

# 野村インデックスファンド・ 外国REIT・為替ヘッジ型

## 愛称：Funds-i 外国REIT・為替ヘッジ型

### 運用報告書(全体版)

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016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／海外／不動産投信／インデックス型                                                                                                                                           |                                                                               |
| 信託期間   | 2013年9月12日以降、無期限とします。                                                                                                                                            |                                                                               |
| 運用方針   | 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド（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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。 |                                                                               |
| 主な投資対象 | 野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型                                                                                                                                       | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。                                                       |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                          | 日本を除く世界各国のREIT（不動産投資信託証券）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・外国REIT・為替ヘッジ型                                                                                                                                       | 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                          | 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。     |
| 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利子・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います。                                        |                                                                               |

### 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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/>

○設定以来の運用実績

| 決 算 期              | 基 準 価 額 |         |           | ベ ン チ マ ー ク<br>S & P 先 進 国 R E I T 指 数<br>(除く日本、配当込み、円ヘッジ) |           | 投 資 信 託 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|--------------------|---------|---------|-----------|------------------------------------------------------------|-----------|----------------------|---------|
|                    | (分配落)   | 税 込 配 分 | 期 騰 落 中 率 | 期 騰 落 中 率                                                  | 期 騰 落 中 率 |                      |         |
| (設定日)              | 円       | 円       | %         |                                                            | %         | %                    | 百万円     |
| 2013年 9 月12日       | 10,000  | —       | —         | 100.00                                                     | —         | —                    | 500     |
| 1 期(2014年 9 月 8 日) | 11,926  | 0       | 19.3      | 121.01                                                     | 21.0      | 100.5                | 742     |
| 2 期(2015年 9 月 7 日) | 11,683  | 0       | △ 2.0     | 119.63                                                     | △ 1.1     | 94.1                 | 591     |
| 3 期(2016年 9 月 6 日) | 14,296  | 0       | 22.4      | 148.46                                                     | 24.1      | 99.1                 | 870     |

\*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。

\*S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）を使用しております。なお、設定時を100として再指数化しています。  
\*S&P先進国REIT指数はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

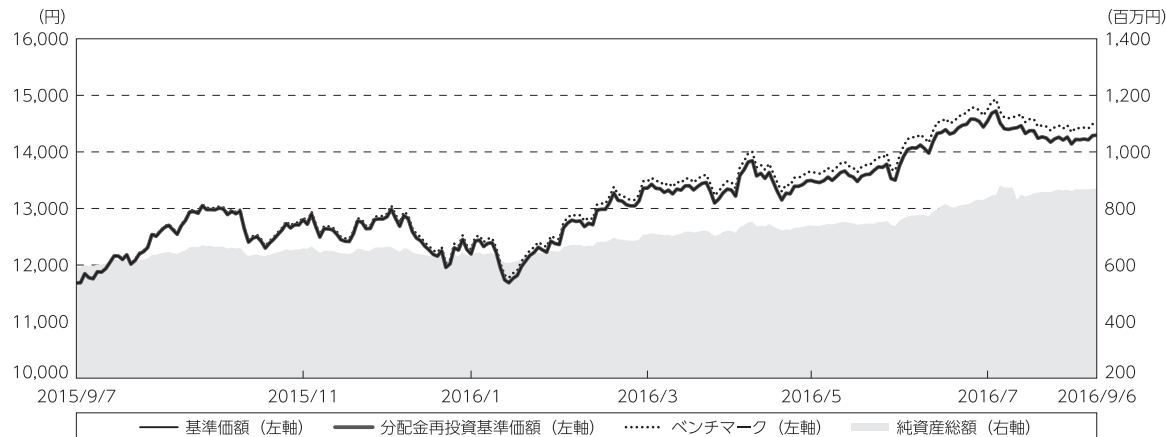
| 年 月 日         | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク<br>S & P 先 進 国 R E I T 指 数<br>(除く日本、配当込み、円ヘッジ) |       | 投 資 信 託 券<br>組 入 比 率 |
|---------------|---------|-------|------------------------------------------------------------|-------|----------------------|
|               |         | 騰 落 率 |                                                            | 騰 落 率 |                      |
| (期 首)         | 円       | %     |                                                            | %     | %                    |
| 2015年 9 月 7 日 | 11,683  | —     | 119.63                                                     | —     | 94.1                 |
| 9 月末          | 12,082  | 3.4   | 123.91                                                     | 3.6   | 96.4                 |
| 10 月末         | 12,993  | 11.2  | 133.34                                                     | 11.5  | 99.0                 |
| 11 月末         | 12,801  | 9.6   | 131.53                                                     | 9.9   | 99.9                 |
| 12 月末         | 12,988  | 11.2  | 133.64                                                     | 11.7  | 96.8                 |
| 2016年 1 月末    | 12,194  | 4.4   | 125.72                                                     | 5.1   | 99.1                 |
| 2 月末          | 12,380  | 6.0   | 127.74                                                     | 6.8   | 89.8                 |
| 3 月末          | 13,360  | 14.4  | 138.03                                                     | 15.4  | 99.9                 |
| 4 月末          | 13,326  | 14.1  | 137.88                                                     | 15.3  | 96.6                 |
| 5 月末          | 13,495  | 15.5  | 139.80                                                     | 16.9  | 101.4                |
| 6 月末          | 13,922  | 19.2  | 144.42                                                     | 20.7  | 91.1                 |
| 7 月末          | 14,545  | 24.5  | 151.03                                                     | 26.2  | 98.1                 |
| 8 月末          | 14,215  | 21.7  | 147.64                                                     | 23.4  | 99.0                 |
| (期 末)         |         |       |                                                            |       |                      |
| 2016年 9 月 6 日 | 14,296  | 22.4  | 148.46                                                     | 24.1  | 99.1                 |

\*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：11,683円

期 末：14,296円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 22.4% (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(2015年9月7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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ)です。ベンチマークは、作成期首(2015年9月7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

基準価額は、期首11,683円から期末14,296円に2,613円の値上がりとなりました。

主要国の緩和的な金融政策や市場予想を上回る経済指標などを背景に、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

期首より、米国の経済指標が市場予想を上回ったことや、主要国が緩和的な金融政策を維持するとの見方が広がったことなどを背景に、主要国のREIT市場は上昇しました。

2016年1月には、中国経済への懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことなどを受けて下落しました。しかし2月中旬以降は、原油価格が持ち直したことや、市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に再び上昇し、その後も欧米の政策金利据え置きや市場予想を上回る経済指標などを背景に、上昇しました。

## ○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・外国REIT・為替ヘッジ型]

[海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド] 受益証券を主要な投資対象とし、期を通じてほぼ全額を投資しました。また、為替ヘッジ（為替の売り予約）を同マザーファンドにおいて行い、為替の送付金などを含んだ外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ））の外貨比率と同等に維持しました。

### [海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド]

#### ・ 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

S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数（除く日本）」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の資金流入や「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行いました。また、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行い、為替の送付金などを含んだ外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマークの外貨比率と同等に維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

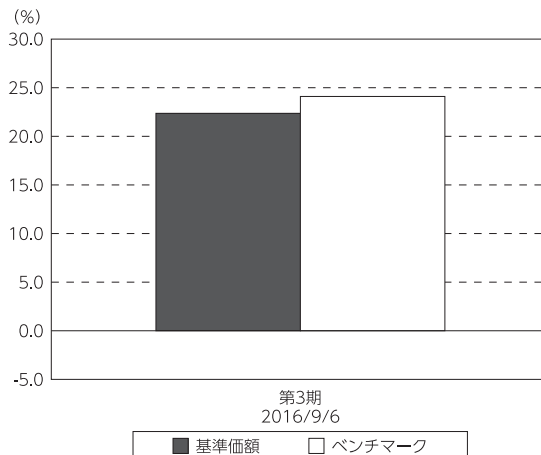
今期の基準価額の騰落率は+22.4%となり、ベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の+24.1%を1.7ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（当ファンドにかかる信託報酬や、マザーファンドでかかる売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

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配当金込みです。

（注）ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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3期                     |
|--------------------|-------------------------|
|                    | 2015年9月8日～<br>2016年9月6日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | —<br>— %                |
| 当期の収益              | —                       |
| 当期の収益以外            | —                       |
| 翌期繰越分配対象額          | 4,295                   |

（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・外国REIT・為替ヘッジ型]**

主要投資対象である[海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド] 受益証券を高位に組み入れ、引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

### **[海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド]**

引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

(2015年9月8日～2016年9月6日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|---------|------------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額     | 比 率        |                                                                        |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>78 | %<br>0.592 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                                               |
| ( 投 信 会 社 )           | ( 36 )  | (0.269)    | 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 )           | ( 36 )  | (0.269)    | 購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、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 )           | ( 7 )   | (0.054)    | 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     | 7       | 0.053      | (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<br>※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 |
| ( 株 式 )               | ( 0 )   | (0.000)    |                                                                        |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 6 )   | (0.044)    |                                                                        |
| ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )   | ( 1 )   | (0.008)    |                                                                        |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 5       | 0.038      | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| ( 株 式 )               | ( 0 )   | (0.000)    |                                                                        |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 5 )   | (0.038)    |                                                                        |
| (d) そ の 他 費 用         | 22      | 0.168      | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                          |
| ( 保 管 費 用 )           | ( 20 )  | (0.154)    | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| ( 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                                            |
| ( そ の 他 )             | ( 1 )   | (0.011)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                                     |
| 合 計                   | 112     | 0.851      |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、13,191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、有価証券取引税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。

## ○売買及び取引の状況

(2015年9月8日～2016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           |
| 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 千口<br>183,129 | 千円<br>255,718 | 千口<br>85,017 | 千円<br>118,031 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年9月8日～2016年9月6日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期                       |
|---------------------|---------------------------|
|                     | 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 131千円                     |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | －千円                       |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | －                         |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年9月8日～2016年9月6日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型&gt;

| 区 分 | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |           |                    |               |           |                    |               |
| 預金  | 百万円<br>37 | 百万円<br>37          | %<br>100.0    | 百万円<br>37 | 百万円<br>37          | %<br>100.0    |

## &lt;海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |               |                    |               |
| 為替先物取引 | 百万円<br>20,690 | 百万円<br>44          | %<br>0.2      | 百万円<br>21,882 | 百万円<br>679         | %<br>3.1      |
| 為替直物取引 | 1,146         | 684                | 59.7          | 187           | 45                 | 24.1          |
| 預金     | 531           | 531                | 100.0         | 531           | 531                | 100.0         |

平均保有割合 48.9%

※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。

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信託銀行です。



## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2015年9月8日～2016年9月6日)

| 期首残高<br>(元 本) | 当期設定<br>元 本 | 当期解約<br>元 本 | 期末残高<br>(元 本) | 取 引 の 理 由   |
|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 百万円<br>309    | 百万円<br>－    | 百万円<br>－    | 百万円<br>309    | 当初設定時における取得 |

## ○組入資産の明細

(2016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   |
|                           | 千口      | 千口      | 千円      |
| 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 501,741 | 599,854 | 870,088 |

\* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

| 項 目                       | 当 期 末         |           |
|---------------------------|---------------|-----------|
|                           | 評 価 額         | 比 率       |
| 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 千円<br>870,088 | %<br>99.3 |
| コール・ローン等、その他              | 5,947         | 0.7       |
| 投資信託財産総額                  | 876,035       | 100.0     |

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,046,188千円）の投資信託財産総額（2,068,656千円）に対する比率は98.9%です。

\* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝103.60円、1カナダドル＝80.12円、1英ポンド＝137.85円、1ユーロ＝115.43円、1香港ドル＝13.36円、1シンガポールドル＝76.33円、1豪ドル＝78.78円、1ニュージーランドドル＝75.68円、1新シェケル＝27.52円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月6日現在)

| 項 目                            | 当 期 末        |
|--------------------------------|--------------|
|                                | 円            |
| (A) 資産                         | 876,035,832  |
| コール・ローン等                       | 3,731,916    |
| 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額) | 870,088,448  |
| 未収入金                           | 2,215,468    |
| (B) 負債                         | 5,860,455    |
| 未払解約金                          | 3,585,199    |
| 未払信託報酬                         | 2,262,973    |
| 未払利息                           | 5            |
| その他未払費用                        | 12,278       |
| (C) 純資産総額(A－B)                 | 870,175,377  |
| 元本                             | 608,700,055  |
| 次期繰越損益金                        | 261,475,322  |
| (D) 受益権総口数                     | 608,700,055口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)                | 14,296円      |

(注) 期首元本額は506,526,221円、期中追加設定元本額は255,088,999円、期中一部解約元本額は152,915,165円、1口当たり純資産額は1.4296円です。

## ○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
|                  | 円             |
| (A) 配当等収益        | △ 165         |
| 受取利息             | 276           |
| 支払利息             | △ 441         |
| (B) 有価証券売買損益     | 116,434,640   |
| 売買益              | 140,791,655   |
| 売買損              | △ 24,357,015  |
| (C) 信託報酬等        | △ 4,176,754   |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 112,257,721   |
| (E) 前期繰越損益金      | 20,826,766    |
| (F) 追加信託差損益金     | 128,390,835   |
| (配当等相当額)         | ( 65,701,121) |
| (売買損益相当額)        | ( 62,689,714) |
| (G) 計(D＋E＋F)     | 261,475,322   |
| (H) 収益分配金        | 0             |
| 次期繰越損益金(G＋H)     | 261,475,322   |
| 追加信託差損益金         | 128,390,835   |
| (配当等相当額)         | ( 66,637,525) |
| (売買損益相当額)        | ( 61,753,310) |
| 分配準備積立金          | 133,084,487   |

\* 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 (2015年9月8日～2016年9月6日) は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                     |
|------------------------------|-------------------------|
|                              | 2015年9月8日～<br>2016年9月6日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 25,840,740円             |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 53,173,814円             |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 128,390,835円            |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 54,069,933円             |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)           | 261,475,322円            |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 4,295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。

# 海外REITインデックス為替ヘッジ型 マザーファンド

## 運用報告書

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016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。

|        |                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 日本を除く世界各国のREIT（不動産投資信託証券）を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。 |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。                                                                                           |
| 主な投資制限 | 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。                     |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋1-12-1

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

## ○設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額     |        | ベ ン チ マ ー ク<br>S & P 先 進 国 R E I T 指 数<br>(除く日本、配当込み、円ヘッジ) |        | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|---------------------|-------------|--------|------------------------------------------------------------|--------|----------------------|--------------|
|                     | 期 騰         | 中 落 率  | 期 騰                                                        | 中 落 率  |                      |              |
| (設定日)<br>2013年9月12日 | 円<br>10,000 | %<br>— | 100.00                                                     | %<br>— | %<br>—               | 百万円<br>499   |
| 1期(2014年9月8日)       | 11,991      | 19.9   | 121.01                                                     | 21.0   | 100.5                | 850          |
| 2期(2015年9月7日)       | 11,793      | △ 1.7  | 119.63                                                     | △ 1.1  | 94.1                 | 1,028        |
| 3期(2016年9月6日)       | 14,505      | 23.0   | 148.46                                                     | 24.1   | 99.1                 | 2,039        |

\*S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）を使用しております。なお、設定時を100として再指数化しています。

\*S&P先進国REIT指数はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスーズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

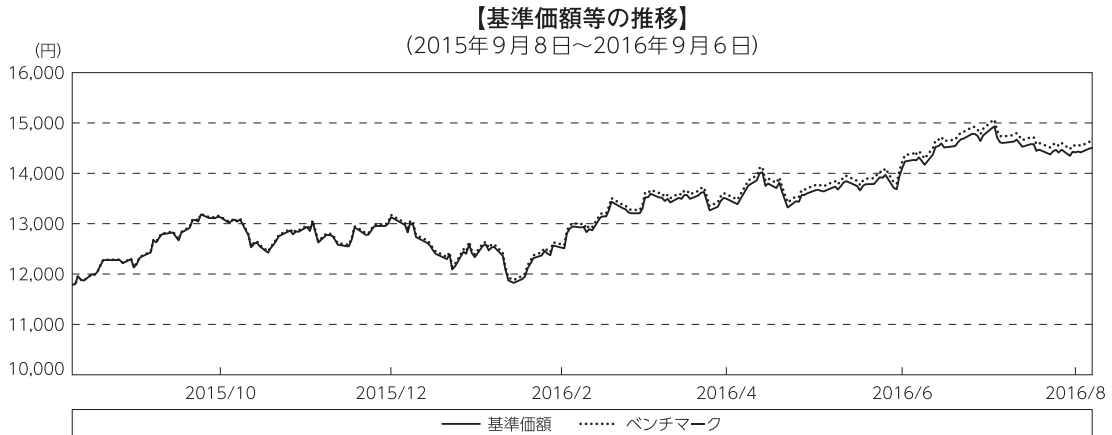
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日              | 基 準 価 額     |        | ベ ン チ マ ー ク<br>S & P 先 進 国 R E I T 指 数<br>(除く日本、配当込み、円ヘッジ) |        | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|--------------------|-------------|--------|------------------------------------------------------------|--------|----------------------|
|                    | 騰 落         | 率      | 騰 落                                                        | 率      |                      |
| (期 首)<br>2015年9月7日 | 円<br>11,793 | %<br>— | 119.63                                                     | %<br>— | %<br>94.1            |
| 9月末                | 12,200      | 3.5    | 123.91                                                     | 3.6    | 96.4                 |
| 10月末               | 13,126      | 11.3   | 133.34                                                     | 11.5   | 99.0                 |
| 11月末               | 12,938      | 9.7    | 131.53                                                     | 9.9    | 99.9                 |
| 12月末               | 13,133      | 11.4   | 133.64                                                     | 11.7   | 96.8                 |
| 2016年1月末           | 12,335      | 4.6    | 125.72                                                     | 5.1    | 99.1                 |
| 2月末                | 12,529      | 6.2    | 127.74                                                     | 6.8    | 89.8                 |
| 3月末                | 13,528      | 14.7   | 138.03                                                     | 15.4   | 99.9                 |
| 4月末                | 13,499      | 14.5   | 137.88                                                     | 15.3   | 96.6                 |
| 5月末                | 13,677      | 16.0   | 139.80                                                     | 16.9   | 101.4                |
| 6月末                | 14,115      | 19.7   | 144.42                                                     | 20.7   | 91.1                 |
| 7月末                | 14,753      | 25.1   | 151.03                                                     | 26.2   | 98.1                 |
| 8月末                | 14,422      | 22.3   | 147.64                                                     | 23.4   | 99.0                 |
| (期 末)<br>2016年9月6日 | 14,505      | 23.0   | 148.46                                                     | 24.1   | 99.1                 |

\*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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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

基準価額は、期首11,793円から期末14,505円に2,712円の値上がりとなりました。

主要国の緩和的な金融政策や市場予想を上回る経済指標などを背景に、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首より、米国の経済指標が市場予想を上回ったことや、主要国が緩和的な金融政策を維持するとの見方が広がったことなどを背景に、主要国のREIT市場は上昇しました。

2016年1月には、中国経済への懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことなどを受けて下落しました。しかし2月中旬以降は、原油価格が持ち直したことや、市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に再び上昇し、その後も欧米の政策金利据え置きや市場予想を上回る経済指標などを背景に、上昇しました。

## ○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

S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数（除く日本）」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の資金流入や「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行いました。また、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行い、為替の送金などを含んだ外貨建て資産の実質組入比率を期を通じて概ねベンチマークの外貨比率と同等に維持しました。

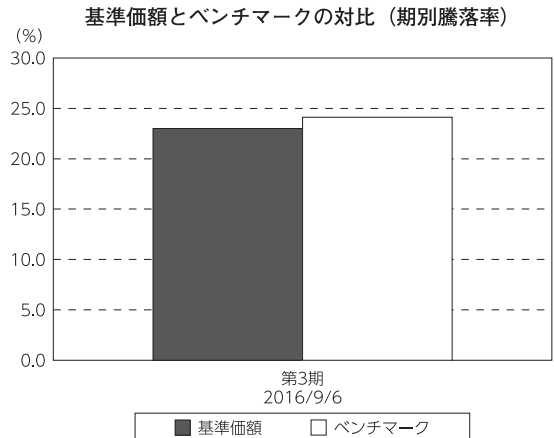
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+23.0%となり、ベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の+24.1%を1.1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）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）



（注）ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年9月8日～2016年9月6日)

| 項 目                   | 当 期  |         | 項 目 の 概 要                                                                                                    |
|-----------------------|------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額  | 比 率     |                                                                                                              |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円 7  | % 0.053 | (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<br>※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                                       |
| (株 式)                 | (0)  | (0.000) |                                                                                                              |
| (投資信託証券)              | (6)  | (0.045) |                                                                                                              |
| (先物・オプション)            | (1)  | (0.008) |                                                                                                              |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 5    | 0.039   | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                        |
| (株 式)                 | (0)  | (0.000) |                                                                                                              |
| (投資信託証券)              | (5)  | (0.039) |                                                                                                              |
| (c) そ の 他 費 用         | 22   | 0.165   | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br><br>保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (21) | (0.156) |                                                                                                              |
| (そ の 他)               | (1)  | (0.009) |                                                                                                              |
| 合 計                   | 34   | 0.257   |                                                                                                              |
| 期中の平均基準価額は、13,354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

(2015年9月8日～2016年9月6日)

## 株式

|     |      | 買 付               |                        | 売 付        |           |
|-----|------|-------------------|------------------------|------------|-----------|
|     |      | 株 数               | 金 額                    | 株 数        | 金 額       |
| 外 国 | アメリカ | 百株<br>—<br>(0.68) | 千米ドル<br>—<br>(0.88928) | 百株<br>0.68 | 千米ドル<br>1 |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\*（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分です。



