

平成28年8月8日

各位

会社名 野村アセットマネジメント株式会社  
(管理会社コード 13064)  
代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
問い合わせ先 商品企画部長 渡部 昭裕  
TEL 03-3241-9511

## 上場ETF(管理会社:野村アセットマネジメント)に関する日々の開示事項 (2/2)

野村アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成28年8月5日の状況をご報告します。

### 上場ETF銘柄(30銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	<a href="#">TOPIX連動型上場投資信託</a>	1306	東証
2	<a href="#">上海株式指数・上証50連動型上場投資信託</a>	1309	東証
3	<a href="#">TOPIX Core 30連動型上場投資信託</a>	1311	東証
4	<a href="#">ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託</a>	1312	東証
5	<a href="#">日経300株価指数連動型上場投資信託</a>	1319	東名札福
6	<a href="#">日経225連動型上場投資信託</a>	1321	東証
7	<a href="#">NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top 40連動型上場投信</a>	1323	東証
8	<a href="#">NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS連動型上場投信</a>	1324	東証
9	<a href="#">NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信</a>	1325	東証
10	<a href="#">金価格連動型上場投資信託</a>	1328	東証
11	<a href="#">NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信</a>	1343	東証
12	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信</a>	1357	東証
13	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信</a>	1470	東証
14	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信</a>	1471	東証
15	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信</a>	1472	東証
16	<a href="#">NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信</a>	1480	東証
17	<a href="#">NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信</a>	1545	東証
18	<a href="#">NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株30種平均株価連動型上場投信</a>	1546	東証
19	<a href="#">NEXT FUNDS タイ株式SET50指数連動型上場投信</a>	1559	東証
20	<a href="#">NEXT FUNDS FTSEブルサ・マレーシアKLCI連動型上場投信</a>	1560	東証
21	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信</a>	1570	東証
22	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信</a>	1571	東証
23	<a href="#">NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信</a>	1577	東証
24	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信</a>	1591	東証
25	<a href="#">NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信</a>	1598	東証
26	<a href="#">東証電気機器株価指数連動型上場投資信託</a>	1613	東証
27	<a href="#">東証銀行業株価指数連動型上場投資信託</a>	1615	東証
28	<a href="#">NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50連動型上場投信</a>	1678	東証
29	<a href="#">NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信</a>	1682	東証
30	<a href="#">NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス連動型上場投信</a>	1699	東証

\* 各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

[掲載番号:1]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1306)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## TOPIX連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

2,066,978,212 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

2,686,939,572,373 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

1,299.94 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

**TOPIX 連動型上場投資信託**  
**TOPIX Exchange Traded Fund**

		TOPIX <sup>(※)</sup> TOPIX Index		TOPIX上場投信 TOPIX Exchange Traded Fund				
		(A)	(B)	(B) - (A)				
		指数終値	純資産価額	騰落率	騰落率差	受益権	純資産総額	
		日次	(一口当たり)	日次		残存口数	(円)	
		騰落率	NAV	騰落率	騰落率差	Unit	NAV	
		Daily	(per Unit)	Daily	Return	Outstanding		
		Return		Return	Differential			
Year		Index Value						
-Month	Day							
2016-07	8	1,209.88	-1.32%	1,256.15	-1.31%	0.01%	2,023,750,656	2,542,137,675,685
	11	1,255.79	3.79%	1,275.48	1.54%	-2.26%	2,023,750,656	2,581,248,293,237
	12	1,285.73	2.38%	1,305.93	2.39%	0.00%	2,030,753,356	2,652,012,335,316
	13	1,300.26	1.13%	1,320.60	1.12%	-0.01%	2,042,754,456	2,697,671,235,649
	14	1,311.16	0.84%	1,331.70	0.84%	0.00%	2,042,754,456	2,720,331,722,852
	15	1,317.10	0.45%	1,337.77	0.46%	0.00%	2,042,754,456	2,732,742,632,125
	19	1,331.39	1.08%	1,352.21	1.08%	-0.01%	2,040,843,866	2,759,648,875,776
	20	1,330.75	-0.05%	1,351.56	-0.05%	0.00%	2,046,893,095	2,766,507,284,589
	21	1,339.39	0.65%	1,360.33	0.65%	0.00%	2,046,893,095	2,784,445,467,825
	22	1,327.51	-0.89%	1,348.26	-0.89%	0.00%	2,046,893,095	2,759,748,913,336
	25	1,325.36	-0.16%	1,346.07	-0.16%	0.00%	2,051,944,549	2,762,055,020,457
	26	1,306.94	-1.39%	1,327.34	-1.39%	0.00%	2,051,944,549	2,723,618,623,234
	27	1,321.67	1.13%	1,342.46	1.14%	0.01%	2,051,944,549	2,754,644,147,136
	28	1,307.00	-1.11%	1,327.47	-1.12%	-0.01%	2,051,944,549	2,723,896,657,845
	29	1,322.74	1.20%	1,343.57	1.21%	0.01%	2,051,944,549	2,756,925,340,398
2016-08	1	1,321.83	-0.07%	1,342.53	-0.08%	-0.01%	2,063,943,049	2,770,907,707,125
	2	1,300.20	-1.64%	1,320.56	-1.64%	0.00%	2,063,943,049	2,725,554,557,869
	3	1,271.98	-2.17%	1,291.90	-2.17%	0.00%	2,063,943,049	2,666,398,406,457
	4	1,282.99	0.87%	1,303.08	0.87%	0.00%	2,061,978,412	2,686,917,412,783
	5	1,279.90	-0.24%	1,299.94	-0.24%	0.00%	2,066,978,212	2,686,939,572,373

(※) 「TOPIX」について

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。
- ② 東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ 東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ 東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。  
また東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、本ファンドの純資産額とTOPIXの間に乖離が発生することがある。
- ⑥ 本ファンドは、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦ 東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、東京証券取引所は本ファンドの発行又は販売に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

(i) The TOPIX Index Value and the TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Index Value or to change the TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX ETF may be substantially deviated from the TOPIX although the investment objective of the TOPIX ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Index Value. (vi) The TOPIX ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the Fund or an advice on investments in the TOPIX ETF to any purchaser of the TOPIX ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX ETF.

平成28年8月8日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:2]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1309)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## 上海株式指数・上証50連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

191,385 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

4,755,238,629 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

24,846.45 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.03 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は32,718.64(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:3]  
各位

平成28年8月8日

会社名 野村アセットマネジメント株式会社  
代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
(コード番号 1311)  
問い合わせ先 商品企画部長 渡部 昭裕  
TEL 03-3241-9511

## TOPIX Core 30連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

4,072,933 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

2,479,727,586 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

608.83 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

**TOPIX Core 30連動型上場投資信託**  
**TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund**

		TOPIX Core 30 <sup>(※)</sup>		TOPIX Core 30上場投信				
		TOPIX Core 30 Index		TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund				
		(A)	(B)	(B) - (A)				
		指数終値	純資産価額	騰落率	騰落率差	受益権	純資産総額	
		日次	(一口当たり)	日次	騰落率差	残存口数	純資産総額	
		騰落率	NAV	騰落率	騰落率差	Unit	NAV	
		Daily	(per Unit)	Daily	Return Differential	Outstanding		
		Return		Return				
Year		Index Value						
-Month	Day							
2016-07	8	568.49	-1.22%	586.31	-1.22%	0.00%	4,072,933	2,388,006,909
	11	588.86	3.58%	607.27	3.57%	-0.01%	4,072,933	2,473,354,728
	12	603.97	2.57%	622.85	2.57%	0.00%	4,072,933	2,536,842,782
	13	613.43	1.57%	632.57	1.56%	-0.01%	4,072,933	2,576,398,848
	14	616.39	0.48%	635.62	0.48%	0.00%	4,072,933	2,588,847,379
	15	622.55	1.00%	615.91	-3.10%	-4.10%	4,072,933	2,508,542,559
	19	623.95	0.22%	617.27	0.22%	0.00%	4,072,933	2,514,117,654
	20	623.96	0.00%	617.28	0.00%	0.00%	4,072,933	2,514,155,064
	21	629.23	0.84%	622.48	0.84%	0.00%	4,072,933	2,535,324,146
	22	624.08	-0.82%	617.39	-0.82%	0.00%	4,072,933	2,514,588,646
	25	621.81	-0.36%	615.13	-0.37%	0.00%	4,072,933	2,505,370,112
	26	613.66	-1.31%	607.08	-1.31%	0.00%	4,072,933	2,472,601,900
	27	621.50	1.28%	614.79	1.27%	-0.01%	4,072,933	2,503,990,582
	28	615.14	-1.02%	608.49	-1.02%	0.00%	4,072,933	2,478,334,486
	29	625.71	1.72%	618.93	1.72%	0.00%	4,072,933	2,520,851,026
2016-08	1	631.09	0.86%	624.25	0.86%	0.00%	4,072,933	2,542,512,398
	2	619.05	-1.91%	612.34	-1.91%	0.00%	4,072,933	2,494,012,943
	3	608.76	-1.66%	602.16	-1.66%	0.00%	4,072,933	2,452,573,205
	4	615.04	1.03%	608.37	1.03%	0.00%	4,072,933	2,477,866,330
	5	615.51	0.08%	608.83	0.08%	0.00%	4,072,933	2,479,727,586

(※) 「TOPIX Core 30」について

- ① TOPIX Core 30の指数値およびTOPIX Core 30の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及びTOPIX Core 30の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。
- ② 東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIX Core 30の指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIX Core 30の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ 東京証券取引所は、TOPIX Core 30の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ 東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」は、TOPIX Core 30の指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の純資産価額とTOPIX Core 30の間に乖離が発生することがある。
- ⑥ 「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦ 東京証券取引所は「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の購入者又は公衆に対し、「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の説明投資のアドバイスをする義務を持たない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、東京証券取引所は「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

(i) The TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value and the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX Core 30 and TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value or to change the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX Core 30 ETF may be substantially deviated from the TOPIX Core 30 although the investment objective of the TOPIX Core 30 ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Core 30 Index Value. (vi) The TOPIX Core 30 ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the TOPIX Core 30 ETF or an advice on investments in the TOPIX Core 30 ETF to any purchaser of the TOPIX Core 30 ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX Core 30 ETF.

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 100万口以上100万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
30			
1	2914	日本たばこ産業	6,100
2	3382	セブン&アイ・ホールディングス	4,000
3	4063	信越化学工業	1,800
4	4502	武田薬品工業	4,100
5	4503	アステラス製薬	11,100
6	6501	日立製作所	25,000
7	6752	パナソニック	11,200
8	6758	ソニー	6,900
9	6902	デンソー	2,400
10	6954	ファナック	1,000
11	6981	村田製作所	1,100
12	7201	日産自動車	13,300
13	7203	トヨタ自動車	12,500
14	7267	本田技研工業	8,800
15	7751	キヤノン	5,300
16	8031	三井物産	8,700
17	8058	三菱商事	7,200
18	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	77,400
19	8316	三井住友フィナンシャルグループ	7,700
20	8411	みずほフィナンシャルグループ	137,200
21	8604	野村ホールディングス	18,600
22	8766	東京海上ホールディングス	3,900
23	8801	三井不動産	5,000
24	8802	三菱地所	7,000
25	9020	東日本旅客鉄道	1,800
26	9022	東海旅客鉄道	800
27	9432	日本電信電話	7,500
28	9433	KDDI	9,500
29	9437	NTTドコモ	7,200
30	9984	ソフトバンクグループ	5,500
			以上



[掲載番号:4]  
各位

平成28年8月8日

会社名 野村アセットマネジメント株式会社  
代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
(コード番号 1312)  
問い合わせ先 商品企画部長 渡部 昭裕  
TEL 03-3241-9511

## ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

209,260 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

3,233,298,892 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

15,451.1 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託 Russell/Nomura Small Cap Core Index Linked Exchange Traded Fund

Russell/Nomura Small Cap Core インデックス(※) ラッセル野村小型コア・インデックス上場投信

		Russell/Nomura Small Cap Core Index		Russell/Nomura Small Cap Core Index Linked Exchange Traded Fund				
		(A)		(B)			(B)-(A)	
Year	Index Value	指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
		Daily Return	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
2016-07	8	153.31	-1.52%	15,077.9	-1.51%	0.01%	209,260	3,155,196,641
	11	158.85	3.61%	15,617.8	3.58%	-0.03%	209,260	3,268,187,926
	12	161.73	1.81%	15,898.9	1.80%	-0.01%	209,260	3,327,012,971
	13	162.86	0.69%	16,009.0	0.69%	0.00%	209,260	3,350,038,924
	14	164.16	0.80%	16,136.3	0.80%	-0.01%	209,260	3,376,690,094
	15	163.38	-0.48%	15,850.9	-1.77%	-1.29%	209,260	3,316,960,418
	19	165.83	1.50%	16,087.0	1.49%	-0.01%	209,260	3,366,372,227
	20	166.42	0.35%	16,144.1	0.35%	0.00%	209,260	3,378,313,382
	21	167.08	0.40%	16,207.8	0.39%	0.00%	209,260	3,391,644,127
	22	165.84	-0.74%	16,088.1	-0.74%	0.00%	209,260	3,366,594,718
	25	165.69	-0.09%	16,072.8	-0.10%	0.00%	209,260	3,363,402,455
	26	164.10	-0.96%	15,918.8	-0.96%	0.00%	209,260	3,331,162,686
2016-08	27	166.03	1.18%	16,105.9	1.18%	0.00%	209,260	3,370,318,399
	28	164.85	-0.71%	15,990.9	-0.71%	0.00%	209,260	3,346,260,054
	29	166.61	1.07%	16,163.6	1.08%	0.01%	209,260	3,382,392,303
	1	165.68	-0.56%	16,072.9	-0.56%	0.00%	209,260	3,363,410,974
	2	163.53	-1.30%	15,864.0	-1.30%	0.00%	209,260	3,319,696,642
	3	159.75	-2.31%	15,498.6	-2.30%	0.01%	209,260	3,243,237,041
	4	160.12	0.23%	15,534.1	0.23%	0.00%	209,260	3,250,670,129
	5	159.25	-0.54%	15,451.1	-0.53%	0.00%	209,260	3,233,298,892

(※) 「Russell/Nomura Small Cap Core インデックス」について

ラッセル・インベストメント (RUSSELL INVESTMENTS) / 野村証券株式会社による「ラッセル野村インデックス」の公表若しくは「ラッセル野村インデックス」から派生する有価証券・その他の金融商品に関連する商標の使用許諾は、「ラッセル野村インデックス」に基づき、また、「ラッセル野村インデックス」から派生する有価証券・その他の金融商品に対する投資の魅力に関し、いかなる意味でも、ラッセル・インベストメント/野村証券株式会社による表明又は意見を示唆するものでも暗示するものでもありません。ラッセル・インベストメント/野村証券株式会社は、いかなる場合においても、そのような有価証券・その他の金融商品の発行者ではありません。また、ラッセル・インベストメント/野村証券株式会社は、いかなる場合においても、「ラッセル野村インデックス」そのもの、また、それに包含されるか、反映されているデータに関する商品適格性や特定の目的への適合性に対し、若しくは、「ラッセル野村インデックス」そのものまた、それに包含されるか、反映されているデータを利用したいいかなる者が得る結果に対し、明示的にせよ黙示的にせよいかなる保証も行いません。

NEITHER PUBLICATION BY RUSSELL INVESTMENTS OR THE NOMURA SECURITIES CO., LTD. OF THE RUSSELL/NOMURA INDEXES NOR THEIR LICENSING OF TRADEMARKS FOR USE IN CONNECTION WITH SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS DERIVED FROM A RUSSELL/NOMURA INDEX IN ANY WAY SUGGESTS OR IMPLIES A REPRESENTATION OR OPINION BY RUSSELL INVESTMENTS OR NOMURA SECURITIES CO., LTD. AS TO THE ATTRACTIVENESS OF INVESTMENT IN ANY SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS BASED UPON OR DERIVED FROM ANY RUSSELL/NOMURA INDEX. NEITHER RUSSELL INVESTMENTS NOR NOMURA SECURITIES CO., LTD. ARE THE ISSUER OF ANY SUCH SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS AND NEITHER MAKES ANY EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR ANY PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO ANY RUSSELL/NOMURA INDEX OR ANY DATA INCLUDED OR REFLECTED THEREIN, NOR AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY ANY PERSON OR ANY ENTITY FROM THE USE OF THE RUSSELL/NOMURA INDEX OR ANY DATA INCLUDED OR REFLECTED THEREIN.

