

平成28年9月27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9月26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9月27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9月26日現在)

2,262,180,819 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

3,069,814,353,160 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

1,357.02 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9月26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上場投信				
		TOPIX Index		TOPIX 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							
2016-08	26	1,287.90	-1.26%	1,308.07	-1.25%	0.00%	2,086,096,450	2,728,760,154,131
	29	1,313.24	1.97%	1,334.15	1.99%	0.03%	2,086,096,450	2,783,161,657,394
	30	1,312.81	-0.03%	1,333.71	-0.03%	0.00%	2,086,096,450	2,782,254,857,250
	31	1,329.54	1.27%	1,350.70	1.27%	0.00%	2,086,096,450	2,817,696,438,270
2016-09	1	1,337.38	0.59%	1,358.68	0.59%	0.00%	2,086,096,450	2,834,331,123,194
	2	1,340.76	0.25%	1,362.12	0.25%	0.00%	2,086,096,450	2,841,503,654,306
	5	1,343.85	0.23%	1,365.21	0.23%	0.00%	2,116,089,350	2,888,916,282,832
	6	1,352.58	0.65%	1,374.09	0.65%	0.00%	2,116,089,350	2,907,689,367,192
	7	1,349.53	-0.23%	1,370.97	-0.23%	0.00%	2,116,089,350	2,901,093,881,979
	8	1,345.95	-0.27%	1,367.32	-0.27%	0.00%	2,120,087,350	2,898,845,940,068
	9	1,343.86	-0.16%	1,365.23	-0.15%	0.00%	2,120,087,350	2,894,411,421,808
	12	1,323.10	-1.54%	1,344.10	-1.55%	0.00%	2,128,130,868	2,860,411,968,723
	13	1,322.99	-0.01%	1,344.00	-0.01%	0.00%	2,208,127,768	2,967,734,068,489
	14	1,314.74	-0.62%	1,335.62	-0.62%	0.00%	2,206,186,619	2,946,630,597,488
	15	1,301.11	-1.04%	1,321.76	-1.04%	0.00%	2,206,186,619	2,916,039,861,490
	16	1,311.50	0.80%	1,332.31	0.80%	0.00%	2,206,186,619	2,939,323,974,654
	20	1,316.97	0.42%	1,337.84	0.42%	0.00%	2,206,186,619	2,951,533,062,682
	21	1,352.67	2.71%	1,374.19	2.72%	0.01%	2,258,183,019	3,103,177,136,582
	23	1,349.56	-0.23%	1,370.93	-0.24%	-0.01%	2,262,180,819	3,101,284,105,443
	26	1,335.84	-1.02%	1,357.02	-1.01%	0.00%	2,262,180,819	3,069,814,353,160

(※) 「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9月27日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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9月27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9月26日現在)

191,385 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

4,832,148,036 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

25,248.31 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9月26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33,272.04(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:3]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

5,072,733 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

3,194,620,776 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

629.76 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9月26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	日次	騰落率差	受益権	純資産総額	
		騰落率	(一口当たり)	騰落率	騰落率差	残存口数	(円)	
		Daily	NAV	Daily	Return	Unit	NAV	
		Return	(per Unit)	Return	Differential	Outstanding		
Year		Index Value						
-Month	Day							
2016-08	26	624.55	-1.49%	617.68	-1.49%	0.00%	5,072,733	3,133,336,044
	29	638.65	2.26%	631.78	2.28%	0.03%	5,072,733	3,204,871,410
	30	638.20	-0.07%	631.32	-0.07%	0.00%	5,072,733	3,202,538,456
	31	646.22	1.26%	639.24	1.25%	0.00%	5,072,733	3,242,693,629
2016-09	1	651.44	0.81%	644.40	0.81%	0.00%	5,072,733	3,268,873,015
	2	654.22	0.43%	647.14	0.43%	0.00%	5,072,733	3,282,792,128
	5	655.24	0.16%	648.15	0.16%	0.00%	5,072,733	3,287,883,983
	6	656.52	0.20%	649.43	0.20%	0.00%	5,072,733	3,294,386,189
	7	652.01	-0.69%	644.96	-0.69%	0.00%	5,072,733	3,271,734,234
	8	648.37	-0.56%	641.38	-0.56%	0.00%	5,072,733	3,253,534,609
	9	646.93	-0.22%	639.95	-0.22%	0.00%	5,072,733	3,246,304,903
	12	635.98	-1.69%	629.12	-1.69%	0.00%	5,072,733	3,191,337,888
	13	634.52	-0.23%	627.67	-0.23%	0.00%	5,072,733	3,183,979,376
	14	629.10	-0.85%	622.31	-0.85%	0.00%	5,072,733	3,156,793,423
	15	620.47	-1.37%	613.76	-1.37%	0.00%	5,072,733	3,113,463,808
	16	623.17	0.44%	616.41	0.43%	0.00%	5,072,733	3,126,901,046
	20	627.81	0.74%	620.97	0.74%	0.00%	5,072,733	3,150,035,612
	21	647.53	3.14%	640.47	3.14%	0.00%	5,072,733	3,248,956,159
	23	642.60	-0.76%	635.60	-0.76%	0.00%	5,072,733	3,224,229,280
	26	636.71	-0.92%	629.76	-0.92%	0.00%	5,072,733	3,194,620,776

(※) 「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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30日)分の交換口数は  
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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30日)分の設定ポートフォリオは  
以下の通りです。

総銘柄数			
30	コード	銘柄名	株式数
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	2,200
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	キャノン	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	77,500
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	138,800
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	9,600
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9月27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9月26日現在)

209,260 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

3,368,260,590 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

16,096.1 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9月26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