## 投資信託証券

| 銘   | 柄                                   | 買 付    |      | 売 付      |       |
|-----|-------------------------------------|--------|------|----------|-------|
|     |                                     | 口 数    | 金 額  | 口 数      | 金 額   |
| 外 国 | アメリカ                                | 口      | 千米ドル | 口        | 千米ドル  |
|     | ACADIA REALTY TRUST                 | 740    | 25   | —        | —     |
|     | AGREE REALTY CORP                   | 330    | 14   | —        | —     |
|     | ALEXANDERS INC                      | 78     | 33   | 35       | 14    |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT        | 803    | 78   | —        | —     |
|     | AMERICAN ASSETS TRUST INC           | 300    | 11   | —        | —     |
|     | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES         | 1,390  | 63   | 250      | 10    |
|     | AMERICAN HOMES 4 RENT-A             | 2,180  | 40   | 500      | 8     |
|     |                                     | ( 340) | ( 4) |          |       |
|     | AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC | —      | —    | —        | —     |
|     |                                     |        |      | ( 300)   | ( 4)  |
|     | APARTMENT INVT&MGMT CO-A            | 1,620  | 67   | 300      | 11    |
|     | APPLE HOSPITALITY REIT INC          | 3,010  | 57   | 350      | 6     |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 1,644  | 295  | 499      | 88    |
|     | BIOMED REALTY TRUST INC             | 380    | 9    | —        | —     |
|     |                                     |        |      | ( 2,290) | ( 43) |
|     | BOSTON PROPERTIES                   | 1,552  | 200  | 329      | 42    |
|     | BRANDYWINE REALTY TRUST             | 1,410  | 20   | —        | —     |
|     | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC          | 3,530  | 93   | 400      | 10    |
|     | CBL&ASSOCIATES PROPERTIES           | 1,190  | 13   | —        | —     |
|     | CAMDEN PROPERTY TRUST               | 1,014  | 85   | 170      | 14    |
|     | CAMPUS CREST COMMUNITIES INC        | —      | —    | 450      | 3     |
|     | CARE CAPITAL PROPERTIES INC         | 924    | 26   | 300      | 8     |
|     | CARETRUST REIT INC ACQUIRES         | 1,028  | 13   | —        | —     |
|     | CHAMBERS STREET PROPERTIES          | —      | —    | —        | —     |
|     |                                     |        |      | ( 2,710) | ( 17) |
|     | CHESAPEAKE LODGING TRUST            | 500    | 12   | —        | —     |
|     | COLONY STARWOOD HOMES               | 510    | 16   | —        | —     |
|     |                                     | ( 370) | ( 8) |          |       |
|     | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC         | 1,130  | 24   | —        | —     |
|     | CORESITE REALTY CORP                | 429    | 30   | —        | —     |
|     | CORPORATE OFFICE PROPERTIES         | 830    | 21   | —        | —     |
|     | CORRECTIONS CORP OF AMERICA         | 970    | 24   | —        | —     |
|     | COUSINS PROPERTIES INC              | 1,300  | 13   | —        | —     |
|     | CUBESMART                           | 2,370  | 71   | 560      | 17    |
|     | CYRUSONE INC                        | 860    | 36   | —        | —     |
|     | DCT INDUSTRIAL TRUST INC            | 900    | 39   | —        | —     |
|     | DDR CORP                            | 3,150  | 56   | 700      | 11    |
|     | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO          | 1,770  | 15   | —        | —     |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC            | 1,819  | 168  | 465      | 44    |
|     | DOUGLAS EMMETT INC                  | 1,350  | 42   | —        | —     |
|     | DUKE REALTY CORP                    | 3,270  | 78   | 500      | 11    |
|     | DUPONT FABROS TECHNOLOGY            | 550    | 22   | —        | —     |
|     | EPR PROPERTIES                      | 698    | 47   | —        | —     |
|     | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC  | 360    | 7    | —        | —     |
|     | EASTGROUP PROPERTIES                | 224    | 13   | —        | —     |
|     | EDUCATION REALTY TRUST INC          | 850    | 35   | —        | —     |
|     | EMPIRE STATE REALTY TRUST IN        | 1,490  | 27   | —        | —     |
|     | EQUITY COMMONWEALTH                 | 1,370  | 37   | 400      | 10    |

| 銘   | 柄                             | 買         |            | 売      |           |
|-----|-------------------------------|-----------|------------|--------|-----------|
|     |                               | 口         | 金 額        | 口      | 金 額       |
| 外 国 | アメリカ                          | 口         | 千米ドル       | 口      | 千米ドル      |
|     | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES   | 803       | 59         | 243    | 17        |
|     | EQUITY ONE INC                | 950       | 28         | —      | —         |
|     | EQUITY RESIDENTIAL            | 4,282     | 306        | 1,264  | 92        |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC      | 890       | 201        | 305    | 68        |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC       | 1,283     | 109        | 153    | 11        |
|     | FEDERAL REALTY INVS TRUST     | 582       | 90         | —      | —         |
|     | FELCOR LODGING TRUST INC      | 2,000     | 13         | —      | —         |
|     | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR    | 1,040     | 26         | —      | —         |
|     | FOREST CITY REALTY TRUST- A   | 3,900     | 77         | —      | —         |
|     | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST   | 870       | 18         | —      | —         |
|     |                               | ( 135)    | ( 2)       | —      | —         |
|     | FRANKLIN STREET PROPERTIES C  | 1,240     | 13         | —      | —         |
|     | GEO GROUP INC/THE             | 360       | 10         | —      | —         |
|     | GAMING AND LEISURE PROPERTIE  | 2,690     | 86         | 320    | 9         |
|     | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 6,370     | 183        | 1,680  | 45        |
|     | GETTY REALTY CORP             | —         | —          | —      | —         |
|     |                               | ( 1)      | ( 0.01818) | —      | —         |
|     | GLOBAL NET LEASE INC          | 3,800     | 33         | —      | —         |
|     | GOVERNMENT PROPERTIES INCOME  | 700       | 13         | —      | —         |
|     |                               | —         | —          | ( —)   | (0.07592) |
|     | GRAMERCY PROPERTY TRUST INC   | —         | —          | —      | —         |
|     |                               | —         | —          | ( 370) | ( 8)      |
|     | GRAMERCY PROPERTY TRUST       | 3,050     | 25         | —      | —         |
|     |                               | ( 3,890)  | ( 26)      | —      | —         |
|     | HCP INC                       | 5,720     | 200        | 1,710  | 58        |
|     | HEALTHCARE REALTY TRUST INC   | 880       | 28         | —      | —         |
|     | HEALTH CARE REIT INC          | —         | —          | 143    | 9         |
|     |                               | (△ 3,034) | (△ 186)    | —      | —         |
|     | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA   | 1,340     | 41         | —      | —         |
|     | HIGHWOODS PROPERTIES INC      | 830       | 40         | —      | —         |
|     | HOME PROPERTIES INC           | —         | —          | —      | —         |
|     |                               | —         | —          | ( 566) | ( 42)     |
|     | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST  | 1,520     | 40         | —      | —         |
|     |                               | —         | —          | ( —)   | (0.28656) |
|     | HOST HOTELS & RESORTS INC     | 6,620     | 108        | 500    | 8         |
|     | HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN  | 1,480     | 43         | —      | —         |
|     | INLAND REAL ESTATE CORP       | —         | —          | —      | —         |
|     |                               | —         | —          | ( 600) | ( 4)      |
|     | INVESTORS REAL ESTATE TRUST   | 1,260     | 8          | —      | —         |
|     | IRON MOUNTAIN INC             | 2,800     | 99         | —      | —         |
|     | KILROY REALTY CORP            | 940       | 59         | 240    | 14        |
|     | KIMCO REALTY CORP             | 4,030     | 116        | 300    | 8         |
|     | KITE REALTY GROUP TRUST       | 470       | 12         | —      | —         |
|     | LTC PROPERTIES INC            | 250       | 11         | —      | —         |
|     | LASALLE HOTEL PROPERTIES      | 550       | 13         | —      | —         |
|     | LEXINGTON REALTY TRUST        | 1,520     | 13         | —      | —         |
|     | LIBERTY PROPERTY TRUST        | 940       | 32         | —      | —         |
|     | LIFE STORAGE INC              | —         | —          | —      | —         |
|     |                               | ( 737)    | ( 73)      | —      | —         |
|     | MACERICH CO /THE              | 1,159     | 94         | 251    | 19        |
|     | MACK-CALI REALTY CORP         | 540       | 12         | —      | —         |

| 銘柄                                  |                                | 買付                |              | 売付              |                 |
|-------------------------------------|--------------------------------|-------------------|--------------|-----------------|-----------------|
|                                     |                                | 口数                | 金額           | 口数              | 金額              |
| 外国                                  | アメリカ                           | 口                 | 千米ドル         | 口               | 千米ドル            |
|                                     | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC   | 1,990             | 26           | —               | —               |
|                                     | MID-AMERICA APARTMENT COMM     | 856               | 83           | 140             | 14              |
|                                     | MONMOUTH REIT-CLASS A          | 900               | 10           | —               | —               |
|                                     | MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 1,260             | 12           | —               | —               |
|                                     | NATL HEALTH INVESTORS INC      | 198               | 13           | —               | —               |
|                                     | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 1,740             | 75           | 270             | 9               |
|                                     | NATIONAL STORAGE AFFILIATES    | 400               | 6            | —               | —               |
|                                     | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP    | 1,260             | 13           | —               | —               |
|                                     | NEW YORK REIT INC              | 1,380             | 13           | —               | —               |
|                                     | NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 380               | 7            | —               | —               |
|                                     | NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP  | 1,250             | 16           | 710<br>( 3,250) | 9<br>( 44)      |
|                                     | NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP  | 1,685<br>( 1,625) | 24<br>( 37)  | —               | —               |
|                                     | NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP   | —<br>( 541)       | —<br>( 7)    | —               | —               |
|                                     | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS     | 1,820             | 63           | 300             | 10              |
|                                     | PS BUSINESS PARKS INC/CA       | 238               | 25           | —               | —               |
|                                     | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST        | 800               | 25           | —               | —               |
|                                     | PENN REAL ESTATE INVEST TST    | 940               | 21           | —               | —               |
|                                     | PHYSICIANS REALTY TRUST        | 1,360             | 24           | —               | —               |
|                                     | PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A   | 980               | 19           | —               | —               |
|                                     | POST PROPERTIES INC            | 470               | 28           | —               | —               |
|                                     | PROLOGIS INC                   | 6,370             | 291          | 1,960           | 85              |
|                                     | PUBLIC STORAGE                 | 1,707             | 417          | 408             | 97              |
|                                     | QTS REALTY TRUST INC CL A      | 520               | 26           | —               | —               |
|                                     | RLJ LODGING TRUST              | 1,170             | 25           | —               | —               |
|                                     | RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES    | 1,650             | 32           | 800             | 16              |
|                                     | REALTY INCOME CORP             | 3,144             | 195          | 660             | 41              |
|                                     | REGENCY CENTERS CORP           | 1,323             | 100          | 370             | 27              |
|                                     | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN   | 600               | 11           | —               | —               |
|                                     | RETAIL PROPERTIES OF AME-A     | 1,870             | 30           | —               | —               |
|                                     | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC  | 500               | 8            | —               | —               |
|                                     | ROUSE PROPERTIES INC           | —                 | —            | —<br>( 280)     | —<br>( 4)       |
|                                     | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES   | 275               | 14           | —               | —               |
|                                     | SL GREEN REALTY CORP           | 813               | 85           | —               | —               |
|                                     | SABRA HEALTH CARE REIT INC     | 460               | 9            | —               | —               |
|                                     | SELECT INCOME REIT             | 510               | 10           | —<br>( —)       | —<br>(0.19453)  |
|                                     | SENIOR HOUSING PROP TRUST      | 2,430             | 45           | 600<br>( —)     | 12<br>(0.33227) |
|                                     | SERITAGE GROWTH PROP-A REIT    | 140               | 5            | —               | —               |
|                                     | SIMON PROPERTY GROUP INC       | 3,316             | 676          | 750             | 144             |
|                                     | SOVRAN SELF STORAGE INC        | 455<br>(△ 737)    | 49<br>(△ 73) | —               | —               |
|                                     | SPIRIT REALTY CAPITAL INC      | 5,320             | 61           | 1,200           | 11              |
|                                     | STAG INDUSTRIAL INC            | 600               | 11           | —               | —               |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST | —<br>(△ 370)                   | —<br>(△ 8)        | —            | —               |                 |
| STORE CAPITAL CORP                  | 2,890                          | 77                | 590          | 17              |                 |