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 10万口以上10万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
349			
1	1332	日本水産	11,400
2	1333	マルハニチロ	2,000
3	1377	サカタのタネ	1,400
4	1414	ショーボンドホールディングス	900
5	1417	ミライト・ホールディングス	2,800
6	1662	石油資源開発	1,500
7	1719	安藤・間	5,900
8	1720	東急建設	3,100
9	1721	コムシスホールディングス	5,000
10	1766	東建コーポレーション	300
11	1820	西松建設	13,000
12	1821	三井住友建設	38,400
13	1824	前田建設工業	6,000
14	1833	奥村組	8,000
15	1835	東鉄工業	1,300
16	1860	戸田建設	10,000
17	1861	熊谷組	17,000
18	1881	NIPPO	2,000
19	1883	前田道路	3,000
20	1893	五洋建設	13,700
21	1911	住友林業	6,200
22	1924	パナホーム	4,000
23	1941	中電工	1,100
24	1942	関電工	5,000
25	1950	日本電設工業	1,400
26	1951	協和エクシオ	4,000
27	1959	九電工	1,700
28	1969	高砂熱学工業	2,200
29	1973	NECネットエスアイ	1,200
30	1979	大気社	1,100
31	2001	日本製粉	5,000
32	2121	ミクシイ	1,900
33	2127	日本M&Aセンター	1,600
34	2131	アコーディア・ゴルフ	3,300
35	2193	クックパッド	2,200
36	2201	森永製菓	8,000
37	2264	森永乳業	8,000
38	2270	雪印メグミルク	1,900
39	2296	伊藤ハム米久ホールディングス	5,900

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
40	2327	新日鉄住金ソリューションズ	1,700
41	2501	サッポロホールディングス	2,800
42	2531	宝ホールディングス	7,700
43	2579	コカ・コーラウエスト	3,200
44	2580	コカ・コーライーストジャパン	3,100
45	2593	伊藤園	2,900
46	2607	不二製油グループ本社	2,500
47	2659	サンエー	800
48	2678	アスクル	1,200
49	2681	ゲオホールディングス	1,700
50	2685	アダストリア	1,500
51	2702	日本マクドナルドホールディングス	3,400
52	2730	エディオン	3,500
53	2782	セリア	800
54	2810	ハウス食品グループ本社	2,700
55	2811	カゴメ	3,600
56	2815	アリアケジャパン	900
57	2871	ニチレイ	10,000
58	2931	ユーグレナ	2,600
59	3002	グンゼ	7,000
60	3046	ジェイアイエヌ	600
61	3048	ビックカメラ	3,800
62	3050	DCMホールディングス	4,000
63	3064	MonotaRO	3,100
64	3076	あい ホールディングス	1,800
65	3098	ココカラファイン	700
66	3101	東洋紡	39,000
67	3116	トヨタ紡織	2,600
68	3141	ウエルシアホールディングス	800
69	3148	クリエイトSDホールディングス	1,200
70	3197	すかいらーく	5,200
71	3288	オープンハウス	1,400
72	3349	コスモス薬品	400
73	3360	シップヘルスケアホールディングス	2,100
74	3398	クスリのアオキ	700
75	3569	セーレン	2,100
76	3591	ワコールホールディングス	5,000
77	3593	ホギメディカル	600
78	3608	TSIホールディングス	3,700
79	3632	グリー	5,400
80	3635	コーエーテクモホールディングス	1,900
81	3668	コロプラ	2,400
82	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,400
83	3769	GMOペイメントゲートウェイ	800
84	3774	インターネットイニシアティブ	1,400
85	3865	北越紀州製紙	6,000
86	3880	大王製紙	3,500
87	3941	レンゴー	8,000
88	4023	クレハ	6,000
89	4041	日本曹達	6,000
90	4043	トクヤマ	15,000

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
91	4044	セントラル硝子	9,000
92	4045	東亜合成	5,000
93	4091	大陽日酸	5,800
94	4095	日本パーカライジング	3,900
95	4186	東京応化工業	1,700
96	4203	住友ベークライト	9,000
97	4205	日本ゼオン	7,000
98	4206	アイカ工業	2,400
99	4272	日本化薬	7,000
100	4321	ケネディクス	12,200
101	4401	ADEKA	3,600
102	4403	日油	6,000
103	4506	大日本住友製薬	6,600
104	4534	持田製薬	600
105	4540	ツムラ	3,100
106	4541	日医工	2,100
107	4547	キッセイ薬品工業	1,300
108	4548	生化学工業	1,800
109	4553	東和薬品	400
110	4565	そーせいグループ	700
111	4569	キョーリン製薬ホールディングス	2,300
112	4587	ペプチドリーム	1,400
113	4626	太陽ホールディングス	800
114	4634	東洋インキSCホールディングス	8,000
115	4665	ダスキン	2,300
116	4716	日本オラクル	1,700
117	4733	オービックビジネスコンサルタント	500
118	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,300
119	4819	デジタルガレージ	1,700
120	4917	マンダム	900
121	4921	ファンケル	1,700
122	4924	シーズ・ホールディングス	1,300
123	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	1,100
124	4974	タカラバイオ	2,400
125	4985	アース製薬	600
126	5019	出光興産	3,600
127	5021	コスモエネルギーホールディングス	2,300
128	5122	オカモト	3,000
129	5202	日本板硝子	44,000
130	5232	住友大阪セメント	19,000
131	5301	東海カーボン	9,000
132	5393	ニチアス	4,000
133	5413	日新製鋼	3,700
134	5423	東京製鐵	5,100
135	5444	大和工業	1,800
136	5463	丸一鋼管	2,400
137	5471	大同特殊鋼	13,000
138	5481	山陽特殊製鋼	5,000
139	5631	日本製鋼所	15,000
140	5703	日本軽金属ホールディングス	22,100
141	5706	三井金属鉱業	28,000

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
142	5715	古河機械金属	14,000
143	5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	1,000
144	5801	古河電気工業	31,000
145	5803	フジクラ	14,000
146	5929	三和ホールディングス	9,600
147	5949	ユニプレス	1,800
148	5975	東プレ	1,500
149	5988	パイオラックス	500
150	6005	三浦工業	3,800
151	6013	タクマ	3,000
152	6028	テクノプロ・ホールディングス	1,800
153	6103	オークマ	6,000
154	6134	富士機械製造	3,300
155	6135	牧野フライス製作所	5,000
156	6136	オーエスジー	3,800
157	6140	旭ダイヤモンド工業	2,500
158	6141	DMG森精機	5,700
159	6287	サトーホールディングス	1,200
160	6349	小森コーポレーション	2,500
161	6366	千代田化工建設	8,000
162	6371	椿本チエイン	6,000
163	6383	ダイフク	4,300
164	6395	タダノ	3,800
165	6406	フジテック	3,200
166	6412	平和	2,600
167	6413	理想科学工業	1,200
168	6432	竹内製作所	1,600
169	6436	アマノ	2,600
170	6457	グローリー	2,900
171	6463	TPR	1,000
172	6474	不二越	6,000
173	6508	明電舎	8,000
174	6588	東芝テック	6,000
175	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	16,000
176	6703	沖電気工業	41,000
177	6727	ワコム	7,300
178	6728	アルバック	1,500
179	6740	ジャパンディスプレイ	18,400
180	6754	アンリツ	6,700
181	6755	富士通ゼネラル	2,000
182	6756	日立国際電気	2,500
183	6767	ミツミ電機	4,400
184	6773	パイオニア	14,500
185	6794	フォスター電機	1,200
186	6807	日本航空電子工業	3,000
187	6810	日立マクセル	1,500
188	6816	アルパイン	2,000
189	6845	アズビル	2,800
190	6849	日本光電工業	3,500
191	6856	堀場製作所	1,700
192	6857	アドバンテスト	7,900

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
193	6877	OBARA GROUP	600
194	6925	ウシオ電機	5,100
195	6967	新光電気工業	3,400
196	6976	太陽誘電	5,200
197	6995	東海理化電機製作所	2,400
198	7003	三井造船	34,000
199	7004	日立造船	8,100
200	7173	東京TYフィナンシャルグループ	1,100
201	7222	日産車体	3,900
202	7224	新明和工業	4,000
203	7230	日信工業	1,800
204	7242	KYB	8,000
205	7248	カルソニックカンセイ	7,000
206	7251	ケーヒン	2,100
207	7278	エクセディ	1,000
208	7279	ハイレックスコーポレーション	900
209	7280	ミツバ	1,500
210	7282	豊田合成	3,100
211	7287	日本精機	2,000
212	7296	エフ・シー・シー	1,600
213	7313	テイ・エス テック	2,000
214	7458	第一興商	1,800
215	7476	アズワン	700
216	7517	黒田電気	1,800
217	7518	ネットワンシステムズ	4,100
218	7550	ゼンショーホールディングス	4,500
219	7581	サイゼリヤ	1,400
220	7599	IDOM	3,000
221	7606	ユナイテッドアローズ	1,100
222	7616	コロワイド	2,800
223	7716	ナカニシ	1,100
224	7729	東京精密	1,900
225	7732	トプコン	3,400
226	7735	SCREENホールディングス	10,000
227	7779	CYBERDYNE	3,900
228	7817	パラマウントベッドホールディングス	900
229	7846	パイロットコーポレーション	1,400
230	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	1,800
231	7862	トッパン・フォームズ	2,100
232	7864	フジシールインターナショナル	1,100
233	7915	日本写真印刷	1,300
234	7947	エフピコ	1,200
235	7966	リンテック	2,300
236	7976	三菱鉛筆	500
237	7981	タカラスタンダード	4,000
238	7984	コクヨ	3,600
239	7994	岡村製作所	2,600
240	8012	長瀬産業	4,700
241	8016	オンワードホールディングス	5,000
242	8020	兼松	18,000
243	8050	セイコーホールディングス	7,000

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
244	8056	日本ユニシス	2,800
245	8060	キヤノンマーケティングジャパン	2,300
246	8078	阪和興業	9,000
247	8086	ニプロ	6,000
248	8088	岩谷産業	9,000
249	8098	稲畑産業	2,000
250	8114	デサント	1,600
251	8129	東邦ホールディングス	2,300
252	8130	サンゲツ	2,700
253	8136	サンリオ	2,200
254	8140	リョーサン	1,400
255	8153	モスフードサービス	1,100
256	8174	日本瓦斯	1,200
257	8184	島忠	2,300
258	8185	チヨダ	800
259	8202	ラオックス	1,000
260	8214	AOKIホールディングス	2,000
261	8218	コメリ	1,500
262	8270	ユニーグループ・ホールディングス	9,900
263	8273	イズミ	1,500
264	8276	平和堂	1,300
265	8279	ヤオコー	700
266	8282	ケーズホールディングス	4,100
267	8283	PALTAC	1,500
268	8324	第四銀行	13,000
269	8336	武蔵野銀行	1,400
270	8341	七十七銀行	14,000
271	8342	青森銀行	8,000
272	8344	山形銀行	6,000
273	8345	岩手銀行	700
274	8346	東邦銀行	9,000
275	8356	十六銀行	14,000
276	8360	山梨中央銀行	7,000
277	8361	大垣共立銀行	14,000
278	8363	北國銀行	10,000
279	8366	滋賀銀行	9,000
280	8367	南都銀行	10,000
281	8368	百五銀行	10,000
282	8370	紀陽銀行	3,200
283	8381	山陰合同銀行	6,300
284	8386	百十四銀行	10,000
285	8388	阿波銀行	9,000
286	8392	大分銀行	7,000
287	8397	沖縄銀行	1,000
288	8399	琉球銀行	1,700
289	8424	芙蓉総合リース	800
290	8425	興銀リース	1,100
291	8439	東京センチュリーリース	2,100
292	8508	Jトラスト	3,900
293	8511	日本証券金融	4,700
294	8515	アイフル	14,000



総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
295	8524	北洋銀行	13,800
296	8544	京葉銀行	11,000
297	8550	栃木銀行	5,000
298	8585	オリエン트コーポレーション	28,100
299	8586	日立キャピタル	2,300
300	8595	ジャフコ	1,400
301	8600	トモニホールディングス	6,700
302	8609	岡三証券グループ	7,000
303	8613	丸三証券	2,600
304	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,900
305	8628	松井証券	5,600
306	8698	マネックスグループ	9,600
307	8703	カブドットコム証券	7,400
308	8714	池田泉州ホールディングス	11,400
309	8840	大京	14,000
310	8848	レオパレス21	12,900
311	8876	リログループ	500
312	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	5,600
313	9031	西日本鉄道	13,000
314	9065	山九	12,000
315	9072	ニッコンホールディングス	2,000
316	9075	福山通運	4,000
317	9076	セイノーホールディングス	6,700
318	9086	日立物流	2,100
319	9303	住友倉庫	6,000
320	9375	近鉄エクスプレス	1,700
321	9401	東京放送ホールディングス	4,100
322	9409	テレビ朝日ホールディングス	2,300
323	9412	スカパーJSATホールディングス	6,400
324	9435	光通信	900
325	9449	GMOインターネット	3,400
326	9468	カドカワ	2,400
327	9511	沖縄電力	1,500
328	9601	松竹	4,000
329	9603	エイチ・アイ・エス	1,700
330	9605	東映	3,000
331	9616	共立メンテナンス	600
332	9627	アインホールディングス	1,000
333	9678	カナモト	1,200
334	9681	東京ドーム	3,900
335	9682	DTS	1,000
336	9697	カプコン	2,300
337	9715	トランス・コスモス	1,200
338	9744	メイテック	1,300
339	9747	アサツー ディ・ケイ	1,600
340	9759	NSD	1,800
341	9787	イオンディライト	900
342	9793	ダイセキ	1,800
343	9810	日鉄住金物産	7,000
344	9830	トラスコ中山	900
345	9832	オートバックスセブン	2,800

総銘柄数			
349	コード	銘柄名	株式数
346	9861	吉野家ホールディングス	2,700
347	9934	因幡電機産業	1,100
348	9948	アークス	1,500
349	9956	バローホールディングス	1,600
			以上

[掲載番号:5]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1319)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## 日経300株価指数連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

34,632,179 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

8,800,301,713 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

254.11 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は257.63(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:6]  
各位

平成28年8月8日

会社名 野村アセットマネジメント株式会社  
代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
(コード番号 1321)  
問い合わせ先 商品企画部長 渡部 昭裕  
TEL 03-3241-9511

## 日経225連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

193,402,126 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

3,197,116,225,109 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

16,530.9 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

**日経225 連動型上場投資信託**  
**Nikkei225 Exchange Traded Fund**

		日経平均 (日経225) <sup>(※)</sup>		日経225上場投信						
		Nikkei Average		Nikkei225 Exchange Traded Fund						
		(A)		(B)		(B)-(A)				
Year	-Month	Day	指数終値	日次	純資産価額	日次	受益権	純資産総額		
			Index Value	騰落率	(一口当たり)	騰落率	残存口数	(円)		
		Daily		NAV	Daily	騰落率差	Unit	NAV		
		Return		(per Unit)	Return	Differential	Outstanding			
2016-07	8	15,106.98	-1.11%	15,365.7	-2.80%	-1.69%	188,121,595	2,890,625,032,705		
	11	15,708.82	3.98%	15,977.4	3.98%	0.00%	188,622,925	3,013,712,067,375		
	12	16,095.65	2.46%	16,371.4	2.47%	0.00%	189,224,535	3,097,872,340,092		
	13	16,231.43	0.84%	16,508.8	0.84%	0.00%	190,076,922	3,137,936,571,818		
	14	16,385.89	0.95%	16,666.0	0.95%	0.00%	189,776,413	3,162,805,331,455		
	15	16,497.85	0.68%	16,780.3	0.69%	0.00%	189,776,413	3,184,503,255,833		
	19	16,723.31	1.37%	17,008.5	1.36%	-0.01%	190,127,343	3,233,774,072,927		
	20	16,681.89	-0.25%	16,966.4	-0.25%	0.00%	190,027,110	3,224,072,536,218		
	21	16,810.22	0.77%	17,096.7	0.77%	0.00%	189,826,627	3,245,409,500,411		
	22	16,627.25	-1.09%	16,910.6	-1.09%	0.00%	189,325,462	3,201,598,385,893		
	25	16,620.29	-0.04%	16,903.0	-0.04%	0.00%	189,726,569	3,206,954,971,982		
	26	16,383.04	-1.43%	16,661.3	-1.43%	0.00%	189,576,214	3,158,583,354,750		
	27	16,664.82	1.72%	16,950.0	1.73%	0.01%	189,576,214	3,213,324,637,624		
	28	16,476.84	-1.13%	16,757.5	-1.14%	-0.01%	189,475,986	3,175,144,923,341		
	29	16,569.27	0.56%	16,852.1	0.56%	0.00%	189,475,986	3,193,065,319,597		
	2016-08	1	16,635.77	0.40%	16,919.1	0.40%	0.00%	190,482,626	3,222,800,947,599	
		2	16,391.45	-1.47%	16,670.5	-1.47%	0.00%	190,985,976	3,183,835,947,916	
		3	16,083.11	-1.88%	16,356.8	-1.88%	0.00%	191,136,986	3,126,395,918,282	
		4	16,254.89	1.07%	16,531.3	1.07%	0.00%	191,287,996	3,162,242,009,655	
		5	16,254.45	0.00%	16,530.9	0.00%	0.00%	193,402,126	3,197,116,225,109	

(※)「日経平均」について

- ① 「日経平均」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」自体及び「日経平均」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。
- ② 「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③ 日経225連動型上場投資信託は、弊社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンド受益証券の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④ 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。
- ⑤ 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

(i) Nikkei Average is copyrightable works calculated through such methodology as independently developed by Nikkei, and Nikkei owns copyrights and any other intellectual property rights subsisting in Nikkei Average and the methodology to calculate Nikkei Average.

