

野村インデックスファンド・ J-REIT

愛称：Funds-i J-REIT

運用報告書(全体版)

第12期（決算日2022年9月6日）

作成対象期間（2021年9月7日～2022年9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	2010年11月26日から無期限です。	
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	野村インデックス ファンド・J-REIT	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	野村インデックス ファンド・J-REIT	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、利子・配当等収益等を中心として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す。	

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			ベンチマーク指数		投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み	期騰落	東証REIT配当	騰落		
	円	円	%		%	%	百万円
8期(2018年9月6日)	23,418	0	9.7	3,454.26	9.8	97.9	5,765
9期(2019年9月6日)	29,443	0	25.7	4,352.00	26.0	97.7	7,248
10期(2020年9月7日)	24,687	0	△16.2	3,652.57	△16.1	96.7	7,187
11期(2021年9月6日)	32,377	0	31.1	4,795.80	31.3	97.1	9,105
12期(2022年9月6日)	31,296	0	△3.3	4,651.68	△3.0	97.2	8,693

*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

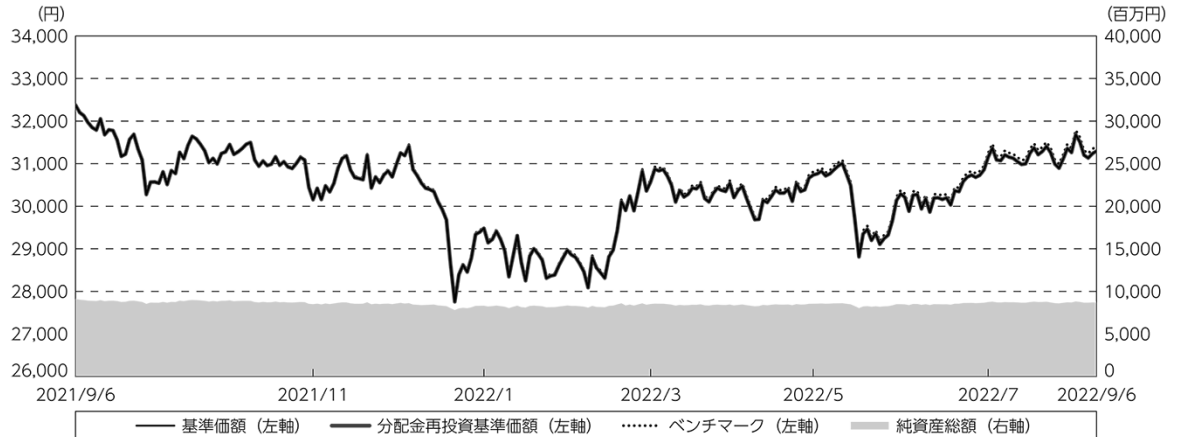
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク 東 証 R E I T 指 数 (配 当 込 み)	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年9月6日	円 32,377	% —	4,795.80	% —
9月末	31,088	△ 4.0	4,605.71	△ 4.0
10月末	31,449	△ 2.9	4,660.54	△ 2.8
11月末	30,155	△ 6.9	4,470.13	△ 6.8
12月末	31,191	△ 3.7	4,624.94	△ 3.6
2022年1月末	29,481	△ 8.9	4,372.24	△ 8.8
2月末	28,607	△ 11.6	4,243.65	△ 11.5
3月末	30,573	△ 5.6	4,536.64	△ 5.4
4月末	30,205	△ 6.7	4,483.12	△ 6.5
5月末	30,734	△ 5.1	4,563.32	△ 4.8
6月末	30,213	△ 6.7	4,487.40	△ 6.4
7月末	31,155	△ 3.8	4,628.79	△ 3.5
8月末	31,513	△ 2.7	4,683.62	△ 2.3
(期 末) 2022年9月6日	31,296	△ 3.3	4,651.68	△ 3.0

*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 : 32,377円

期 末 : 31,296円 (既払分配金(税込み) : 0円)

騰落率 : △ 3.3% (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(2021年9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(2021年9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、期首から中国の大手不動産会社の債務問題などを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり下落して始まりました。2021年10月以降は、米国REIT市場が上昇したことや、新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高いと思われるオミクロン株への懸念が高まったこと、その後オミクロン株の重症化リスクについての楽観的な見方が広がったことなどから、一進一退の展開となりました。

2022年1月以降は、米長期金利が上昇したことやロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて下落しました。3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しました。6月中旬には、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受けて上昇しました。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

