITインデックス マザーファンド]

・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数でほぼ同水準になるよう銘柄間の投資比率調整を行なってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

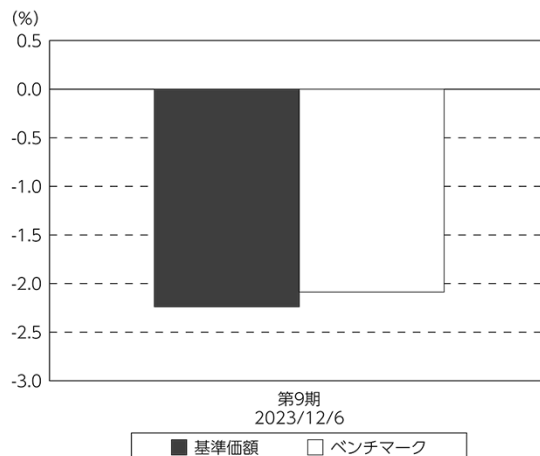
今期の基準価額の騰落率は-2.2%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の-2.1%を0.1ポイント下回りました。

【主な差異要因】

（マイナス要因）

ファンドでは信託報酬などのコスト負担が日々生じること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第9期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.036%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,941

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）]

主要投資対象である「J-REITインデックス マザーファンド」受益証券を高位に組み入れ、引き続き、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

[J-REITインデックス マザーファンド]

引き続き、REITの実質組入比率を高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2022年12月7日～2023年12月6日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	50	0.363	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(38)	(0.275)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(8)	(0.055)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(5)	(0.033)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	50	0.368	
期中の平均基準価額は、13,769円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

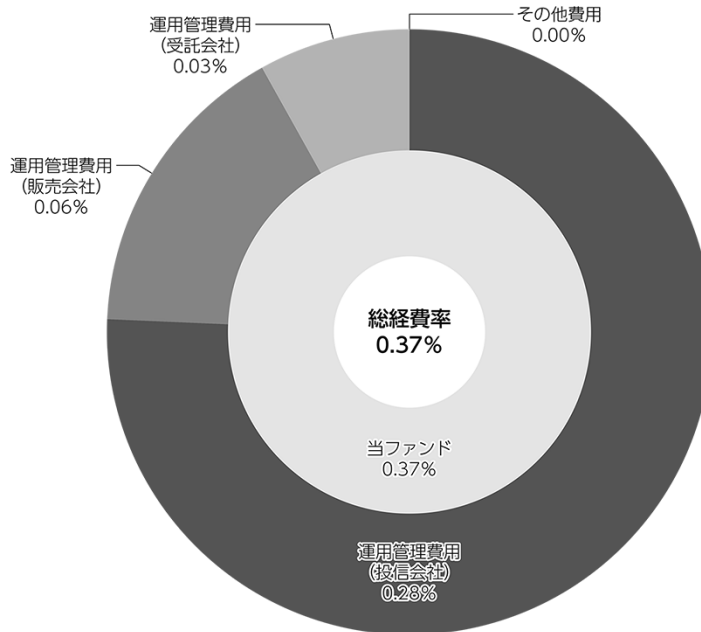
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.37%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年12月7日～2023年12月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
J-REITインデックス マザーファンド	千口 136,660	千円 356,781	千口 268,735	千円 702,616

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月7日～2023年12月6日)

利害関係人との取引状況

<野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）>
該当事項はございません。

<J-REITインデックス マザーファンド>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
投資信託証券	百万円 15,833	百万円 1,008	6.4	百万円 7,209	百万円 241	3.3
株式先物取引	6,168	1,296	21.0	6,201	—	—

平均保有割合 8.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当	期
売買委託手数料総額 (A)		72千円
うち利害関係人への支払額 (B)		5千円
(B) / (A)		8.1%

*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年12月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
J-REITインデックス マザーファンド	千口 1,601,533	千口 1,469,459	千円 3,877,168

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J-REITインデックス マザーファンド	千円 3,877,168	% 99.5
コール・ローン等、その他	19,270	0.5
投資信託財産総額	3,896,438	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年12月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,896,438,910
コール・ローン等	9,063,890
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	3,877,168,882
未収入金	10,206,138
(B) 負債	18,883,893
未払収益分配金	1,405,114
未払解約金	10,238,440
未払信託報酬	7,175,169
未払利息	4
その他未払費用	65,166
(C) 純資産総額(A-B)	3,877,555,017
元本	2,810,229,349
次期繰越損益金	1,067,325,668
(D) 受益権総口数	2,810,229,349口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,798円