# Russell/Nomura Small Cap Core Index Linked Exchange Traded Fund

Russell/Nomura Small Cap Core インデックス(※) Russell/Nomura Small Cap Core インデックス上場投信

		<i>Russell/Nomura Small Cap Core Index</i>		<i>Russell/Nomura Small Cap Core Index Linked Exchange Traded Fund</i>				
		(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)
		NAV	Daily Return	NAV	Daily Return	Return Differential	Unit	NAV
-Month	Day	Index Value	Return	(per Unit)	Return	Differential	Outstanding	
2016-08	26	158.99	-0.93%	15,419.8	-0.93%	0.00%	209,260	3,226,752,537
	29	160.69	1.06%	15,592.0	1.12%	0.05%	209,260	3,262,790,006
	30	160.33	-0.22%	15,556.2	-0.23%	-0.01%	209,260	3,255,299,422
2016-09	31	161.87	0.97%	15,707.5	0.97%	0.01%	209,260	3,286,953,294
	1	162.60	0.45%	15,777.4	0.45%	0.00%	209,260	3,301,587,600
	2	162.20	-0.24%	15,739.4	-0.24%	0.00%	209,260	3,293,628,859
	5	162.75	0.34%	15,790.9	0.33%	-0.01%	209,260	3,304,396,434
	6	164.89	1.32%	15,997.6	1.31%	-0.01%	209,260	3,347,667,945
	7	165.11	0.14%	16,018.8	0.13%	0.00%	209,260	3,352,094,426
	8	164.76	-0.21%	15,984.8	-0.21%	0.00%	209,260	3,344,979,435
	9	164.33	-0.26%	15,942.5	-0.26%	0.00%	209,260	3,336,125,263
	12	162.10	-1.35%	15,726.2	-1.36%	0.00%	209,260	3,290,855,689
	13	162.63	0.32%	15,776.7	0.32%	0.00%	209,260	3,301,432,728
	14	161.64	-0.61%	15,680.9	-0.61%	0.00%	209,260	3,281,380,087
	15	160.43	-0.75%	15,563.7	-0.75%	0.00%	209,260	3,256,869,084
	16	162.19	1.09%	15,732.6	1.09%	-0.01%	209,260	3,292,209,595
	20	162.39	0.13%	15,751.6	0.12%	0.00%	209,260	3,296,188,749
21	166.47	2.51%	16,146.3	2.51%	0.00%	209,260	3,378,772,597	
23	167.54	0.64%	16,249.0	0.64%	-0.01%	209,260	3,400,264,109	
26	165.97	-0.94%	16,096.1	-0.94%	0.00%	209,260	3,368,260,590	

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

Russell/Nomura Small Cap Core インデックス(※) Russell/Nomura Small Cap Core インデックス上場投信  
 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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30日)分の交換口数は  
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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30日)分の設定ポートフォリオは  
以下の通りです。

総銘柄数			
348	コード	銘柄名	株式数
1	1332	日本水産	12,700
2	1333	マルハニチロ	2,000
3	1377	サカタのタネ	1,500
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	5,100
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	38,600
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	13,800
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	2,500
32	2121	ミクシィ	1,900
33	2127	日本M&Aセンター	3,200
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	1,600
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	6,000

総銘柄数			
348	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	7,800
43	2579	コカ・コーラウエスト	3,300
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	3,700
56	2815	アリアケジャパン	900
57	2871	ニチレイ	5,100
58	2931	ユーグレナ	2,600
59	3002	ゲンゼ	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	グリーン	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	2,500
82	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,500
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	8,100
88	4023	クレハ	600
89	4041	日本曹達	6,000
90	4043	トクヤマ	15,000

総銘柄数				
348	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	太陽日酸		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		7,000
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		1,500
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		2,400
119	4819	デジタルガレージ		1,700
120	4917	マンダム		1,000
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		4,400
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		3,800
134	5423	東京製鐵		5,200
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		2,900
140	5703	日本軽金属ホールディングス		22,200
141	5706	三井金属鉱業		28,000

総銘柄数			
348	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	3,200
145	5803	フジクラ	13,700
146	5929	三和ホールディングス	9,700
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	5,800
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	2,600
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	3,900
165	6406	フジテック	3,300
166	6412	平和	2,600
167	6413	理想科学工業	1,300
168	6432	竹内製作所	1,600
169	6436	アマノ	2,700
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	4,100
177	6727	ワコム	7,400
178	6728	アルバック	1,500
179	6740	ジャパンディスプレイ	18,500
180	6754	アンリツ	6,700
181	6755	富士通ゼネラル	3,000
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	14,600
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	2,900
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	8,000

総銘柄数			
348	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	1,600
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	ネットワークシステムズ	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	1,900
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	600
237	7981	タカラスタンダード	1,800
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			
348	コード	銘柄名	株式数
244	8056	日本ユニシス	2,800
245	8060	キャ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	2,300
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	8273	イズミ	1,500
263	8276	平和堂	1,300
264	8279	ヤオコー	700
265	8282	ケーズホールディングス	4,100
266	8283	PALTAC	1,500
267	8324	第四銀行	13,000
268	8336	武蔵野銀行	1,400
269	8341	七十七銀行	14,000
270	8342	青森銀行	9,000
271	8344	山形銀行	6,000
272	8345	岩手銀行	700
273	8346	東邦銀行	9,000
274	8356	十六銀行	14,000
275	8360	山梨中央銀行	7,000
276	8361	大垣共立銀行	14,000
277	8363	北國銀行	11,000
278	8366	滋賀銀行	10,000
279	8367	南都銀行	1,000
280	8368	百五銀行	10,000
281	8370	紀陽銀行	3,200
282	8381	山陰合同銀行	6,300
283	8386	百十四銀行	10,000
284	8388	阿波銀行	9,000
285	8392	大分銀行	7,000
286	8397	沖縄銀行	1,000
287	8399	琉球銀行	1,700
288	8424	芙蓉総合リース	800
289	8425	興銀リース	1,100
290	8439	東京センチュリー	2,100
291	8508	Jトラスト	4,000
292	8511	日本証券金融	4,700
293	8515	アイフル	14,100
294	8524	北洋銀行	13,900



