

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年12月20日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	N E X T F U N D S J P X日経インデックス400連動型上場投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成29年6月30日から平成30年6月27日まで) 15兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成29年 6月29日付をもって提出した有価証券届出書（平成29年9月28日提出の有価証券届出書の訂正届出書にて訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

## 委託会社の概況(平成29年11月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村證券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

## ・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

## 2 投資方針

## (5) 投資制限

## &lt; 訂正前 &gt;

## 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・株式への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ・デリバティブの利用は、運用の基本方針にしたがって株式に投資するまでの間、または対象株価指数に連動する投資成果を目指す目的に限るものとし、対象株価指数またはその他のわが国の株価指数を対象とした先物取引の買建に限り、補完的に行なうことができます。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

## 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を下記( )に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。
- ( ) 上記( )の株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないこととします。
- ( ) 上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( ) 委託者は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

## 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## 外国為替予約取引の指図および範囲(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ( ) 上記( )の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ( ) 上記( )の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- ( ) 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( ) 委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ( ) 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

## &lt;訂正後&gt;

## 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・株式への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ・デリバティブの利用は、運用の基本方針にしたがって株式に投資するまでの間、または対象株価指数に連動する投資成果を目指す目的に限るものとし、対象株価指数またはその他のわが国の株価指数を対象とした先物取引の買建に限り、補完的に行なうことができます。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそ

れぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を下記( )に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。
- ( )上記( )の株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないこととします。
- ( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( )委託者は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ( )上記( )の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ( )上記( )の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- ( )委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( )委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

### 3 投資リスク

< 更新後 >

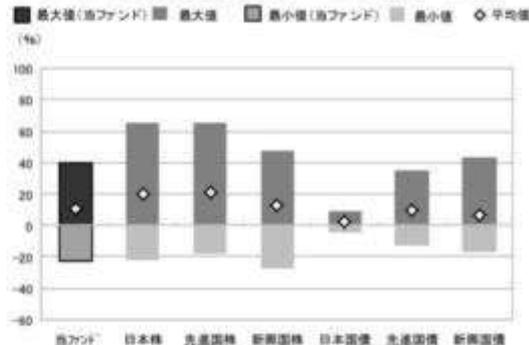
## リスクの定量的比較

(2012年11月末～2017年10月末:月次)

## 〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



## 〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	40.3	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△ 22.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	10.8	20.0	21.4	12.3	2.4	9.4	6.9

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。当初元本(1口あたり)を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2014年8月から2017年10月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2014年12月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2012年11月から2017年10月の5年間(当ファンドは2014年8月から2017年10月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの2014年12月までの年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株：東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債：NOMURA-BPI国債
- 先進国債：シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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く、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあります。また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。米国のJ.P. Morgan Securities LLC(ここでは「JPM」と呼びます)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMMLLはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、Citigroup Index LLC 他)

## 4 手数料等及び税金

## (3) 信託報酬等

## &lt;更新後&gt;

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、次の第1号により計算した額に、第2号により計算した額を加算して得た額とします。ただし、第1号により計算した額(税抜)に、第2号により計算した額(税抜)を加えた額は、信託財産の純資産総額に年0.25%の率を乗じて得た額を超えないものとします。

1. 信託財産の純資産総額に年0.216%(税抜年0.20%)以内で委託会社が定める率(「信託報酬率」といいます。)を乗じて得た額とし、平成29年12月20日現在の信託報酬率およびその配分については純資産総額の残高に応じて次の通りとします。

純資産総額	5,000億円以下の部分	5,000億円超 1兆5,000億円以下の部分	1兆5,000億円超の部分
信託報酬率	年0.216% (税抜年0.20%)	年0.1728% (税抜年0.16%)	年0.1296% (税抜年0.12%)
委託会社(税抜)	年0.15%	年0.12%	年0.09%
受託会社(税抜)	年0.05%	年0.04%	年0.03%

2. 株式の貸付を行なった場合は、その品貸料の43.2%(税抜40%)以内の額とし、その配分については、委託会社は80%、受託会社は20%とします。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払われます。

## 支払先の役務の内容

<委託会社>	<受託会社>
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

## (4) その他の手数料等

## &lt;更新後&gt;

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。なお、受益権の上場に係る費用および対象株価指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(以下、「商標使用料」といいます。)ならびに当該上場に係る費用および当該商標使用料に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支払うことができます。なお、ファンドから支払わない金額については、委託会社の負担となり、委託会社が受領する信託報酬中から支払います。

## &lt;商標使用料&gt;

平成29年12月20日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、最大年0.0432%(税抜年0.04%)を乗じて得た額

純資産総額	商標使用料(税抜)
5,000億円以下の部分	年0.04%
5,000億円超1兆円以下の部分	年0.035%
1兆円超の部分	年0.03%

## &lt; 上場に係る費用 &gt;

平成29年12月20日現在、受益権の上場に係る費用は以下の通りです。

- ・追加上場料：追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.0081%（税抜0.0075%）。
- ・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.0081%（税抜0.0075%）。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産中から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産中から支払われます。

これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

## (5) 課税上の取扱い

## &lt; 更新後 &gt;

## 個人の受益者に対する課税

## 受益権の売却時

売却時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（国税（所得税及び復興特別所得税）15.315%および地方税5%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

## 収益分配金の受取り時

分配金については、20.315%（国税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

## 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

## 損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> <li>・特定公社債<sup>(注1)</sup>の利子</li> <li>・公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・譲渡益</li> <li>・譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・上場株式の配当</li> <li>・公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、平成27年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

(注2) 株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

\* 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、分配金の受取方法によっては非課税とならない場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

##### 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、受益権の取得価額と売却価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

##### 収益分配金の受取り時

収益分配金の益金不算入の対象となります。

益金不算入の限度は株式の配当金と同様の取扱いとなります。

##### 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

なお、税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（平成29年10月末現在）が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は平成29年10月31日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### (1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	538,839,466,360	98.18
現金・預金・その他資産(負債控除後)		9,972,603,711	1.81
合計(純資産総額)		548,812,070,071	100.00

### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	9,902,825,000	1.80

### (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,288,300	6,899.82	8,889,047,762	6,990.00	9,005,217,000	1.64
2	日本	株式	キーエンス	電気機器	141,000	59,838.64	8,437,249,080	62,830.00	8,859,030,000	1.61
3	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,477,700	3,399.06	8,421,858,360	3,523.00	8,728,937,100	1.59
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	834,500	9,219.89	7,694,005,929	9,947.00	8,300,771,500	1.51
5	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	36,961,500	198.67	7,343,445,333	204.90	7,573,411,350	1.37
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,637,800	4,348.64	7,122,202,592	4,517.00	7,397,942,600	1.34
7	日本	株式	ソニー	電気機器	1,673,700	4,149.82	6,945,553,734	4,413.00	7,386,038,100	1.34
8	日本	株式	ファナック	電気機器	272,900	23,903.30	6,523,210,570	26,370.00	7,196,373,000	1.31
9	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,371,900	734.39	6,882,629,641	762.50	7,146,073,750	1.30
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,339,200	2,987.70	6,988,827,840	3,024.00	7,073,740,800	1.28
11	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,270,900	5,172.63	6,573,895,467	5,473.00	6,955,635,700	1.26
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,057,700	6,183.25	6,540,023,525	6,395.00	6,763,991,500	1.23
13	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,783,200	3,692.14	6,583,828,818	3,747.00	6,681,650,400	1.21
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	1,546,000	3,918.53	6,058,059,924	4,243.00	6,559,678,000	1.19
15	日本	株式	日立製作所	電気機器	6,895,000	814.53	5,616,241,700	897.00	6,184,815,000	1.12
16	日本	株式	信越化学工業	化学	500,900	10,109.31	5,063,753,379	11,910.00	5,965,719,000	1.08
17	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	2,086,100	2,567.77	5,356,634,660	2,741.00	5,718,000,100	1.04
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	515,800	10,300.57	5,313,034,006	10,970.00	5,658,326,000	1.03
19	日本	株式	パナソニック	電気機器	3,280,800	1,627.01	5,337,910,480	1,700.50	5,579,000,400	1.01
20	日本	株式	三菱電機	電気機器	2,871,700	1,796.12	5,157,917,804	1,931.50	5,546,688,550	1.01
21	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	1,015,000	5,206.50	5,284,599,880	5,390.00	5,470,850,000	0.99
22	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,185,500	4,339.67	5,144,680,518	4,572.00	5,420,106,000	0.98
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	301,300	16,409.71	4,944,246,407	17,690.00	5,329,997,000	0.97
24	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	257,100	19,809.12	5,092,926,945	20,570.00	5,288,547,000	0.96
25	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,984,800	2,607.77	5,175,901,896	2,648.50	5,256,742,800	0.95
26	日本	株式	日本電産	電気機器	345,600	13,918.61	4,810,271,616	14,995.00	5,182,272,000	0.94
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,067,100	4,496.78	4,798,513,938	4,855.00	5,180,770,500	0.94
28	日本	株式	小松製作所	機械	1,386,600	3,293.55	4,566,847,593	3,697.00	5,126,260,200	0.93
29	日本	株式	ダイキン工業	機械	392,000	11,596.74	4,545,922,962	12,470.00	4,888,240,000	0.89
30	日本	株式	花王	化学	706,200	6,600.95	4,661,597,237	6,836.00	4,827,583,200	0.87

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.04
		鉱業	0.34
		建設業	3.44

	食料品	4.50
	繊維製品	0.56
	パルプ・紙	0.18
	化学	7.31
	医薬品	5.26
	ゴム製品	1.26
	ガラス・土石製品	0.91
	鉄鋼	1.07
	非鉄金属	0.92
	金属製品	0.22
	機械	5.66
	電気機器	16.27
	輸送用機器	8.04
	精密機器	1.61
	その他製品	0.63
	電気・ガス業	1.48
	陸運業	4.75
	空運業	0.77
	情報・通信業	7.09
	卸売業	4.44
	小売業	4.14
	銀行業	6.36
	証券、商品先物取引業	1.16
	保険業	2.90
	その他金融業	1.39
	不動産業	2.74
	サービス業	2.60
合 計		98.18

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	J P X 日経インデックス400 (2017年12月限)	買建	6,350	日本円	9,461,500,000	9,902,825,000	1.80

### (3) 運用実績

## 純資産の推移

平成29年10月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産及び金融商品取引所の取引価格の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）		東京証券取引所 取引価格（円）
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1計算期間	(2014年 4月 7日)	22,804	23,004	10,865.0000	10,960.0000	10,910
第2計算期間	(2014年10月 7日)	100,938	101,686	11,743.0000	11,830.0000	11,750
第3計算期間	(2015年 4月 7日)	213,866	215,519	14,366.0000	14,477.0000	14,380
第4計算期間	(2015年10月 7日)	228,408	230,267	13,393.0000	13,502.0000	13,400
第5計算期間	(2016年 4月 7日)	232,106	234,510	11,490.0000	11,609.0000	11,480
第6計算期間	(2016年10月 7日)	295,021	297,677	12,107.0000	12,216.0000	12,090
第7計算期間	(2017年 4月 7日)	417,199	421,322	13,359.0000	13,491.0000	13,360
第8計算期間	(2017年10月 7日)	523,810	528,272	14,909.0000	15,036.0000	14,920
	2016年10月末日	310,833		12,497.0000		12,500
	11月末日	345,418		13,192.0000		13,170
	12月末日	360,496		13,640.0000		13,620
	2017年 1月末日	374,844		13,664.0000		13,670
	2月末日	397,200		13,776.0000		13,790
	3月末日	426,795		13,666.0000		13,680
	4月末日	436,409		13,701.0000		13,700
	5月末日	428,451		13,991.0000		13,970
	6月末日	444,860		14,384.0000		14,360
	7月末日	460,345		14,419.0000		14,430
	8月末日	482,678		14,354.0000		14,350
	9月末日	524,584		14,931.0000		14,940
	10月末日	548,812		15,647.0000		15,650

決算日が休日の場合は、前営業日の取引価格を記載しております。

## 分配の推移

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	95.0000円
第2計算期間	2014年 4月 8日～2014年10月 7日	87.0000円
第3計算期間	2014年10月 8日～2015年 4月 7日	111.0000円
第4計算期間	2015年 4月 8日～2015年10月 7日	109.0000円
第5計算期間	2015年10月 8日～2016年 4月 7日	119.0000円
第6計算期間	2016年 4月 8日～2016年10月 7日	109.0000円
第7計算期間	2016年10月 8日～2017年 4月 7日	132.0000円
第8計算期間	2017年 4月 8日～2017年10月 7日	127.0000円

## 収益率の推移

	計算期間	収益率
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	5.7%
第2計算期間	2014年 4月 8日～2014年10月 7日	8.9%
第3計算期間	2014年10月 8日～2015年 4月 7日	23.3%
第4計算期間	2015年 4月 8日～2015年10月 7日	6.0%
第5計算期間	2015年10月 8日～2016年 4月 7日	13.3%
第6計算期間	2016年 4月 8日～2016年10月 7日	6.3%
第7計算期間	2016年10月 8日～2017年 4月 7日	11.4%
第8計算期間	2017年 4月 8日～2017年10月 7日	12.6%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4) 設定及び解約の実績

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	2,098,932		2,098,932
第2計算期間	2014年 4月 8日～2014年10月 7日	6,693,631	196,877	8,595,686
第3計算期間	2014年10月 8日～2015年 4月 7日	12,092,932	5,801,234	14,887,384
第4計算期間	2015年 4月 8日～2015年10月 7日	5,893,491	3,727,008	17,053,867
第5計算期間	2015年10月 8日～2016年 4月 7日	5,893,904	2,746,309	20,201,462
第6計算期間	2016年 4月 8日～2016年10月 7日	7,691,217	3,524,640	24,368,039
第7計算期間	2016年10月 8日～2017年 4月 7日	9,983,580	3,120,808	31,230,811
第8計算期間	2017年 4月 8日～2017年10月 7日	9,592,536	5,690,130	35,133,217