(注) 期首元本額は3,052,469,848円、期中追加設定元本額は388,514,138円、期中一部解約元本額は630,754,637円、1口当たり純資産額は1.3798円です。

○損益の状況（2022年12月7日～2023年12月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,912
支払利息	△ 1,912
(B) 有価証券売買損益	△ 62,463,656
売買益	21,764,787
売買損	△ 84,228,443
(C) 信託報酬等	△ 14,577,906
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 77,043,474
(E) 前期繰越損益金	376,771,230
(F) 追加信託差損益金	769,003,026
(配当等相当額)	(1,034,127,063)
(売買損益相当額)	(△ 265,124,037)
(G) 計(D+E+F)	1,068,730,782
(H) 収益分配金	△ 1,405,114
次期繰越損益金(G+H)	1,067,325,668
追加信託差損益金	769,003,026
(配当等相当額)	(1,034,298,331)
(売買損益相当額)	(△ 265,295,305)
分配準備積立金	635,301,502
繰越損益金	△ 336,978,860

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2022年12月7日～2023年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	140,977,593円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,034,298,331円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	495,729,023円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,671,004,947円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	5,946円
g. 分配金	1,405,114円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	5円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日2023年6月12日）

作成対象期間（2022年6月11日～2023年6月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国のREIT（不動産投資信託証券）（「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	J-REITを主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	東証REIT指数 (配当込み)	期騰落		
	円	%			%	百万円
14期(2019年6月10日)	23,229	15.1	3,896.50	15.0	97.7	40,406
15期(2020年6月10日)	22,155	△4.6	3,713.86	△4.7	96.6	37,084
16期(2021年6月10日)	28,259	27.6	4,732.62	27.4	97.0	48,024
17期(2022年6月10日)	27,270	△3.5	4,567.19	△3.5	97.0	44,302
18期(2023年6月12日)	26,371	△3.3	4,415.85	△3.3	97.5	49,385

東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）に係る標準又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数（配当込み）に係る標準又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託 組入比率
	騰落	率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落	
(期首)	円	%			%
2022年6月10日	27,270	—	4,567.19	—	97.0
6月末	26,794	△1.7	4,487.40	△1.7	97.0
7月末	27,638	1.3	4,628.79	1.3	96.8
8月末	27,965	2.5	4,683.62	2.5	96.6
9月末	26,801	△1.7	4,488.86	△1.7	97.1
10月末	27,256	△0.1	4,564.72	△0.1	97.1
11月末	27,260	△0.0	4,565.38	△0.0	96.8
12月末	26,296	△3.6	4,403.82	△3.6	96.1
2023年1月末	25,461	△6.6	4,263.06	△6.7	97.1
2月末	25,860	△5.2	4,331.37	△5.2	97.0
3月末	25,108	△7.9	4,204.73	△7.9	97.1
4月末	26,396	△3.2	4,420.34	△3.2	95.9
5月末	26,567	△2.6	4,448.91	△2.6	97.5
(期末)					
2023年6月12日	26,371	△3.3	4,415.85	△3.3	97.5

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

国内REITの価格の変動

○投資環境

国内REIT市場は、期首から欧米諸国の金融引き締めによる世界景気低迷への懸念などから下落して始まりました。その後は国内株式市場が上昇したことや米国で過度な金融引き締め懸念が後退したことなどをを受けて上昇しました。2022年9月以降は国内外で金利が上昇したことや米国の金融引き締めによる景気減速への警戒感が高まったことなどから下落し、10月下旬以降は米長期金利の上昇が一服したことなどから上昇するなど、一進一退の展開となりました。

12月中旬以降は日銀が金融緩和策を修正したことで国内の長期金利が上昇し、REITの業績や不動産市況の先行きに対する警戒感が広がったことなどから下落しました。2023年3月中旬には米金融機関の経営破綻を契機とした金融システム不安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどからさらに下落しました。4月中旬以降は植田日銀新総裁が就任会見で現状の大規模な金融緩和を継続する姿勢を示したことや、好調な米金融大手の決算を受け金融不安への過度な懸念が後退したことなどから上昇しましたが、期を通じては下落となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・REIT組入比率