総銘柄数			
348	コード	銘柄名	株式数
295	8544	京葉銀行	11,000
296	8550	栃木銀行	4,700
297	8585	オリエントコーポレーション	28,300
298	8586	日立キャピタル	2,300
299	8595	ジャフコ	1,400
300	8600	トモニホールディングス	6,800
301	8609	岡三証券グループ	7,000
302	8613	丸三証券	2,700
303	8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,000
304	8628	松井証券	5,600
305	8698	マネックスグループ	9,700
306	8703	カブドットコム証券	7,400
307	8714	池田泉州ホールディングス	11,500
308	8840	大京	14,000
309	8848	レオパレス21	13,000
310	8876	リログループ	500
311	8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	5,600
312	9031	西日本鉄道	13,000
313	9065	山九	12,000
314	9072	ニッコンホールディングス	2,000
315	9075	福山通運	4,000
316	9076	セイノーホールディングス	6,800
317	9086	日立物流	2,100
318	9303	住友倉庫	6,000
319	9375	近鉄エクスプレス	1,700
320	9401	東京放送ホールディングス	4,100
321	9409	テレビ朝日ホールディングス	2,300
322	9412	スカパーJSATホールディングス	6,400
323	9435	光通信	900
324	9449	GMOインターネット	3,400
325	9468	カドカワ	2,400
326	9511	沖縄電力	1,500
327	9601	松竹	4,000
328	9603	エイチ・アイ・エス	1,700
329	9605	東映	3,000
330	9616	共立メンテナンス	600
331	9627	アインホールディングス	1,000
332	9678	カナモト	1,300
333	9681	東京ドーム	3,900
334	9682	DTS	1,000
335	9697	カブコン	2,300
336	9715	トランス・コスモス	1,200
337	9744	メイテック	1,300
338	9747	アサツー ディ・ケイ	1,600
339	9759	NSD	1,800
340	9787	イオンディライト	900
341	9793	ダイセキ	1,800
342	9810	日鉄住金物産	700
343	9830	トラスコ中山	900
344	9832	オートバックスセブン	2,800
345	9861	吉野家ホールディングス	2,700

総銘柄数			
348	コード	銘柄名	株式数
346	9934	因幡電機産業	1,100
347	9948	アークス	1,500
348	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9月27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9月26日現在)

34,632,179 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

9,167,157,157 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

264.70 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9月26日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は268.52(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:6]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

200,867,152 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

3,381,598,558,386 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

16,835.0 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9月26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	純資産価額	日次	受益権	純資産総額	
			Index Value	(一口当たり)	騰落率	残存口数	(円)	
			NAV	NAV	Daily	Unit	NAV	
			(per Unit)	(per Unit)	Return	Outstanding		
					Differential			
2016-08		26	16,360.71	16,638.0	-1.18%	0.00%	193,964,580	3,227,188,551,100
		29	16,737.49	17,033.2	2.30%	0.07%	193,964,580	3,303,846,926,912
		30	16,725.36	17,021.1	-0.07%	0.00%	193,964,580	3,301,494,728,103
2016-09		31	16,887.40	17,185.8	0.97%	0.00%	193,964,580	3,333,435,660,420
		1	16,926.84	17,226.0	0.23%	0.00%	194,986,840	3,358,848,404,027
		2	16,925.68	17,224.8	-0.01%	0.00%	196,060,210	3,377,096,911,564
		5	17,037.63	17,338.3	0.66%	0.00%	195,651,443	3,392,257,701,474
		6	17,081.98	17,383.4	0.26%	0.00%	197,440,646	3,432,190,199,868
		7	17,012.44	17,312.3	-0.41%	0.00%	197,440,646	3,418,153,727,739
		8	16,958.77	17,257.8	-0.32%	0.00%	196,929,864	3,398,571,597,713
		9	16,965.76	17,265.2	0.04%	0.00%	196,112,993	3,385,930,026,984
		12	16,672.92	16,966.6	-1.73%	0.00%	196,368,745	3,331,717,451,286
		13	16,729.04	17,023.7	0.34%	0.00%	196,368,745	3,342,924,879,962
		14	16,614.24	16,906.7	-0.69%	0.00%	196,368,745	3,319,956,496,314
		15	16,405.01	16,694.0	-1.26%	0.00%	196,368,745	3,278,181,099,486
		16	16,519.29	16,809.9	0.70%	0.00%	196,164,282	3,297,505,173,921
		20	16,492.15	16,781.9	-0.16%	0.00%	196,164,282	3,292,011,490,857
21	16,807.62	17,103.9	1.91%	0.01%	200,713,792	3,432,996,484,817		
23	16,754.02	17,048.0	-0.32%	-0.01%	200,764,912	3,422,631,498,263		
26	16,544.56	16,835.0	-1.25%	0.00%	200,867,152	3,381,598,558,386		

(※)「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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30日)分の交換口数は  
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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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	麒麟ホールディングス	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	1,000
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	400
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	4042	東ソー		2,000
45	4043	トクヤマ		2,000
46	4061	デンカ		2,000
47	4063	信越化学工業		2,000
48	4151	協和発酵キリン		2,000
49	4183	三井化学		2,000
50	4188	三菱ケミカルホールディングス		1,000
51	4208	宇部興産		2,000
52	4272	日本化薬		2,000
53	4324	電通		2,000
54	4452	花王		2,000
55	4502	武田薬品工業		2,000
56	4503	アステラス製薬		10,000
57	4506	大日本住友製薬		2,000
58	4507	塩野義製薬		2,000
59	4519	中外製薬		2,000
60	4523	エーザイ		2,000
61	4543	テルモ		4,000
62	4568	第一三共		2,000
63	4689	ヤフー		800
64	4704	トレンドマイクロ		2,000
65	4755	楽天		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		200
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		200
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		400
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		200

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	200
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	400
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	200
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	400
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	8028	ファミリーマート	2,000
164	8031	三井物産	2,000
165	8035	東京エレクトロン	2,000
166	8053	住友商事	2,000
167	8058	三菱商事	2,000
168	8233	高島屋	2,000
169	8252	丸井グループ	2,000
170	8253	クレディセゾン	2,000
171	8267	イオン	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	200
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	1,000
198	9008	京王電鉄	2,000
199	9009	京成電鉄	1,000
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9月27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9月26日現在)

2,014,404 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

687,784,233 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

341.43 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9月26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333,076.89(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:8]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

23,458,550 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

2,326,157,276 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

99.16 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9月26日現在)

-0.41 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は100,139.46(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:9]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