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

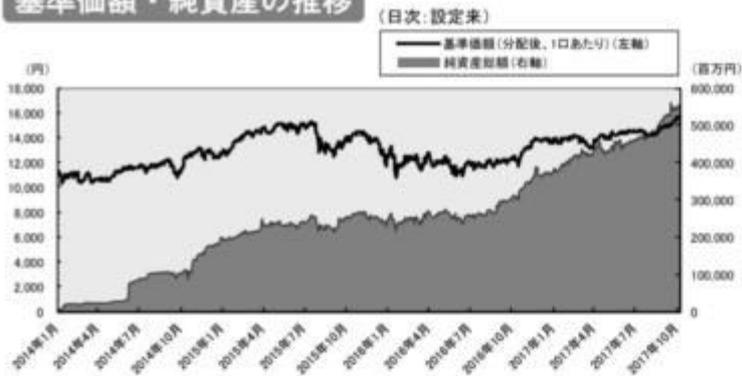
解約口数は交換口数を表示しております。

## 参考情報

< 更新後 >

## 運用実績 (2017年10月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

(1口あたり、課税前)

2017年10月	127 円
2017年4月	132 円
2016年10月	109 円
2016年4月	119 円
2015年10月	109 円
設定来累計	889 円

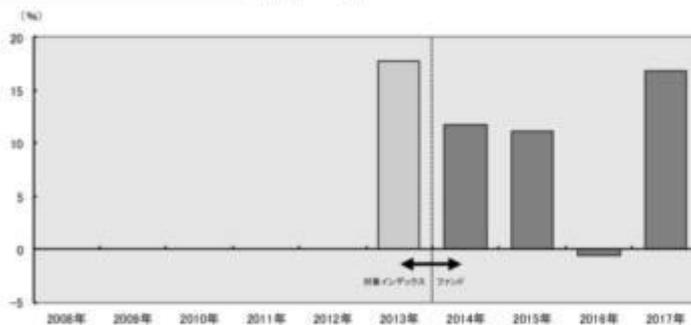
## 主要な資産の状況

## 銘柄別投資比率(上位)

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.6
2	キーエンス	電気機器	1.6
3	本田技研工業	輸送用機器	1.6
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5
5	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.4
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.3
7	ソニー	電気機器	1.3
8	ファナック	電気機器	1.3
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3
10	KDDI	情報・通信業	1.3

## 年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・対象インデックスは、2013年8月30日を起算日として計算されているため、2008年から2012年の期間は対象インデックスが存在しないことから、記載を行っていません。
- ・2013年は8月30日から年末までの対象インデックスの収益率。
- ・2014年は設定日(2014年1月24日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2017年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●対象インデックスの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

## 第3【ファンドの経理状況】

## NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(平成29年4月8日から平成29年10月7日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1 財務諸表

## (1) 貸借対照表

	(単位：円)	
	第7期 (平成29年 4月 7日現在)	第8期 (平成29年10月 7日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,372,331,066	34,820,763,524
株式	406,742,789,100	514,302,766,410
派生商品評価勘定	-	375,840,300
未収入金	4,148,579,960	4,509,575,270
未収配当金	3,783,693,896	4,084,990,504
未収利息	3,961,993	2,374,627
その他未収収益	97,351,299	62,668,406
差入委託証拠金	793,721,603	-
流動資産合計	449,942,428,917	558,158,979,041
資産合計	449,942,428,917	558,158,979,041
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	306,978,455	-
前受金	-	103,776,162
未払金	-	4,994,143,791
未払収益分配金	4,122,467,052	4,461,918,559
未払受託者報酬	101,444,212	126,192,815
未払委託者報酬	307,440,152	380,755,477
未払利息	37,950	74,086
有価証券貸借取引受入金	27,858,219,845	24,133,206,562
その他未払費用	45,923,307	148,196,596
流動負債合計	32,742,510,973	34,348,264,048
負債合計	32,742,510,973	34,348,264,048
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	363,089,408,686	408,458,780,842
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	54,110,509,258	115,351,934,151
(分配準備積立金)	27,386,758	36,570,521
元本等合計	417,199,917,944	523,810,714,993
純資産合計	417,199,917,944	523,810,714,993
負債純資産合計	449,942,428,917	558,158,979,041

## (2) 損益及び剰余金計算書

	第7期		第8期	
	自	平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	自	平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		4,410,681,752		4,981,405,125
有価証券売買等損益		29,722,155,053		49,821,780,168
派生商品取引等損益		558,866,892		1,240,927,263
その他収益		158,239,944		112,497,037
営業収益合計		34,849,943,641		56,156,609,593
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,645,708		4,958,423
受託者報酬		101,444,212		126,192,815
委託者報酬		307,440,152		380,755,477
その他費用		109,610,631		120,809,971
営業費用合計		508,849,287		622,799,840
営業利益又は営業損失（ ）		34,341,094,354		55,533,809,753
経常利益又は経常損失（ ）		34,341,094,354		55,533,809,753
当期純利益又は当期純損失（ ）		34,341,094,354		55,533,809,753
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,718,446,501		54,110,509,258
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,090,142,987		24,360,963,529
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		18,090,142,987		24,360,963,529
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,916,707,532		14,191,429,830
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,916,707,532		14,191,429,830
分配金		4,122,467,052		4,461,918,559
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,110,509,258		115,351,934,151

## (3) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成29年 4月 8日から平成29年10月 7日までとなっております。
-------	--

## (貸借対照表に関する注記)

第7期 平成29年 4月 7日現在	第8期 平成29年10月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 31,230,811口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 35,133,217口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 13,359円	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 14,909円
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 26,448,555,100円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 22,952,677,850円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	第8期 自 平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,578,567,404円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>89,781,401円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>4,668,348,805円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>518,494,995円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>4,149,853,810円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>4,122,467,052円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>27,386,758円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>31,230,811口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>132円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,578,567,404円	分配準備積立金	B	89,781,401円	配当等収益合計額	C=A+B	4,668,348,805円	経費	D	518,494,995円	収益分配可能額	E=C-D	4,149,853,810円	収益分配金	F	4,122,467,052円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,386,758円	口数	H	31,230,811口	1口当たり分配金	I=F/H	132円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>5,098,860,585円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,386,758円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>5,126,247,343円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>627,758,263円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>4,498,489,080円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>4,461,918,559円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>36,570,521円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>35,133,217口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>127円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	5,098,860,585円	分配準備積立金	B	27,386,758円	配当等収益合計額	C=A+B	5,126,247,343円	経費	D	627,758,263円	収益分配可能額	E=C-D	4,498,489,080円	収益分配金	F	4,461,918,559円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	36,570,521円	口数	H	35,133,217口	1口当たり分配金	I=F/H	127円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	4,578,567,404円																																																											
分配準備積立金	B	89,781,401円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	4,668,348,805円																																																											
経費	D	518,494,995円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	4,149,853,810円																																																											
収益分配金	F	4,122,467,052円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,386,758円																																																											
口数	H	31,230,811口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	132円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	5,098,860,585円																																																											
分配準備積立金	B	27,386,758円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	5,126,247,343円																																																											
経費	D	627,758,263円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	4,498,489,080円																																																											
収益分配金	F	4,461,918,559円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	36,570,521円																																																											
口数	H	35,133,217口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	127円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち78,515,838円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち99,244,830円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第7期 自 平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	第8期 自 平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
---	---