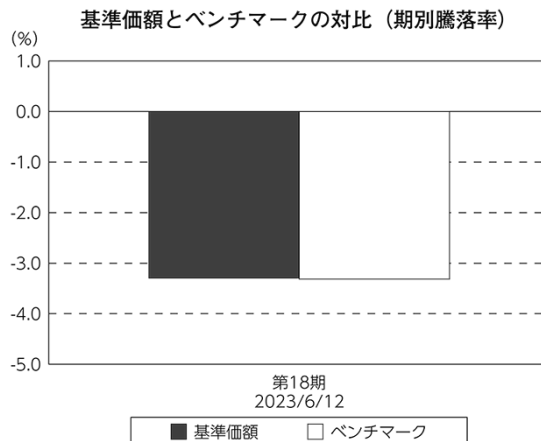
REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数でほぼ同水準になるよう銘柄間の投資比率調整を行なってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－3.3%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の－3.3%と同程度となりました。



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

◎今後の運用方針

引き続き、REITの実質組入比率を高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年6月11日～2023年6月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投 資 信 託 証 券)	0	0.002	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、26,616円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年6月11日～2023年6月12日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	261	30,211	111	12,701
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	404	36,549	166	14,937
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	719	99,500	246	34,083
	東海道リート投資法人 投資証券	542	65,035	78	9,258
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	431	272,336	189	119,954
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,459	222,923	634	97,447
	産業ファンド投資法人 投資証券	2,270	364,282	789	123,825
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,240	423,133	538	184,544
	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	966	202,385	383	80,496
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	655	265,608	304	123,859
	G L P 投資法人 投資証券	5,214	791,130	2,336	373,619
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	638	201,165	253	80,788
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,494	772,221	877	272,861
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	247	168,530	96	66,266
	One リート投資法人 投資証券	218	54,134	92	22,858
	内	イオンリート投資法人 投資証券	1,581	238,954	884
ヒューリックリート投資法人 投資証券		1,164	186,364	497	79,560
日本リート投資法人 投資証券		458	159,282	167	57,358
積水ハウス・リート投資法人 投資証券		3,692	285,315	1,702	131,853
トーセイ・リート投資法人 投資証券		320	42,907	115	15,319
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	669	173,749	227	58,193	

銘 柄		買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
国	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	308	53,355	129	22,356	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	444	53,357	133	15,578	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	4,018	644,920	1,749	280,192	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	205	21,251	89	9,313	
	ラサールレジポート投資法人 投資証券	1,517	245,585	659	106,091	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	2,356	132,983	648	36,056	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	321	41,463	76	9,884	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	494	242,266	212	103,850	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	199	13,024	86	5,617	
	投資法人みらい 投資証券	1,511	70,594	645	30,062	
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	193	25,621	89	11,760	
		(Δ 1,011)	(Δ 133,193)			
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	614	263,573	168	71,637	
	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	670	124,199	211	40,340	
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	204	24,081	87	10,187	
	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	869	85,652	241	23,562	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	710	100,610	227	32,316	
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,451	884,859	630	381,963	
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,357	782,280	540	313,347	
	日本都市ファンド投資法人 投資証券	6,269	643,790	2,730	282,490	
	オリックス不動産投資法人 投資証券	2,477	452,638	1,079	197,391	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	847	315,837	365	136,160	
	N T T都市開発リート投資法人	1,195	165,990	510	71,025	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	838	163,412	367	71,186	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	1,098	118,176	385	41,517	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	2,743	406,428	1,229	182,630	
	森トラストリート投資法人 投資証券	1,376	139,605	577	60,134	
		(4,939)	(133,193)			
	内	インヴィンシブル投資法人 投資証券	5,465	273,010	2,377	119,668
		フロンティア不動産投資法人 投資証券	541	276,697	202	101,877
		平和不動産リート投資法人 投資証券	943	143,529	360	55,222
		日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	843	262,681	370	115,023
福岡リート投資法人 投資証券		644	107,135	281	46,785	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券		588	229,391	318	146,938	
		(1,192)	(-)			
いちごオフィスリート投資法人 投資証券		1,017	88,654	442	38,345	
大和証券オフィス投資法人 投資証券		259	165,895	130	83,333	
阪急阪神リート投資法人 投資証券		559	82,298	243	36,006	
スターツプロシード投資法人 投資証券		280	65,084	90	21,392	
大和ハウスリート投資法人 投資証券		1,889	557,574	789	231,326	
		(Δ 20)	(Δ 6,025)			
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		4,582	338,283	1,696	126,904	
大和証券リビング投資法人 投資証券		1,845	211,895	740	85,059	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,143	143,427	499	62,941		
合 計	80,524	14,216,843	33,082	5,912,168		
	(5,100)	(Δ 6,025)				