29,279,416 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

4,381,117,613 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

149.63 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9月26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1,823,715.79(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:10]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

1,636,196 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

6,003,935,736 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

3,669.45 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9月26日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指標の終値は4,345.17(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:11]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

107,220,878 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

206,869,076,289 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

1,929.37 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9月26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	純資産価額	騰落率	騰落率差	受益権	純資産総額	
		騰落率	(一口当たり)	騰落率	騰落率差	残存口数	(円)	
		Daily	NAV	Daily	Return	Unit	NAV	
		Return	(per Unit)	Return	Differential	Outstanding		
Year	-Month Day	Index Value						
2016-08	26	1,836.55	1,942.20	0.39%	0.38%	0.00%	105,225,878	204,369,916,346
	29	1,844.98	1,960.37	0.46%	0.94%	0.48%	105,225,878	206,281,263,647
	30	1,831.31	1,945.85	-0.74%	-0.74%	0.00%	105,225,878	204,754,083,732
2016-09	31	1,823.54	1,937.55	-0.42%	-0.43%	0.00%	105,225,878	203,880,913,910
	1	1,823.91	1,937.96	0.02%	0.02%	0.00%	105,424,878	204,309,481,006
	2	1,819.80	1,933.59	-0.23%	-0.23%	0.00%	106,021,478	205,001,803,328
	5	1,820.04	1,933.78	0.01%	0.01%	0.00%	106,021,478	205,022,308,542
	6	1,838.21	1,953.04	1.00%	1.00%	0.00%	106,621,378	208,236,304,776
	7	1,840.34	1,955.34	0.12%	0.12%	0.00%	106,621,378	208,480,639,771
	8	1,832.40	1,946.89	-0.43%	-0.43%	0.00%	106,621,378	207,579,714,234
	9	1,820.82	1,934.58	-0.63%	-0.63%	0.00%	106,621,378	206,267,877,251
	12	1,814.23	1,927.53	-0.36%	-0.36%	0.00%	106,621,378	205,515,790,858
	13	1,834.26	1,948.78	1.10%	1.10%	0.00%	106,621,378	207,781,238,280
	14	1,818.16	1,931.70	-0.88%	-0.88%	0.00%	106,621,378	205,960,425,167
	15	1,815.33	1,928.69	-0.16%	-0.16%	0.00%	106,621,378	205,639,811,517
	16	1,813.11	1,926.33	-0.12%	-0.12%	0.00%	106,621,378	205,387,916,535
	20	1,811.55	1,924.61	-0.09%	-0.09%	0.00%	107,220,878	206,358,790,904
	21	1,802.84	1,915.34	-0.48%	-0.48%	0.00%	107,220,878	205,364,466,929
23	1,807.98	1,920.76	0.29%	0.28%	0.00%	107,220,878	205,945,305,998	
26	1,816.15	1,929.37	0.45%	0.45%	0.00%	107,220,878	206,869,076,289	

(※)「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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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
55			
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	58
4	3249	産業ファンド投資法人 投資証券	12
5	3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	45
6	3278	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	12
7	3279	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	20
8	3281	GLP投資法人 投資証券	94
9	3282	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	17
10	3283	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	61
11	3287	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2
12	3290	SIA不動産投資法人 投資証券	3
13	3292	イオンリート投資法人 投資証券	43
14	3295	ヒューリックリート投資法人 投資証券	32
15	3296	日本リート投資法人 投資証券	13
16	3298	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	27
17	3308	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	2
18	3309	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	30
19	3451	トーセイ・リート投資法人 投資証券	5
20	3453	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	14
21	3455	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	4
22	3459	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	9
23	3460	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	3
24	3462	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	138
25	3463	いちごホテルリート投資法人 投資証券	9
26	3466	ラサールロジポート投資法人 投資証券	36
27	3468	スターアジア不動産投資法人 投資証券	11
28	3470	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	3
29	3471	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	7
30	3472	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	6
31	8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	47
32	8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	43
33	8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	84
34	8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	83
35	8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	29
36	8956	プレミア投資法人 投資証券	44
37	8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	32
38	8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	6
39	8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	98

総銘柄数			
55	コード	銘柄名	投資口数
40	8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	44
41	8963	インヴェンシブル投資法人 投資証券	121
42	8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	16
43	8966	平和不動産リート投資法人 投資証券	34
44	8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	29
45	8968	福岡リート投資法人 投資証券	25
46	8972	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	13
47	8973	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人 投資証券	34
48	8975	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	51
49	8976	大和証券オフィス投資法人 投資証券	17
50	8977	阪急リート投資法人 投資証券	20
51	8979	スターツプロシード投資法人 投資証券	6
52	8984	大和ハウスリート投資法人 投資証券	50
53	8985	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	124
54	8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	54
55	8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	43

以上

[掲載番号:12]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

24,640,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

69,578,531,272 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

2,823.80 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9月26日現在)

-0.46 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は3,080.32(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

180,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

2,408,474,437 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

13,380.41 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9月26日現在)

0.55 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は12,405.40(平成28年9月26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**

J P X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J P X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J P X日経400レバレッジ・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J P X日経400レバレッジ・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2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レバレッジ・インデックス連動型上場投信（J P X日経400レバレッジ指数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:14]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

1,350,596,277 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

6,752.98 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9月26日現在)

-0.28 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は7,235.50(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

60,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

236,975,276 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

3,949.59 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9月26日現在)

-0.56 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は4,532.31(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