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第7期 平成29年 4月 7日現在	第8期 平成29年10月 7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自 平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	第8期 自 平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第7期 自 平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	第8期 自 平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日
期首元本額 283,302,821,414円	期首元本額 363,089,408,686円
期中追加設定元本額 116,069,101,080円	期中追加設定元本額 111,522,823,536円
期中一部交換元本額 36,282,513,808円	期中一部交換元本額 66,153,451,380円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第7期 自 平成28年10月 8日 至 平成29年 4月 7日	第8期 自 平成29年 4月 8日 至 平成29年10月 7日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
株式	25,068,479,708	44,795,301,814
合計	25,068,479,708	44,795,301,814

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第7期(平成29年 4月 7日現在)				第8期(平成29年10月 7日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	10,685,363,603	-	10,379,640,000	306,978,455	9,086,120,838	-	9,462,990,000	375,840,300
合計	10,685,363,603	-	10,379,640,000	306,978,455	9,086,120,838	-	9,462,990,000	375,840,300

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成29年10月7日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	409,400	652.00	266,928,800	
		国際石油開発帝石	1,660,900	1,180.00	1,959,862,000	
		安藤・間	226,500	778.00	176,217,000	貸付有価証券 69,200株
		東急建設	111,900	900.00	100,710,000	貸付有価証券 66,200株
		コムシスホールディングス	123,200	2,698.00	332,393,600	貸付有価証券 300株
		大成建設	320,600	5,890.00	1,888,334,000	
		大林組	945,500	1,359.00	1,284,934,500	
		清水建設	964,500	1,252.00	1,207,554,000	
		長谷工コーポレーション	367,900	1,524.00	560,679,600	
		鹿島建設	1,386,000	1,114.00	1,544,004,000	
		三井住友建設	241,620	699.00	168,892,380	
		前田建設工業	207,500	1,300.00	269,750,000	
		戸田建設	366,000	862.00	315,492,000	
		熊谷組	49,500	3,405.00	168,547,500	
		大東建託	114,200	20,235.00	2,310,837,000	
		N I P P O	73,000	2,275.00	166,075,000	貸付有価証券 8,000株
		前田道路	99,000	2,368.00	234,432,000	貸付有価証券 1,000株
		五洋建設	349,800	704.00	246,259,200	
		住友林業	217,000	1,796.00	389,732,000	
		大和ハウス工業	931,300	3,918.00	3,648,833,400	
積水ハウス	965,500	1,946.00	1,878,863,000			

協和エクシオ	123,500	2,206.00	272,441,000	
九電工	62,000	4,385.00	271,870,000	貸付有価証券 500株
江崎グリコ	78,900	6,010.00	474,189,000	
カルビー	128,600	4,000.00	514,400,000	貸付有価証券 56,000株（3,800株）
ヤクルト本社	169,100	8,180.00	1,383,238,000	貸付有価証券 300株
明治ホールディングス	186,800	8,850.00	1,653,180,000	
日本ハム	224,000	3,175.00	711,200,000	
アサヒグループホールディングス	591,500	4,910.00	2,904,265,000	貸付有価証券 37,900株
キリンホールディングス	1,357,500	2,718.50	3,690,363,750	貸付有価証券 125,500株
サントリー食品インターナショナル	216,000	5,040.00	1,088,640,000	
キッコーマン	220,600	3,515.00	775,409,000	貸付有価証券 100株
味の素	649,500	2,218.50	1,440,915,750	
キューピー	160,400	2,781.00	446,072,400	
ニチレイ	146,700	2,846.00	417,508,200	
東洋水産	155,000	4,240.00	657,200,000	
日清食品ホールディングス	123,100	6,900.00	849,390,000	
日本たばこ産業	1,747,300	3,690.00	6,447,537,000	貸付有価証券 376,000株
帝人	240,900	2,259.00	544,193,100	
東レ	2,138,100	1,094.50	2,340,150,450	
王子ホールディングス	1,152,000	600.00	691,200,000	
大王製紙	117,400	1,349.00	158,372,600	貸付有価証券 71,300株（20,600株）
クラレ	496,100	2,127.00	1,055,204,700	貸付有価証券 74,600株
旭化成	1,838,100	1,386.00	2,547,606,600	
住友化学	2,169,000	696.00	1,509,624,000	
日産化学工業	158,300	3,880.00	614,204,000	
東ソー	426,000	2,472.00	1,053,072,000	
デンカ	116,100	3,765.00	437,116,500	
信越化学工業	528,500	10,105.00	5,340,492,500	

エア・ウォーター	243,000	2,066.00	502,038,000	
大陽日酸	227,000	1,341.00	304,407,000	貸付有価証券 3,800株（3,800株）
日本パーカライズン	150,600	1,737.00	261,592,200	
三菱瓦斯化学	274,600	2,589.00	710,939,400	
三井化学	267,900	3,350.00	897,465,000	
J S R	296,300	2,081.00	616,600,300	
三菱ケミカルホールディングス	1,985,600	1,106.00	2,196,073,600	
ダイセル	397,500	1,355.00	538,612,500	
積水化学工業	655,900	2,190.00	1,436,421,000	
日本ゼオン	248,600	1,486.00	369,419,600	
アイカ工業	94,500	3,715.00	351,067,500	
宇部興産	148,500	3,285.00	487,822,500	
日立化成	163,800	3,025.00	495,495,000	
ダイキョーニシカワ	51,600	1,813.00	93,550,800	
日本化薬	191,300	1,735.00	331,905,500	
日油	113,800	3,075.00	349,935,000	貸付有価証券 500株
花王	691,900	6,586.00	4,556,853,400	貸付有価証券 107,500株
日本ペイントホールディングス	227,400	3,665.00	833,421,000	貸付有価証券 148,800株（28,300株）
関西ペイント	309,600	2,731.00	845,517,600	貸付有価証券 42,100株（19,800株）
D I C	116,400	4,175.00	485,970,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
資生堂	524,200	4,452.00	2,333,738,400	貸付有価証券 2,900株（2,900株）
ライオン	392,000	2,038.00	798,896,000	貸付有価証券 24,200株（2,900株）
コーセー	47,600	13,000.00	618,800,000	
シーズ・ホールディングス	38,200	3,915.00	149,553,000	
小林製薬	78,900	6,240.00	492,336,000	
日東電工	212,500	9,470.00	2,012,375,000	
ニフコ	51,700	6,740.00	348,458,000	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
ユニ・チャーム	596,600	2,620.00	1,563,092,000	