(ii) Nikkei owns any and all rights to trademarks and any other intellectual property rights to such marks referring to "Nikkei" or Nikkei Average.

(iii) The Nikkei 225 ETF shall be managed under the responsibilities of the relevant investment trust management companies and other participants. Nikkei shall not be liable for management of the Nikkei 225 ETF or any other transactions of beneficiary certificates.

(iv) Nikkei shall not be obligated to publish continuously Nikkei Average. Nikkei shall not be liable for any error, delay or discontinuance of publication of Nikkei Average.

(v) Nikkei shall have the rights to make any changes in composition of stocks, calculation method and any other elements or contents of Nikkei Average. Nikkei shall also have the right to discontinue publishing Nikkei Average.

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 50,710口の整数倍

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
225			
1	1332	日本水産	2,000
2	1333	マルハニチロ	200
3	1605	国際石油開発帝石	800
4	1721	コムシスホールディングス	2,000
5	1801	大成建設	2,000
6	1802	大林組	2,000
7	1803	清水建設	2,000
8	1808	長谷工コーポレーション	400
9	1812	鹿島建設	2,000
10	1925	大和ハウス工業	2,000
11	1928	積水ハウス	2,000
12	1963	日揮	2,000
13	2002	日清製粉グループ本社	2,000
14	2269	明治ホールディングス	400
15	2282	日本ハム	2,000
16	2432	ディー・エヌ・エー	600
17	2501	サッポロホールディングス	400
18	2502	アサヒグループホールディングス	2,000
19	2503	キリンホールディングス	2,000
20	2531	宝ホールディングス	2,000
21	2768	双日	200
22	2801	キッコーマン	2,000
23	2802	味の素	2,000
24	2871	ニチレイ	2,000
25	2914	日本たばこ産業	2,000
26	3086	J. フロント リテイリング	1,000
27	3099	三越伊勢丹ホールディングス	2,000
28	3101	東洋紡	2,000
29	3103	ユニチカ	2,000
30	3105	日清紡ホールディングス	2,000
31	3289	東急不動産ホールディングス	2,000
32	3382	セブン&アイ・ホールディングス	2,000
33	3401	帝人	2,000
34	3402	東レ	2,000
35	3405	クラレ	2,000
36	3407	旭化成	2,000
37	3436	SUMCO	200
38	3861	王子ホールディングス	2,000
39	3863	日本製紙	200

総銘柄数			
225	コード	銘柄名	株式数
40	3865	北越紀州製紙	2,000
41	4004	昭和電工	200
42	4005	住友化学	2,000
43	4021	日産化学工業	2,000
44	4041	日本曹達	2,000
45	4042	東ソー	2,000
46	4043	トクヤマ	2,000
47	4061	デンカ	2,000
48	4063	信越化学工業	2,000
49	4151	協和発酵キリン	2,000
50	4183	三井化学	2,000
51	4188	三菱ケミカルホールディングス	1,000
52	4208	宇部興産	2,000
53	4272	日本化薬	2,000
54	4324	電通	2,000
55	4452	花王	2,000
56	4502	武田薬品工業	2,000
57	4503	アステラス製薬	10,000
58	4506	大日本住友製薬	2,000
59	4507	塩野義製薬	2,000
60	4519	中外製薬	2,000
61	4523	エーザイ	2,000
62	4543	テルモ	4,000
63	4568	第一三共	2,000
64	4689	ヤフー	800
65	4704	トレンドマイクロ	2,000
66	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
67	4902	コニカミノルタ	2,000
68	4911	資生堂	2,000
69	5002	昭和シェル石油	2,000
70	5020	JXホールディングス	2,000
71	5101	横浜ゴム	1,000
72	5108	ブリヂストン	2,000
73	5201	旭硝子	2,000
74	5202	日本板硝子	2,000
75	5214	日本電気硝子	3,000
76	5232	住友大阪セメント	2,000
77	5233	太平洋セメント	2,000
78	5301	東海カーボン	2,000
79	5332	TOTO	1,000
80	5333	日本碍子	2,000
81	5401	新日鐵住金	200
82	5406	神戸製鋼所	2,000
83	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	200
84	5413	日新製鋼	200
85	5541	大平洋金属	2,000
86	5631	日本製鋼所	2,000
87	5703	日本軽金属ホールディングス	2,000
88	5706	三井金属鉱業	2,000
89	5707	東邦亜鉛	2,000
90	5711	三菱マテリアル	2,000

総銘柄数			
225	コード	銘柄名	株式数
91	5713	住友金属鉱山	2,000
92	5714	DOWAホールディングス	2,000
93	5715	古河機械金属	2,000
94	5801	古河電気工業	2,000
95	5802	住友電気工業	2,000
96	5803	フジクラ	2,000
97	5901	東洋製罐グループホールディングス	2,000
98	6103	オークマ	2,000
99	6113	アマダホールディングス	2,000
100	6301	小松製作所	2,000
101	6302	住友重機械工業	2,000
102	6305	日立建機	2,000
103	6326	クボタ	2,000
104	6361	荏原製作所	2,000
105	6366	千代田化工建設	2,000
106	6367	ダイキン工業	2,000
107	6471	日本精工	2,000
108	6472	NTN	2,000
109	6473	ジェイテクト	2,000
110	6479	ミネベア	2,000
111	6501	日立製作所	2,000
112	6502	東芝	2,000
113	6503	三菱電機	2,000
114	6504	富士電機	2,000
115	6506	安川電機	2,000
116	6508	明電舎	2,000
117	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000
118	6701	日本電気	2,000
119	6702	富士通	2,000
120	6703	沖電気工業	2,000
121	6752	パナソニック	2,000
122	6758	ソニー	2,000
123	6762	TDK	2,000
124	6767	ミツミ電機	2,000
125	6770	アルプス電気	2,000
126	6773	パイオニア	2,000
127	6841	横河電機	2,000
128	6857	アドバンテスト	4,000
129	6902	デンソー	2,000
130	6952	カシオ計算機	2,000
131	6954	ファナック	2,000
132	6971	京セラ	4,000
133	6976	太陽誘電	2,000
134	6988	日東電工	2,000
135	7003	三井造船	2,000
136	7004	日立造船	400
137	7011	三菱重工業	2,000
138	7012	川崎重工業	2,000
139	7013	IHI	2,000
140	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000
141	7201	日産自動車	2,000



総銘柄数			
225	コード	銘柄名	株式数
142	7202	いすゞ自動車	1,000
143	7203	トヨタ自動車	2,000
144	7205	日野自動車	2,000
145	7211	三菱自動車工業	200
146	7261	マツダ	400
147	7267	本田技研工業	4,000
148	7269	スズキ	2,000
149	7270	富士重工業	2,000
150	7272	ヤマハ発動機	2,000
151	7731	ニコン	2,000
152	7733	オリンパス	2,000
153	7735	SCREENホールディングス	2,000
154	7751	キヤノン	3,000
155	7752	リコー	2,000
156	7762	シチズンホールディングス	2,000
157	7911	凸版印刷	2,000
158	7912	大日本印刷	2,000
159	7951	ヤマハ	2,000
160	8001	伊藤忠商事	2,000
161	8002	丸紅	2,000
162	8015	豊田通商	2,000
163	8031	三井物産	2,000
164	8035	東京エレクトロン	2,000
165	8053	住友商事	2,000
166	8058	三菱商事	2,000
167	8233	高島屋	2,000
168	8252	丸井グループ	2,000
169	8253	クレディセゾン	2,000
170	8267	イオン	2,000
171	8270	ユニーグループ・ホールディングス	2,000
172	8303	新生銀行	2,000
173	8304	あおぞら銀行	2,000
174	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,000
175	8308	りそなホールディングス	200
176	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2,000
177	8316	三井住友フィナンシャルグループ	200
178	8331	千葉銀行	2,000
179	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	2,000
180	8355	静岡銀行	2,000
181	8411	みずほフィナンシャルグループ	2,000
182	8601	大和証券グループ本社	2,000
183	8604	野村ホールディングス	2,000
184	8628	松井証券	2,000
185	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	500
186	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	600
187	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	400
188	8750	第一生命保険	200
189	8766	東京海上ホールディングス	1,000
190	8795	T&Dホールディングス	400
191	8801	三井不動産	2,000
192	8802	三菱地所	2,000

総銘柄数			
225	コード	銘柄名	株式数
193	8804	東京建物	1,000
194	8830	住友不動産	2,000
195	9001	東武鉄道	2,000
196	9005	東京急行電鉄	2,000
197	9007	小田急電鉄	2,000
198	9008	京王電鉄	2,000
199	9009	京成電鉄	2,000
200	9020	東日本旅客鉄道	200
201	9021	西日本旅客鉄道	200
202	9022	東海旅客鉄道	200
203	9062	日本通運	2,000
204	9064	ヤマトホールディングス	2,000
205	9101	日本郵船	2,000
206	9104	商船三井	2,000
207	9107	川崎汽船	2,000
208	9202	ANAホールディングス	2,000
209	9301	三菱倉庫	2,000
210	9412	スカパーJSATホールディングス	200
211	9432	日本電信電話	400
212	9433	KDDI	12,000
213	9437	NTTドコモ	200
214	9501	東京電力ホールディングス	200
215	9502	中部電力	200
216	9503	関西電力	200
217	9531	東京瓦斯	2,000
218	9532	大阪瓦斯	2,000
219	9602	東宝	200
220	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,000
221	9681	東京ドーム	1,000
222	9735	セコム	2,000
223	9766	コナミホールディングス	2,000
224	9983	ファーストリテイリング	2,000
225	9984	ソフトバンクグループ	6,000
			以上

[掲載番号:7]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1323)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top40  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

2,014,404 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

692,400,636 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

343.72 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.01 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は336,490.50(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:8]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1324)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

27,858,550 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

2,627,235,555 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

94.31 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.27 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は93,927.93(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:9]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1325)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

33,279,416 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

4,992,474,919 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

150.02 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.03 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は1,825,726.31(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:10]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1328)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## 金価格連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

1,636,196 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

6,117,839,154 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

3,739.06 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.01 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指標の終値は4,429.32(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:11]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1343)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

102,021,568 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

199,225,011,758 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

1,952.77 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る有価証券のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

**NEXTFUNDS 東証REIT指数連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS REIT INDEX ETF**

		東証REIT指数 <sup>(※)</sup> TSE REIT Index		NEXTFUNDS 東証REIT指数連動型上場投信 NEXT FUNDS REIT INDEX ETF				
		(A)		(B)			(B)-(A)	
		指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
Year		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
-Month	Day							
2016-07	8	1,823.23	-1.20%	1,937.86	-1.20%	0.00%	101,181,030	196,074,754,840
	11	1,836.86	0.75%	1,952.29	0.74%	0.00%	101,181,030	197,534,993,425
	12	1,855.10	0.99%	1,971.66	0.99%	0.00%	101,181,030	199,494,334,372
	13	1,853.50	-0.09%	1,969.94	-0.09%	0.00%	101,581,130	200,108,686,597
	14	1,876.76	1.25%	1,994.65	1.25%	0.00%	101,780,930	203,017,536,849
	15	1,849.16	-1.47%	1,965.33	-1.47%	0.00%	101,980,730	200,425,671,760
	19	1,864.25	0.82%	1,981.37	0.82%	0.00%	101,980,730	202,061,148,084
	20	1,876.34	0.65%	1,994.19	0.65%	0.00%	101,980,730	203,368,623,023
	21	1,869.23	-0.38%	1,986.61	-0.38%	0.00%	102,779,830	204,183,253,880
	22	1,862.98	-0.33%	1,979.94	-0.34%	0.00%	102,979,730	203,893,402,867
	25	1,858.01	-0.27%	1,974.63	-0.27%	0.00%	102,979,730	203,346,995,480
	26	1,865.01	0.38%	1,982.03	0.37%	0.00%	102,202,770	202,568,917,574
	27	1,849.36	-0.84%	1,969.44	-0.64%	0.20%	102,202,770	201,282,678,938
	28	1,879.30	1.62%	2,001.28	1.62%	0.00%	102,202,770	204,536,265,739
2016-08	29	1,869.32	-0.53%	1,990.64	-0.53%	0.00%	101,618,002	202,284,514,418
	1	1,850.72	-1.00%	1,970.79	-1.00%	0.00%	101,821,568	200,669,125,771
	2	1,842.52	-0.44%	1,962.02	-0.44%	0.00%	101,821,568	199,775,448,351
	3	1,831.23	-0.61%	1,949.98	-0.61%	0.00%	102,021,568	198,940,228,890
	4	1,846.19	0.82%	1,965.89	0.82%	0.00%	102,021,568	200,562,903,252
	5	1,833.88	-0.67%	1,952.77	-0.67%	0.00%	102,021,568	199,225,011,758

(※)「東証REIT指数」について

- ①東証REIT指数の指数値、東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所という。）の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有する。
- ②(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤本件ETFは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、本件ETFの純資産価額と東証REIT指数の間に乖離が発生することがある。
- ⑥本件ETFは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦(株)東京証券取引所は、本件ETFの購入者又は公衆に対し、本件ETFの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- ⑧以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本件ETFの発行等又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。



## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 20万口以上20万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	投資口数
54			
1	3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	16
2	3227	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	9
3	3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	59
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	12
5	3263	大和ハウスリート投資法人 投資証券	12
6	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	43
7	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	12
8	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	20
9	3281	GLP投資法人 投資証券	87
10	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	17
11	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	62
12	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2
13	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	3
14	3292	イオンリート投資法人 投資証券	44
15	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	32
16	3296	日本リート投資法人 投資証券	13
17	3298	インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	27
18	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	2
19	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	30
20	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	5
21	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	14
22	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	4
23	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	9
24	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	3
25	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	124
26	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	5
27	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	37
28	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	12
29	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	47
30	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	44
31	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	85
32	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	81
33	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	29
34	8956	プレミア投資法人 投資証券	44
35	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	33
36	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	6
37	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	99
38	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	44
39	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	123