678,557 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

8,637,640,623 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

12,729.4 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9月26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>							
		(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	-Month	Day	Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	Unit Outstanding	NAV
2016-08		26	12297.58	-1.23%	12,312.2	-1.23%	0.00%	638,975	7,867,211,802
		29	12534.84	1.93%	12,553.8	1.96%	0.03%	638,975	8,021,534,482
		30	12524.68	-0.08%	12,543.6	-0.08%	0.00%	638,975	8,015,014,996
		31	12666.84	1.14%	12,685.6	1.13%	0.00%	638,975	8,105,777,086
2016-09		1	12730.87	0.51%	12,749.5	0.50%	0.00%	638,975	8,146,628,969
		2	12758.43	0.22%	12,776.9	0.21%	0.00%	638,975	8,164,113,706
		5	12782.36	0.19%	12,800.4	0.18%	0.00%	638,975	8,179,137,235
		6	12858.89	0.60%	12,876.9	0.60%	0.00%	638,975	8,227,993,130
		7	12832.99	-0.20%	12,851.0	-0.20%	0.00%	638,975	8,211,483,871
		8	12777.80	-0.43%	12,795.7	-0.43%	0.00%	638,975	8,176,100,970
		9	12748.68	-0.23%	12,766.4	-0.23%	0.00%	638,975	8,157,436,883
		12	12554.03	-1.53%	12,571.2	-1.53%	0.00%	638,975	8,032,688,874
		13	12590.35	0.29%	12,607.4	0.29%	0.00%	638,975	8,055,804,504
		14	12515.65	-0.59%	12,532.5	-0.59%	0.00%	638,975	8,007,954,606
		15	12402.88	-0.90%	12,419.6	-0.90%	0.00%	638,975	7,935,819,571
		16	12494.64	0.74%	12,511.3	0.74%	0.00%	638,975	7,994,429,139
		20	12551.23	0.45%	12,567.5	0.45%	0.00%	638,975	8,030,304,386
		21	12842.21	2.32%	12,859.1	2.32%	0.00%	638,975	8,216,616,175
23	12830.57	-0.09%	12,846.7	-0.10%	-0.01%	638,975	8,208,748,070		
26	12713.32	-0.91%	12,729.4	-0.91%	0.00%	678,557	8,637,640,623		

(※)「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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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
249			
1	1605	国際石油開発帝石	2,600
2	1808	長谷工コーポレーション	700
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	1,500
6	2181	テンブホールディングス	400
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	2413	エムスリー	400
13	2432	ディー・エヌ・エー	300
14	2433	博報堂DYホールディングス	600
15	2440	ぐるなび	100
16	2502	アサヒグループホールディングス	900
17	2503	キリンホールディングス	2,000
18	2580	コカ・コーライーストジャパン	200
19	2587	サントリー食品インターナショナル	300
20	2593	伊藤園	200
21	2607	不二製油グループ本社	100
22	2651	ローソン	200
23	2670	エービーシー・マート	100
24	2681	ゲオホールディングス	100
25	2685	アダストリア	100
26	2802	味の素	1,300
27	2809	キューピー	200
28	2897	日清食品ホールディングス	200
29	2914	日本たばこ産業	3,000
30	3003	ヒューリック	600
31	3088	マツモトキヨシホールディングス	100
32	3116	トヨタ紡織	100
33	3197	すかいらーく	300
34	3231	野村不動産ホールディングス	300
35	3291	飯田グループホールディングス	400
36	3382	セブン&アイホールディングス	1,900
37	3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	100
38	3391	ツルハホールディングス	100
39	3402	東レ	4,000

総銘柄数			
249	コード	銘柄名	株式数
40	3405	クラレ	900
41	3407	旭化成	3,000
42	3659	ネクソン	400
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	4063	信越化学工業	1,000
47	4088	エア・ウォーター	300
48	4091	大陽日酸	300
49	4118	カネカ	1,000
50	4151	協和発酵キリン	600
51	4182	三菱瓦斯化学	500
52	4185	JSR	500
53	4188	三菱ケミカルホールディングス	3,200
54	4202	ダイセル	700
55	4204	積水化学工業	1,000
56	4217	日立化成	300
57	4307	野村総合研究所	300
58	4321	ケネディクス	600
59	4324	電通	600
60	4452	花王	1,300
61	4502	武田薬品工業	1,900
62	4503	アステラス製薬	5,500
63	4506	大日本住友製薬	300
64	4507	塩野義製薬	700
65	4508	田辺三菱製薬	500
66	4519	中外製薬	500
67	4523	エーザイ	700
68	4528	小野薬品工業	1,000
69	4530	久光製薬	100
70	4536	参天製薬	900
71	4540	ツムラ	200
72	4543	テルモ	700
73	4544	みらかホールディングス	100
74	4555	沢井製薬	100
75	4568	第一三共	1,600
76	4578	大塚ホールディングス	1,100
77	4612	日本ペイントホールディングス	400
78	4631	DIC	200
79	4661	オリエンタルランド	500
80	4666	パーク24	200
81	4681	リゾートトラスト	200
82	4689	ヤフー	3,300
83	4704	トレンドマイクロ	300
84	4739	伊藤忠テクノソリューションズ	100
85	4751	サイバーエージェント	300
86	4755	楽天	2,200
87	4768	大塚商会	100
88	4902	コニカミノルタ	1,200
89	4911	資生堂	900
90	4922	コーセー	100

総銘柄数			
249	コード	銘柄名	株式数
91	4967	小林製薬	100
92	5101	横浜ゴム	300
93	5105	東洋ゴム工業	200
94	5108	ブリヂストン	1,600
95	5110	住友ゴム工業	400
96	5233	太平洋セメント	3,000
97	5332	TOTO	400
98	5333	日本碍子	700
99	5334	日本特殊陶業	400
100	5401	新日鐵住金	1,800
101	5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	1,200
102	5486	日立金属	400
103	5711	三菱マテリアル	300
104	5714	DOWAホールディングス	1,000
105	5802	住友電気工業	1,900
106	5929	三和ホールディングス	500
107	5947	リンナイ	100
108	5991	日本発條	400
109	6098	リクルートホールディングス	600
110	6136	オーエスジー	200
111	6141	DMG森精機	300
112	6146	ディスコ	100
113	6201	豊田自動織機	400
114	6268	ナブテスコ	300
115	6273	SMC	200
116	6301	小松製作所	2,300
117	6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	100
118	6326	クボタ	2,500
119	6361	荏原製作所	200
120	6367	ダイキン工業	600
121	6370	栗田工業	300
122	6395	タダノ	200
123	6448	ブラザー工業	600
124	6460	セガサミーホールディングス	500
125	6465	ホシザキ	100
126	6471	日本精工	1,000
127	6472	NTN	1,000
128	6473	ジェイテクト	500
129	6479	ミネベア	800
130	6481	THK	300
131	6501	日立製作所	12,000
132	6503	三菱電機	4,800
133	6504	富士電機	1,000
134	6506	安川電機	600
135	6586	マキタ	300
136	6592	マブチモーター	100
137	6594	日本電産	500
138	6645	オムロン	500
139	6702	富士通	5,000
140	6703	沖電気工業	200
141	6724	セイコーエプソン	700