協和発酵キリン	352,600	1,960.00	691,096,000	
武田薬品工業	1,105,500	6,185.00	6,837,517,500	
アステラス製薬	2,891,900	1,456.00	4,210,606,400	
大日本住友製薬	208,600	1,519.00	316,863,400	貸付有価証券 139,600株
塩野義製薬	373,800	6,263.00	2,341,109,400	
田辺三菱製薬	343,300	2,599.00	892,236,700	
中外製薬	293,400	4,735.00	1,389,249,000	
科研製薬	55,000	5,700.00	313,500,000	
エーザイ	362,700	5,889.00	2,135,940,300	
小野薬品工業	669,200	2,559.00	1,712,482,800	貸付有価証券 63,900株
久光製薬	83,100	5,420.00	450,402,000	貸付有価証券 5,800株（300株）
参天製薬	532,500	1,745.00	929,212,500	
ツムラ	98,900	4,085.00	404,006,500	
沢井製薬	50,000	6,490.00	324,500,000	貸付有価証券 22,000株
第一三共	867,200	2,500.00	2,168,000,000	
大塚ホールディングス	584,800	4,506.00	2,635,108,800	
横浜ゴム	162,900	2,418.00	393,892,200	
東洋ゴム工業	166,700	2,537.00	422,917,900	貸付有価証券 1,600株
ブリヂストン	994,500	5,196.00	5,167,422,000	
住友ゴム工業	275,800	2,088.00	575,870,400	貸付有価証券 18,600株
旭硝子	287,700	4,245.00	1,221,286,500	
住友大阪セメント	547,000	497.00	271,859,000	貸付有価証券 10,000株
太平洋セメント	177,700	4,350.00	772,995,000	
TOTO	216,500	4,925.00	1,066,262,500	貸付有価証券 13,700株
日本碍子	372,000	2,160.00	803,520,000	
日本特殊陶業	241,400	2,451.00	591,671,400	貸付有価証券 138,300株
新日鐵住金	1,328,400	2,654.50	3,526,237,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	805,200	2,254.00	1,814,920,800	
東京製鐵	149,000	936.00	139,464,000	貸付有価証券

				19,300株
日立金属	299,800	1,585.00	475,183,000	
日本軽金属ホールディングス	758,300	336.00	254,788,800	
三菱マテリアル	183,800	3,940.00	724,172,000	
住友金属鉱山	381,100	3,859.00	1,470,664,900	
DOWAホールディングス	65,000	4,350.00	282,750,000	
住友電気工業	1,109,800	1,839.00	2,040,922,200	
三和ホールディングス	287,400	1,281.00	368,159,400	
リンナイ	49,600	9,650.00	478,640,000	貸付有価証券 8,500株
日本発條	277,200	1,240.00	343,728,000	貸付有価証券 700株
アマダホールディングス	396,400	1,252.00	496,292,800	
オーエスジー	125,700	2,571.00	323,174,700	貸付有価証券 72,100株(68,000株)
D M G 森精機	154,100	2,056.00	316,829,600	貸付有価証券 89,000株(82,600株)
ディスコ	34,500	22,890.00	789,705,000	
ニューフレアテクノロジー	6,300	6,180.00	38,934,000	貸付有価証券 3,800株(800株)
ナブテスコ	153,100	4,140.00	633,834,000	
S M C	88,300	39,520.00	3,489,616,000	
小松製作所	1,358,700	3,281.00	4,457,894,700	
住友重機械工業	171,800	4,440.00	762,792,000	
日立建機	131,600	3,410.00	448,756,000	貸付有価証券 9,100株(7,100株)
ハーモニック・ドライブ・システムズ	41,400	5,600.00	231,840,000	貸付有価証券 27,600株(24,200株)
クボタ	1,518,100	2,065.00	3,134,876,500	貸付有価証券 35,200株
荏原製作所	133,400	3,780.00	504,252,000	
ダイキン工業	384,100	11,560.00	4,440,196,000	貸付有価証券 9,300株
椿本チエイン	167,000	909.00	151,803,000	
ダイフク	140,400	5,320.00	746,928,000	
タダノ	147,100	1,325.00	194,907,500	貸付有価証券 22,900株
平和	87,200	2,214.00	193,060,800	貸付有価証券

				100株
竹内製作所	51,400	2,283.00	117,346,200	
T P R	31,500	3,830.00	120,645,000	貸付有価証券 1,300株
ホシザキ	88,600	9,940.00	880,684,000	貸付有価証券 20,300株
日本精工	577,900	1,531.00	884,764,900	
ジェイテクト	299,900	1,617.00	484,938,300	
T H K	198,800	3,860.00	767,368,000	
イーグル工業	30,400	2,083.00	63,323,200	
マキタ	367,000	4,470.00	1,640,490,000	
三菱重工業	471,600	4,467.00	2,106,637,200	
コニカミノルタ	658,700	951.00	626,423,700	
ブラザー工業	343,600	2,565.00	881,334,000	
ミネベアミツミ	512,000	1,805.00	924,160,000	
日立製作所	6,757,000	812.10	5,487,359,700	
三菱電機	3,001,500	1,797.00	5,393,695,500	
富士電機	848,000	631.00	535,088,000	貸付有価証券 3,000株
安川電機	326,200	3,570.00	1,164,534,000	貸付有価証券 61,900株（7,400株）
日本電産	364,700	13,915.00	5,074,800,500	
オムロン	299,100	5,690.00	1,701,879,000	貸付有価証券 51,400株
日本電気	386,900	3,065.00	1,185,848,500	
富士通	2,713,000	848.80	2,302,794,400	
ルネサスエレクトロニクス	145,700	1,259.00	183,436,300	貸付有価証券 97,400株
セイコーエプソン	419,000	2,686.00	1,125,434,000	貸付有価証券 100株
アルバック	47,400	6,940.00	328,956,000	
エレコム	24,400	2,215.00	54,046,000	
パナソニック	3,231,400	1,624.50	5,249,409,300	
富士通ゼネラル	95,500	2,251.00	214,970,500	
日立国際電気	73,500	3,070.00	225,645,000	貸付有価証券 41,600株（40,300株）
ソニー	1,736,300	4,151.00	7,207,381,300	
T D K	158,500	7,650.00	1,212,525,000	
アルプス電気	259,800	3,020.00	784,596,000	貸付有価証券

				30,000株
クラリオン	148,000	440.00	65,120,000	
ヒロセ電機	45,500	15,860.00	721,630,000	
日本航空電子工業	81,000	1,782.00	144,342,000	
横河電機	305,100	1,982.00	604,708,200	
日本光電工業	117,600	2,598.00	305,524,800	
堀場製作所	55,700	6,330.00	352,581,000	
アドバンテスト	191,800	2,271.00	435,577,800	貸付有価証券 61,200株(2,100株)
キーエンス	127,500	59,390.00	7,572,225,000	
シスメックス	218,800	7,300.00	1,597,240,000	貸付有価証券 42,800株
O B A R A G R O U P	16,400	6,510.00	106,764,000	
スタンレー電気	200,200	3,930.00	786,786,000	
カシオ計算機	226,300	1,619.00	366,379,700	貸付有価証券 29,200株
ファナック	285,200	23,900.00	6,816,280,000	
浜松ホトニクス	204,900	3,455.00	707,929,500	貸付有価証券 83,300株
京セラ	461,900	7,115.00	3,286,418,500	
村田製作所	295,200	16,365.00	4,830,948,000	貸付有価証券 2,100株
小糸製作所	168,600	6,970.00	1,175,142,000	貸付有価証券 10,800株
ミツバ	51,800	1,765.00	91,427,000	
S C R E E Nホールディングス	57,700	7,780.00	448,906,000	
キヤノン	1,514,800	3,909.00	5,921,353,200	貸付有価証券 334,400株
リコー	846,000	1,136.00	961,056,000	貸付有価証券 192,200株
東京エレクトロン	187,600	17,025.00	3,193,890,000	
トヨタ紡織	98,400	2,425.00	238,620,000	
豊田自動織機	256,200	6,450.00	1,652,490,000	貸付有価証券 23,500株
デンソー	693,800	5,740.00	3,982,412,000	
川崎重工業	219,000	3,855.00	844,245,000	
日産自動車	3,318,800	1,091.50	3,622,470,200	
いすゞ自動車	815,400	1,509.50	1,230,846,300	