| 銘 柄 |                                          | 買 付                 |                  | 売 付                |                 |
|-----|------------------------------------------|---------------------|------------------|--------------------|-----------------|
|     |                                          | 口 数                 | 金 額              | 口 数                | 金 額             |
| 外 国 | アメリカ                                     | 口                   | 千米ドル             | 口                  | 千米ドル            |
|     | STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC           | 1,410               | 19               | 690<br>( 2,830)    | 9<br>( 39)      |
|     | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC              | 570                 | 7                | —                  | —               |
|     | SUN COMMUNITIES INC                      | 593                 | 40               | —                  | —               |
|     | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC             | 2,159<br>( 58)      | 28<br>( 0.62469) | —                  | —               |
|     | TANGER FACTORY OUTLET CENTER             | 820                 | 31               | —                  | —               |
|     | TAUBMAN CENTERS INC                      | 559                 | 42               | —                  | —               |
|     | TERRENO REALTY CORP                      | 630                 | 14               | —                  | —               |
|     | UDR INC                                  | 2,950               | 106              | 630                | 23              |
|     | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME             | 110                 | 6                | —                  | —               |
|     | URBAN EDGE PROPERTIES                    | 950                 | 25               | —                  | —               |
|     | URSTADT BIDDLE-CL A                      | 300                 | 6                | —                  | —               |
|     | VENTAS INC                               | 4,184               | 272              | 1,219              | 76              |
|     | VEREIT INC                               | 13,630              | 123              | 4,320              | 36              |
|     | VORNADO REALTY TRUST                     | 2,119               | 205              | 595                | 55              |
|     | WP CAREY INC                             | 912                 | 56               | 210                | 11              |
|     | WP GLIMCHER INC                          | 1,280<br>(△ 3,190)  | 13<br>(△ 35)     | —                  | —               |
|     | WASHINGTON PRIME GROUP INC               | —<br>( 3,190)       | —<br>( 35)       | —                  | —               |
|     | WASHINGTON REAL ESTATE INV               | 460                 | 13               | —                  | —               |
|     | WEINGARTEN REALTY INVESTORS              | 1,410               | 51               | 300                | 9               |
|     | WELLTOWER INC                            | 4,521<br>( 3,034)   | 319<br>( 186)    | 1,325              | 90              |
|     | WINTHROP REALTY TRUST                    | 580                 | 8                | 580<br>( —)        | 5<br>( 1)       |
|     | XENIA HOTELS & RESORTS INC               | 890                 | 13               | —                  | —               |
|     | 小 計                                      | 214,489<br>( 6,590) | 8,391<br>( 78)   | 31,944<br>(13,196) | 1,498<br>( 212) |
|     | カナダ                                      |                     | 千カナダドル           |                    | 千カナダドル          |
|     | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT             | 200                 | 7                | —                  | —               |
|     | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT             | 700                 | 9                | —                  | —               |
|     | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST             | 170                 | 9                | 192                | 10              |
|     | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA             | 1,290               | 37               | 400                | 11              |
|     | CAN REAL ESTATE INVEST TRUST             | 290                 | 12               | —                  | —               |
|     | CHOICE PROPERTIES REIT                   | 900                 | 12               | 780                | 10              |
|     | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U             | 2,680               | 44               | 1,970              | 32              |
|     | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 500                 | 10               | —                  | —               |
|     | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 1,130               | 10               | —                  | —               |
|     | H&R REAL ESTATE INVSTMT-UTS              | 1,060               | 21               | —                  | —               |
|     | INNVEST REAL ESTATE INVESTME             | 1,380               | 9                | —<br>( 1,700)      | —<br>( 11)      |
|     | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE             | 560                 | 5                | —                  | —               |
|     | MILESTONE APARTMENTS REAL ES             | 1,250               | 20               | 600                | 10              |
|     | MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS              | 600                 | 9                | —                  | —               |
|     | NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT             | —                   | —                | —<br>( 120)        | —<br>( 2)       |
|     | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST   | 200<br>( 120)       | 4<br>( 2)        | —                  | —               |
|     | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT             | 810                 | 8                | —                  | —               |

| 銘   | 柄                                   | 買                   |                  | 売                  |                |
|-----|-------------------------------------|---------------------|------------------|--------------------|----------------|
|     |                                     | 口                   | 金 額              | 口                  | 金 額            |
| 外 国 | カナダ                                 | 口                   | 千カナダドル           | 口                  | 千カナダドル         |
|     | PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE         | 1,500               | 7                | —                  | —              |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR         | 1,550               | 42               | —                  | —              |
|     | SLATE RETAIL REIT                   | 240<br>( 26)        | 3<br>( 0.35252)  | —<br>( —)          | —<br>(0.01783) |
|     | SLATE RETAIL REIT-RIGHTS            | —<br>( 240)         | —<br>( 0.01783)  | —<br>( 240)        | —<br>(0.01783) |
|     | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 380                 | 12               | —                  | —              |
|     | 小 計                                 | 17,390<br>( 386)    | 299<br>( 2)      | 3,942<br>( 2,060)  | 75<br>( 13)    |
|     | イギリス                                |                     | 千英ポンド            |                    | 千英ポンド          |
|     | BRITISH LAND                        | 10,780              | 76               | 2,070              | 16             |
|     | DERWENT LONDON PLC                  | 1,217               | 37               | 236                | 7              |
|     | BIG YELLOW GROUP PLC                | 1,560               | 12               | —                  | —              |
|     | HAMMERSON PLC                       | 7,620               | 43               | 1,800              | 8              |
|     | MUCKLOW < A & J > GROUP PLC         | —                   | —                | 560                | 2              |
|     | INTU PROPERTIES PLC                 | 8,840               | 27               | 5,230              | 16             |
|     | PRIMARY HEALTH PROPERTIES           | —                   | —                | —<br>( 630)        | —<br>( 2)      |
|     | SHAFTESBURY PLC                     | 2,600               | 23               | —                  | —              |
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC           | 10,340              | 116              | 3,330              | 38             |
|     | GREAT PORTLAND ESTATES PLC          | 2,530               | 18               | —                  | —              |
|     | HANSTEEN HOLDINGS PLC               | 8,000               | 7                | —                  | —              |
|     | SAFESTORE HOLDINGS PLC              | 2,800               | 9                | —                  | —              |
|     | LONDONMETRIC PROPERTY PLC           | 4,300               | 6                | —                  | —              |
|     | SEGRO PLC                           | 6,110               | 26               | —                  | —              |
|     | WORKSPACE GROUP PLC                 | 760                 | 7                | 640                | 5              |
|     | REDEFINE INTERNATIONAL PLC          | 15,000              | 6                | —                  | —              |
|     | TRITAX BIG BOX REIT PLC             | 11,600<br>( —)      | 15<br>( 0.05669) | 4,600<br>( —)      | 5<br>(0.05669) |
|     | TRITAX BIG BOX REIT PLC-RTS         | —<br>( 845)         | —<br>( 0.05669)  | —<br>( 845)        | —<br>(0.05669) |
|     | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC        | 12,000<br>( —)      | 13<br>( 0.01589) | —<br>( —)          | —<br>(0.01589) |
|     | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC-RIGHTS | —<br>( 571)         | —<br>( 0.01589)  | —<br>( 571)        | —<br>(0.01589) |
|     | ASSURA PLC                          | 29,000<br>( 1,400)  | 16<br>( 0.82892) | —<br>( —)          | —<br>(0.12892) |
|     | ASSURA PLC-RIGHTS                   | —<br>( 1,400)       | —<br>( 0.12892)  | —<br>( 1,400)      | —<br>(0.12892) |
|     | PRIMARY HEALTH PROPERTIES           | 9,880<br>( 2,520)   | 10<br>( 2)       | —<br>( —)          | —<br>(0.02299) |
|     | PRIMARY HEALTH PROPERTIES-RIGHTS    | —<br>( 252)         | —<br>( 0.02299)  | —<br>( 252)        | —<br>(0.02299) |
|     | 小 計                                 | 144,937<br>( 6,988) | 477<br>( 3)      | 18,466<br>( 3,698) | 101<br>( 3)    |
|     | ユーロ                                 |                     | 千ユーロ             |                    | 千ユーロ           |
|     | ドイツ                                 |                     |                  |                    |                |
|     | HAMBORNER REIT AG                   | 700                 | 6                | —                  | —              |

| 銘 柄 |                                  | 買 付      |            | 売 付      |           |
|-----|----------------------------------|----------|------------|----------|-----------|
|     |                                  | 口 数      | 金 額        | 口 数      | 金 額       |
| 外 国 | ユーロ                              | 口        | 千ユーロ       | 口        | 千ユーロ      |
|     | ドイツ                              |          |            |          |           |
|     | ALSTRIA OFFICE REIT-AG           | 1,150    | 14         | ( —)     | ( 0.61)   |
|     | 小 計                              | 1,850    | 20         | ( —)     | ( 0.61)   |
|     | イタリア                             |          |            |          |           |
|     | BENI STABILI SPA                 | —        | —          | ( —)     | ( 0.2784) |
|     | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ     | 6,200    | 4          | —        | —         |
|     | 小 計                              | 6,200    | 4          | ( —)     | ( 0.2784) |
|     | フランス                             |          |            |          |           |
|     | AFFINE                           | 50       | 0.84292    | —        | —         |
|     | ICADE                            | 355      | 24         | —        | —         |
|     | ALTAREA                          | 30       | 5          | —        | —         |
|     |                                  | ( 1)     | ( 0.16565) | ( —)     | (0.18761) |
|     | ALTAREA-RIGHTS                   | —        | —          | 5        | 0.01414   |
|     |                                  | ( 14)    | ( 0.03991) | ( 9)     | (0.02565) |
|     | KLEPIERRE                        | 1,830    | 74         | 650      | 25        |
|     | GECINA SA                        | 373      | 44         | 80       | 8         |
|     | FONCIERE DES REGIONS             | 501      | 40         | 129      | 9         |
|     |                                  |          |            | ( —)     | (0.63293) |
|     | MERCIALYS                        | —        | —          | 230      | 4         |
|     | FONCIERE DES MURS                | 170      | 4          | —        | —         |
|     |                                  | ( 170)   | ( 4)       | ( 170)   | ( 4)      |
|     | UNIBAIL RODAMCO-NA               | 1,062    | 253        | 205      | 48        |
|     | FONCIERE DES MURS                | —        | —          | —        | —         |
|     |                                  | ( 170)   | ( 4)       | ( 170)   | ( 4)      |
|     | 小 計                              | 4,371    | 447        | 1,299    | 96        |
|     |                                  | ( 355)   | ( 8)       | ( 349)   | ( 9)      |
|     | オランダ                             |          |            |          |           |
|     | EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA       | 490      | 20         | —        | —         |
|     | WERELDHAVE NV                    | 497      | 23         | 190      | 9         |
|     | NSI NV                           | 2,000    | 8          | —        | —         |
|     | 小 計                              | 2,987    | 52         | 190      | 9         |
|     | スペイン                             |          |            |          |           |
|     | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM     | 860      | 7          | —        | —         |
|     |                                  | ( 585)   | ( 3)       | ( —)     | ( 1)      |
|     | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM-RTS | —        | —          | 17       | 0.01114   |
|     |                                  | ( 1,200) | ( 0.99772) | ( 1,183) | (0.98189) |
|     | HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI     | 2,000    | 23         | —        | —         |
|     | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA      | 2,500    | 24         | 450      | 4         |
|     |                                  |          |            | ( —)     | (0.39155) |
|     | AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA      | 1,420    | 17         | 920      | 11        |
|     | 小 計                              | 6,780    | 73         | 1,387    | 16        |
|     |                                  | ( 1,785) | ( 4)       | ( 1,183) | ( 2)      |
|     | ベルギー                             |          |            |          |           |
|     | BEFIMMO S. C. A.                 | 204      | 11         | —        | —         |
|     | COFINIMMO                        | 160      | 17         | —        | —         |
|     | RETAIL ESTATES                   | 87       | 6          | —        | —         |
|     | WERELDHAVE BELGIUM               | 30       | 3          | —        | —         |