[野村インデックスファンド・J-REIT]

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

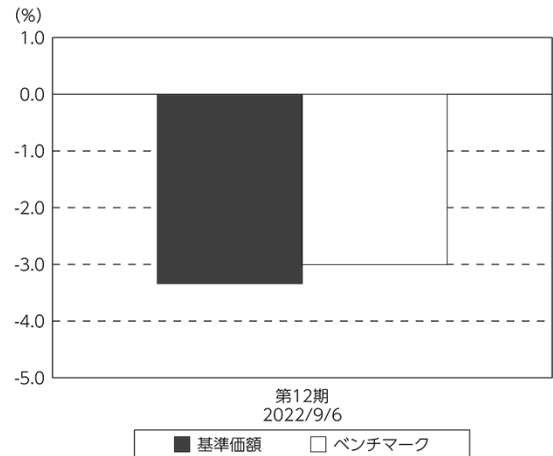
今期の基準価額の騰落率は-3.3%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の-3.0%を0.3ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

(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見送ら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12期
	2021年9月7日～ 2022年9月6日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	21,296

(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

[野村インデックスファンド・J-REIT]

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の組入比率をできるだけ高位に維持し、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

(2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 134	% 0.440	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(59)	(0.193)	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)	(59)	(0.192)	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)	(17)	(0.055)	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	1	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)	(1)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	1	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)	(1)	(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	136	0.445	
期中の平均基準価額は、30,530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。

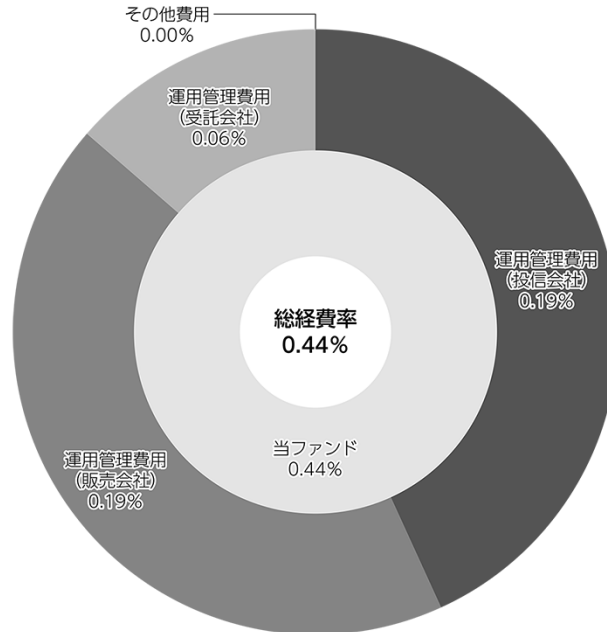
*売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

*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0.44%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、売買委託手数料及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) 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

(2021年9月7日～2022年9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 594,279	千円 1,579,329	千口 643,446	千円 1,745,048

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月7日～2022年9月6日)

利害関係人との取引状況

<野村インデックスファンド・J-REIT>

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 11,906	百万円 1,865	15.7	百万円 8,609	百万円 1,928	22.4

平均保有割合 19.0%

※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)	180千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.8%

*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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2022年9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 3,178,864	千口 3,129,697	千円 8,692,421

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年9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 8,692,421	% 99.4
コール・ローン等、その他	53,233	0.6
投資信託財産総額	8,745,654	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 (2022年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,745,654,860
コール・ローン等	31,445,786
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	8,692,421,444
未収入金	21,787,630
(B) 負債	52,366,597
未払解約金	33,519,331
未払信託報酬	18,706,993
未払利息	32
その他未払費用	140,241
(C) 純資産総額(A-B)	8,693,288,263
元本	2,777,737,847
次期繰越損益金	5,915,550,416
(D) 受益権総口数	2,777,737,847口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,296円

(注) 期首元本額は2,812,256,873円、期中追加設定元本額は1,085,646,147円、期中一部解約元本額は1,120,165,173円、1口当たり純資産額は3.1296円です。

○損益の状況 (2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,657
支払利息	△ 4,657
(B) 有価証券売買損益	△ 79,827,675
売買益	145,972,421
売買損	△ 225,800,096
(C) 信託報酬等	△ 37,799,722
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 117,632,054
(E) 前期繰越損益金	1,030,295,828
(F) 追加信託差損益金	5,002,886,642
(配当等相当額)	(3,285,848,202)
(売買損益相当額)	(1,717,038,440)
(G) 計(D+E+F)	5,915,550,416
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,915,550,416
追加信託差損益金	5,002,886,642
(配当等相当額)	(3,287,364,700)
(売買損益相当額)	(1,715,521,942)
分配準備積立金	1,295,392,073
繰越損益金	△ 382,728,299