総銘柄数			
249	コード	銘柄名	株式数
142	6727	ワコム	400
143	6752	パナソニック	5,500
144	6754	アンリツ	300
145	6756	日立国際電気	100
146	6762	TDK	300
147	6770	アルプス電気	500
148	6806	ヒロセ電機	100
149	6841	横河電機	500
150	6849	日本光電工業	200
151	6856	堀場製作所	100
152	6861	キーエンス	100
153	6869	シスメックス	300
154	6902	デンソー	1,200
155	6923	スタンレー電気	300
156	6925	ウシオ電機	300
157	6952	カシオ計算機	600
158	6954	ファナック	500
159	6963	ローム	200
160	6965	浜松ホトニクス	400
161	6976	太陽誘電	300
162	6981	村田製作所	500
163	6988	日東電工	400
164	6995	東海理化電機製作所	100
165	7011	三菱重工業	7,000
166	7012	川崎重工業	3,000
167	7013	IHI	3,000
168	7201	日産自動車	6,300
169	7202	いすゞ自動車	1,400
170	7203	トヨタ自動車	2,600
171	7205	日野自動車	600
172	7211	三菱自動車工業	1,700
173	7240	NOK	200
174	7259	アイシン精機	400
175	7261	マツダ	1,400
176	7269	スズキ	800
177	7270	富士重工業	1,500
178	7272	ヤマハ発動機	700
179	7276	小糸製作所	200
180	7282	豊田合成	200
181	7309	シマノ	200
182	7313	テイ・エス テック	100
183	7453	良品計画	100
184	7458	第一興商	100
185	7532	ドンキホーテホールディングス	300
186	7599	IDOM	200
187	7606	ユナイテッドアローズ	100
188	7649	スギホールディングス	100
189	7701	島津製作所	1,000
190	7729	東京精密	100
191	7731	ニコン	800
192	7732	トプコン	200



総銘柄数			
249	コード	銘柄名	株式数
193	7733	オリンパス	600
194	7735	SCREENホールディングス	100
195	7741	HOYA	1,100
196	7747	朝日インテック	100
197	7751	キヤノン	2,600
198	7752	リコー	1,600
199	7762	シチズンホールディングス	600
200	7832	バンダイナムコホールディングス	500
201	7936	アシックス	400
202	7951	ヤマハ	400
203	7956	ビジョン	300
204	7988	ニフコ	100
205	8015	豊田通商	500
206	8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	100
207	8035	東京エレクトロン	400
208	8086	ニプロ	300
209	8113	ユニ・チャーム	1,000
210	8219	青山商事	100
211	8227	しまむら	100
212	8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	200
213	8267	イオン	1,600
214	8273	イズミ	100
215	8316	三井住友フィナンシャルグループ	3,400
216	8439	東京センチュリーリース	100
217	8586	日立キャピタル	100
218	8591	オリックス	3,500
219	8593	三菱UFJリース	1,100
220	8601	大和証券グループ本社	4,000
221	8897	タカラレーベン	200
222	8905	イオンモール	300
223	9005	東京急行電鉄	2,000
224	9020	東日本旅客鉄道	800
225	9021	西日本旅客鉄道	400
226	9022	東海旅客鉄道	400
227	9062	日本通運	2,000
228	9201	日本航空	900
229	9202	ANAホールディングス	8,000
230	9432	日本電信電話	3,100
231	9433	KDDI	4,800
232	9437	NTTドコモ	3,600
233	9502	中部電力	1,600
234	9505	北陸電力	400
235	9506	東北電力	1,100
236	9531	東京瓦斯	5,000
237	9532	大阪瓦斯	5,000
238	9603	エイチ・アイ・エス	100
239	9613	エヌ・ティ・ティ・データ	300
240	9678	カナモト	100
241	9697	カプコン	100
242	9719	SCSK	100
243	9735	セコム	500

総銘柄数			
249	コード	銘柄名	株式数
244	9843	ニトリホールディングス	200
245	9861	吉野家ホールディングス	100
246	9956	バローホールディングス	100
247	9962	ミスミグループ本社	500
248	9983	ファーストリテイリング	100
249	9989	サンドラッグ	100
			以上

[掲載番号:17]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

1,150,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

5,702,163,596 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

4,958.40 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9月26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489,535.18(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:18]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

400,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

7,224,567,943 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

18,061.42 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9月26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1,839,840.87(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:19]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

240,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

629,695,630 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

2,623.73 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9月26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2,769.53(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:20]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

120,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

487,404,837 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

4,061.71 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9月26日現在)

0.19 %

※乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は40,822.21(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:21]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

46,800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

505,380,770,461 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

10,798.73 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9月26日現在)

0.44 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は10,307.87(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

12,530,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

30,471,426,190 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

2,431.88 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9月26日現在)

-0.23 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は2,697.99(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