| 銘 柄 |                                    | 買 付                |                  | 売 付               |                 |
|-----|------------------------------------|--------------------|------------------|-------------------|-----------------|
|     |                                    | 口 数                | 金 額              | 口 数               | 金 額             |
| 外 国 | ユーロ                                | 口                  | 千ユーロ             | 口                 | 千ユーロ            |
|     | ベルギー                               |                    |                  |                   |                 |
|     | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES     | 170                | 4                | —                 | —               |
|     | WAREHOUSES DE PAUW SCA             | 100                | 8                | —                 | —               |
|     | AEDIFICA                           | 350                | 22               | 110               | 6               |
|     | 小 計                                | 1,101              | 73               | 110               | 6               |
|     | アイルランド                             |                    |                  |                   |                 |
|     | GREEN REIT PLC                     | 7,000              | 10               | —                 | —               |
|     | HIBERNIA REIT PLC                  | 6,500              | 8                | —                 | —               |
|     | 小 計                                | 13,500             | 19               | —                 | —               |
|     | ユ ー ロ 計                            | 36,789<br>( 2,140) | 691<br>( 13)     | 2,986<br>( 1,532) | 129<br>( 12)    |
|     | 香港                                 |                    | 千香港ドル            |                   | 千香港ドル           |
|     | LINK REIT                          | 23,500             | 1,130            | 6,000             | 276             |
|     | PROSPERITY REIT                    | 23,000             | 75               | —                 | —               |
|     | CHAMPION REIT                      | 18,000             | 91               | —                 | —               |
|     | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT    | 16,000             | 64               | —                 | —               |
|     | FORTUNE REIT                       | 8,000              | 65               | —                 | —               |
|     | NEW CENTURY REIT                   | 6,000              | 18               | —                 | —               |
|     | 小 計                                | 94,500             | 1,446            | 6,000             | 276             |
|     | シンガポール                             |                    | 千シンガポールドル        |                   | 千シンガポールドル       |
|     | CAPITALAND MALL TRUST              | 31,600             | 66               | 8,300             | 16              |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT       | 25,200<br>( —)     | 60<br>( 0.03121) | 7,000<br>( —)     | 16<br>(0.07928) |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS       | —<br>( 712)        | —<br>( 0.04051)  | —<br>( 712)       | —<br>(0.04051)  |
|     | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST        | 10,300             | 15               | —                 | —               |
|     | SUNTEC REIT                        | 28,700<br>( —)     | 48<br>(△ 0.1384) | 9,000<br>( —)     | 14<br>(0.17332) |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST          | 15,000<br>( —)     | 15<br>(△ 0.0672) | —<br>( —)         | —<br>(0.16162)  |
|     | STARHILL GLOBAL REIT               | 20,000<br>( —)     | 15<br>(△ 0.1023) | —<br>( —)         | —<br>( 0.088)   |
|     | ASCOTT RESIDENCE TRUST             | 15,200<br>( —)     | 17<br>(△0.12487) | —<br>( —)         | —<br>(0.33142)  |
|     | FRASERS COMMERCIAL TRUST           | —<br>( —)          | —<br>(△0.02274)  | —<br>( —)         | —<br>(0.00645)  |
|     | KEPPEL REIT                        | 13,800<br>( —)     | 13<br>(△ 0.0308) | —<br>( —)         | —<br>( 0.0648)  |
|     | FRASERS CENTREPOINT TRUST          | 5,500              | 10               | —                 | —               |
|     | CDL HOSPITALITY TRUSTS             | 12,000<br>( —)     | 16<br>(△ 0.0136) | —<br>( —)         | —<br>( 0.0055)  |
|     | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST      | 9,100<br>( —)      | 13<br>(△ 0.4084) | —<br>( —)         | —<br>(0.22792)  |
|     | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST       | —<br>( —)          | —<br>(△ 0.0356)  | —<br>( —)         | —<br>( 0.1092)  |
|     | PARKWAY LIFE REAL ESTATE           | 5,000<br>( —)      | 12<br>(△ 0.0392) | —<br>( —)         | —<br>( 0.045)   |
|     | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | —<br>( —)          | —<br>(△ 0.0735)  | —<br>( —)         | —<br>( 0.1848)  |
|     | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST         | 7,000              | 10               | —<br>( —)         | —<br>( 0.0071)  |

| 銘 柄 |                                     | 買 付       |            | 売 付      |           |
|-----|-------------------------------------|-----------|------------|----------|-----------|
|     |                                     | 口 数       | 金 額        | 口 数      | 金 額       |
| 外 国 | シンガポール                              | 口         | 千シンガポールドル  | 口        | 千シンガポールドル |
|     | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST          | 20,800    | 30         | 5,400    | 8         |
|     | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST-RIGHTS   | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( 3,400)  | ( 4)       | —        | —         |
|     | CACHE LOGISTICS TRUST               | 19,000    | 16         | —        | —         |
|     |                                     |           |            | ( —)     | ( 0.0345) |
|     | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT    | 9,700     | 13         | —        | —         |
|     |                                     | ( —)      | (△0.01177) | ( —)     | (0.01694) |
|     | MAPLETREE GREATER CHINA COMM        | 12,700    | 12         | —        | —         |
|     |                                     |           |            | ( —)     | (0.31533) |
|     | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST          | 11,900    | 9          | —        | —         |
|     |                                     |           |            | ( —)     | (0.09112) |
|     | SPH REIT                            | 18,000    | 17         | —        | —         |
|     | OUE HOSPITALITY TRUST               | 9,600     | 7          | —        | —         |
|     |                                     | ( 4,488)  | ( 3)       | ( —)     | (0.77443) |
| 外 国 | OUE HOSPITALITY TRUST-RIGHTS        | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( 4,488)  | ( 0.77443) | ( 4,488) | (0.77443) |
|     | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI-RIGHTS | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( 500)    | ( —)       | —        | —         |
|     | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I        | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( —)      | (△0.04176) | ( —)     | (0.05742) |
|     | FRASERS HOSPITALITY TRUST           | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     |           |            | ( —)     | (0.13113) |
|     | 小 計                                 | 300,100   | 425        | 29,700   | 55        |
|     |                                     | ( 13,588) | ( 7)       | ( 5,200) | ( 3)      |
|     | オーストラリア                             |           | 千豪ドル       |          | 千豪ドル      |
|     | MIRVAC GROUP                        | 34,500    | 67         | 7,100    | 12        |
|     | INVESTA OFFICE FUND                 | 3,500     | 14         | —        | —         |
|     | CROMWELL PROPERTY GROUP             | 18,000    | 18         | 13,000   | 13        |
|     | CHARTER HALL RETAIL REIT            | 5,800     | 24         | 2,800    | 11        |
|     | GPT GROUP                           | 18,200    | 92         | 3,000    | 14        |
|     | ABACUS PROPERTY GROUP               | 4,400     | 14         | —        | —         |
|     | ALE PROPERTY GROUP                  | 2,000     | 8          | —        | —         |
|     | STOCKLAND TRUST GROUP               | 34,200    | 148        | 12,600   | 54        |
|     | DEXUS PROPERTY GROUP                | 10,490    | 84         | 1,900    | 13        |
|     | GOODMAN GROUP                       | 14,850    | 102        | —        | —         |
|     | CHARTER HALL GROUP                  | 3,500     | 16         | —        | —         |
|     | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR        | 3,000     | 9          | —        | —         |
|     | INGENIA COMMUNITIES GROUP           | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | (△ 4,390) | ( —)       | —        | —         |
|     | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA        | 7,500     | 17         | —        | —         |
|     | FEDERATION CENTRES                  | 3,000     | 8          | —        | —         |
|     |                                     |           |            | (32,200) | ( 89)     |
|     | AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT          | —         | —          | 900      | 2         |
|     | INDUSTRIA REIT-RIGHTS               | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( 225)    | ( —)       | —        | —         |
|     | NATIONAL STORAGE REIT               | 10,000    | 16         | —        | —         |
|     |                                     | ( 660)    | ( 1)       | ( —)     | (0.06554) |
|     | NATIONAL STORAGE REIT-RIGHTS        | —         | —          | —        | —         |
|     |                                     | ( 660)    | ( 0.06554) | ( 660)   | (0.06554) |
|     | SCENTRE GROUP                       | 61,000    | 280        | 18,700   | 81        |
|     | WESTFIELD CORP                      | 26,090    | 267        | 9,310    | 94        |



| 銘 柄 |                                       | 買 付                  |                  | 売 付                |                |
|-----|---------------------------------------|----------------------|------------------|--------------------|----------------|
|     |                                       | 口 数                  | 金 額              | 口 数                | 金 額            |
| 外 国 | オーストラリア                               | 口                    | 千豪ドル             | 口                  | 千豪ドル           |
|     | VICINITY CENTRES                      | 26,800<br>( 32,200)  | 88<br>( 89)      | —                  | —              |
|     | 小 計                                   | 286,830<br>( 29,355) | 1,283<br>( 90)   | 69,310<br>(32,860) | 299<br>( 89)   |
|     | ニュージーランド                              |                      | 千ニュージーランドドル      |                    | 千ニュージーランドドル    |
|     | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST       | 7,000<br>( 411)      | 15<br>( 0.88285) | —<br>( —)          | —<br>(0.02797) |
|     | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST - RTS | —<br>( 411)          | —<br>( 0.02797)  | —<br>( 411)        | —<br>(0.02797) |
|     | GOODMAN PROPERTY TRUST                | 12,100               | 15               | —                  | —              |
|     | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD             | —<br>( 266)          | —<br>( 0.40033)  | —                  | —              |
|     | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD-RIGHTS      | —                    | —                | ( 266)             | (0.01729)      |
|     | STRIDE PROPERTY LTD                   | 4,600                | 9                | —<br>( 6,560)      | —<br>( 14)     |
|     | ARGOSY PROPERTY LTD                   | 10,000               | 11               | —                  | —              |
|     | INVESTORE PROPERTY LTD                | —<br>( 1,640)        | —<br>( 2)        | —                  | —              |
|     | STRIDE STAPLED GROUP                  | —<br>( 6,560)        | —<br>( 11)       | —                  | —              |
|     | KIWI PROPERTY GROUP LTD               | 10,000               | 15               | —                  | —              |
|     | 小 計                                   | 43,700<br>( 9,288)   | 68<br>( 15)      | —<br>( 7,237)      | —<br>( 14)     |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 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 別 |          | 買 建        |            | 売 建      |          |
|-----|----------|------------|------------|----------|----------|
|     |          | 新規買付額      | 決 済 額      | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外 国 | REIT先物取引 | 百万円<br>423 | 百万円<br>438 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2015年9月8日～2016年9月6日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期   |
|---------------------|-------|
| (a) 期中の株式売買金額       | 131千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | —千円   |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | —     |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月8日～2016年9月6日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |               |                    |               |
| 為替先物取引 | 百万円<br>20,690 | 百万円<br>44          | %<br>0.2      | 百万円<br>21,882 | 百万円<br>679         | %<br>3.1      |
| 為替直物取引 | 1,146         | 684                | 59.7          | 187           | 45                 | 24.1          |
| 預金     | 531           | 531                | 100.0         | 531           | 531                | 100.0         |

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年9月6日現在)