トヨタ自動車	1,262,400	6,889.00	8,696,673,600	
日野自動車	401,600	1,378.00	553,404,800	貸付有価証券 2,500株
日信工業	62,900	2,026.00	127,435,400	
N O K	136,100	2,554.00	347,599,400	
アイシン精機	257,400	6,030.00	1,552,122,000	
マツダ	891,000	1,730.00	1,541,430,000	
本田技研工業	2,427,900	3,395.00	8,242,720,500	貸付有価証券 129,200株
スズキ	557,700	5,932.00	3,308,276,400	貸付有価証券 88,700株（62,300株）
S U B A R U	873,600	4,005.00	3,498,768,000	
ヤマハ発動機	397,400	3,265.00	1,297,511,000	貸付有価証券 117,300株
豊田合成	90,900	2,787.00	253,338,300	貸付有価証券 2,200株
シマノ	113,400	14,600.00	1,655,640,000	貸付有価証券 15,700株
テイ・エス テック	65,400	3,825.00	250,155,000	
テルモ	431,300	4,495.00	1,938,693,500	貸付有価証券 2,900株
島津製作所	362,100	2,220.00	803,862,000	
オリンパス	449,100	3,935.00	1,767,208,500	貸付有価証券 5,800株
H O Y A	578,900	6,125.00	3,545,762,500	
朝日インテック	67,600	6,050.00	408,980,000	
セイコーホールディングス	39,800	2,456.00	97,748,800	
バンダイナムコホールディングス	310,300	3,850.00	1,194,655,000	
パイロットコーポレーション	49,100	5,250.00	257,775,000	
アシックス	279,500	1,715.00	479,342,500	貸付有価証券 144,700株（6,900株）
ヤマハ	189,600	4,195.00	795,372,000	
ピジョン	170,100	3,765.00	640,426,500	
中部電力	927,100	1,409.50	1,306,747,450	
関西電力	1,148,200	1,495.50	1,717,133,100	
東北電力	703,000	1,474.00	1,036,222,000	
電源開発	223,900	2,877.00	644,160,300	

東京瓦斯	600,300	2,814.50	1,689,544,350	
大阪瓦斯	546,100	2,140.00	1,168,654,000	
東邦瓦斯	139,400	3,355.00	467,687,000	
東武鉄道	300,700	3,075.00	924,652,500	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
相鉄ホールディングス	120,000	2,718.00	326,160,000	貸付有価証券 200株
東京急行電鉄	764,300	1,615.00	1,234,344,500	
小田急電鉄	450,700	2,111.00	951,427,700	
京王電鉄	157,200	4,560.00	716,832,000	
京成電鉄	210,900	3,100.00	653,790,000	
東日本旅客鉄道	539,100	10,300.00	5,552,730,000	貸付有価証券 90,700株
西日本旅客鉄道	270,800	7,669.00	2,076,765,200	
東海旅客鉄道	234,000	19,715.00	4,613,310,000	貸付有価証券 76,500株（1,800株）
西武ホールディングス	388,600	1,919.00	745,723,400	
西日本鉄道	90,100	2,728.00	245,792,800	
近鉄グループホールディングス	283,200	4,180.00	1,183,776,000	貸付有価証券 65,700株
阪急阪神ホールディングス	355,500	4,230.00	1,503,765,000	
南海電気鉄道	158,500	2,807.00	444,909,500	
京阪ホールディングス	168,100	3,305.00	555,570,500	貸付有価証券 21,800株
名古屋鉄道	273,200	2,416.00	660,051,200	貸付有価証券 175,900株（11,000株）
日本通運	104,600	7,080.00	740,568,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
ヤマトホールディングス	503,100	2,247.50	1,130,717,250	貸付有価証券 500株
山九	74,100	4,650.00	344,565,000	
日立物流	58,600	2,689.00	157,575,400	
日本航空	494,400	3,770.00	1,863,888,000	
A N Aホールディングス	522,300	4,208.00	2,197,838,400	
新日鉄住金ソリューションズ	43,500	2,442.00	106,227,000	
ネクソン	308,300	3,060.00	943,398,000	
コロプラ	89,100	1,188.00	105,850,800	貸付有価証券

				11,800株
ティーガイア	27,600	2,124.00	58,622,400	貸付有価証券 2,700株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	748,600	307.00	229,820,200	貸付有価証券 501,000株
野村総合研究所	207,600	4,200.00	871,920,000	
オービック	95,700	6,840.00	654,588,000	
ヤフー	1,990,800	517.00	1,029,243,600	貸付有価証券 1,302,800株
トレンドマイクロ	134,800	5,680.00	765,664,000	貸付有価証券 700株
日本オラクル	44,700	8,750.00	391,125,000	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	62,900	4,010.00	252,229,000	
大塚商会	83,000	7,110.00	590,130,000	
日本テレビホールディン グス	253,500	1,959.00	496,606,500	貸付有価証券 86,200株
日本電信電話	1,401,000	5,174.00	7,248,774,000	
K D D I	2,500,600	2,988.00	7,471,792,800	
光通信	33,400	13,900.00	464,260,000	
N T T ドコモ	2,044,200	2,562.00	5,237,240,400	
G M O インターネット	101,300	1,425.00	144,352,500	貸付有価証券 41,400株(21,900株)
東宝	181,600	3,930.00	713,688,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	857,700	1,206.00	1,034,386,200	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	106,900	4,275.00	456,997,500	
S C S K	75,500	4,655.00	351,452,500	
コナミホールディングス	125,400	5,360.00	672,144,000	貸付有価証券 200株
ソフトバンクグループ	817,800	9,173.00	7,501,679,400	
双日	1,640,100	312.00	511,711,200	
アルフレッサ ホール ディングス	328,500	2,088.00	685,908,000	
神戸物産	17,900	5,020.00	89,858,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
シップヘルスケアホール ディングス	53,300	3,510.00	187,083,000	
第一興商	60,000	5,310.00	318,600,000	