総銘柄数	コード	銘柄名	投資口数
54			
40	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	17
41	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	34
42	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	29
43	8968	福岡リート投資法人 投資証券	25
44	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	14
45	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	34
46	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	51
47	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	17
48	8977	阪急リート投資法人 投資証券	20
49	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	6
50	8982	トップリート投資法人 投資証券	6
51	8984	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	25
52	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	125
53	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	55
54	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	44

以上

[掲載番号:12]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1357)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

24,740,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

73,537,103,237 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

2,972.40 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.25 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は3,224.14(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・日経平均ダブルインバース・インデックスに内在する性質に関する注意点**

日経平均ダブルインバース・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の「-2倍」（マイナス2倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の「-2倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の「-2倍」との差（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（日経ダブルインバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:13]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1470)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

220,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

2,721,495,214 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

12,370.43 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.08 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は11,503.85(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・JPX日経400レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注意点**

JPX日経400レバレッジ・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJPX日経インデックス400の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400の2倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の2倍との差（ずれ）は、当該期間中のJPX日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、JPX日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信（JPX日経400レバレッジ指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:14]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1471)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

1,416,131,404 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

7,080.66 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.05 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は7,553.15(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・JPX日経400インバース・インデックスに内在する性質に関する注意点**

J P X日経400インバース・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJ P X日経インデックス400の騰落率の「-1倍」（マイナス1倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJ P X日経400インバース・インデックスの騰落率は、一般にJ P X日経インデックス400の「-1倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJ P X日経400インバース・インデックスの騰落率とJ P X日経インデックス400の騰落率の「-1倍」との差（ずれ）は、当該期間中のJ P X日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、J P X日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、N E X T F U N D S J P X日経400インバース・インデックス連動型上場投信（J P X日経400インバース指数E T F）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、J P X日経インデックス400の値動きとJ P X日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。



[掲載番号:15]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1472)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

435,450,351 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

4,354.50 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.09 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は4,956.68(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・JPX日経400ダブルインバース・インデックスに内在する性質に関する注意点**

JPX日経400ダブルインバース・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJPX日経インデックス400の騰落率の「-2倍」（マイナス2倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400の「-2倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の「-2倍」との差（ずれ）は、当該期間中のJPX日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、JPX日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（JPX日経400ダブルインバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:16]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1480)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

559,440 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

6,839,529,698 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

12,225.7 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信 NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund

野村企業価値分配指数(※) NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信

<i>Nomura Enterprise Value Allocation Index</i>		<i>NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund</i>						
Year -Month	Day	指数終値	(A) 日次 騰落率	純資産価額 (一口当たり)	(B) 日次 騰落率	(B)-(A) 騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
2016-07	8	11681.84	-1.24%	11,701.2	-1.24%	0.00%	479,509	5,610,841,158
	11	12084.78	3.45%	12,103.6	3.44%	-0.01%	479,509	5,803,789,104
	12	12344.94	2.15%	12,363.5	2.15%	-0.01%	479,509	5,928,409,512
	13	12474.57	1.05%	12,493.0	1.05%	0.00%	479,509	5,990,489,596
	14	12568.02	0.75%	12,586.4	0.75%	0.00%	559,440	7,041,340,381
	15	12582.12	0.11%	12,599.9	0.11%	0.00%	559,440	7,048,913,342
	19	12689.80	0.86%	12,707.1	0.85%	-0.01%	559,440	7,108,872,788
	20	12714.06	0.19%	12,731.3	0.19%	0.00%	559,440	7,122,376,470
	21	12787.47	0.58%	12,804.5	0.57%	0.00%	559,440	7,163,356,292
	22	12663.70	-0.97%	12,680.7	-0.97%	0.00%	559,440	7,094,104,841
	25	12655.91	-0.06%	12,672.7	-0.06%	0.00%	559,440	7,089,634,774
	26	12482.88	-1.37%	12,499.6	-1.37%	0.00%	559,440	6,992,765,206
27	12641.48	1.27%	12,658.9	1.27%	0.00%	559,440	7,081,903,227	
28	12509.23	-1.05%	12,526.7	-1.04%	0.00%	559,440	7,007,917,918	
29	12593.89	0.68%	12,611.0	0.67%	0.00%	559,440	7,055,084,744	
2016-08	1	12600.69	0.05%	12,617.6	0.05%	0.00%	559,440	7,058,777,269
	2	12405.21	-1.55%	12,422.1	-1.55%	0.00%	559,440	6,949,447,003
	3	12151.01	-2.05%	12,167.9	-2.05%	0.00%	559,440	6,807,207,263
	4	12233.38	0.68%	12,250.2	0.68%	0.00%	559,440	6,853,242,122
	5	12209.22	-0.20%	12,225.7	-0.20%	0.00%	559,440	6,839,529,698

(※)「野村企業価値分配指数」について

野村企業価値分配指数は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用される当ETFの運用成果等に関し一切責任を負いません。

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 4万口以上4万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
245			
1	1605	国際石油開発帝石	2,500
2	1662	石油資源開発	100
3	1878	大東建託	200
4	1925	大和ハウス工業	1,300
5	1928	積水ハウス	1,400
6	2181	テンプホールディングス	300
7	2229	カルビー	200
8	2267	ヤクルト本社	200
9	2269	明治ホールディングス	300
10	2331	総合警備保障	100
11	2371	カカクコム	400
12	2432	ディー・エヌ・エー	300
13	2433	博報堂DYホールディングス	600
14	2440	ぐるなび	100
15	2502	アサヒグループホールディングス	900
16	2503	麒麟ホールディングス	2,000
17	2580	コカ・コーライーストジャパン	100
18	2587	サントリー食品インターナショナル	300
19	2593	伊藤園	100
20	2651	ローソン	200
21	2670	エービーシー・マート	100
22	2678	アスクル	100
23	2685	アダストリア	100
24	2802	味の素	1,300
25	2809	キューピー	200
26	2871	ニチレイ	1,000
27	2897	日清食品ホールディングス	200
28	2914	日本たばこ産業	3,000
29	3003	ヒューリック	500
30	3064	MonotaRO	200
31	3087	ドトール・日レスホールディングス	100
32	3088	マツモトキヨシホールディングス	100
33	3116	トヨタ紡織	100
34	3231	野村不動産ホールディングス	300
35	3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,900
36	3391	ツルハホールディングス	100
37	3402	東レ	4,000
38	3405	クラレ	800
39	3407	旭化成	3,000

総銘柄数			
245	コード	銘柄名	株式数
40	3632	グリー	300
41	3659	ネクソン	300
42	3774	インターネットイニシアティブ	100
43	4005	住友化学	4,000
44	4021	日産化学工業	300
45	4042	東ソー	1,000
46	4062	イビデン	300
47	4063	信越化学工業	1,000
48	4091	大陽日酸	500
49	4118	カネカ	1,000
50	4151	協和発酵キリン	600
51	4185	JSR	500
52	4188	三菱ケミカルホールディングス	3,100
53	4202	ダイセル	700
54	4204	積水化学工業	1,000
55	4206	アイカ工業	100
56	4217	日立化成	200
57	4307	野村総合研究所	300
58	4324	電通	600
59	4452	花王	1,300
60	4503	アステラス製薬	5,500
61	4506	大日本住友製薬	300
62	4507	塩野義製薬	700
63	4508	田辺三菱製薬	400
64	4519	中外製薬	500
65	4523	エーザイ	600
66	4528	小野薬品工業	1,000
67	4530	久光製薬	100
68	4536	参天製薬	900
69	4540	ツムラ	200
70	4543	テルモ	700
71	4544	みらかホールディングス	100
72	4555	沢井製薬	100
73	4568	第一三共	1,600
74	4578	大塚ホールディングス	1,100
75	4631	DIC	200
76	4661	オリエンタルランド	500
77	4666	パーク24	200
78	4681	リゾートトラスト	200
79	4689	ヤフー	3,400
80	4704	トレンドマイクロ	300
81	4716	日本オラクル	100
82	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	100
83	4751	サイバーエージェント	100
84	4755	楽天	2,200
85	4768	大塚商会	100
86	4902	コニカミノルタ	1,200
87	4911	資生堂	900
88	4922	コーセー	100
89	4927	ポーラ・オルビスホールディングス	100
90	5012	東燃ゼネラル石油	1,000

総銘柄数			
245	コード	銘柄名	株式数
91	5101	横浜ゴム	300
92	5105	東洋ゴム工業	200
93	5108	ブリヂストン	1,600
94	5110	住友ゴム工業	400
95	5233	太平洋セメント	3,000
96	5332	TOTO	300
97	5333	日本碍子	700
98	5334	日本特殊陶業	400
99	5401	新日鐵住金	1,800
100	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	1,200
101	5486	日立金属	400
102	5714	DOWAホールディングス	1,000
103	5741	UACJ	1,000
104	5802	住友電気工業	1,900
105	5929	三和ホールディングス	500
106	5938	LIXILグループ	700
107	5947	リンナイ	100
108	5991	日本発條	400
109	6146	ディスコ	100
110	6201	豊田自動織機	400
111	6268	ナブテスコ	300
112	6273	SMC	100
113	6301	小松製作所	2,300
114	6326	クボタ	2,500
115	6361	荏原製作所	1,000
116	6367	ダイキン工業	600
117	6370	栗田工業	300
118	6376	日機装	100
119	6383	ダイフク	200
120	6395	タダノ	200
121	6448	ブラザー工業	600
122	6457	グローリー	100
123	6460	セガサミーホールディングス	500
124	6465	ホシザキ	100
125	6471	日本精工	1,000
126	6473	ジェイテクト	500
127	6479	ミネベア	700
128	6501	日立製作所	12,000
129	6502	東芝	9,000
130	6503	三菱電機	5,000
131	6504	富士電機	1,000
132	6506	安川電機	600
133	6586	マキタ	300
134	6645	オムロン	500
135	6702	富士通	5,000
136	6703	沖電気工業	2,000
137	6724	セイコーエプソン	700
138	6727	ワコム	400
139	6754	アンリツ	300
140	6762	TDK	300
141	6770	アルプス電気	400

総銘柄数			
245	コード	銘柄名	株式数
142	6806	ヒロセ電機	100
143	6841	横河電機	500
144	6845	アズビル	100
145	6849	日本光電工業	200
146	6856	堀場製作所	100
147	6861	キーエンス	100
148	6869	シスメックス	300
149	6902	デンソー	1,200
150	6923	スタンレー電気	300
151	6952	カシオ計算機	500
152	6954	ファナック	500
153	6965	浜松ホトニクス	400
154	6981	村田製作所	500
155	6988	日東電工	400
156	6995	東海理化電機製作所	100
157	7011	三菱重工業	7,000
158	7012	川崎重工業	3,000
159	7013	IHI	3,000
160	7201	日産自動車	6,200
161	7202	いすゞ自動車	1,400
162	7203	トヨタ自動車	2,300
163	7205	日野自動車	600
164	7211	三菱自動車工業	1,500
165	7240	NOK	200
166	7251	ケーヒン	100
167	7259	アイシン精機	400
168	7261	マツダ	1,400
169	7267	本田技研工業	4,100
170	7269	スズキ	800
171	7270	富士重工業	1,400
172	7272	ヤマハ発動機	700
173	7274	ショーワ	100
174	7276	小糸製作所	200
175	7282	豊田合成	200
176	7309	シマノ	200
177	7312	タカタ	100
178	7313	テイ・エス テック	100
179	7453	良品計画	100
180	7532	ドンキホーテホールディングス	300
181	7581	サイゼリヤ	100
182	7599	IDOM	100
183	7606	ユナイテッドアローズ	100
184	7616	コロワイド	100
185	7649	スギホールディングス	100
186	7701	島津製作所	1,000
187	7729	東京精密	100
188	7731	ニコン	800
189	7732	トプコン	200
190	7733	オリンパス	600
191	7741	HOYA	1,100
192	7747	朝日インテック	100



総銘柄数			
245	コード	銘柄名	株式数
193	7751	キャノン	2,700
194	7752	リコー	1,600
195	7832	バンダイナムコホールディングス	500
196	7936	アシックス	400
197	7956	ビジョン	300
198	7988	ニフコ	100
199	8001	伊藤忠商事	3,600
200	8015	豊田通商	500
201	8028	ファミリーマート	200
202	8053	住友商事	2,600
203	8086	ニプロ	300
204	8113	ユニ・チャーム	900
205	8214	AOKIホールディングス	100
206	8219	青山商事	100
207	8227	しまむら	100
208	8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	200
209	8267	イオン	1,600
210	8273	イズミ	100
211	8316	三井住友フィナンシャルグループ	3,300
212	8439	東京センチュリーリース	100
213	8586	日立キャピタル	100
214	8591	オリックス	3,500
215	8593	三菱UFJリース	1,000
216	8601	大和証券グループ本社	4,000
217	8830	住友不動産	1,000
218	8905	イオンモール	300
219	9001	東武鉄道	3,000
220	9020	東日本旅客鉄道	800
221	9021	西日本旅客鉄道	400
222	9022	東海旅客鉄道	400
223	9064	ヤマトホールディングス	800
224	9101	日本郵船	4,000
225	9201	日本航空	900
226	9202	ANAホールディングス	8,000
227	9432	日本電信電話	3,800
228	9433	KDDI	4,500
229	9437	NTTドコモ	3,600
230	9505	北陸電力	400
231	9531	東京瓦斯	5,000
232	9532	大阪瓦斯	5,000
233	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	300
234	9678	カナモト	100
235	9697	カプコン	100
236	9719	SCSK	100
237	9735	セコム	500
238	9766	コナミホールディングス	300
239	9783	ベネッセホールディングス	200
240	9843	ニトリホールディングス	200
241	9956	バローホールディングス	100
242	9962	ミスミグループ本社	500
243	9983	ファーストリテイリング	100

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
245			
244	9984	ソフトバンクグループ	2,200
245	9989	サンドラッグ	100
			以上

[掲載番号:17]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1545)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

1,150,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

5,623,140,470 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

4,889.69 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.05 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は480,405.64(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:18]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1546)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株30種平均株価  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

7,410,212,100 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

18,525.53 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.02 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は1,858,512.21(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:19]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1559)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS タイ株式SET50指数連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

240,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

636,322,115 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

2,651.34 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.01 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は2,765.32(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:20]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1560)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS FTSEブルサ・マレーシアKLCI連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

120,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

503,142,886 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

4,192.86 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.01 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は41,531.26(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:21]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1570)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

50,180,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

524,041,440,393 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

10,443.23 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.25 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は9,983.16(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・日経平均レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注 意点**

日経平均レバレッジ・インデックスは、つねに、前営業日  
に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の  
日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。し  
かしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レ  
バレッジ・インデックスの騰落率は、**一般に日経平均株価  
の騰落率の2倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避  
に生じます。**

2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・イ  
ンデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差  
（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって  
変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも  
生じる可能性があります、**一般に、日経平均株価の値動  
きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差  
（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、  
期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大き  
くなる傾向があります。**

したがって、**NEXT FUNDS日経平均レバレッジ・  
インデックス連動型上場投信（日経レバレッジ指数ETF  
F）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間  
の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品  
です。**

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や  
追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均  
先物の値動きの差異の影響などにより、**運用目標が完全に  
達成できるとは限りません。**

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を  
通じ、需給を反映して決まります。したがって、**市場価格  
は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。**



[掲載番号:22]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1571)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

12,670,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

31,567,045,478 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

2,491.48 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

-0.13 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は2,755.54(平成28年8月5日現在)です

以上

## **・日経平均インバース・インデックスに内在する性質に関する注意点**

日経平均インバース・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の「-1倍」（マイナス1倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均インバース・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の「-1倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均インバース・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の「-1倍」との差（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS日経平均インバース・インデックス連動型上場投信（日経インバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## **・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:23]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1577)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