## 外国投資信託証券

| 銘柄                                  | 期首(前期末) |       | 当 期 末 |        |     |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|--------|-----|
|                                     | 口 数     | 口 数   | 評 価 額 |        | 比 率 |
|                                     |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |     |
| (アメリカ)                              | 口       | 口     | 千米ドル  | 千円     | %   |
| ACADIA REALTY TRUST                 | 580     | 1,320 | 48    | 5,058  | 0.2 |
| AGREE REALTY CORP                   | 90      | 420   | 20    | 2,103  | 0.1 |
| ALEXANDERS INC                      | 38      | 81    | 34    | 3,617  | 0.2 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT        | 607     | 1,410 | 157   | 16,338 | 0.8 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC           | 330     | 630   | 28    | 2,905  | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES         | 1,040   | 2,180 | 111   | 11,513 | 0.6 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A             | 1,210   | 3,230 | 72    | 7,468  | 0.4 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC | 300     | —     | —     | —      | —   |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A            | 1,490   | 2,810 | 128   | 13,338 | 0.7 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC          | —       | 2,660 | 49    | 5,164  | 0.3 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC       | 130     | 130   | 1     | 191    | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC       | 250     | 250   | 3     | 399    | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST           | 500     | 500   | 3     | 353    | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 1,176   | 2,321 | 407   | 42,190 | 2.1 |
| BIOMED REALTY TRUST INC             | 1,910   | —     | —     | —      | —   |
| BOSTON PROPERTIES                   | 1,381   | 2,604 | 370   | 38,388 | 1.9 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST             | 1,320   | 2,730 | 44    | 4,649  | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC          | 1,560   | 4,690 | 134   | 13,954 | 0.7 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES           | 1,500   | 2,690 | 36    | 3,804  | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST               | 736     | 1,580 | 141   | 14,664 | 0.7 |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC        | 450     | —     | —     | —      | —   |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC         | 736     | 1,360 | 41    | 4,269  | 0.2 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES         | 282     | 1,310 | 19    | 2,069  | 0.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC              | 400     | 400   | 3     | 316    | 0.0 |
| CHAMBERS STREET PROPERTIES          | 2,710   | —     | —     | —      | —   |
| CHATHAM LODGING TRUST               | 360     | 360   | 7     | 756    | 0.0 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST            | 510     | 1,010 | 25    | 2,639  | 0.1 |
| COLONY STARWOOD HOMES               | —       | 880   | 27    | 2,853  | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC         | 1,030   | 2,160 | 51    | 5,307  | 0.3 |
| CORESITE REALTY CORP                | 180     | 609   | 48    | 5,021  | 0.2 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES         | 800     | 1,630 | 46    | 4,868  | 0.2 |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA         | 1,150   | 2,120 | 34    | 3,525  | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC              | 2,010   | 3,310 | 36    | 3,830  | 0.2 |
| CUBESMART                           | 1,520   | 3,330 | 93    | 9,714  | 0.5 |
| CYRUSONE INC                        | 440     | 1,300 | 66    | 6,845  | 0.3 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC            | 680     | 1,580 | 77    | 8,053  | 0.4 |
| DDR CORP                            | 2,860   | 5,310 | 100   | 10,419 | 0.5 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO          | 2,080   | 3,850 | 38    | 4,036  | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 1,246   | 2,600 | 260   | 26,962 | 1.3 |
| DOUGLAS EMMETT INC                  | 1,060   | 2,410 | 91    | 9,492  | 0.5 |
| DUKE REALTY CORP                    | 3,240   | 6,010 | 170   | 17,614 | 0.9 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY            | 660     | 1,210 | 52    | 5,390  | 0.3 |
| EPR PROPERTIES                      | 442     | 1,140 | 90    | 9,398  | 0.5 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC  | —       | 360   | 7     | 729    | 0.0 |
| EASTGROUP PROPERTIES                | 316     | 540   | 40    | 4,177  | 0.2 |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) |        | 当 期 末 |        |     |  |
|-------------------------------|---------|--------|-------|--------|-----|--|
|                               | 口 数     | 口 数    | 評 価 額 |        | 比 率 |  |
|                               |         |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |     |  |
| (アメリカ)                        | 口       | 口      | 千米ドル  | 千円     | %   |  |
| EDUCATION REALTY TRUST INC    | 310     | 1,160  | 52    | 5,488  | 0.3 |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN  | 790     | 2,280  | 49    | 5,158  | 0.3 |  |
| EQUITY COMMONWEALTH           | 1,130   | 2,100  | 66    | 6,890  | 0.3 |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES   | 737     | 1,297  | 102   | 10,596 | 0.5 |  |
| EQUITY ONE INC                | 730     | 1,680  | 52    | 5,466  | 0.3 |  |
| EQUITY RESIDENTIAL            | 3,172   | 6,190  | 399   | 41,420 | 2.0 |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC      | 573     | 1,158  | 261   | 27,099 | 1.3 |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC       | 1,040   | 2,170  | 177   | 18,403 | 0.9 |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST     | 641     | 1,223  | 195   | 20,206 | 1.0 |  |
| FELCOR LODGING TRUST INC      | 1,130   | 3,130  | 21    | 2,230  | 0.1 |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR    | 980     | 2,020  | 58    | 6,094  | 0.3 |  |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST    | 400     | 400    | 4     | 430    | 0.0 |  |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A   | —       | 3,900  | 93    | 9,717  | 0.5 |  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST   | —       | 1,005  | 20    | 2,170  | 0.1 |  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C  | 610     | 1,850  | 23    | 2,462  | 0.1 |  |
| GEO GROUP INC/THE             | 639     | 999    | 20    | 2,157  | 0.1 |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE  | 690     | 3,060  | 105   | 10,927 | 0.5 |  |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 5,580   | 10,270 | 300   | 31,163 | 1.5 |  |
| GETTY REALTY CORP             | 190     | 191    | 4     | 469    | 0.0 |  |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP     | 100     | 100    | 1     | 190    | 0.0 |  |
| GLOBAL NET LEASE INC          | —       | 3,800  | 32    | 3,326  | 0.2 |  |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME  | 590     | 1,290  | 30    | 3,208  | 0.2 |  |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC   | 370     | —      | —     | —      | —   |  |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST       | —       | 6,940  | 66    | 6,931  | 0.3 |  |
| HCP INC                       | 4,200   | 8,210  | 320   | 33,239 | 1.6 |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC   | 920     | 1,800  | 63    | 6,606  | 0.3 |  |
| HEALTH CARE REIT INC          | 3,177   | —      | —     | —      | —   |  |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA   | 1,240   | 2,580  | 87    | 9,066  | 0.4 |  |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST      | 597     | 597    | 11    | 1,180  | 0.1 |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC      | 920     | 1,750  | 93    | 9,704  | 0.5 |  |
| HOME PROPERTIES INC           | 566     | —      | —     | —      | —   |  |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST  | 1,440   | 2,960  | 90    | 9,368  | 0.5 |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC     | 6,690   | 12,810 | 223   | 23,105 | 1.1 |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN  | 600     | 2,080  | 70    | 7,274  | 0.4 |  |
| INLAND REAL ESTATE CORP       | 600     | —      | —     | —      | —   |  |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST   | 700     | 1,960  | 12    | 1,342  | 0.1 |  |
| IRON MOUNTAIN INC             | 1,500   | 4,300  | 166   | 17,280 | 0.8 |  |
| KILROY REALTY CORP            | 800     | 1,500  | 108   | 11,250 | 0.6 |  |
| KIMCO REALTY CORP             | 3,730   | 7,460  | 224   | 23,309 | 1.1 |  |
| KITE REALTY GROUP TRUST       | 810     | 1,280  | 37    | 3,840  | 0.2 |  |
| LTC PROPERTIES INC            | 330     | 580    | 30    | 3,159  | 0.2 |  |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES      | 1,140   | 1,690  | 45    | 4,695  | 0.2 |  |
| LEXINGTON REALTY TRUST        | 2,040   | 3,560  | 38    | 4,005  | 0.2 |  |
| LIBERTY PROPERTY TRUST        | 1,430   | 2,370  | 99    | 10,268 | 0.5 |  |
| LIFE STORAGE INC              | —       | 737    | 67    | 7,017  | 0.3 |  |
| MACERICH CO /THE              | 1,280   | 2,188  | 179   | 18,569 | 0.9 |  |
| MACK-CALI REALTY CORP         | 870     | 1,410  | 40    | 4,166  | 0.2 |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC  | 2,100   | 4,090  | 62    | 6,444  | 0.3 |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM    | 654     | 1,370  | 131   | 13,601 | 0.7 |  |
| MONMOUTH REIT-CLASS A         | 290     | 1,190  | 17    | 1,787  | 0.1 |  |

| 銘<br>柄                              | 期首(前期末) |       | 当 期 末 |         |     |  |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|---------|-----|--|
|                                     | 口 数     | 口 数   | 評 価 額 |         | 比 率 |  |
|                                     |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |     |  |
| (アメリカ)                              | 口       | 口     | 千米ドル  | 千円      | %   |  |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC      | 1,450   | 2,710 | 28    | 2,973   | 0.1 |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC           | 352     | 550   | 44    | 4,596   | 0.2 |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC      | 1,060   | 2,530 | 128   | 13,320  | 0.7 |  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES         | —       | 400   | 8     | 844     | 0.0 |  |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP         | 520     | 1,780 | 22    | 2,294   | 0.1 |  |
| NEW YORK REIT INC                   | 1,580   | 2,960 | 28    | 2,956   | 0.1 |  |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC      | —       | 380   | 8     | 830     | 0.0 |  |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP       | 2,710   | —     | —     | —       | —   |  |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP       | —       | 3,310 | 44    | 4,629   | 0.2 |  |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP        | —       | 541   | 5     | 586     | 0.0 |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS          | 1,340   | 2,860 | 104   | 10,853  | 0.5 |  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC          | 80      | 80    | 1     | 206     | 0.0 |  |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA            | 167     | 405   | 45    | 4,746   | 0.2 |  |
| PARKWAY PROPERTIES INC              | 1,000   | 1,000 | 18    | 1,884   | 0.1 |  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST             | 550     | 1,350 | 40    | 4,180   | 0.2 |  |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST         | 460     | 1,400 | 34    | 3,596   | 0.2 |  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST             | 740     | 2,100 | 44    | 4,625   | 0.2 |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A        | 1,310   | 2,290 | 49    | 5,169   | 0.3 |  |
| POST PROPERTIES INC                 | 500     | 970   | 65    | 6,792   | 0.3 |  |
| PROLOGIS INC                        | 4,750   | 9,160 | 494   | 51,225  | 2.5 |  |
| PUBLIC STORAGE                      | 1,266   | 2,565 | 581   | 60,265  | 3.0 |  |
| QTS REALTY TRUST INC CL A           | 330     | 850   | 46    | 4,801   | 0.2 |  |
| RLJ LODGING TRUST                   | 1,100   | 2,270 | 52    | 5,432   | 0.3 |  |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES         | 790     | 1,640 | 31    | 3,285   | 0.2 |  |
| REALTY INCOME CORP                  | 2,056   | 4,540 | 300   | 31,169  | 1.5 |  |
| REGENCY CENTERS CORP                | 906     | 1,859 | 150   | 15,615  | 0.8 |  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN        | 910     | 1,510 | 34    | 3,535   | 0.2 |  |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A          | 2,420   | 4,290 | 73    | 7,622   | 0.4 |  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC       | 350     | 850   | 19    | 2,009   | 0.1 |  |
| ROUSE PROPERTIES INC                | 280     | —     | —     | —       | —   |  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES        | 535     | 810   | 43    | 4,458   | 0.2 |  |
| SL GREEN REALTY CORP                | 917     | 1,730 | 202   | 20,928  | 1.0 |  |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC          | 430     | 890   | 22    | 2,372   | 0.1 |  |
| SAUL CENTERS INC                    | 90      | 90    | 6     | 630     | 0.0 |  |
| SELECT INCOME REIT                  | 350     | 860   | 23    | 2,470   | 0.1 |  |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST           | 2,250   | 4,080 | 93    | 9,688   | 0.5 |  |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT         | —       | 140   | 6     | 651     | 0.0 |  |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP        | 250     | 250   | 4     | 488     | 0.0 |  |
| SIMON PROPERTY GROUP INC            | 2,782   | 5,348 | 1,158 | 120,057 | 5.9 |  |
| SOVRAN SELF STORAGE INC             | 282     | —     | —     | —       | —   |  |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC           | 4,130   | 8,250 | 109   | 11,393  | 0.6 |  |
| STAG INDUSTRIAL INC                 | 530     | 1,130 | 28    | 2,926   | 0.1 |  |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST | 370     | —     | —     | —       | —   |  |
| STORE CAPITAL CORP                  | 330     | 2,630 | 77    | 8,075   | 0.4 |  |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC      | 2,110   | —     | —     | —       | —   |  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC         | 880     | 1,450 | 20    | 2,094   | 0.1 |  |
| SUN COMMUNITIES INC                 | 438     | 1,031 | 79    | 8,230   | 0.4 |  |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC        | 1,893   | 4,110 | 55    | 5,773   | 0.3 |  |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER        | 920     | 1,740 | 70    | 7,322   | 0.4 |  |
| TAUBMAN CENTERS INC                 | 507     | 1,066 | 84    | 8,742   | 0.4 |  |