メディバルホールディングス	277,700	2,050.00	569,285,000	
伊藤忠商事	2,033,900	1,837.50	3,737,291,250	
丸紅	2,733,100	761.60	2,081,528,960	
豊田通商	309,300	3,755.00	1,161,421,500	貸付有価証券 300株
兼松	118,100	1,402.00	165,576,200	
三井物産	2,511,300	1,644.00	4,128,577,200	
日立ハイテクノロジーズ	96,300	4,275.00	411,682,500	
住友商事	1,748,200	1,581.00	2,763,904,200	
三菱商事	2,083,800	2,610.00	5,438,718,000	
阪和興業	55,500	4,045.00	224,497,500	貸付有価証券 3,300株
岩谷産業	61,500	3,380.00	207,870,000	
東邦ホールディングス	88,900	2,145.00	190,690,500	
サンリオ	85,600	2,113.00	180,872,800	貸付有価証券 57,200株（9,100株）
日鉄住金物産	24,300	5,950.00	144,585,000	
ミスミグループ本社	320,100	2,833.00	906,843,300	貸付有価証券 74,300株
ローソン	87,600	7,460.00	653,496,000	貸付有価証券 51,300株（2,600株）
エービーシー・マート	50,500	5,950.00	300,475,000	貸付有価証券 200株
アダストリア	42,600	2,576.00	109,737,600	
セリア	66,300	6,210.00	411,723,000	
ビックカメラ	159,400	1,289.00	205,466,600	貸付有価証券 104,500株
MonotaRO	98,400	3,015.00	296,676,000	貸付有価証券 65,800株（10,800株）
J．フロント リテイリング	351,400	1,595.00	560,483,000	
マツモトキヨシホールディングス	52,500	7,600.00	399,000,000	
スタートトゥデイ	245,000	3,295.00	807,275,000	
ウエルシアホールディングス	73,300	4,170.00	305,661,000	
クリエイティブSDホールディングス	40,900	2,707.00	110,716,300	
コスモス薬品	14,000	24,960.00	349,440,000	

セブン & アイ・ホールディングス	1,162,300	4,328.00	5,030,434,400	
ツルハホールディングス	55,600	13,460.00	748,376,000	
クスリのアオキホールディングス	22,000	6,280.00	138,160,000	貸付有価証券 300株
ノジマ	43,600	2,379.00	103,724,400	
良品計画	36,800	32,200.00	1,184,960,000	貸付有価証券 15,300株
ドンキホーテホールディングス	179,700	4,315.00	775,405,500	貸付有価証券 21,200株
ユナイテッドアローズ	37,000	3,990.00	147,630,000	
スギホールディングス	60,900	5,720.00	348,348,000	貸付有価証券 400株（400株）
ユニー・ファミリーマートホールディングス	121,800	6,180.00	752,724,000	貸付有価証券 7,500株（2,700株）
日本瓦斯	50,900	3,580.00	182,222,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
しまむら	32,200	12,870.00	414,414,000	
高島屋	466,000	1,071.00	499,086,000	貸付有価証券 36,000株（31,000株）
イオン	1,142,700	1,691.50	1,932,877,050	貸付有価証券 715,500株（135,800株）
イズミ	50,100	5,610.00	281,061,000	
ヤオコー	31,500	5,200.00	163,800,000	
ケーズホールディングス	117,500	2,543.00	298,802,500	貸付有価証券 48,100株（3,500株）
アインホールディングス	39,400	7,690.00	302,986,000	貸付有価証券 8,600株（7,200株）
ニトリホールディングス	120,000	16,020.00	1,922,400,000	貸付有価証券 49,800株
バローホールディングス	59,800	2,413.00	144,297,400	貸付有価証券 400株
ファーストリテイリング	46,300	35,230.00	1,631,149,000	貸付有価証券 4,000株（900株）
サンドラッグ	105,600	4,625.00	488,400,000	
めぶきフィナンシャルグループ	1,339,100	443.00	593,221,300	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	40,200	2,889.00	116,137,800	貸付有価証券 1,800株
九州フィナンシャルグループ	607,300	695.00	422,073,500	

ループ				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,799,900	578.30	1,040,882,170	
新生銀行	264,300	1,845.00	487,633,500	
あおぞら銀行	175,700	4,315.00	758,145,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,757,400	734.80	7,169,737,520	
りそなホールディングス	3,248,800	577.10	1,874,882,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	579,800	4,141.00	2,400,951,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,698,900	4,350.00	7,390,215,000	
千葉銀行	1,071,000	823.00	881,433,000	貸付有価証券 4,000株
群馬銀行	604,000	704.00	425,216,000	貸付有価証券 2,900株
静岡銀行	733,000	1,033.00	757,189,000	
スルガ銀行	283,900	2,452.00	696,122,800	貸付有価証券 48,000株（4,400株）
ほくほくフィナンシャルグループ	184,700	1,826.00	337,262,200	
広島銀行	409,700	919.00	376,514,300	貸付有価証券 1,500株
中国銀行	255,900	1,567.00	400,995,300	
セブン銀行	1,041,000	401.00	417,441,000	貸付有価証券 569,500株（8,200株）
みずほフィナンシャルグループ	36,217,600	198.50	7,189,193,600	
山口フィナンシャルグループ	346,000	1,329.00	459,834,000	貸付有価証券 172,000株（83,000株）
F P G	99,200	1,200.00	119,040,000	貸付有価証券 9,900株（9,900株）
S B Iホールディングス	313,900	1,711.00	537,082,900	貸付有価証券 79,300株（79,300株）
ジャフコ	46,400	5,490.00	254,736,000	
大和証券グループ本社	2,524,000	645.10	1,628,232,400	
野村ホールディングス	5,677,400	642.50	3,647,729,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	318,700	676.00	215,441,200	
松井証券	158,600	873.00	138,457,800	貸付有価証券

				15,800株(5,500株)
カブドットコム証券	207,200	348.00	72,105,600	貸付有価証券 21,800株(3,400株)
SOMPOホールディングス	580,600	4,528.00	2,628,956,800	
MS&ADインシュアランスグループホール	777,500	3,705.00	2,880,637,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	266,000	1,838.00	488,908,000	貸付有価証券 106,300株
第一生命ホールディングス	1,674,700	2,065.00	3,458,255,500	貸付有価証券 32,000株
東京海上ホールディングス	1,118,400	4,503.00	5,036,155,200	
T&Dホールディングス	972,800	1,647.50	1,602,688,000	
全国保証	78,200	4,565.00	356,983,000	貸付有価証券 50,800株(900株)
芙蓉総合リース	31,800	7,410.00	235,638,000	
興銀リース	52,200	3,095.00	161,559,000	貸付有価証券 100株(100株)
東京センチュリー	55,900	5,040.00	281,736,000	
イオンフィナンシャルサービス	177,300	2,368.00	419,846,400	貸付有価証券 18,200株(5,800株)
オリエントコーポレーション	600,500	184.00	110,492,000	貸付有価証券 398,300株
日立キャピタル	65,400	2,765.00	180,831,000	
オリックス	1,966,600	1,827.00	3,592,978,200	
三菱UFJリース	704,400	606.00	426,866,400	
日本取引所グループ	863,500	2,061.00	1,779,673,500	
いちご	264,100	390.00	102,999,000	貸付有価証券 171,800株
ヒューリック	579,300	1,130.00	654,609,000	
野村不動産ホールディングス	184,500	2,383.00	439,663,500	貸付有価証券 200株
プレサンスコーポレーション	43,200	1,521.00	65,707,200	
オープンハウス	45,200	3,965.00	179,218,000	
東急不動産ホールディングス	671,800	693.00	465,557,400	
飯田グループホールディングス	231,500	2,010.00	465,315,000	貸付有価証券 9,200株
パーク24	153,800	2,702.00	415,567,600	貸付有価証券