3,372,596 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

66,175,235,013 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

19,621.5 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9月26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)	(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
2016-08	26	19018.42	-1.08%	18,980.5	-1.07%	0.00%	3,172,654	60,218,610,734
	29	19467.28	2.36%	19,426.9	2.35%	-0.01%	3,192,623	62,022,769,674
	30	19490.94	0.12%	19,450.3	0.12%	0.00%	3,192,623	62,097,343,793
2016-09	31	19711.92	1.13%	19,670.1	1.13%	0.00%	3,192,623	62,799,280,808
	1	19802.32	0.46%	19,759.9	0.46%	0.00%	3,192,623	63,086,009,065
	2	19848.68	0.23%	19,805.9	0.23%	0.00%	3,192,623	63,232,718,099
	5	19938.39	0.45%	19,894.4	0.45%	-0.01%	3,192,623	63,515,205,724
	6	20011.00	0.36%	19,966.6	0.36%	0.00%	3,192,623	63,745,766,185
	7	19868.48	-0.71%	19,824.2	-0.71%	0.00%	3,192,623	63,291,307,429
	8	19835.68	-0.17%	19,791.3	-0.17%	0.00%	3,192,623	63,186,232,624
	9	19882.59	0.24%	19,837.9	0.24%	0.00%	3,192,623	63,334,976,734
	12	19567.76	-1.58%	19,523.3	-1.59%	0.00%	3,172,852	61,944,666,473
	13	19538.98	-0.15%	19,494.4	-0.15%	0.00%	3,172,852	61,852,964,609
	14	19405.39	-0.68%	19,361.0	-0.68%	0.00%	3,232,776	62,589,838,905
	15	19211.18	-1.00%	19,167.2	-1.00%	0.00%	3,272,726	62,728,832,647
	16	19301.74	0.47%	19,257.3	0.47%	0.00%	3,272,726	63,023,808,742
20	19429.61	0.66%	19,384.0	0.66%	0.00%	3,292,700	63,825,825,228	
21	19952.80	2.69%	19,905.6	2.69%	0.00%	3,292,700	65,543,212,178	
23	19880.02	-0.36%	19,832.6	-0.37%	0.00%	3,352,621	66,491,353,391	
26	19668.84	-1.06%	19,621.5	-1.06%	0.00%	3,372,596	66,175,235,013	

(※)「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。

平成28年9月27日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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:24]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

23,468,557 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

281,470,779,188 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

11,993.5 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9月26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
2016-08	26	11573.51	-1.25%	11,591.0	-1.24%	0.00%	22,066,543	255,772,423,517
	29	11810.49	2.05%	11,831.3	2.07%	0.03%	22,066,543	261,076,682,994
	30	11810.53	0.00%	11,829.1	-0.02%	-0.02%	22,066,543	261,026,726,049
2016-09	31	11967.56	1.33%	11,986.3	1.33%	0.00%	22,066,543	264,497,074,131
	1	12033.47	0.55%	12,052.2	0.55%	0.00%	22,466,365	270,768,939,653
	2	12061.44	0.23%	12,080.3	0.23%	0.00%	22,466,365	271,400,957,245
	5	12087.00	0.21%	12,105.5	0.21%	0.00%	22,466,365	271,965,493,893
	6	12160.56	0.61%	12,179.1	0.61%	0.00%	22,367,757	272,419,938,667
	7	12119.24	-0.34%	12,137.6	-0.34%	0.00%	22,367,757	271,491,529,225
	8	12070.28	-0.40%	12,088.0	-0.41%	0.00%	22,367,757	270,381,007,171
	9	12055.60	-0.12%	12,073.8	-0.12%	0.00%	22,367,757	270,063,263,891
	12	11870.36	-1.54%	11,887.7	-1.54%	0.00%	22,367,757	265,900,832,780
	13	11870.74	0.00%	11,888.2	0.00%	0.00%	22,467,723	267,101,110,535
	14	11802.24	-0.58%	11,819.5	-0.58%	0.00%	22,467,723	265,556,347,241
	15	11670.87	-1.11%	11,687.7	-1.12%	0.00%	22,467,723	262,596,107,520
	16	11768.86	0.84%	11,785.9	0.84%	0.00%	22,369,113	263,640,121,756
	20	11812.31	0.37%	11,828.9	0.36%	0.00%	22,369,113	264,601,797,860
21	12140.66	2.78%	12,158.7	2.79%	0.01%	23,368,621	284,131,454,906	
23	12105.95	-0.29%	12,122.6	-0.30%	-0.01%	23,468,557	284,500,707,832	
26	11976.89	-1.07%	11,993.5	-1.06%	0.00%	23,468,557	281,470,779,188	

(※)「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。

平成28年9月27日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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:25]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

154,028 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

2,294,351,151 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

14,895.7 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9月26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)		(B)	(B)-(A)			
Year	-Month Day	指数終値	日次騰落率	純資産価額	日次騰落率	騰落率差	受益権	純資産総額
		Index Value	Daily Return	(一口当たり) NAV (per Unit)	Daily Return	Return Differential	残存口数 Unit Outstanding	(円) NAV
2016-08	26	143.45	-1.12%	14,333.6	-1.11%	0.01%	154,028	2,207,778,973
	29	146.38	2.05%	14,629.5	2.06%	0.02%	154,028	2,253,349,945
	30	146.62	0.16%	14,652.1	0.15%	0.00%	154,028	2,256,828,084
2016-09	31	148.97	1.61%	14,886.2	1.60%	-0.01%	154,028	2,292,895,851
	1	150.04	0.71%	14,992.2	0.71%	0.00%	154,028	2,309,211,420
	2	150.48	0.30%	15,036.6	0.30%	0.00%	154,028	2,316,050,946
	5	150.90	0.28%	15,078.6	0.28%	0.00%	154,028	2,322,520,882
	6	151.79	0.59%	15,166.7	0.58%	0.00%	154,028	2,336,089,896
	7	150.93	-0.57%	15,080.2	-0.57%	0.00%	154,028	2,322,770,079
	8	150.38	-0.37%	15,023.8	-0.37%	-0.01%	154,028	2,314,087,000
	9	150.26	-0.08%	15,011.9	-0.08%	0.00%	154,028	2,312,257,354
	12	147.89	-1.58%	14,774.4	-1.58%	-0.01%	154,028	2,275,664,898
	13	147.37	-0.35%	14,723.8	-0.34%	0.01%	154,028	2,267,882,820
	14	146.21	-0.78%	14,609.0	-0.78%	0.00%	154,028	2,250,195,165
	15	144.49	-1.18%	14,435.5	-1.19%	-0.01%	154,028	2,223,466,367
	16	145.86	0.95%	14,571.9	0.94%	-0.01%	154,028	2,244,483,234
	20	146.63	0.53%	14,646.7	0.51%	-0.01%	154,028	2,256,003,131
21	151.43	3.27%	15,126.8	3.28%	0.01%	154,028	2,329,950,893	
23	150.79	-0.42%	15,060.8	-0.44%	-0.01%	154,028	2,319,784,282	
26	149.13	-1.10%	14,895.7	-1.10%	0.00%	154,028	2,294,351,151	