2,992,912 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

55,306,721,842 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

18,479.2 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信

## NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund

野村日本株高配当70(※) NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信

		Nomura Japan Equity High Dividend 70		NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund					
		(A)		(B)	(B)-(A)				
		指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)	
Year		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV	
-Month	Day								
2016-07	8	17202.41	-1.02%	17,177.6	-1.02%	0.00%	2,992,635	51,406,202,525	
	11	17814.57	3.56%	17,787.8	3.55%	-0.01%	2,992,635	53,232,481,284	
	12	18310.52	2.78%	18,282.5	2.78%	0.00%	3,012,620	55,078,145,157	
	13	18585.67	1.50%	18,556.8	1.50%	0.00%	3,012,620	55,904,652,502	
	14	18790.84	1.10%	18,761.3	1.10%	0.00%	3,012,620	56,520,756,657	
	15	18903.75	0.60%	18,873.8	0.60%	0.00%	3,012,620	56,859,601,720	
	19	19106.58	1.07%	19,075.4	1.07%	0.00%	3,012,620	57,466,982,775	
	20	19008.57	-0.51%	18,977.4	-0.51%	0.00%	3,012,620	57,171,808,383	
	21	19235.92	1.20%	19,204.1	1.19%	0.00%	3,012,620	57,854,590,715	
	22	19095.11	-0.73%	19,063.4	-0.73%	0.00%	3,012,620	57,430,868,039	
	25	19084.50	-0.06%	19,052.3	-0.06%	0.00%	3,012,620	57,397,322,365	
	26	18721.19	-1.90%	18,690.4	-1.90%	0.00%	3,012,620	56,307,017,835	
	27	18934.67	1.14%	18,895.3	1.10%	-0.04%	3,012,620	56,924,466,858	
	28	18774.40	-0.85%	18,736.0	-0.84%	0.00%	3,012,620	56,444,353,887	
	29	18923.99	0.80%	18,882.7	0.78%	-0.01%	3,012,620	56,886,535,308	
	2016-08	1	18823.83	-0.53%	18,791.4	-0.48%	0.05%	3,012,620	56,611,465,011
		2	18498.66	-1.73%	18,467.5	-1.72%	0.00%	2,992,912	55,271,647,857
		3	18157.97	-1.84%	18,128.1	-1.84%	0.00%	2,992,912	54,255,950,680
		4	18552.70	2.17%	18,521.0	2.17%	-0.01%	2,992,912	55,431,577,014
		5	18510.99	-0.22%	18,479.2	-0.23%	0.00%	2,992,912	55,306,721,842

(※)「野村日本株高配当70」について  
野村日本株高配当70は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用される当ETFの運用成果等に関し一切責任を負いません。

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 2万口以上2万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
69			
1	1878	大東建託	500
2	1925	大和ハウス工業	2,000
3	2503	麒麟ホールディングス	3,900
4	2768	双日	23,700
5	2914	日本たばこ産業	1,500
6	3231	野村不動産ホールディングス	2,700
7	3405	クラレ	4,300
8	3407	旭化成	9,000
9	4005	住友化学	10,000
10	4182	三菱瓦斯化学	10,000
11	4185	JSR	3,500
12	4508	田辺三菱製薬	3,100
13	4523	エーザイ	900
14	4568	第一三共	2,700
15	4578	大塚ホールディングス	1,600
16	4631	DIC	2,000
17	4676	フジ・メディア・ホールディングス	4,600
18	4704	トレンドマイクロ	1,400
19	5101	横浜ゴム	2,800
20	5108	ブリヂストン	1,500
21	5110	住友ゴム工業	3,800
22	5201	旭硝子	9,000
23	5214	日本電気硝子	10,000
24	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	3,400
25	5711	三菱マテリアル	16,000
26	5713	住友金属鉱山	4,000
27	5938	LIXILグループ	2,400
28	6113	アマダホールディングス	5,800
29	6301	小松製作所	3,200
30	6302	住友重機械工業	12,000
31	6417	SANKYO	1,400
32	6448	ブラザー工業	4,300
33	6460	セガサミーホールディングス	5,100
34	6471	日本精工	4,500
35	6481	THK	2,800
36	6724	セイコーエプソン	3,400
37	7012	川崎重工業	13,000
38	7201	日産自動車	5,200
39	7203	トヨタ自動車	2,000

総銘柄数			
69	コード	銘柄名	株式数
40	7205	日野自動車	4,500
41	7259	アイシン精機	1,300
42	7267	本田技研工業	1,600
43	7751	キャノン	1,800
44	7752	リコー	4,900
45	7912	大日本印刷	5,000
46	8001	伊藤忠商事	4,200
47	8002	丸紅	9,400
48	8031	三井物産	4,300
49	8035	東京エレクトロン	900
50	8058	三菱商事	3,200
51	8304	あおぞら銀行	15,000
52	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,000
53	8308	りそなホールディングス	10,000
54	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	13,000
55	8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,300
56	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	10,000
57	8411	みずほフィナンシャルグループ	25,800
58	8570	イオンフィナンシャルサービス	2,200
59	8591	オリックス	3,600
60	8601	大和証券グループ本社	8,000
61	8604	野村ホールディングス	8,300
62	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	2,900
63	8766	東京海上ホールディングス	1,300
64	9201	日本航空	1,400
65	9432	日本電信電話	1,400
66	9433	KDDI	2,200
67	9437	NTTドコモ	2,700
68	9505	北陸電力	3,600
69	9783	ベネッセホールディングス	2,000
			以上

[掲載番号:24]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1591)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

21,865,288 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

252,100,286,049 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

11,529.7 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信 NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund

JPX日経インデックス400(※) NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

		JPX-Nikkei Index 400		NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund				
		(A)	(B)	(B)-(A)				
Year	-Month Day	指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
2016-07	8	10893.60	-1.38%	10,912.4	-1.37%	0.00%	21,464,529	234,229,333,986
	11	11296.43	3.70%	11,315.8	3.70%	0.00%	21,464,529	242,887,339,724
	12	11566.66	2.39%	11,586.7	2.39%	0.00%	21,664,248	251,017,570,027
	13	11700.02	1.15%	11,719.8	1.15%	0.00%	21,664,248	253,900,443,368
	14	11785.75	0.73%	11,805.5	0.73%	0.00%	21,664,248	255,756,292,267
	15	11830.47	0.38%	11,850.6	0.38%	0.00%	21,565,760	255,567,394,938
	19	11939.98	0.93%	11,959.3	0.92%	-0.01%	21,565,760	257,911,928,826
	20	11953.84	0.12%	11,973.2	0.12%	0.00%	21,565,760	258,212,183,659
	21	12033.16	0.66%	12,052.7	0.66%	0.00%	21,565,760	259,926,088,708
	22	11914.59	-0.99%	11,933.7	-0.99%	0.00%	21,565,760	257,359,502,234
	25	11921.16	0.06%	11,940.0	0.05%	0.00%	21,565,760	257,495,775,885
	26	11750.11	-1.43%	11,768.4	-1.44%	0.00%	21,565,760	253,794,078,801
	27	11887.23	1.17%	11,907.6	1.18%	0.02%	21,565,760	256,795,581,082
	28	11753.36	-1.13%	11,772.3	-1.14%	-0.01%	21,565,760	253,877,973,640
2016-08	29	11879.95	1.08%	11,900.2	1.09%	0.01%	21,565,760	256,637,056,190
	1	11885.15	0.04%	11,904.1	0.03%	-0.01%	21,865,288	260,286,500,651
	2	11689.47	-1.65%	11,708.0	-1.65%	0.00%	21,865,288	255,998,330,162
	3	11435.75	-2.17%	11,453.9	-2.17%	0.00%	21,865,288	250,442,287,264
	4	11541.05	0.92%	11,559.3	0.92%	0.00%	21,865,288	252,747,918,789
	5	11511.57	-0.26%	11,529.7	-0.26%	0.00%	21,865,288	252,100,286,049

(※)「JPX日経インデックス400」について

「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」といいます。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400指数」を算出する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属しています。

「NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び「NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信」の取引に関して、一切の責任を負いません。

「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。

「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。



## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 10万口以上10万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
388			
1	1605	国際石油開発帝石	4,900
2	1719	安藤・間	600
3	1721	コムシスホールディングス	400
4	1722	ミサワホーム	100
5	1801	大成建設	5,000
6	1802	大林組	2,800
7	1803	清水建設	3,000
8	1808	長谷工コーポレーション	1,100
9	1812	鹿島建設	4,000
10	1821	三井住友建設	3,600
11	1878	大東建託	300
12	1911	住友林業	600
13	1925	大和ハウス工業	2,700
14	1928	積水ハウス	3,100
15	1951	協和エクシオ	400
16	1963	日揮	900
17	2121	ミクシィ	200
18	2127	日本M&Aセンター	100
19	2181	テンブホールディングス	600
20	2193	クックパッド	200
21	2229	カルビー	300
22	2267	ヤクルト本社	500
23	2269	明治ホールディングス	600
24	2282	日本ハム	1,000
25	2331	総合警備保障	300
26	2371	カカクコム	600
27	2413	エムスリー	800
28	2432	ディー・エヌ・エー	400
29	2433	博報堂DYホールディングス	1,200
30	2502	アサヒグループホールディングス	1,700
31	2503	キリンホールディングス	4,000
32	2593	伊藤園	300
33	2651	ローソン	300
34	2670	エービーシー・マート	100
35	2681	ゲオホールディングス	100
36	2768	双日	5,200
37	2782	セリア	100
38	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,000
39	2801	キッコーマン	1,000

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
40	2802	味の素	2,000
41	2809	キューピー	500
42	2871	ニチレイ	1,000
43	2875	東洋水産	500
44	2897	日清食品ホールディングス	400
45	2914	日本たばこ産業	5,100
46	3003	ヒューリック	1,700
47	3064	MonotaRO	300
48	3086	J. フロント リテイリング	1,000
49	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
50	3092	スタートトゥデイ	200
51	3099	三越伊勢丹ホールディングス	1,600
52	3116	トヨタ紡織	300
53	3141	ウエルシアホールディングス	100
54	3231	野村不動産ホールディングス	500
55	3289	東急不動産ホールディングス	2,000
56	3291	飯田グループホールディングス	800
57	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
58	3382	セブン&アイ・ホールディングス	3,400
59	3391	ツルハホールディングス	200
60	3402	東レ	6,000
61	3405	クラレ	1,500
62	3407	旭化成	5,000
63	3632	グリー	500
64	3659	ネクソン	900
65	3738	ティーガイア	100
66	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,900
67	3861	王子ホールディングス	3,000
68	3880	大王製紙	400
69	4005	住友化学	6,000
70	4021	日産化学工業	500
71	4042	東ソー	2,000
72	4061	デンカ	2,000
73	4063	信越化学工業	1,600
74	4088	エア・ウォーター	1,000
75	4091	大陽日酸	700
76	4095	日本パーカライジング	400
77	4151	協和発酵キリン	1,000
78	4185	JSR	800
79	4188	三菱ケミカルホールディングス	5,800
80	4202	ダイセル	1,200
81	4204	積水化学工業	2,000
82	4205	日本ゼオン	1,000
83	4206	アイカ工業	300
84	4208	宇部興産	5,000
85	4217	日立化成	400
86	4272	日本化薬	1,000
87	4307	野村総合研究所	600
88	4324	電通	1,000
89	4403	日油	1,000
90	4452	花王	2,200

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
91	4502	武田薬品工業	3,500
92	4503	アステラス製薬	9,400
93	4507	塩野義製薬	1,300
94	4508	田辺三菱製薬	1,000
95	4519	中外製薬	900
96	4521	科研製薬	100
97	4523	エーザイ	1,100
98	4527	ロート製薬	400
99	4528	小野薬品工業	2,000
100	4530	久光製薬	300
101	4534	持田製薬	100
102	4536	参天製薬	1,600
103	4540	ツムラ	300
104	4543	テルモ	1,300
105	4544	みらかホールディングス	200
106	4555	沢井製薬	100
107	4568	第一三共	2,900
108	4569	キョーリン製薬ホールディングス	200
109	4578	大塚ホールディングス	1,900
110	4581	大正製薬ホールディングス	200
111	4612	日本ペイントホールディングス	700
112	4613	関西ペイント	1,000
113	4631	DIC	300
114	4661	オリエンタルランド	900
115	4666	パーク24	400
116	4676	フジ・メディア・ホールディングス	900
117	4681	リゾートトラスト	400
118	4684	オービック	300
119	4689	ヤフー	5,900
120	4704	トレンドマイクロ	400
121	4716	日本オラクル	100
122	4732	ユー・エス・エス	1,000
123	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200
124	4751	サイバーエージェント	200
125	4755	楽天	4,400
126	4768	大塚商会	200
127	4842	USEN	400
128	4901	富士フイルムホールディングス	2,000
129	4902	コニカミノルタ	2,100
130	4911	資生堂	1,600
131	4922	ユーシー	100
132	4924	シーズ・ホールディングス	100
133	4967	小林製薬	300
134	5002	昭和シェル石油	800
135	5101	横浜ゴム	500
136	5105	東洋ゴム工業	500
137	5108	ブリヂストン	2,900
138	5110	住友ゴム工業	800
139	5201	旭硝子	4,000
140	5233	太平洋セメント	5,000
141	5332	TOTO	600

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
142	5333	日本碍子	1,100
143	5334	日本特殊陶業	700
144	5401	新日鐵住金	3,900
145	5406	神戸製鋼所	16,000
146	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	2,400
147	5486	日立金属	1,000
148	5706	三井金属鉱業	2,000
149	5711	三菱マテリアル	5,000
150	5713	住友金属鉱山	2,000
151	5714	DOWAホールディングス	1,000
152	5802	住友電気工業	3,500
153	5857	アサヒホールディングス	100
154	5929	三和ホールディングス	900
155	5932	三協立山	100
156	5947	リンナイ	200
157	5949	ユニプレス	200
158	5991	日本発條	800
159	6136	オーエスジー	400
160	6146	ディスコ	100
161	6201	豊田自動織機	800
162	6268	ナブテスコ	500
163	6273	SMC	300
164	6301	小松製作所	4,300
165	6302	住友重機械工業	3,000
166	6305	日立建機	400
167	6326	クボタ	4,200
168	6361	荏原製作所	2,000
169	6366	千代田化工建設	1,000
170	6367	ダイキン工業	1,200
171	6395	タダノ	400
172	6412	平和	300
173	6425	ユニバーサルエンターテインメント	100
174	6448	ブラザー工業	1,100
175	6460	セガサミーホールディングス	900
176	6463	TPR	100
177	6465	ホシザキ	200
178	6471	日本精工	1,700
179	6473	ジェイテクト	900
180	6474	不二越	1,000
181	6479	ミネベア	1,300
182	6481	THK	600
183	6486	イーグル工業	100
184	6501	日立製作所	21,000
185	6503	三菱電機	9,000
186	6504	富士電機	2,000
187	6506	安川電機	1,000
188	6586	マキタ	500
189	6594	日本電産	1,000
190	6645	オムロン	900
191	6701	日本電気	11,000
192	6702	富士通	8,000

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
193	6703	沖電気工業	4,000
194	6724	セイコーエプソン	1,200
195	6727	ワコム	600
196	6752	パナソニック	9,500
197	6754	アンリツ	500
198	6756	日立国際電気	200
199	6762	TDK	500
200	6770	アルプス電気	700
201	6806	ヒロセ電機	100
202	6841	横河電機	800
203	6849	日本光電工業	300
204	6856	堀場製作所	200
205	6861	キーエンス	200
206	6869	シスメックス	600
207	6902	デンソー	2,000
208	6923	スタンレー電気	600
209	6952	カシオ計算機	800
210	6954	ファナック	800
211	6965	浜松ホトニクス	600
212	6971	京セラ	1,400
213	6981	村田製作所	900
214	6988	日東電工	700
215	6995	東海理化電機製作所	200
216	7003	三井造船	3,000
217	7011	三菱重工業	15,000
218	7012	川崎重工業	6,000
219	7013	IHI	6,000
220	7014	名村造船所	200
221	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,500
222	7201	日産自動車	11,300
223	7202	いすゞ自動車	2,400
224	7203	トヨタ自動車	2,700
225	7205	日野自動車	1,200
226	7211	三菱自動車工業	3,300
227	7240	NOK	400
228	7248	カルソニックカンセイ	1,000
229	7259	アイシン精機	800
230	7261	マツダ	2,600
231	7267	本田技研工業	5,600
232	7269	スズキ	1,500
233	7270	富士重工業	2,600
234	7272	ヤマハ発動機	1,200
235	7276	小糸製作所	500
236	7278	エクセディ	100
237	7280	ミツバ	100
238	7282	豊田合成	300
239	7309	シマノ	300
240	7313	テイ・エス テック	200
241	7453	良品計画	100
242	7458	第一興商	200
243	7459	メディパルホールディングス	800