*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(2021年9月7日～2022年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年9月7日～ 2022年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	265,096,245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	4,620,158,343円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,030,295,828円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	5,915,550,416円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	21,296円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	0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17期（決算日2022年6月10日）

作成対象期間（2021年6月11日～2022年6月10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
13期(2018年6月11日)	20,182	4.2	3,387.54	4.1	97.8	33,180
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

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	%			%
2021年6月10日	28,259	—	4,732.62	—	97.0
6月末	28,258	△ 0.0	4,732.24	△ 0.0	95.7
7月末	28,468	0.7	4,767.40	0.7	97.0
8月末	28,395	0.5	4,755.00	0.5	97.2
9月末	27,505	△ 2.7	4,605.71	△ 2.7	97.1
10月末	27,831	△ 1.5	4,660.54	△ 1.5	96.9
11月末	26,693	△ 5.5	4,470.13	△ 5.5	97.0
12月末	27,616	△ 2.3	4,624.94	△ 2.3	96.4
2022年1月末	26,109	△ 7.6	4,372.24	△ 7.6	97.0
2月末	25,342	△ 10.3	4,243.65	△ 10.3	97.0
3月末	27,089	△ 4.1	4,536.64	△ 4.1	96.3
4月末	26,769	△ 5.3	4,483.12	△ 5.3	96.6
5月末	27,248	△ 3.6	4,563.32	△ 3.6	96.0
(期末)					
2022年6月10日	27,270	△ 3.5	4,567.19	△ 3.5	97.0

*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、期首から新型コロナウイルスのワクチン普及による経済の正常化期待や国内の新型コロナウイルス変異株による感染再拡大懸念などを巡り一進一退の展開となりました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の債務問題などを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しました。10月以降は、米債務上限問題が先送りされたことなどから米国REIT市場が上昇したことや、新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高いと思われるオミクロン株への懸念が高まったこと、その後オミクロン株の重症化リスクについての楽観的な見方が広がったことなどから、一進一退の展開となりました。

2022年1月には、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げや資産圧縮が早期に進むとの見方が広がったことで、米長期金利が上昇したことなどから下落しました。2月下旬には、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて上値の重い展開となりましたが、3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しました。4月以降は、日米の金融政策などを巡り一進一退の展開となりました。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

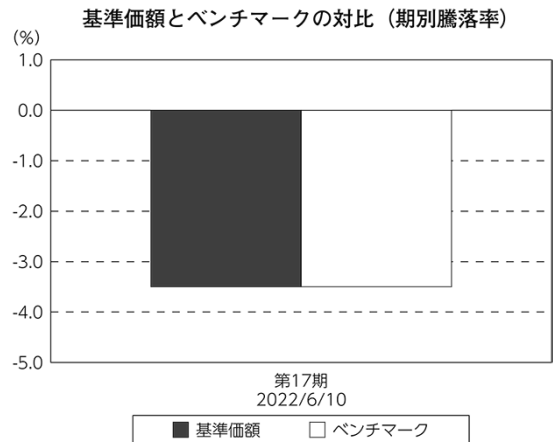
REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・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-3.5%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の-3.5%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

(2021年6月11日～2022年6月10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)	1	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、27,276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

(2021年6月11日～2022年6月10日)

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付			
	口 数	金 額	口 数	金 額		
	口	千円	口	千円		
国	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	309	43,446	184	25,466	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	524	62,658	278	32,209	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,110	185,051	363	57,664	
	東海道リート投資法人 投資証券	352	38,527	56	6,221	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	280	178,796	324	207,687	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	956	144,155	1,110	166,919	
	産業ファンド投資法人 投資証券	1,144	227,257	1,312	255,369	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	946	338,106	882	308,586	
	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	658	138,257	619	134,310	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	545	236,784	489	212,849	
	GLP投資法人 投資証券	3,011	555,121	2,994	550,838	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	434	141,726	434	143,817	
	内	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,478	543,561	1,479	527,458
		星野リゾート・リート投資法人 投資証券	182	122,640	143	96,052
Oneリート投資法人 投資証券		209	61,863	162	48,709	
イオンリート投資法人 投資証券		1,499	229,034	1,011	152,766	
ヒューリックリート投資法人 投資証券		1,102	190,602	813	137,085	
日本リート投資法人 投資証券		254	102,817	361	147,940	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	665	15,077	26,099	591,887		