(※) 「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。

平成28年9月27日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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:26]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

1,141,003 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

1,898,031,169 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

1,663.48 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9月26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
2016-08	26	1,647.92	-1.38%	1,624.35	-1.38%	0.00%	1,141,003	1,853,385,681
	29	1,687.88	2.42%	1,663.64	2.42%	-0.01%	1,141,003	1,898,216,531
	30	1,692.62	0.28%	1,668.30	0.28%	0.00%	1,141,003	1,903,534,654
	31	1,725.63	1.95%	1,700.77	1.95%	0.00%	1,141,003	1,940,589,242
2016-09	1	1,725.71	0.00%	1,700.86	0.01%	0.00%	1,141,003	1,940,690,587
	2	1,716.86	-0.51%	1,692.16	-0.51%	0.00%	1,141,003	1,930,754,831
	5	1,723.72	0.40%	1,698.87	0.40%	0.00%	1,141,003	1,938,418,657
	6	1,729.27	0.32%	1,704.30	0.32%	0.00%	1,141,003	1,944,613,616
	7	1,724.18	-0.29%	1,699.27	-0.30%	0.00%	1,141,003	1,938,869,734
	8	1,713.08	-0.64%	1,688.32	-0.64%	0.00%	1,141,003	1,926,381,790
	9	1,716.01	0.17%	1,691.22	0.17%	0.00%	1,141,003	1,929,686,929
	12	1,674.50	-2.42%	1,650.40	-2.41%	0.01%	1,141,003	1,883,114,275
	13	1,681.20	0.40%	1,656.99	0.40%	0.00%	1,141,003	1,890,629,596
	14	1,672.26	-0.53%	1,648.20	-0.53%	0.00%	1,141,003	1,880,601,267
	15	1,660.59	-0.70%	1,636.79	-0.69%	0.01%	1,141,003	1,867,582,703
	16	1,681.55	1.26%	1,657.36	1.26%	-0.01%	1,141,003	1,891,057,025
20	1,689.64	0.48%	1,665.24	0.48%	-0.01%	1,141,003	1,900,047,494	
21	1,718.42	1.70%	1,693.54	1.70%	0.00%	1,141,003	1,932,337,703	
23	1,714.72	-0.22%	1,689.84	-0.22%	0.00%	1,141,003	1,928,116,496	
26	1,687.93	-1.56%	1,663.48	-1.56%	0.00%	1,141,003	1,898,031,169	

(※)「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9月29日)、交換受付日(平成28年9月30日)分の交換口数は  
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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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	ユニカミノルタ	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	74,500
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	テクノメディアカ	200
41	6701	日本電気	96,000
42	6702	富士通	67,000
43	6703	沖電気工業	3,000
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	13,000
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	400
62	6752	パナソニック	79,800
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	エスペック	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	オブテックス	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	図研	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	エンプラス	400
139	6962	大真空	300
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	1,400
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9月27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9月26日現在)

172,781,415 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

26,841,814,605 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

155.35 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9月26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)		
Year		Daily	NAV	Daily	Return	Unit	NAV		
-Month	Day	Return	(per Unit)	Return	Differential	Outstanding			
		Index Value							
2016-08	26	144.77		-0.98%	146.67	-0.97%	0.01%	167,782,815	24,608,207,050
	29	148.45		2.54%	150.39	2.54%	-0.01%	167,782,815	25,232,964,358
	30	150.50		1.38%	152.46	1.38%	0.00%	167,782,815	25,580,087,238
2016-09	31	155.85		3.55%	157.87	3.55%	-0.01%	167,782,815	26,488,658,360
	1	158.39		1.63%	160.45	1.63%	0.00%	167,782,815	26,920,558,164
	2	158.55		0.10%	160.61	0.10%	0.00%	167,782,815	26,946,838,841
	5	157.28		-0.80%	159.32	-0.80%	0.00%	167,782,815	26,730,993,411
	6	158.31		0.65%	160.36	0.65%	0.00%	167,782,815	26,906,424,092
	7	155.44		-1.81%	157.46	-1.81%	0.00%	167,782,815	26,418,279,540
	8	154.21		-0.79%	156.20	-0.80%	-0.01%	167,782,815	26,208,252,474
	9	154.27		0.04%	156.27	0.04%	0.01%	167,782,815	26,218,990,339
	12	151.19		-2.00%	153.15	-2.00%	0.00%	167,782,815	25,695,954,519
	13	148.63		-1.69%	150.56	-1.69%	0.00%	167,782,815	25,260,901,475
	14	146.21		-1.63%	148.10	-1.63%	-0.01%	167,782,815	24,849,125,085
	15	143.50		-1.85%	145.36	-1.85%	0.00%	167,782,815	24,388,764,282
	16	147.71		2.93%	149.62	2.93%	0.00%	167,782,815	25,102,984,228
	20	148.13		0.28%	150.04	0.28%	0.00%	167,782,815	25,174,397,629
	21	158.46		6.97%	160.49	6.96%	-0.01%	167,782,815	26,928,077,134
	23	156.19		-1.43%	158.20	-1.43%	0.01%	167,782,815	26,543,573,802
	26	153.38		-1.80%	155.35	-1.80%	0.00%	172,781,415	26,841,814,605

(※) 「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.

平成28年9月27日

## ○ 交換に係わる交換口数

※交換申込日(平成28年9月29日)、交換受付日(平成28年9月30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9月29日)、設定受付日(平成28年9月30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:28]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

33,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

4,146,160,111 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

122.31 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9月26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13,382.45(平成28年9月26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9月27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9月26日現在)

1,940,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

360,078,287 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

185.61 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9月26日現在)

0.00 %

※乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は196.09(平成28年9月26日現在)です

以上

[掲載番号:30]  
各位

平成28年9月27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9月26日現在)

118,960,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(平成28年9月26日現在)

35,393,620,122 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(平成28年9月26日現在)

297.53 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9月26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30,494.00(平成28年9月26日現在)です

以上