| 銘柄                                       |  | 期首(前期末)   | 当 期 末   |         |        |           |
|------------------------------------------|--|-----------|---------|---------|--------|-----------|
|                                          |  | 口 数       | 口 数     | 評 価 額   |        | 比 率       |
|                                          |  |           |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |           |
| (アメリカ)                                   |  | 口         | 口       | 千米ドル    | 千円     | %         |
| TERRENO REALTY CORP                      |  | 330       | 960     | 26      | 2,701  | 0.1       |
| UDR INC                                  |  | 2,320     | 4,640   | 168     | 17,420 | 0.9       |
| UMH PROPERTIES INC                       |  | 110       | 110     | 1       | 137    | 0.0       |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME             |  | 90        | 200     | 12      | 1,297  | 0.1       |
| URBAN EDGE PROPERTIES                    |  | 660       | 1,610   | 46      | 4,857  | 0.2       |
| URSTADT BIDDLE-CL A                      |  | 180       | 480     | 11      | 1,146  | 0.1       |
| VENTAS INC                               |  | 2,945     | 5,910   | 433     | 44,947 | 2.2       |
| VEREIT INC                               |  | 7,440     | 16,750  | 175     | 18,133 | 0.9       |
| VORNADO REALTY TRUST                     |  | 1,599     | 3,123   | 323     | 33,564 | 1.6       |
| WP CAREY INC                             |  | 928       | 1,630   | 108     | 11,233 | 0.6       |
| WP GLIMCHER INC                          |  | 1,910     | —       | —       | —      | —         |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC               |  | —         | 3,190   | 44      | 4,577  | 0.2       |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV               |  | 770       | 1,230   | 40      | 4,173  | 0.2       |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS              |  | 880       | 1,990   | 82      | 8,574  | 0.4       |
| WELLTOWER INC                            |  | —         | 6,230   | 477     | 49,504 | 2.4       |
| WHITESTONE REIT                          |  | 120       | 120     | 1       | 180    | 0.0       |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC               |  | 1,030     | 1,920   | 32      | 3,331  | 0.2       |
| 小 計                                      |  | 口 数 ・ 金 額 | 170,619 | 346,558 | 14,179 | 1,469,037 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                            |  |           | 147     | 148     | —      | <72.0%>   |
| (カナダ)                                    |  |           |         | 千カナダドル  |        |           |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT             |  | 380       | 580     | 21      | 1,728  | 0.1       |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT             |  | 720       | 1,420   | 18      | 1,449  | 0.1       |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST             |  | 332       | 310     | 15      | 1,278  | 0.1       |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES      |  | 110       | 110     | 3       | 249    | 0.0       |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR             |  | 400       | —       | —       | —      | —         |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR             |  | —         | 400     | 5       | 479    | 0.0       |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA             |  | 520       | 1,410   | 42      | 3,434  | 0.2       |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST             |  | 330       | 620     | 30      | 2,431  | 0.1       |
| CHOICE PROPERTIES REIT                   |  | 320       | 440     | 6       | 494    | 0.0       |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U             |  | 510       | 1,220   | 20      | 1,624  | 0.1       |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT           |  | 770       | 770     | 11      | 936    | 0.0       |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS |  | 430       | 930     | 15      | 1,210  | 0.1       |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT  |  | 200       | 200     | 1       | 130    | 0.0       |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS |  | 370       | 1,500   | 13      | 1,079  | 0.1       |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME             |  | 300       | 300     | 12      | 989    | 0.0       |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS             |  | 1,270     | 2,330   | 54      | 4,355  | 0.2       |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME             |  | 320       | —       | —       | —      | —         |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST             |  | 190       | 190     | 1       | 125    | 0.0       |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE             |  | —         | 560     | 7       | 563    | 0.0       |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES             |  | 140       | 790     | 15      | 1,252  | 0.1       |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI             |  | 110       | 110     | 1       | 117    | 0.0       |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS              |  | 220       | 820     | 12      | 1,036  | 0.1       |
| NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT             |  | 120       | —       | —       | —      | —         |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST   |  | —         | 320     | 6       | 522    | 0.0       |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT             |  | 130       | 940     | 10      | 806    | 0.0       |
| ONEREIT                                  |  | 210       | 210     | 0.7728  | 61     | 0.0       |
| PLAZA RETAIL REIT                        |  | 330       | 330     | 1       | 131    | 0.0       |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE              |  | 500       | 2,000   | 11      | 900    | 0.0       |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR              |  | 1,430     | 2,980   | 83      | 6,678  | 0.3       |
| SLATE RETAIL REIT                        |  | —         | 266     | 3       | 298    | 0.0       |

| 銘 柄                                |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |        |         |     |
|------------------------------------|---------------|---------|---------|--------|---------|-----|
|                                    |               | 口 数     | 口 数     | 評 価 額  |         | 比 率 |
|                                    |               |         |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |     |
| (カナダ)                              |               | 口       | 口       | 千カナダドル | 千円      | %   |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |               | 630     | 1,010   | 35     | 2,882   | 0.1 |
| 小 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 11,292  | 23,066  | 464    | 37,249  |     |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 27      | 28      | —      | <1.8%>  |     |
| (イギリス)                             |               |         |         | 千英ポンド  |         |     |
| BRITISH LAND                       |               | 9,100   | 17,810  | 118    | 16,387  | 0.8 |
| DERWENT LONDON PLC                 |               | 1,049   | 2,030   | 55     | 7,706   | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC               |               | 980     | 2,540   | 19     | 2,671   | 0.1 |
| HAMMERSON PLC                      |               | 6,940   | 12,760  | 75     | 10,351  | 0.5 |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD           |               | 900     | 900     | 1      | 223     | 0.0 |
| MUCKLOW < A & J > GROUP PLC        |               | 560     | —       | —      | —       | —   |
| INTU PROPERTIES PLC                |               | 9,150   | 12,760  | 38     | 5,375   | 0.3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES          |               | 630     | —       | —      | —       | —   |
| SHAFTESBURY PLC                    |               | 2,240   | 4,840   | 47     | 6,571   | 0.3 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC          |               | 7,260   | 14,270  | 156    | 21,579  | 1.1 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC         |               | 3,090   | 5,620   | 38     | 5,279   | 0.3 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST |               | 3,000   | 3,000   | 1      | 240     | 0.0 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC              |               | 7,200   | 15,200  | 17     | 2,434   | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC             |               | 1,688   | 4,488   | 17     | 2,369   | 0.1 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC          |               | 5,100   | 9,400   | 15     | 2,123   | 0.1 |
| SEGRO PLC                          |               | 6,090   | 12,200  | 54     | 7,551   | 0.4 |
| WORKSPACE GROUP PLC                |               | 1,380   | 1,500   | 10     | 1,458   | 0.1 |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC         |               | 6,130   | 21,130  | 8      | 1,226   | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC            |               | 4,800   | 11,800  | 17     | 2,345   | 0.1 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC       |               | —       | 12,000  | 13     | 1,923   | 0.1 |
| ASSURA PLC                         |               | 7,000   | 37,400  | 21     | 3,008   | 0.1 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES          |               | —       | 12,400  | 13     | 1,901   | 0.1 |
| 小 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 84,287  | 214,048 | 745    | 102,730 |     |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20      | 20      | —      | <5.0%>  |     |
| (ユーロ…ドイツ)                          |               |         |         | 千ユーロ   |         |     |
| HAMBORNER REIT AG                  |               | 386     | 1,086   | 11     | 1,309   | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG             |               | 620     | 1,770   | 22     | 2,573   | 0.1 |
| 小 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 1,006   | 2,856   | 33     | 3,883   |     |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2       | —      | <0.2%>  |     |
| (ユーロ…イタリア)                         |               |         |         |        |         |     |
| BENI STABILI SPA                   |               | 11,600  | 11,600  | 6      | 738     | 0.0 |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ       |               | 1,070   | 7,270   | 5      | 613     | 0.0 |
| 小 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 12,670  | 18,870  | 11     | 1,351   |     |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2       | —      | <0.1%>  |     |
| (ユーロ…フランス)                         |               |         |         |        |         |     |
| AFFINE                             |               | —       | 50      | 0.7735 | 89      | 0.0 |
| ICADE                              |               | 321     | 676     | 48     | 5,550   | 0.3 |
| ALTAREA                            |               | 14      | 45      | 8      | 928     | 0.0 |
| KLEPIERRE                          |               | 1,983   | 3,163   | 134    | 15,544  | 0.8 |
| GECINA SA                          |               | 306     | 599     | 84     | 9,717   | 0.5 |
| FONCIERE DES REGIONS               |               | 405     | 777     | 65     | 7,593   | 0.4 |
| ANF IMMOBILIER                     |               | 60      | 60      | 1      | 152     | 0.0 |
| MERCIALYS                          |               | 520     | 290     | 6      | 711     | 0.0 |
| FONCIERE DES MURS                  |               | —       | 170     | 4      | 539     | 0.0 |

| 銘 柄                                 |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |         |     |
|-------------------------------------|---------------|---------|---------|-----------|---------|-----|
|                                     |               | 口 数     | 口 数     | 評 価 額     |         | 比 率 |
|                                     |               |         |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |     |
| (ユーロ…フランス)                          |               | 口       | 口       | 千ユーロ      | 千円      | %   |
| UNIBAIL RODAMCO-NA                  |               | 853     | 1,710   | 424       | 49,050  | 2.4 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 4,462   | 7,540   | 778       | 89,877  |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8       | 10      | —         | <4.4%>  |     |
| (ユーロ…オランダ)                          |               |         |         |           |         |     |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA         |               | 364     | 854     | 34        | 4,030   | 0.2 |
| VASTNED RETAIL NV                   |               | 232     | 232     | 8         | 1,002   | 0.0 |
| WERELDHAVE NV                       |               | 343     | 650     | 28        | 3,266   | 0.2 |
| NSI NV                              |               | 870     | 2,870   | 11        | 1,272   | 0.1 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 1,809   | 4,606   | 82        | 9,571   |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 4       | —         | <0.5%>  |     |
| (ユーロ…スペイン)                          |               |         |         |           |         |     |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM        |               | 340     | 1,785   | 11        | 1,300   | 0.1 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI        |               | —       | 2,000   | 24        | 2,770   | 0.1 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA         |               | 3,066   | 5,116   | 53        | 6,200   | 0.3 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA         |               | 800     | 1,300   | 15        | 1,796   | 0.1 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 4,206   | 10,201  | 104       | 12,068  |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 4       | —         | <0.6%>  |     |
| (ユーロ…ベルギー)                          |               |         |         |           |         |     |
| BEFIMMO S. C. A.                    |               | 176     | 380     | 22        | 2,633   | 0.1 |
| COFINIMMO                           |               | 180     | 340     | 37        | 4,354   | 0.2 |
| RETAIL ESTATES                      |               | —       | 87      | 6         | 805     | 0.0 |
| WERELDHAVE BELGIUM                  |               | —       | 30      | 3         | 387     | 0.0 |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES      |               | —       | 170     | 4         | 491     | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA              |               | 145     | 245     | 21        | 2,512   | 0.1 |
| AEDIFICA                            |               | 85      | 325     | 23        | 2,749   | 0.1 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 586     | 1,577   | 120       | 13,934  |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 7       | —         | <0.7%>  |     |
| (ユーロ…アイルランド)                        |               |         |         |           |         |     |
| GREEN REIT PLC                      |               | 6,500   | 13,500  | 19        | 2,287   | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC                   |               | 6,000   | 12,500  | 17        | 2,020   | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES        |               | 4,000   | 4,000   | 4         | 544     | 0.0 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 16,500  | 30,000  | 42        | 4,852   |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3       | —         | <0.2%>  |     |
| ユ ー ロ 計                             | 口 数 ・ 金 額     | 41,239  | 75,650  | 1,174     | 135,539 |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 26      | 32      | —         | <6.6%>  |     |
| (香港)                                |               |         |         | 千香港ドル     |         |     |
| LINK REIT                           |               | 20,500  | 38,000  | 2,175     | 29,064  | 1.4 |
| PROSPERITY REIT                     |               | 8,000   | 31,000  | 108       | 1,449   | 0.1 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |               | 12,000  | 12,000  | 60        | 812     | 0.0 |
| CHAMPION REIT                       |               | 31,000  | 49,000  | 238       | 3,188   | 0.2 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT     |               | 7,000   | 23,000  | 115       | 1,536   | 0.1 |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT        |               | 6,000   | 6,000   | 13        | 173     | 0.0 |
| FORTUNE REIT                        |               | 12,000  | 20,000  | 200       | 2,682   | 0.1 |
| NEW CENTURY REIT                    |               | —       | 6,000   | 15        | 205     | 0.0 |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN        |               | 4,000   | 4,000   | 14        | 188     | 0.0 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 100,500 | 189,000 | 2,941     | 39,302  |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8       | 9       | —         | <1.9%>  |     |
| (シンガポール)                            |               |         |         | 千シンガポールドル |         |     |
| CAPITALAND MALL TRUST               |               | 25,500  | 48,800  | 105       | 8,045   | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT        |               | 19,000  | 37,200  | 92        | 7,041   | 0.3 |