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
244	7532	ドンキホーテホールディングス	500
245	7593	VTホールディングス	400
246	7606	ユナイテッドアローズ	100
247	7649	スギホールディングス	100
248	7731	ニコン	1,500
249	7732	トプコン	300
250	7733	オリンパス	1,200
251	7741	HOYA	1,900
252	7751	キヤノン	4,500
253	7752	リコー	2,700
254	7832	バンダイナムコホールディングス	900
255	7846	パイロットコーポレーション	100
256	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	200
257	7936	アシックス	800
258	7951	ヤマハ	600
259	7956	ビジョン	500
260	7988	ニフコ	200
261	8001	伊藤忠商事	6,400
262	8002	丸紅	8,100
263	8015	豊田通商	900
264	8020	兼松	2,000
265	8028	ファミリーマート	300
266	8031	三井物産	7,400
267	8035	東京エレクトロン	700
268	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
269	8050	セイコーホールディングス	1,000
270	8053	住友商事	5,200
271	8058	三菱商事	6,100
272	8088	岩谷産業	1,000
273	8113	ユニ・チャーム	1,800
274	8129	東邦ホールディングス	300
275	8136	サンリオ	300
276	8174	日本瓦斯	100
277	8214	AOKIホールディングス	200
278	8227	しまむら	100
279	8233	高島屋	1,000
280	8253	クレディセゾン	600
281	8267	イオン	3,400
282	8273	イズミ	200
283	8279	ヤオコー	100
284	8282	ケーズホールディングス	300
285	8303	新生銀行	7,000
286	8304	あおぞら銀行	5,000
287	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,100
288	8308	りそなホールディングス	9,600
289	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	17,000
290	8316	三井住友フィナンシャルグループ	4,300
291	8327	西日本シティ銀行	3,000
292	8331	千葉銀行	3,000
293	8333	常陽銀行	3,000
294	8334	群馬銀行	1,800

総銘柄数 388	コード	銘柄名	株式数
295	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	4,000
296	8355	静岡銀行	2,000
297	8356	十六銀行	1,000
298	8358	スルガ銀行	800
299	8359	八十二銀行	2,000
300	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	6,000
301	8379	広島銀行	2,000
302	8382	中国銀行	800
303	8385	伊予銀行	1,200
304	8410	セブン銀行	3,100
305	8411	みずほフィナンシャルグループ	84,900
306	8418	山口フィナンシャルグループ	1,000
307	8424	芙蓉総合リース	100
308	8425	興銀リース	200
309	8439	東京センチュリーリース	200
310	8473	SBIホールディングス	1,000
311	8524	北洋銀行	1,200
312	8544	京葉銀行	1,000
313	8570	イオンフィナンシャルサービス	500
314	8572	アコム	1,600
315	8586	日立キャピタル	200
316	8591	オリックス	5,800
317	8593	三菱UFJリース	2,100
318	8595	ジャフコ	100
319	8601	大和証券グループ本社	8,000
320	8604	野村ホールディングス	15,700
321	8609	岡三証券グループ	1,000
322	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	900
323	8628	松井証券	400
324	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,800
325	8697	日本取引所グループ	2,400
326	8703	カブドットコム証券	700
327	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,400
328	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	800
329	8750	第一生命保険	5,200
330	8766	東京海上ホールディングス	3,300
331	8795	T&Dホールディングス	3,000
332	8801	三井不動産	4,000
333	8802	三菱地所	6,000
334	8804	東京建物	900
335	8830	住友不動産	2,000
336	8840	大京	2,000
337	8848	レオパレス21	1,000
338	8850	スターツコーポレーション	100
339	8870	住友不動産販売	100
340	8897	タカラレーベン	400
341	8905	イオンモール	500
342	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	500
343	9001	東武鉄道	4,000
344	9003	相鉄ホールディングス	2,000
345	9005	東京急行電鉄	5,000

総銘柄数			
388	コード	銘柄名	株式数
346	9007	小田急電鉄	3,000
347	9008	京王電鉄	2,000
348	9009	京成電鉄	1,000
349	9020	東日本旅客鉄道	1,500
350	9021	西日本旅客鉄道	800
351	9022	東海旅客鉄道	700
352	9031	西日本鉄道	1,000
353	9041	近鉄グループホールディングス	8,000
354	9042	阪急阪神ホールディングス	1,100
355	9044	南海電気鉄道	2,000
356	9045	京阪ホールディングス	2,000
357	9048	名古屋鉄道	4,000
358	9062	日本通運	3,000
359	9064	ヤマトホールディングス	1,500
360	9065	山九	1,000
361	9101	日本郵船	7,000
362	9202	ANAホールディングス	15,000
363	9375	近鉄エクスプレス	100
364	9404	日本テレビホールディングス	700
365	9432	日本電信電話	4,900
366	9433	KDDI	7,300
367	9435	光通信	100
368	9437	NTTドコモ	6,100
369	9449	GMOインターネット	300
370	9513	電源開発	700
371	9531	東京瓦斯	9,000
372	9532	大阪瓦斯	9,000
373	9602	東宝	600
374	9603	エイチ・アイ・エス	100
375	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
376	9627	アインホールディングス	100
377	9678	カナモト	100
378	9719	SCSK	200
379	9735	セコム	900
380	9783	ベネッセホールディングス	300
381	9787	イオンデイライト	100
382	9810	日鉄住金物産	1,000
383	9843	ニトリホールディングス	400
384	9956	パローホールディングス	200
385	9962	ミスミグループ本社	900
386	9983	ファーストリテイリング	200
387	9984	ソフトバンクグループ	3,300
388	9989	サンドラッグ	200

以上



[掲載番号:25]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1598)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

449,629 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

6,347,717,462 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

14,117.7 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

## NEXT FUNDS Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund

Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス (配当除く) (※) NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

		Russell/Nomura Fundamental Prime Index		NEXT FUNDS Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund				
		(A)	(A)	(B)	(B)-(A)			
		指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
Year		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
-Month	Day							
2016-07	8	132.03	-1.27%	13,200.3	-1.26%	0.00%	449,629	5,935,241,450
	11	136.97	3.75%	13,694.3	3.74%	0.00%	449,629	6,157,347,496
	12	140.48	2.56%	14,044.9	2.56%	0.00%	449,629	6,315,010,005
	13	142.66	1.55%	14,261.4	1.54%	-0.01%	449,629	6,412,327,871
	14	143.62	0.68%	14,358.2	0.68%	0.00%	449,629	6,455,856,944
	15	144.92	0.91%	14,488.3	0.91%	0.00%	449,629	6,514,377,321
	19	146.29	0.95%	14,623.8	0.94%	-0.01%	449,629	6,575,306,456
	20	145.77	-0.36%	14,571.4	-0.36%	0.00%	449,629	6,551,733,800
	21	147.02	0.86%	14,696.6	0.86%	0.00%	449,629	6,608,024,213
	22	145.63	-0.95%	14,557.5	-0.95%	0.00%	449,629	6,545,489,936
	25	145.29	-0.23%	14,524.0	-0.23%	0.00%	449,629	6,530,410,344
	26	143.00	-1.58%	14,294.0	-1.58%	0.00%	449,629	6,427,002,020
	27	144.48	1.04%	14,443.7	1.05%	0.01%	449,629	6,494,286,820
28	142.73	-1.21%	14,267.9	-1.22%	-0.01%	449,629	6,415,259,068	
29	145.23	1.75%	14,517.9	1.75%	0.00%	449,629	6,527,676,625	
2016-08	1	145.77	0.37%	14,569.3	0.35%	-0.01%	449,629	6,550,780,945
	2	142.78	-2.05%	14,271.4	-2.04%	0.00%	449,629	6,416,848,303
	3	139.68	-2.17%	13,961.6	-2.17%	0.00%	449,629	6,277,524,363
	4	141.54	1.33%	14,147.1	1.33%	0.00%	449,629	6,360,963,914
	5	141.24	-0.21%	14,117.7	-0.21%	0.00%	449,629	6,347,717,462

(※) 「Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス」について

Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックスは野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社、Russell InvestmentsおよびResearch Affiliates, LLCに帰属します。なお、野村証券株式会社、Russell InvestmentsおよびResearch Affiliates, LLCは、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 10万口以上10万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
1	1332	日本水産	1,500
2	1417	ミライト・ホールディングス	400
3	1605	国際石油開発帝石	4,700
4	1662	石油資源開発	200
5	1721	コムシスホールディングス	700
6	1722	ミサワホーム	600
7	1801	大成建設	3,000
8	1802	大林組	1,700
9	1803	清水建設	2,000
10	1808	長谷工コーポレーション	1,100
11	1812	鹿島建設	3,000
12	1820	西松建設	1,000
13	1833	奥村組	1,000
14	1860	戸田建設	1,000
15	1878	大東建託	500
16	1911	住友林業	900
17	1925	大和ハウス工業	1,500
18	1928	積水ハウス	2,300
19	1942	関電工	1,000
20	1944	きんでん	700
21	1951	協和エクシオ	600
22	1963	日揮	1,100
23	2001	日本製粉	1,000
24	2002	日清製粉グループ本社	700
25	2131	アコーディア・ゴルフ	700
26	2174	GCA	400
27	2181	テンプホールディングス	200
28	2206	江崎グリコ	100
29	2212	山崎製パン	500
30	2229	カルビー	100
31	2264	森永乳業	2,000
32	2267	ヤクルト本社	200
33	2269	明治ホールディングス	200
34	2270	雪印メグミルク	300
35	2282	日本ハム	1,000
36	2288	丸大食品	1,000
37	2296	伊藤ハム米久ホールディングス	700
38	2331	総合警備保障	100
39	2432	ディー・エヌ・エー	600

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
40	2433	博報堂DYホールディングス	1,100
41	2501	サッポロホールディングス	300
42	2502	アサヒグループホールディングス	1,200
43	2503	麒麟ホールディングス	4,500
44	2531	宝ホールディングス	600
45	2579	コカ・コーラウエスト	500
46	2580	コカ・コーライーストジャパン	300
47	2587	サントリー食品インターナショナル	300
48	2593	伊藤園	300
49	2602	日清オイリオグループ	1,000
50	2607	不二製油グループ本社	300
51	2651	ローソン	200
52	2681	ゲオホールディングス	300
53	2685	アダストリア	100
54	2702	日本マクドナルドホールディングス	200
55	2730	エディオン	1,100
56	2733	あらた	200
57	2768	双日	18,000
58	2784	アルフレッサ ホールディングス	1,100
59	2802	味の素	1,900
60	2809	キューピー	400
61	2810	ハウス食品グループ本社	300
62	2811	カゴメ	200
63	2871	ニチレイ	1,000
64	2875	東洋水産	300
65	2897	日清食品ホールディングス	200
66	2914	日本たばこ産業	3,500
67	3002	ゲンゼ	1,000
68	3048	ビックカメラ	400
69	3050	DCMホールディングス	800
70	3086	J. フロント リテイリング	900
71	3088	マツモトキヨシホールディングス	200
72	3098	ココカラファイン	100
73	3099	三越伊勢丹ホールディングス	1,200
74	3101	東洋紡	5,000
75	3105	日清紡ホールディングス	600
76	3107	ダイワボウホールディングス	2,000
77	3116	トヨタ紡織	300
78	3197	すかいらく	400
79	3231	野村不動産ホールディングス	400
80	3289	東急不動産ホールディングス	700
81	3291	飯田グループホールディングス	600
82	3360	シップヘルスケアホールディングス	200
83	3382	セブン&アイ・ホールディングス	2,800
84	3391	ツルハホールディングス	100
85	3401	帝人	5,000
86	3402	東レ	5,000
87	3405	クラレ	1,600
88	3407	旭化成	7,000
89	3608	TSIホールディングス	500
90	3626	TIS	300

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
91	3632	グリー	800
92	3659	ネクソン	300
93	3861	王子ホールディングス	4,000
94	3863	日本製紙	800
95	3865	北越紀州製紙	700
96	3880	大王製紙	400
97	3941	レンゴー	2,000
98	4004	昭和電工	1,300
99	4005	住友化学	7,000
100	4021	日産化学工業	300
101	4023	クレハ	1,000
102	4042	東ソー	2,000
103	4043	トクヤマ	3,000
104	4044	セントラル硝子	1,000
105	4045	東亜合成	700
106	4061	デンカ	2,000
107	4062	イビデン	900
108	4063	信越化学工業	1,200
109	4088	エア・ウォーター	1,000
110	4091	太陽日酸	400
111	4114	日本触媒	100
112	4118	カネカ	1,000
113	4151	協和発酵キリン	600
114	4182	三菱瓦斯化学	2,000
115	4183	三井化学	5,000
116	4185	JSR	1,000
117	4186	東京応化工業	100
118	4188	三菱ケミカルホールディングス	9,700
119	4202	ダイセル	900
120	4203	住友ベークライト	1,000
121	4204	積水化学工業	2,200
122	4205	日本ゼオン	1,000
123	4206	アイカ工業	200
124	4208	宇部興産	8,000
125	4217	日立化成	600
126	4272	日本化薬	1,000
127	4307	野村総合研究所	200
128	4324	電通	500
129	4401	ADEKA	300
130	4403	日油	1,000
131	4452	花王	1,400
132	4502	武田薬品工業	2,700
133	4503	アステラス製薬	6,300
134	4506	大日本住友製薬	500
135	4507	塩野義製薬	500
136	4508	田辺三菱製薬	600
137	4519	中外製薬	300
138	4521	科研製薬	100
139	4523	エーザイ	600
140	4527	ロート製薬	300
141	4528	小野薬品工業	500

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
142	4530	久光製薬	200
143	4534	持田製薬	100
144	4536	参天製薬	700
145	4540	ツムラ	200
146	4543	テルモ	500
147	4544	みらかホールディングス	200
148	4555	沢井製薬	100
149	4568	第一三共	2,400
150	4569	キョーリン製薬ホールディングス	200
151	4578	大塚ホールディングス	1,500
152	4581	大正製薬ホールディングス	100
153	4612	日本ペイントホールディングス	200
154	4613	関西ペイント	500
155	4631	DIC	400
156	4634	東洋インキSCホールディングス	1,000
157	4661	オリエンタルランド	300
158	4665	ダスキン	300
159	4666	パーク24	200
160	4676	フジ・メディア・ホールディングス	1,100
161	4680	ラウンドワン	800
162	4684	オービック	100
163	4689	ヤフー	2,100
164	4704	トレンドマイクロ	300
165	4716	日本オラクル	100
166	4732	ユー・エス・エス	500
167	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	200
168	4751	サイバーエージェント	100
169	4755	楽天	300
170	4768	大塚商会	200
171	4901	富士フイルムホールディングス	1,800
172	4902	コニカミノルタ	2,300
173	4911	資生堂	1,000
174	4912	ライオン	1,000
175	4967	小林製薬	100
176	5002	昭和シェル石油	1,900
177	5012	東燃ゼネラル石油	2,000
178	5019	出光興産	1,200
179	5020	JXホールディングス	35,600
180	5021	コスモエネルギーホールディングス	600
181	5101	横浜ゴム	500
182	5105	東洋ゴム工業	300
183	5108	ブリヂストン	2,200
184	5110	住友ゴム工業	900
185	5201	旭硝子	7,000
186	5202	日本板硝子	11,000
187	5214	日本電気硝子	3,000
188	5232	住友大阪セメント	2,000
189	5233	太平洋セメント	5,000
190	5301	東海カーボン	1,000
191	5332	TOTO	400
192	5333	日本碍子	500