銘柄		買付		売付		
		口数	金額	口数	金額	
国	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,797	234,878	2,832	238,155	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	173	23,066	250	33,927	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	325	91,176	373	104,854	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	309	44,407	216	32,870	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	300	37,422	194	23,900	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,608	426,909	3,047	496,900	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	133	11,584	192	16,815	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	988	182,350	1,095	198,797	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,090	65,206	1,206	72,941	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	178	23,082	100	13,090	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	460	269,297	334	191,174	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	132	9,661	154	11,361	
	投資法人みらい 投資証券	1,407	72,885	1,046	53,755	
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	244	32,197	204	26,160	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	363	165,790	247	116,282	
	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	554	115,568	337	68,397	
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	187	22,022	176	21,310	
	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	655	75,715	333	39,222	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	312	50,395	356	56,284	
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,053	724,419	1,049	715,540	
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	812	528,701	947	614,676	
	日本都市ファンド投資法人 投資証券	4,068	415,894	4,493	464,571	
	オリックス不動産投資法人 投資証券	1,605	291,126	1,876	343,621	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	746	299,374	596	237,971	
	N T T都市開発リート投資法人	975	148,763	884	136,225	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	543	102,825	634	121,304	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	558	65,092	688	79,981	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	2,136	312,531	1,990	282,283	
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	572	82,627	668	97,231	
	内	インヴィンシブル投資法人 投資証券	4,175	172,970	3,891	159,348
		フロンティア不動産投資法人 投資証券	352	175,826	324	159,781
		平和不動産リート投資法人 投資証券	657	99,163	607	92,734
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券		619	200,002	627	201,140	
福岡リート投資法人 投資証券		419	69,962	489	82,399	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券		251	179,778	293	212,296	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券		660	57,761	771	68,241	
大和証券オフィス投資法人 投資証券		170	124,221	206	151,931	
阪急阪神リート投資法人 投資証券		364	56,750	425	65,597	
スターツプロシード投資法人 投資証券		127	29,948	148	34,873	
大和ハウスリート投資法人 投資証券		1,481	481,332	1,386	448,051	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		2,475	154,926	3,523	221,939	
大和証券リビング投資法人 投資証券		1,250	142,661	1,251	144,307	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券		749	101,132	916	125,109	
合 計		55,690	10,526,903	80,487	10,881,203	

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

*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 5,864	百万円 5,949	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

(2021年6月11日～2022年6月10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	10,526	1,223	11.6	10,881	1,258	11.6

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)	867千円
うち利害関係人への支払額 (B)	25千円
(B) / (A)	2.9%

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。

(2022年6月10日現在)

○組入資産の明細

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
	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	654	779	104,308	0.2
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	979	1,225	121,397	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,052	1,799	274,167	0.6
東海道リート投資法人 投資証券	—	296	35,401	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,379	1,335	897,120	2.0
森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,701	4,547	689,779	1.6
産業ファンド投資法人 投資証券	5,657	5,489	1,017,660	2.3
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,802	3,866	1,385,961	3.1
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	2,728	2,767	592,691	1.3
アクティビア・プロバティーズ投資法人 投資証券	2,005	2,061	864,589	2.0
G L P 投資法人 投資証券	12,506	12,523	2,096,350	4.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,799	1,799	602,665	1.4
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,327	6,326	2,223,589	5.0
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	609	648	448,416	1.0
O n e リート投資法人 投資証券	624	671	185,799	0.4
イオンリート投資法人 投資証券	4,059	4,547	696,600	1.6
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,318	3,607	581,448	1.3
日本リート投資法人 投資証券	1,300	1,193	454,533	1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	25,434	—	—	—
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,772	11,737	930,744	2.1
トーセイ・リート投資法人 投資証券	885	808	107,787	0.2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,592	1,544	431,548	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	854	947	150,762	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	770	876	120,888	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,943	12,504	2,123,179	4.8
いちごホテルリート投資法人 投資証券	700	641	61,087	0.1
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,841	4,734	843,598	1.9
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,112	3,996	241,758	0.5
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	375	453	62,287	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,397	1,523	840,696	1.9
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	646	624	44,616	0.1
投資法人みらい 投資証券	4,323	4,684	236,073	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	867	907	119,270	0.3
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,007	1,123	519,949	1.2
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,281	1,498	306,041	0.7
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	613	624	79,934	0.2
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,203	1,525	180,712	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,552	1,508	241,280	0.5
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,504	4,508	3,236,744	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,002	3,867	2,501,949	5.6
日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,935	19,510	2,066,109	4.7
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,975	7,704	1,438,336	3.2
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,492	2,642	1,095,109	2.5
N T T 都市開発リート投資法人	3,615	3,706	556,641	1.3