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	REIT先物取引	百万円 5,932	百万円 5,955	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年6月11日～2023年6月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
			%			%
投資信託証券	百万円 14,216	百万円 2,233	15.7	百万円 5,912	百万円 824	13.9

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	836千円
うち利害関係人への支払額 (B)	21千円
(B) / (A)	2.5%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年6月12日現在)

国内投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	投資証券	779	929	108,693	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	投資証券	1,225	1,463	127,134	0.3
S O S i L A物流リート投資法人	投資証券	1,799	2,272	303,539	0.6
東海道リート投資法人	投資証券	296	760	91,808	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	1,335	1,577	1,042,397	2.1
森ヒルズリート投資法人	投資証券	4,547	5,372	801,502	1.6
産業ファンド投資法人	投資証券	5,489	6,970	1,094,290	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	3,866	4,568	1,630,776	3.3
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	2,767	3,350	701,490	1.4
アクティビア・プロバティーズ投資法人	投資証券	2,061	2,412	974,448	2.0
G L P投資法人	投資証券	12,523	15,401	2,271,647	4.6
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	投資証券	1,799	2,184	756,756	1.5
日本プロロジスリート投資法人	投資証券	6,326	7,943	2,414,672	4.9
星野リゾート・リート投資法人	投資証券	648	799	534,531	1.1
O n e リート投資法人	投資証券	671	797	194,547	0.4
イオンリート投資法人	投資証券	4,547	5,244	818,588	1.7
ヒューリックリート投資法人	投資証券	3,607	4,274	675,719	1.4
日本リート投資法人	投資証券	1,193	1,484	496,398	1.0
積水ハウス・リート投資法人	投資証券	11,737	13,727	1,091,296	2.2
トーセイ・リート投資法人	投資証券	808	1,013	132,196	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	投資証券	1,544	1,986	502,259	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人	投資証券	947	1,126	184,889	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人	投資証券	876	1,187	138,760	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	12,504	14,773	2,425,726	4.9
いちごホテルリート投資法人	投資証券	641	757	76,305	0.2
ラサールロジポート投資法人	投資証券	4,734	5,592	911,496	1.8
スターアジア不動産投資法人	投資証券	3,996	5,704	338,817	0.7
マリモ地方創生リート投資法人	投資証券	453	698	92,205	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	投資証券	1,523	1,805	916,940	1.9
大江戸温泉リート投資法人	投資証券	624	737	47,905	0.1
投資法人みらい	投資証券	4,684	5,550	255,855	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	投資証券	907	—	—	—
三菱地所物流リート投資法人	投資証券	1,123	1,569	666,040	1.3
C R Eロジスティクスファンド投資法人	投資証券	1,498	1,957	370,264	0.7
ザイマックス・リート投資法人	投資証券	624	741	82,176	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	投資証券	1,525	2,153	201,736	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	投資証券	1,508	1,991	273,762	0.6
日本ビルファンド投資法人	投資証券	4,508	5,329	2,994,898	6.1
ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	3,867	4,684	2,505,940	5.1
日本都市ファンド投資法人	投資証券	19,510	23,049	2,256,497	4.6
オリックス不動産投資法人	投資証券	7,704	9,102	1,632,898	3.3
日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	2,642	3,124	1,088,714	2.2
N T T都市開発リート投資法人	投資証券	3,706	4,391	584,442	1.2
東急リアル・エステート投資法人	投資証券	2,592	3,063	575,844	1.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	口	口	千円	%	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,649	3,362	363,768	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,705	10,219	1,492,995	3.0	
森トラストリート投資法人 投資証券	2,764	8,502	600,241	1.2	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,019	20,107	1,134,034	2.3	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,356	1,695	822,075	1.7	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,636	3,219	492,507	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,607	3,080	1,001,000	2.0	
福岡リート投資法人 投資証券	2,000	2,363	381,151	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,196	2,658	821,322	1.7	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,168	3,743	331,629	0.7	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	817	946	561,924	1.1	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,747	2,063	298,103	0.6	
スターツプロシード投資法人 投資証券	602	792	185,011	0.4	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,806	6,886	1,978,347	4.0	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,846	14,732	1,075,436	2.2	
大和証券リビング投資法人 投資証券	5,225	6,330	716,556	1.5	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,547	4,191	504,177	1.0	
合 計	口 数 ・ 金 額	225,953	278,495	48,147,088	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	60	< 97.5% >	