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
193	5334	日本特殊陶業	400
194	5401	新日鐵住金	4,600
195	5406	神戸製鋼所	23,000
196	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	3,900
197	5413	日新製鋼	600
198	5444	大和工業	200
199	5463	丸一鋼管	200
200	5471	大同特殊鋼	2,000
201	5482	愛知製鋼	1,000
202	5486	日立金属	600
203	5631	日本製鋼所	1,000
204	5703	日本軽金属ホールディングス	2,700
205	5706	三井金属鉱業	5,000
206	5711	三菱マテリアル	7,000
207	5713	住友金属鉱山	3,000
208	5714	DOWAホールディングス	1,000
209	5801	古河電気工業	7,000
210	5802	住友電気工業	4,000
211	5803	フジクラ	2,000
212	5901	東洋製罐グループホールディングス	800
213	5929	三和ホールディングス	700
214	5932	三協立山	200
215	5938	LIXILグループ	1,200
216	5947	リンナイ	100
217	5949	ユニプレス	300
218	5991	日本発條	900
219	6098	リクルートホールディングス	600
220	6113	アマダホールディングス	1,100
221	6136	オーエスジー	200
222	6141	DMG森精機	300
223	6146	ディスコ	100
224	6201	豊田自動織機	500
225	6268	ナブテスコ	400
226	6273	SMC	100
227	6301	小松製作所	4,900
228	6302	住友重機械工業	3,000
229	6305	日立建機	700
230	6326	クボタ	2,300
231	6361	荏原製作所	2,000
232	6366	千代田化工建設	1,000
233	6367	ダイキン工業	500
234	6370	栗田工業	500
235	6383	ダイフク	200
236	6406	フジテック	300
237	6412	平和	300
238	6417	SANKYO	300
239	6448	ブラザー工業	1,300
240	6457	グローリー	200
241	6460	セガサミーホールディングス	1,600
242	6465	ホシザキ	100
243	6471	日本精工	1,300

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
244	6472	NTN	2,000
245	6473	ジェイテクト	800
246	6479	ミネベア	700
247	6481	THK	400
248	6501	日立製作所	29,000
249	6502	東芝	26,000
250	6503	三菱電機	8,000
251	6504	富士電機	3,000
252	6506	安川電機	600
253	6586	マキタ	300
254	6588	東芝テック	1,000
255	6592	マブチモーター	100
256	6594	日本電産	300
257	6632	JVCケンウッド	1,200
258	6645	オムロン	700
259	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000
260	6701	日本電気	12,000
261	6702	富士通	11,000
262	6703	沖電気工業	4,000
263	6724	セイコーエプソン	1,000
264	6740	ジャパンディスプレイ	1,500
265	6752	パナソニック	15,600
266	6753	シャープ	8,000
267	6754	アンリツ	700
268	6758	ソニー	4,400
269	6762	TDK	600
270	6767	ミツミ電機	900
271	6770	アルプス電気	400
272	6773	パイオニア	1,900
273	6804	ホシデン	800
274	6806	ヒロセ電機	100
275	6810	日立マクセル	400
276	6816	アルパイン	300
277	6841	横河電機	700
278	6845	アズビル	300
279	6849	日本光電工業	200
280	6856	堀場製作所	100
281	6857	アドバンテスト	500
282	6869	シスメックス	100
283	6902	デンソー	1,600
284	6923	スタンレー電気	500
285	6925	ウシオ電機	400
286	6952	カシオ計算機	500
287	6954	ファナック	300
288	6963	ローム	400
289	6965	浜松ホトニクス	200
290	6967	新光電気工業	500
291	6971	京セラ	1,000
292	6976	太陽誘電	400
293	6981	村田製作所	300
294	6988	日東電工	500



総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
295	6995	東海理化電機製作所	300
296	7003	三井造船	5,000
297	7004	日立造船	800
298	7011	三菱重工業	12,000
299	7012	川崎重工業	5,000
300	7013	IHI	5,000
301	7161	じもとホールディングス	4,300
302	7167	足利ホールディングス	1,300
303	7173	東京TYフィナンシャルグループ	400
304	7180	九州フィナンシャルグループ	2,800
305	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	10,700
306	7201	日産自動車	11,200
307	7202	いすゞ自動車	2,700
308	7203	トヨタ自動車	7,600
309	7205	日野自動車	1,200
310	7211	三菱自動車工業	5,300
311	7222	日産車体	500
312	7230	日信工業	300
313	7239	タチエス	300
314	7240	NOK	300
315	7241	フタバ産業	900
316	7242	KYB	2,000
317	7246	プレス工業	900
318	7248	カルソニックカンセイ	1,000
319	7251	ケーヒン	300
320	7259	アイシン精機	1,200
321	7261	マツダ	1,600
322	7267	本田技研工業	8,300
323	7269	スズキ	1,200
324	7270	富士重工業	1,100
325	7272	ヤマハ発動機	800
326	7274	ショーワ	600
327	7276	小糸製作所	200
328	7278	エクセディ	100
329	7282	豊田合成	400
330	7296	エフ・シー・シー	200
331	7309	シマノ	100
332	7313	テイ・エス テック	300
333	7451	三菱食品	100
334	7458	第一興商	200
335	7459	メディバルホールディングス	1,200
336	7516	ユーナン商事	200
337	7517	黒田電気	200
338	7518	ネットワンシステムズ	800
339	7532	ドンキホーテホールディングス	300
340	7550	ゼンショーホールディングス	400
341	7649	スギホールディングス	100
342	7731	ニコン	1,900
343	7733	オリンパス	300
344	7735	SCREENホールディングス	1,000
345	7741	HOYA	1,100

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
346	7751	キヤノン	6,600
347	7752	リコー	3,600
348	7762	シチズンホールディングス	1,000
349	7832	バンダイナムコホールディングス	700
350	7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	300
351	7862	トッパン・フォームズ	300
352	7911	凸版印刷	3,000
353	7912	大日本印刷	4,000
354	7936	アシックス	200
355	7951	ヤマハ	400
356	7966	リンテック	200
357	7974	任天堂	200
358	7984	コクヨ	400
359	7988	ニフコ	100
360	8001	伊藤忠商事	12,700
361	8002	丸紅	16,700
362	8012	長瀬産業	800
363	8015	豊田通商	1,800
364	8016	オンワードホールディングス	1,000
365	8020	兼松	4,000
366	8028	ファミリーマート	200
367	8031	三井物産	15,400
368	8035	東京エレクトロン	500
369	8036	日立ハイテクノロジーズ	300
370	8037	カメイ	400
371	8053	住友商事	9,700
372	8058	三菱商事	13,200
373	8060	キヤノンマーケティングジャパン	300
374	8078	阪和興業	2,000
375	8086	ニプロ	600
376	8088	岩谷産業	1,000
377	8097	三愛石油	900
378	8098	稲畑産業	400
379	8113	ユニ・チャーム	800
380	8129	東邦ホールディングス	400
381	8130	サンゲツ	300
382	8133	伊藤忠エネクス	600
383	8136	サンリオ	100
384	8140	リョーサン	200
385	8150	三信電気	300
386	8184	島忠	300
387	8218	コメリ	200
388	8219	青山商事	300
389	8227	しまむら	100
390	8233	高島屋	2,000
391	8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	400
392	8252	丸井グループ	700
393	8253	クレディセゾン	300
394	8267	イオン	3,900
395	8270	ユニーグループ・ホールディングス	2,500
396	8273	イズミ	100

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
397	8276	平和堂	200
398	8282	ケーズホールディングス	600
399	8283	PALTAC	300
400	8303	新生銀行	3,000
401	8304	あおぞら銀行	7,000
402	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	74,600
403	8308	りそなホールディングス	72,100
404	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	29,000
405	8316	三井住友フィナンシャルグループ	22,900
406	8324	第四銀行	2,000
407	8325	北越銀行	3,000
408	8327	西日本シティ銀行	4,000
409	8331	千葉銀行	3,000
410	8333	常陽銀行	3,000
411	8334	群馬銀行	1,400
412	8336	武蔵野銀行	200
413	8337	千葉興業銀行	1,100
414	8338	筑波銀行	1,300
415	8341	七十七銀行	6,000
416	8342	青森銀行	2,000
417	8343	秋田銀行	2,000
418	8344	山形銀行	1,000
419	8345	岩手銀行	300
420	8346	東邦銀行	9,000
421	8350	みちのく銀行	3,000
422	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	10,000
423	8355	静岡銀行	2,000
424	8356	十六銀行	3,000
425	8358	スルガ銀行	500
426	8359	八十二銀行	3,000
427	8360	山梨中央銀行	2,000
428	8361	大垣共立銀行	2,000
429	8362	福井銀行	2,000
430	8363	北國銀行	3,000
431	8366	滋賀銀行	1,000
432	8367	南都銀行	3,000
433	8368	百五銀行	3,000
434	8369	京都銀行	1,000
435	8370	紀陽銀行	900
436	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	13,000
437	8379	広島銀行	4,000
438	8381	山陰合同銀行	1,300
439	8382	中国銀行	1,600
440	8385	伊予銀行	1,100
441	8386	百十四銀行	2,000
442	8387	四国銀行	3,000
443	8388	阿波銀行	1,000
444	8392	大分銀行	2,000
445	8393	宮崎銀行	1,000
446	8395	佐賀銀行	2,000
447	8396	十八銀行	2,000

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
448	8397	沖縄銀行	200
449	8399	琉球銀行	700
450	8410	セブン銀行	1,600
451	8411	みずほフィナンシャルグループ	307,300
452	8418	山ロフィナンシャルグループ	2,000
453	8473	SBIホールディングス	500
454	8515	アイフル	1,200
455	8522	名古屋銀行	1,000
456	8524	北洋銀行	5,800
457	8527	愛知銀行	100
458	8541	愛媛銀行	5,000
459	8543	みなと銀行	2,000
460	8544	京葉銀行	1,000
461	8545	関西アーバン銀行	300
462	8558	東和銀行	5,000
463	8570	イオンフィナンシャルサービス	300
464	8591	オリックス	3,900
465	8593	三菱UFJリース	800
466	8600	トモニホールディングス	1,900
467	8601	大和証券グループ本社	25,000
468	8604	野村ホールディングス	10,000
469	8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,100
470	8697	日本取引所グループ	400
471	8713	フィデアホールディングス	4,700
472	8714	池田泉州ホールディングス	2,300
473	8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,800
474	8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	1,600
475	8750	第一生命保険	7,200
476	8766	東京海上ホールディングス	2,100
477	8795	T&Dホールディングス	3,500
478	8801	三井不動産	1,000
479	8802	三菱地所	2,000
480	8804	東京建物	1,000
481	8840	大京	2,000
482	8848	レオパレス21	1,100
483	8905	イオンモール	300
484	9001	東武鉄道	5,000
485	9003	相鉄ホールディングス	1,000
486	9005	東京急行電鉄	3,000
487	9006	京浜急行電鉄	1,000
488	9007	小田急電鉄	1,000
489	9008	京王電鉄	1,000
490	9020	東日本旅客鉄道	1,000
491	9021	西日本旅客鉄道	600
492	9022	東海旅客鉄道	300
493	9031	西日本鉄道	1,000
494	9041	近鉄グループホールディングス	5,000
495	9042	阪急阪神ホールディングス	700
496	9044	南海電気鉄道	1,000
497	9045	京阪ホールディングス	1,000
498	9048	名古屋鉄道	3,000

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
499	9062	日本通運	5,000
500	9064	ヤマトホールディングス	1,600
501	9065	山九	1,000
502	9072	ニッコンホールディングス	200
503	9076	セイノーホールディングス	800
504	9086	日立物流	200
505	9101	日本郵船	13,000
506	9104	商船三井	7,000
507	9107	川崎汽船	8,000
508	9201	日本航空	1,300
509	9202	ANAホールディングス	13,000
510	9364	上組	1,000
511	9375	近鉄エクスプレス	200
512	9401	東京放送ホールディングス	300
513	9404	日本テレビホールディングス	500
514	9409	テレビ朝日ホールディングス	200
515	9412	スカパーJSATホールディングス	800
516	9432	日本電信電話	11,800
517	9433	KDDI	7,100
518	9435	光通信	100
519	9437	NTTドコモ	7,400
520	9468	カドカワ	200
521	9501	東京電力ホールディングス	12,300
522	9502	中部電力	3,800
523	9503	関西電力	3,900
524	9504	中国電力	1,700
525	9505	北陸電力	1,200
526	9506	東北電力	2,100
527	9507	四国電力	800
528	9508	九州電力	1,200
529	9509	北海道電力	900
530	9511	沖縄電力	300
531	9513	電源開発	500
532	9531	東京瓦斯	12,000
533	9532	大阪瓦斯	10,000
534	9533	東邦瓦斯	2,000
535	9602	東宝	200
536	9603	エイチ・アイ・エス	100
537	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	500
538	9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	100
539	9719	SCSK	100
540	9735	セコム	600
541	9744	メイテック	100
542	9747	アサツー ディ・ケイ	300
543	9766	コナミホールディングス	300
544	9783	ベネッセホールディングス	400
545	9810	日鉄住金物産	2,000
546	9831	ヤマダ電機	6,200
547	9832	オートバックスセブン	500
548	9843	ニトリホールディングス	100
549	9861	吉野家ホールディングス	400

総銘柄数			
557	コード	銘柄名	株式数
550	9869	加藤産業	200
551	9934	因幡電機産業	100
552	9948	アークス	300
553	9956	バローホールディングス	200
554	9962	ミスミグループ本社	400
555	9984	ソフトバンクグループ	2,300
556	9987	スズケン	500
557	9989	サンドラッグ	100
			以上

[掲載番号:26]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1613)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## 東証電気機器株価指数連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

1,141,003 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

1,819,469,706 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

1,594.62 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

**東証電気機器株価指数連動型上場投資信託**  
**TOPIX Electric Appliances Exchange Traded Fund**

		東証電気機器株価指数 <sup>(※)</sup>		東証電気機器上場投信				
		TOPIX Electric Appliances Index		TOPIX Electric Appliances Exchange Traded Fund				
		(A)		(B)			(B)-(A)	
		指数終値	日次騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次騰落率	騰落率差	受益権 残存口数	純資産総額 (円)
Year	Day	Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
2016-07	8	1,477.67	-0.58%	1,485.25	-0.57%	0.01%	1,141,003	1,694,669,219
	11	1,541.87	4.34%	1,548.42	4.25%	-0.09%	1,141,003	1,766,756,240
	12	1,594.27	3.40%	1,600.04	3.33%	-0.06%	1,141,003	1,825,655,357
	13	1,618.14	1.50%	1,623.54	1.47%	-0.03%	1,141,003	1,852,458,905
	14	1,629.10	0.68%	1,634.29	0.66%	-0.02%	1,141,003	1,864,724,501
	15	1,632.89	0.23%	1,610.16	-1.48%	-1.71%	1,141,003	1,837,194,138
	19	1,656.40	1.44%	1,633.20	1.43%	-0.01%	1,141,003	1,863,484,527
	20	1,658.69	0.14%	1,635.43	0.14%	0.00%	1,141,003	1,866,032,545
	21	1,678.11	1.17%	1,654.56	1.17%	0.00%	1,141,003	1,887,863,466
	22	1,661.59	-0.98%	1,638.30	-0.98%	0.00%	1,141,003	1,869,303,326
	25	1,669.96	0.50%	1,646.48	0.50%	0.00%	1,141,003	1,878,640,072
	26	1,635.47	-2.07%	1,612.52	-2.06%	0.00%	1,141,003	1,839,892,805
	27	1,667.09	1.93%	1,643.68	1.93%	0.00%	1,141,003	1,875,441,623
	28	1,649.62	-1.05%	1,626.44	-1.05%	0.00%	1,141,003	1,855,771,489
29	1,662.16	0.76%	1,638.67	0.75%	-0.01%	1,141,003	1,869,730,357	
2016-08	1	1,641.16	-1.26%	1,618.04	-1.26%	0.00%	1,141,003	1,846,183,544
	2	1,623.25	-1.09%	1,600.46	-1.09%	0.00%	1,141,003	1,826,132,701
	3	1,589.41	-2.08%	1,567.19	-2.08%	0.01%	1,141,003	1,788,168,879
	4	1,620.96	1.99%	1,598.13	1.97%	-0.01%	1,141,003	1,823,474,848
	5	1,617.37	-0.22%	1,594.62	-0.22%	0.00%	1,141,003	1,819,469,706

(※)「東証電気機器株価指数」について

- ① 東証電気機器株価指数の指数値および東証電気機器株価指数の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及び東証電気機器株価指数の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。
- ② 東京証券取引所は、東証電気機器株価指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証電気機器株価指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証電気機器株価指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ 東京証券取引所は、東証電気機器株価指数の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ 東京証券取引所は、東証電気機器株価指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また東京証券取引所は、東証電気機器株価指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」は、東証電気機器株価指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」の純資産価額と東証電気機器株価指数の間に乖離が発生することがある。
- ⑥ 「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦ 東京証券取引所は「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」の購入者又は公衆に対し、「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、東京証券取引所は「東証電気機器株価指数連動型上場投資信託」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

(i) The TOPIX Electric Appliances and TOPIX Index Value and the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX Electric Appliances and TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Index Value or to change the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Electric Appliances and TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX Electric Appliances ETF may be substantially deviated from the TOPIX Electric Appliances although the investment objective of the TOPIX Electric Appliances ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Electric Appliances Index Value. (vi) The TOPIX Electric Appliances ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the TOPIX Electric Appliances ETF or an advice on investments in the TOPIX Electric Appliances ETF to any purchaser of the TOPIX Electric Appliances ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX Electric Appliances ETF.



## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 100万口以上100万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
162			
1	3105	日清紡ホールディングス	3,900
2	4062	イビデン	4,300
3	4902	コニカミノルタ	17,500
4	6448	ブラザー工業	9,000
5	6479	ミネベア	11,300
6	6501	日立製作所	178,000
7	6502	東芝	147,000
8	6503	三菱電機	75,000
9	6504	富士電機	21,000
10	6505	東洋電機製造	1,000
11	6506	安川電機	8,700
12	6507	シンフォニアテクノロジー	5,000
13	6508	明電舎	6,000
14	6513	オリジン電気	1,000
15	6516	山洋電気	2,000
16	6517	デンヨー	600
17	6588	東芝テック	5,000
18	6590	芝浦メカトロニクス	1,000
19	6592	マブチモーター	2,000
20	6594	日本電産	8,400
21	6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100
22	6617	東光高岳	400
23	6619	ダブル・スコープ	700
24	6620	宮越ホールディングス	200
25	6622	ダイヘン	4,000
26	6624	田淵電機	800
27	6630	ヤーマン	100
28	6632	JVCケンウッド	5,100
29	6638	ミマキエンジニアリング	600
30	6640	第一精工	300
31	6641	日新電機	1,600
32	6644	大崎電気工業	2,000
33	6645	オムロン	7,900
34	6651	日東工業	1,100
35	6652	IDEC	900
36	6654	不二電機工業	100
37	6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	13,000
38	6675	サクサホールディングス	2,000
39	6676	メルコホールディングス	400

総銘柄数 162	コード	銘柄名	株式数
40	6678	テクノメディカ	200
41	6701	日本電気	96,000
42	6702	富士通	67,000
43	6703	沖電気工業	30,000
44	6704	岩崎通信機	3,000
45	6706	電気興業	2,000
46	6707	サンケン電気	4,000
47	6715	ナカヨ	1,000
48	6718	アイホン	400
49	6723	ルネサスエレクトロニクス	3,600
50	6724	セイコーエプソン	10,400
51	6727	ワコム	5,400
52	6728	アルバック	1,300
53	6730	アクセル	300
54	6737	EIZO	700
55	6740	ジャパンディスプレイ	13,100
56	6741	日本信号	1,900
57	6742	京三製作所	2,000
58	6744	能美防災	800
59	6745	ホーチキ	500
60	6750	エレコム	600
61	6751	日本無線	2,000
62	6752	パナソニック	79,900
63	6754	アンリツ	4,200
64	6755	富士通ゼネラル	3,000
65	6756	日立国際電気	1,600
66	6758	ソニー	49,300
67	6762	TDK	4,200
68	6763	帝国通信工業	2,000
69	6767	ミツミ電機	2,700
70	6768	タムラ製作所	3,000
71	6770	アルプス電気	6,000
72	6771	池上通信機	2,000
73	6773	パイオニア	11,300
74	6779	日本電波工業	600
75	6785	鈴木	300
76	6788	日本トリム	200
77	6789	ローランド ディー. ジー.	400
78	6794	フォスター電機	900
79	6796	クラリオン	4,000
80	6798	SMK	2,000
81	6800	ヨコオ	500
82	6803	ティアック	5,000
83	6804	ホシデン	2,100
84	6806	ヒロセ電機	1,200
85	6807	日本航空電子工業	2,000
86	6809	TOA	800
87	6810	日立マクセル	1,200
88	6814	古野電気	800
89	6815	ユニデンホールディングス	2,000
90	6816	アルパイン	1,700

総銘柄数 162	コード	銘柄名	株式数
91	6817	スミダコーポレーション	600
92	6820	アイコム	400
93	6823	リオン	300
94	6826	本多通信工業	200
95	6839	船井電機	700
96	6841	横河電機	7,000
97	6844	新電元工業	2,000
98	6845	アズビル	2,300
99	6848	東亜ディーケーケー	400
100	6849	日本光電工業	2,900
101	6850	チノー	200
102	6853	共和電業	800
103	6855	日本電子材料	300
104	6856	堀場製作所	1,400
105	6857	アドバンテスト	4,800
106	6858	小野測器	300
107	6859	エスベック	700
108	6860	パナソニック デバイスSUNX	600
109	6861	キーエンス	1,500
110	6866	日置電機	400
111	6869	シスメックス	5,500
112	6871	日本マイクロニクス	1,300
113	6875	メガチップス	700
114	6877	OBARA GROUP	400
115	6905	コーセル	1,000
116	6908	イリソ電子工業	200
117	6911	新日本無線	500
118	6914	オプテックス	500
119	6915	千代田インテグレ	400
120	6916	アイ・オー・データ機器	200
121	6920	レーザーテック	800
122	6923	スタンレー電気	5,000
123	6924	岩崎電気	2,000
124	6925	ウシオ電機	4,200
125	6926	岡谷電機産業	400
126	6927	ヘリオス テクノ ホールディング	600
127	6929	日本セラミック	600
128	6932	遠藤照明	400
129	6935	日本デジタル研究所	600
130	6937	古河電池	1,000
131	6938	双信電機	300
132	6941	山一電機	600
133	6947	凶研	500
134	6951	日本電子	3,000
135	6952	カシオ計算機	7,000
136	6954	ファナック	7,100
137	6958	日本シイエムケイ	1,500
138	6961	エンブラス	400
139	6962	大真空	1,000
140	6963	ローム	3,400
141	6965	浜松ホトニクス	5,500

総銘柄数			
162	コード	銘柄名	株式数
142	6966	三井ハイテック	1,000
143	6967	新光電気工業	2,600
144	6971	京セラ	11,500
145	6976	太陽誘電	3,400
146	6981	村田製作所	7,400
147	6985	ユーシン	900
148	6986	双葉電子工業	1,100
149	6989	北陸電気工業	3,000
150	6996	ニチコン	2,200
151	6997	日本ケミコン	6,000
152	6999	KOA	1,000
153	7244	市光工業	2,000
154	7276	小糸製作所	4,200
155	7280	ミツバ	1,200
156	7718	スター精密	1,300
157	7735	SCREENホールディングス	7,000
158	7739	キヤノン電子	600
159	7751	キヤノン	37,600
160	7752	リコー	22,600
161	7999	MUTOHホールディングス	1,000
162	8035	東京エレクトロン	5,800
			以上

[掲載番号:27]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号)	1615)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## 東証銀行業株価指数連動型上場投資信託に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

162,785,115 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

23,183,459,004 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

142.42 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以上

# 東証銀行業株価指数連動型上場投資信託 TOPIX Banks Exchange Traded Fund

		東証銀行業株価指数 <sup>(※)</sup> TOPIX Banks Index		東証銀行業上場投信 TOPIX Banks Exchange Traded Fund				
		(A)	(B)	(B)-(A)				
		指数終値	純資産価額	日次	騰落率差	受益権	純資産総額	
			(一口当たり)	騰落率	騰落率差	残存口数	(円)	
			NAV	Daily	Return	Unit	NAV	
Year	Day	Index Value	(per Unit)	Return	Differential	Outstanding		
-Month	Day							
2016-07	8	121.67	129.09	-1.42%	0.07%	162,785,115	21,014,094,943	
	11	126.85	134.33	4.26%	-0.20%	162,785,115	21,867,324,923	
	12	133.59	141.15	5.31%	-0.24%	162,785,115	22,977,036,635	
	13	138.78	146.40	3.89%	-0.17%	162,785,115	23,831,238,882	
	14	138.44	146.06	-0.24%	0.01%	162,785,115	23,775,597,313	
	15	143.25	145.17	3.47%	-4.08%	162,785,115	23,630,831,408	
	19	143.59	145.51	0.24%	0.00%	162,785,115	23,686,540,417	
	20	141.45	143.34	-1.49%	0.00%	162,785,115	23,334,276,317	
	21	143.38	145.30	1.36%	0.00%	162,785,115	23,652,095,082	
	22	141.20	143.08	-1.52%	-0.01%	162,785,115	23,291,479,938	
	25	140.40	142.27	-0.57%	0.00%	162,785,115	23,159,731,054	
	26	137.83	139.68	-1.83%	0.01%	162,785,115	22,737,453,037	
	27	138.70	140.55	0.63%	-0.01%	162,785,115	22,879,488,676	
	28	135.78	137.60	-2.11%	0.01%	162,785,115	22,399,382,308	
2016-08	29	145.12	147.05	6.88%	-0.01%	162,785,115	23,937,336,478	
	1	149.95	151.93	3.33%	-0.01%	162,785,115	24,732,686,072	
	2	143.23	145.14	-4.48%	0.01%	162,785,115	23,625,897,986	
	3	137.49	139.32	-4.01%	0.00%	162,785,115	22,678,809,805	
	4	141.06	142.93	2.60%	-0.01%	162,785,115	23,267,299,741	
	5	140.55	142.42	-0.36%	0.00%	162,785,115	23,183,459,004	

(※) 「東証銀行業株価指数」について

- ① 東証銀行業株価指数の指数値および東証銀行業株価指数の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及び東証銀行業株価指数の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。
- ② 東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証銀行業株価指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証銀行業株価指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ 東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ 東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」は、東証銀行業株価指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の純資産価額と東証銀行業株価指数の間に乖離が発生することがある。
- ⑥ 「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑦ 東京証券取引所は「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の購入者又は公衆に対し、「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の説明、投資のアドバイスを有する義務を持たない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、東京証券取引所は「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

(i) The TOPIX Banks and TOPIX Index Value and the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX Banks and TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value or to change the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX Banks ETF may be substantially deviated from the TOPIX Banks although the investment objective of the TOPIX Banks ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Banks Index Value. (vi) The TOPIX Banks ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the TOPIX Banks ETF or an advice on investments in the TOPIX Banks ETF to any purchaser of the TOPIX Banks ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX Banks ETF.

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年8月10日)、交換受付日(平成28年8月12日)分の交換口数は以下の通りです。

交換口数: 500万口以上500万口単位

## ○ 設定ポートフォリオ

※設定申込日(平成28年8月10日)、設定受付日(平成28年8月12日)分の設定ポートフォリオは以下の通りです。

総銘柄数	コード	銘柄名	株式数
87			
1	7150	島根銀行	100
2	7161	じもとホールディングス	3,500
3	7167	足利ホールディングス	3,600
4	7173	東京TYフィナンシャルグループ	700
5	7180	九州フィナンシャルグループ	7,500
6	7182	ゆうちょ銀行	12,600
7	7184	富山第一銀行	1,300
8	7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	34,300
9	8303	新生銀行	43,000
10	8304	あおぞら銀行	31,000
11	8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	395,100
12	8308	りそなホールディングス	57,600
13	8309	三井住友トラスト・ホールディングス	103,000
14	8316	三井住友フィナンシャルグループ	39,400
15	8324	第四銀行	6,000
16	8325	北越銀行	5,000
17	8327	西日本シティ銀行	16,000
18	8331	千葉銀行	19,000
19	8333	常陽銀行	18,000
20	8334	群馬銀行	10,900
21	8336	武蔵野銀行	800
22	8337	千葉興業銀行	1,300
23	8338	筑波銀行	2,000
24	8341	七十七銀行	8,000
25	8342	青森銀行	4,000
26	8343	秋田銀行	3,000
27	8344	山形銀行	3,000
28	8345	岩手銀行	300
29	8346	東邦銀行	4,000
30	8349	東北銀行	3,000
31	8350	みちのく銀行	2,000
32	8354	ふくおかフィナンシャルグループ	21,000
33	8355	静岡銀行	14,000
34	8356	十六銀行	6,000
35	8358	スルガ銀行	4,700
36	8359	八十二銀行	8,900
37	8360	山梨中央銀行	3,000
38	8361	大垣共立銀行	7,000
39	8362	福井銀行	4,000

総銘柄数			
87	コード	銘柄名	株式数
40	8363	北國銀行	5,000
41	8364	清水銀行	200
42	8365	富山銀行	100
43	8366	滋賀銀行	5,000
44	8367	南都銀行	5,000
45	8368	百五銀行	4,000
46	8369	京都銀行	9,000
47	8370	紀陽銀行	1,900
48	8374	三重銀行	2,000
49	8377	ほくほくフィナンシャルグループ	34,000
50	8379	広島銀行	15,000
51	8381	山陰合同銀行	3,000
52	8382	中国銀行	3,500
53	8383	鳥取銀行	2,000
54	8385	伊予銀行	5,300
55	8386	百十四銀行	5,000
56	8387	四国銀行	4,000
57	8388	阿波銀行	4,000
58	8392	大分銀行	3,000
59	8393	宮崎銀行	3,000
60	8395	佐賀銀行	3,000
61	8396	十八銀行	3,000
62	8397	沖縄銀行	500
63	8399	琉球銀行	1,000
64	8410	セブン銀行	18,500
65	8411	みずほフィナンシャルグループ	700,600
66	8416	高知銀行	2,000
67	8418	山口フィナンシャルグループ	4,000
68	8521	長野銀行	2,000
69	8522	名古屋銀行	4,000
70	8524	北洋銀行	7,400
71	8527	愛知銀行	200
72	8529	第三銀行	3,000
73	8530	中京銀行	2,000
74	8537	大光銀行	2,000
75	8541	愛媛銀行	3,000
76	8542	トマト銀行	2,000
77	8543	みなと銀行	4,000
78	8544	京葉銀行	4,000
79	8545	関西アーバン銀行	700
80	8550	栃木銀行	3,000
81	8551	北日本銀行	200
82	8558	東和銀行	9,000
83	8562	福島銀行	6,000
84	8563	大東銀行	3,000
85	8600	トモニホールディングス	3,800
86	8713	フィデアホールディングス	4,000
87	8714	池田泉州ホールディングス	5,200

以上



[掲載番号:28]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1678)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

33,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

4,015,165,808 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

118.44 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は12,953.21(平成28年8月5日現在)です

※「CNX Nifty指数」は名称が変更され「Nifty 50指数」となりました。

※「NEXT FUNDS インド株式指数・CNX Nifty連動型上場投信」は、平成28年4月27日に  
名称が変更され、「NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50連動型上場投信」となりました。

以上

[掲載番号:29]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1682)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

1,940,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

400,113,230 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

206.24 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は217.59(平成28年8月5日現在)です

以上

[掲載番号:30]  
各位

平成28年8月8日

会社名	野村アセットマネジメント株式会社
代表者名	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
(コード番号	1699)
問い合わせ先	商品企画部長 渡部 昭裕
	TEL 03-3241-9511

## NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス 連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(平成28年8月5日現在)

118,600,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年8月5日現在)

34,484,599,040 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年8月5日現在)

290.76 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(平成28年8月5日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は29,792.62(平成28年8月5日現在)です

以上