| 銘                                   | 柄             | 期首(前期末) |         | 当 期 末     |          |     |
|-------------------------------------|---------------|---------|---------|-----------|----------|-----|
|                                     |               | 口 数     | 口 数     | 評 価 額     |          | 比 率 |
|                                     |               |         |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額   |     |
| (シンガポール)                            |               | 口       | 口       | 千シンガポールドル | 千円       | %   |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST         |               | 20,000  | 30,300  | 48        | 3,677    | 0.2 |
| SUNTEC REIT                         |               | 24,100  | 43,800  | 75        | 5,767    | 0.3 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST           |               | 16,800  | 31,800  | 34        | 2,609    | 0.1 |
| STARHILL GLOBAL REIT                |               | 11,000  | 31,000  | 25        | 1,952    | 0.1 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST              |               | 7,800   | 23,000  | 26        | 1,992    | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST            |               | 6,000   | 6,000   | 8         | 636      | 0.0 |
| KEPPEL REIT                         |               | 17,000  | 30,800  | 34        | 2,633    | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST           |               | 3,600   | 9,100   | 19        | 1,493    | 0.1 |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST          |               | 8,000   | 8,000   | 4         | 326      | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS              |               | 5,000   | 17,000  | 23        | 1,784    | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST       |               | 5,180   | 14,280  | 23        | 1,809    | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST        |               | 4,000   | 4,000   | 5         | 404      | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE            |               | 3,000   | 8,000   | 19        | 1,520    | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST  |               | 21,000  | 21,000  | 7         | 601      | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST          |               | 10,000  | 17,000  | 30        | 2,290    | 0.1 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST          |               | 12,000  | 30,800  | 49        | 3,761    | 0.2 |
| CACHE LOGISTICS TRUST               |               | 5,000   | 24,000  | 21        | 1,676    | 0.1 |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT    |               | 3,525   | 13,225  | 18        | 1,413    | 0.1 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT        |               | 8,000   | 8,000   | 4         | 314      | 0.0 |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM        |               | 11,500  | 24,200  | 26        | 2,059    | 0.1 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST          |               | 4,000   | 15,900  | 11        | 873      | 0.0 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST          |               | 9,000   | 9,000   | 5         | 415      | 0.0 |
| SPH REIT                            |               | 5,000   | 23,000  | 22        | 1,711    | 0.1 |
| QUE HOSPITALITY TRUST               |               | 4,000   | 18,088  | 12        | 931      | 0.0 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI        |               | 5,000   | 5,000   | 3         | 259      | 0.0 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI-RIGHTS |               | —       | 500     | 0.025     | 1        | 0.0 |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I        |               | 5,800   | 5,800   | 3         | 303      | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST           |               | 4,000   | 4,000   | 3         | 239      | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT                      |               | 10,500  | 10,500  | 12        | 957      | 0.0 |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 294,305 | 573,093 | 779       | 59,506   |     |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 30      | 31      | —         | < 2.9% > |     |
| (オーストラリア)                           |               |         |         | 千豪ドル      |          |     |
| BWP TRUST                           |               | 6,100   | 6,100   | 20        | 1,576    | 0.1 |
| MIRVAC GROUP                        |               | 35,800  | 63,200  | 141       | 11,152   | 0.5 |
| INVESTA OFFICE FUND                 |               | 6,000   | 9,500   | 43        | 3,390    | 0.2 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP             |               | 13,330  | 18,330  | 18        | 1,458    | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT            |               | 2,200   | 5,200   | 22        | 1,761    | 0.1 |
| ASPEN GROUP                         |               | 825     | 825     | 0.98175   | 77       | 0.0 |
| GPT GROUP                           |               | 16,300  | 31,500  | 163       | 12,904   | 0.6 |
| ABACUS PROPERTY GROUP               |               | 2,015   | 6,415   | 19        | 1,500    | 0.1 |
| ALE PROPERTY GROUP                  |               | 1,330   | 3,330   | 14        | 1,149    | 0.1 |
| STOCKLAND TRUST GROUP               |               | 19,800  | 41,400  | 199       | 15,753   | 0.8 |
| DEXUS PROPERTY GROUP                |               | 7,620   | 16,210  | 156       | 12,323   | 0.6 |
| GOODMAN GROUP                       |               | 13,450  | 28,300  | 214       | 16,877   | 0.8 |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP          |               | 480     | 480     | 3         | 270      | 0.0 |
| CHARTER HALL GROUP                  |               | 2,300   | 5,800   | 32        | 2,572    | 0.1 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR        |               | 1,032   | 4,032   | 12        | 1,016    | 0.0 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP           |               | 5,268   | 878     | 2         | 197      | 0.0 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA        |               | 8,470   | 15,970  | 36        | 2,893    | 0.1 |
| FEDERATION CENTRES                  |               | 29,200  | —       | —         | —        | —   |

| 銘 柄                              |               | 期首(前期末)   | 当 期 末     |             |           |     |
|----------------------------------|---------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-----|
|                                  |               | 口 数       | 口 数       | 評 価 額       |           | 比 率 |
|                                  |               |           |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |     |
| (オーストラリア)                        |               | 口         | 口         | 千豪ドル        | 千円        | %   |
| ARENA REIT                       |               | 3,700     | 3,700     | 8           | 635       | 0.0 |
| AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT       |               | 900       | —         | —           | —         | —   |
| INDUSTRIA REIT                   |               | 900       | 900       | 1           | 153       | 0.0 |
| INDUSTRIA REIT-RIGHTS            |               | —         | 225       | 0.01125     | 0.886     | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT            |               | 2,200     | 12,860    | 21          | 1,661     | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L     |               | 1,800     | 1,800     | 5           | 441       | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP               |               | 4,000     | 4,000     | 3           | 313       | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                    |               | 48,100    | 90,400    | 442         | 34,896    | 1.7 |
| WESTFIELD CORP                   |               | 17,020    | 33,800    | 343         | 27,027    | 1.3 |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST       |               | 1,800     | 1,800     | 5           | 404       | 0.0 |
| VICINITY CENTRES                 |               | —         | 59,000    | 192         | 15,199    | 0.7 |
| 小 計                              | 口 数 ・ 金 額     | 251,940   | 465,955   | 2,127       | 167,607   |     |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 27        | 27        | —           | <8.2%>    |     |
| (ニュージーランド)                       |               |           |           | 千ニュージーランドドル |           |     |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND  |               | 14,700    | 14,700    | 19          | 1,457     | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST  |               | 1,850     | 9,261     | 21          | 1,608     | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST           |               | 7,800     | 19,900    | 27          | 2,108     | 0.1 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD        |               | 3,200     | 3,466     | 5           | 438       | 0.0 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD-RIGHTS |               | 266       | —         | —           | —         | —   |
| STRIDE PROPERTY LTD              |               | 1,960     | —         | —           | —         | —   |
| ARGOSY PROPERTY LTD              |               | 5,400     | 15,400    | 17          | 1,357     | 0.1 |
| INVESTORE PROPERTY LTD           |               | —         | 1,640     | 2           | 201       | 0.0 |
| STRIDE STAPLED GROUP             |               | —         | 6,560     | 13          | 1,037     | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD          |               | 11,666    | 21,666    | 34          | 2,574     | 0.1 |
| 小 計                              | 口 数 ・ 金 額     | 46,842    | 92,593    | 142         | 10,783    |     |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8         | 8         | —           | <0.5%>    |     |
| (イスラエル)                          |               |           |           | 千新シェケル      |           |     |
| REIT 1 LTD                       |               | 800       | 800       | 9           | 253       | 0.0 |
| 小 計                              | 口 数 ・ 金 額     | 800       | 800       | 9           | 253       |     |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 1         | —           | <0.0%>    |     |
| 合 計                              | 口 数 ・ 金 額     | 1,001,824 | 1,980,763 | —           | 2,022,010 |     |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 294       | 304       | —           | <99.1%>   |     |

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 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 |
| 外 国   | REIT先物取引 | DJREA<br>FTEPR | 百万円   | 百万円   |
|       |          |                | 23    | —     |
|       |          |                | 2     | —     |

\*単位未満は切り捨て。

\*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## ○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

| 項 目          | 当 期       | 末     |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
| 投資証券         | 千円        | %     |
|              | 2,022,010 | 97.7  |
| コール・ローン等、その他 | 46,646    | 2.3   |
| 投資信託財産総額     | 2,068,656 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（2,046,188千円）の投資信託財産総額（2,068,656千円）に対する比率は98.9%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝103.60円、1カナダドル＝80.12円、1英ポンド＝137.85円、1ユーロ＝115.43円、1香港ドル＝13.36円、1シンガポールドル＝76.33円、1豪ドル＝78.78円、1ニュージーランドドル＝75.68円、1新シェケル＝27.52円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月6日現在)

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 4,100,849,639  |
| コール・ローン等        | 32,866,823     |
| 投資証券(評価額)       | 2,022,010,578  |
| 未収入金            | 2,033,011,620  |
| 未収配当金           | 1,214,531      |
| 差入委託証拠金         | 11,746,087     |
| (B) 負債          | 2,061,274,647  |
| 未払金             | 2,058,624,123  |
| 未払解約金           | 2,374,694      |
| 未払利息            | 30             |
| その他未払費用         | 275,800        |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 2,039,574,992  |
| 元本              | 1,406,148,913  |
| 次期繰越損益金         | 633,426,079    |
| (D) 受益権総口数      | 1,406,148,913口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,505円        |

(注) 期首元本額は872,066,198円、期中追加設定元本額は802,567,364円、期中一部解約元本額は268,484,649円、1口当たり純資産額は1.4505円です。

(注) 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  
・野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型 599,854,153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) 483,218,078円  
・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 323,076,682円

## ○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

| 項 目                | 当 期          |
|--------------------|--------------|
|                    | 円            |
| (A) 配当等収益          | 50,433,014   |
| 受取配当金              | 50,423,587   |
| 受取利息               | 15,003       |
| 支払利息               | △ 5,576      |
| (B) 有価証券売買損益       | 221,268,546  |
| 売買益                | 590,084,133  |
| 売買損                | △368,815,587 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 4,552,598    |
| 取引益                | 7,080,874    |
| 取引損                | △ 2,528,276  |
| (D) 保管費用等          | △ 2,333,629  |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 273,920,529  |
| (F) 前期繰越損益金        | 156,361,047  |
| (G) 追加信託差損益金       | 290,866,206  |
| (H) 解約差損益金         | △ 87,721,703 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 633,426,079  |
| 次期繰越損益金(I)         | 633,426,079  |

\* 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(G)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(H)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。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

### ＜お申し込み時の留意点＞

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

（2016年9月6日現在）

| 年 月       | 日     |
|-----------|-------|
| 2016年 9 月 | －     |
| 10月       | －     |
| 11月       | 22、24 |
| 12月       | 22、26 |

※ 2016年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ（<http://www.nomura-am.co.jp/>）にも掲載いたしております。