* 評価額の単位未満は切り捨て。

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 REIT先物取引	百万円 1,233	百万円 -
東証REIT指数		

* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年6月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	48,147,088	97.3
コール・ローン等、その他	1,354,933	2.7
投資信託財産総額	49,502,021	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月12日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	49,501,704,884	
コール・ローン等	920,490,783	
投資証券(評価額)	48,147,088,000	
未収入金	65,321,367	
未収配当金	306,066,734	
差入委託証拠金	62,738,000	
(B) 負債	115,798,629	
未払金	12,133,850	
未払解約金	103,663,661	
未払利息	1,118	
(C) 純資産総額(A-B)	49,385,906,255	
元本	18,727,673,927	
次期繰越損益金	30,658,232,328	
(D) 受益権総口数	18,727,673,927口	
1口当たり基準価額(C/D)	26,371円	

(注) 期首元本額は16,245,462,523円、期中追加設定元本額は5,950,038,201円、期中一部解約元本額は3,467,826,797円、1口当たり純資産額は2.6371円です。

○損益の状況 (2022年6月11日～2023年6月12日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	1,759,402,622	
受取配当金	1,758,292,788	
受取利息	168	
その他収益金	1,434,720	
支払利息	△ 325,054	
(B) 有価証券売買損益	△ 3,142,658,534	
売買益	527,702,939	
売買損	△ 3,670,361,473	
(C) 先物取引等取引損益	△ 49,045,260	
取引益	65,074,730	
取引損	△ 114,119,990	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,432,301,172	
(E) 前期繰越損益金	28,056,541,607	
(F) 追加信託差損益金	9,703,517,851	
(G) 解約差損益金	△ 5,669,525,958	
(H) 計(D+E+F+G)	30,658,232,328	
次期繰越損益金(H)	30,658,232,328	

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額	円
野村6資産均等バランス	3,366,280,477	
野村インデックスファンド・J-REIT	3,157,280,807	
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,285,247,728	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,735,257,078	
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,675,189,591	
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	1,503,551,948	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,174,779,438	
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,170,640,514	
野村DC運用戦略ファンド	963,970,892	
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	688,465,321	
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)REIT	298,939,016	
野村世界REITインデックスAコース(野村投資一任口座向け)	108,512,416	
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	101,639,000	
ノムラFof用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	97,494,581	
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	82,206,268	
野村世界6資産分散投信(2040)	41,810,199	
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	36,355,848	
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	26,189,529	
ネクストコア	24,890,710	
野村資産設計ファンド2035	23,072,046	
野村資産設計ファンド2030	22,004,725	

ファンド名	当期末 元本額	円
野村資産設計ファンド2025	18,925,784	
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	15,302,709	
野村資産設計ファンド2020	14,837,124	
野村資産設計ファンド2015	13,401,310	
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,888,966	
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	11,467,842	
オールウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用)	11,379,921	
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	10,581,520	
野村資産設計ファンド2045	6,418,980	
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,247,272	
野村資産設計ファンド2050	5,293,138	
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,356,488	
野村資産設計ファンド2060	3,757,423	
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,031,826	
インデックス・ブレンド(タイプIII)	2,448,869	
インデックス・ブレンド(タイプV)	1,956,548	
インデックス・ブレンド(タイプIV)	647,227	
野村Fof用・ターゲット・リターン・6資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	449,908	
インデックス・ブレンド(タイプI)	302,281	
インデックス・ブレンド(タイプII)	200,659	

○お知らせ

該当事項はございません。