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	口	口	千円	%	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,683	2,592	503,625	1.1	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,779	2,649	282,648	0.6	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,559	8,705	1,274,412	2.9	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,860	2,764	394,146	0.9	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,735	17,019	705,437	1.6	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,328	1,356	720,036	1.6	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,586	2,636	390,128	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,615	2,607	848,578	1.9	
福岡リート投資法人 投資証券	2,070	2,000	337,200	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,238	1,196	791,752	1.8	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,279	3,168	266,428	0.6	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	853	817	564,547	1.3	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,808	1,747	263,272	0.6	
スターツプロシード投資法人 投資証券	623	602	148,573	0.3	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,711	5,806	1,849,211	4.2	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,894	11,846	778,282	1.8	
大和証券リビング投資法人 投資証券	5,226	5,225	609,235	1.4	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,714	3,547	454,016	1.0	
合 計	口 数 ・ 金 額	250,750	225,953	42,991,112	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	61	< 97.0% >	

*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 1,305	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

(2022年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	42,991,112	97.0
コール・ローン等、その他	1,343,667	3.0
投資信託財産総額	44,334,779	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 (2022年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	44,334,779,462
コール・ローン等	1,013,907,264
投資証券(評価額)	42,991,112,850
未収配当金	261,853,748
差入委託証拠金	67,905,600
(B) 負債	32,775,332
未払金	1,519,980
未払解約金	31,254,899
未払利息	453
(C) 純資産総額(A-B)	44,302,004,130
元本	16,245,462,523
次期繰越損益金	28,056,541,607
(D) 受益権総口数	16,245,462,523口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,270円

(注) 期首元本額は16,994,222,275円、期中追加設定元本額は4,218,264,847円、期中一部解約元本額は4,967,024,599円、1口当たり純資産額は2,7270円です。

○損益の状況 (2021年6月11日～2022年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,563,981,482
受取配当金	1,564,217,362
その他収益金	283
支払利息	△ 236,163
(B) 有価証券売買損益	△ 3,237,502,685
売買益	200,957,533
売買損	△ 3,438,460,218
(C) 先物取引等取引損益	△ 47,955,770
取引益	110,083,680
取引損	△ 158,039,450
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,721,476,973
(E) 前期繰越損益金	31,029,869,349
(F) 追加信託差損益金	7,173,215,037
(G) 解約差損益金	△ 8,425,065,806
(H) 計(D+E+F+G)	28,056,541,607
次期繰越損益金(H)	28,056,541,607

* 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
野村インデックスファンド・J-REIT	3,130,064,885
野村6資産均等バランス	2,278,487,625
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,187,154,292
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,690,655,354
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,690,449,979
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	1,624,001,376
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	1,145,189,264
野村世界6資産分散投信(成長コース)	910,907,789
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	650,813,298
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	356,971,108
野村DC運用戦略ファンド	118,075,090
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)	88,203,619
ノムラPOF用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	86,169,160
野村資産設計ファンド2040	37,531,608
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	31,165,213
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)	26,237,585
野村資産設計ファンド2035	20,554,527
野村資産設計ファンド2030	20,060,597
野村資産設計ファンド2025	18,115,415
野村資産設計ファンド2020	14,299,898
野村資産設計ファンド2015	13,561,033

ファンド名	当期末 元本額
	円
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)	13,554,486
ホールウェザー・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
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	10,295,314
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	9,571,964
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	9,100,585
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A)2040	6,488,801
インデックス・ブレンド(タイプIII)	6,233,233
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A)2030	6,158,870
インデックス・ブレンド(タイプV)	4,925,131
野村資産設計ファンド2050	4,778,286
野村資産設計ファンド2045	4,767,337
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,405,873
ネクストコア	3,840,933
野村資産設計ファンド2060	3,145,241
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A)2050	2,586,592
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A)2060	1,571,577
インデックス・ブレンド(タイプIV)	1,479,491
インデックス・ブレンド(タイプI)	1,197,150
インデックス・ブレンド(タイプII)	836,574
野村POF用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	476,449

○お知らせ

該当事項はございません。