				101,000株（9,600株）
三井不動産	1,472,500	2,555.00	3,762,237,500	
三菱地所	2,065,600	1,999.50	4,130,167,200	
東京建物	303,300	1,500.00	454,950,000	貸付有価証券 300株
住友不動産	666,000	3,514.00	2,340,324,000	
レオパレス21	345,200	827.00	285,480,400	
スターツコーポレーション	37,700	2,892.00	109,028,400	貸付有価証券 300株
イオンモール	178,800	1,974.00	352,951,200	
エヌ・ティ・ティ都市開発	172,500	1,170.00	201,825,000	
ミクシィ	75,200	5,340.00	401,568,000	貸付有価証券 1,400株
日本M&Aセンター	85,800	5,440.00	466,752,000	
パーソルホールディングス	227,500	2,564.00	583,310,000	
総合警備保障	107,000	5,030.00	538,210,000	貸付有価証券 49,600株
カカクコム	206,600	1,536.00	317,337,600	貸付有価証券 17,800株
ディップ	37,900	2,486.00	94,219,400	
エムスリー	254,600	3,155.00	803,263,000	貸付有価証券 20,900株
ディー・エヌ・エー	131,800	2,525.00	332,795,000	貸付有価証券 4,900株（3,600株）
博報堂DYホールディングス	407,400	1,537.00	626,173,800	
オリエンタルランド	317,700	8,882.00	2,821,811,400	貸付有価証券 31,100株（2,800株）
リゾートトラスト	113,800	2,079.00	236,590,200	
ユー・エス・エス	355,800	2,289.00	814,426,200	
サイバーエージェント	176,700	3,235.00	571,624,500	貸付有価証券 71,500株
楽天	1,378,200	1,242.00	1,711,724,400	貸付有価証券 234,000株
リログループ	147,000	2,517.00	369,999,000	貸付有価証券 98,300株（2,100株）
カナモト	41,000	3,510.00	143,910,000	
セコム	305,700	8,386.00	2,563,600,200	

	メイテック	34,100	5,470.00	186,527,000	
	イオンディライト	33,100	4,045.00	133,889,500	
小計	銘柄数：400			514,302,766,410	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
合計				514,302,766,410	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2)備考欄の貸付有価証券の( )内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2)株式以外の有価証券(平成29年10月 7日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

平成29年10月31日現在

資産総額	620,676,163,595円
負債総額	71,864,093,524円
純資産総額( - )	548,812,070,071円
発行済口数	35,074,451口
1口当たり純資産額( / )	15,647円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

平成29年11月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

当社は指名委員会等設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

###### 株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

###### 取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

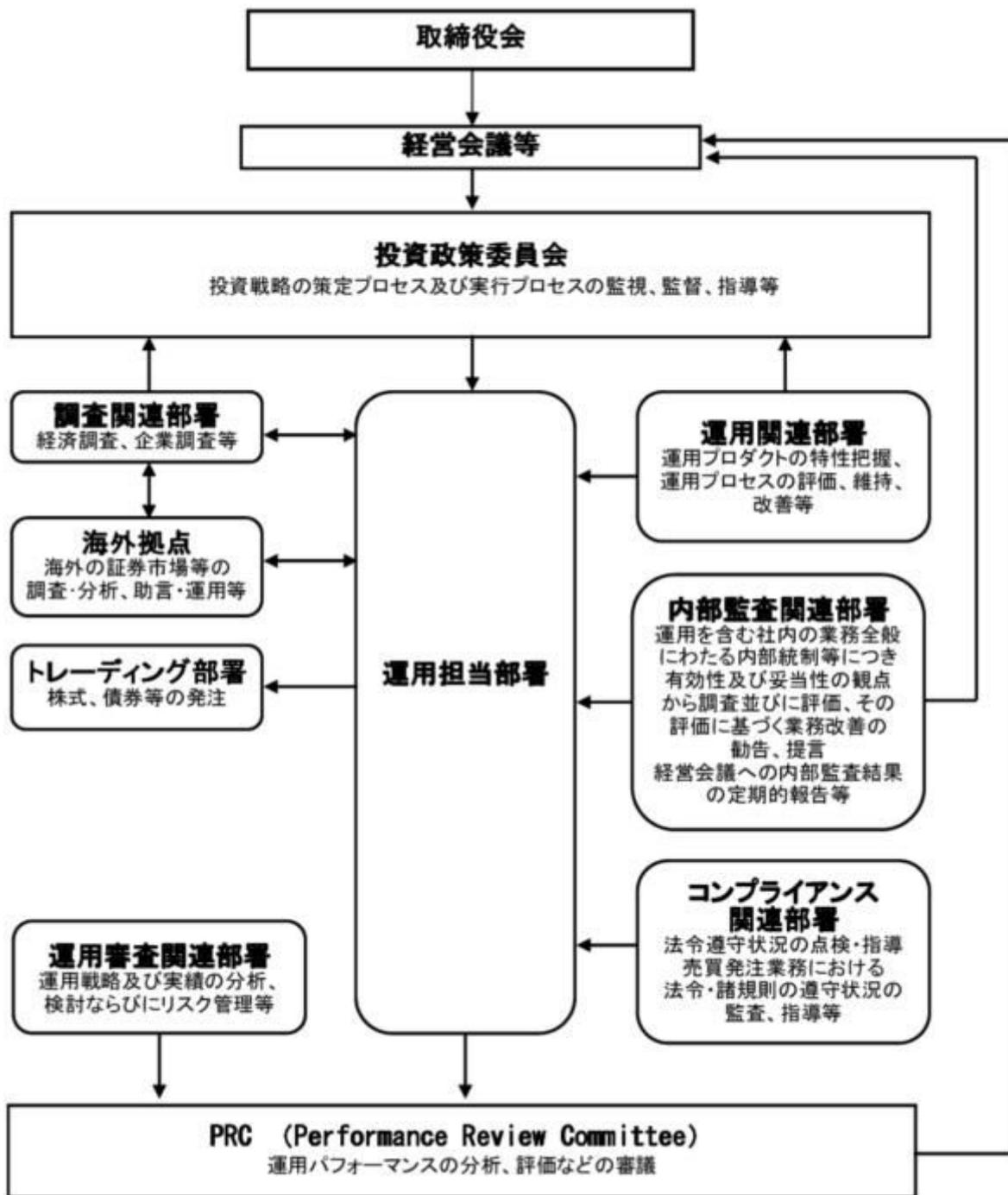
###### 代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

###### 委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定します。

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt;更新後&gt;

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は平成29年10月31日現在次の通りです（ただし、親投資信託を除きま

す。 )。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	961	24,663,066
単位型株式投資信託	97	517,696
追加型公社債投資信託	14	5,916,505
単位型公社債投資信託	371	1,978,590
合計	1,443	33,075,856

### 3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

#### (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(平成28年3月31日)	(平成29年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		208	127
金銭の信託		55,341	52,247
有価証券		24,100	15,700
前払金		34	33
前払費用		2	2
未収入金		511	495
未収委託者報酬		14,131	16,287
未収運用受託報酬		7,309	7,481
繰延税金資産		2,028	1,661
その他		56	42
貸倒引当金		10	11
流動資産計		103,715	94,066
固定資産			

有形固定資産			1,176		1,001
建物	2	403		377	
器具備品	2	773		624	
無形固定資産			7,681		7,185
ソフトウェア		7,680		7,184	
その他		0		0	
投資その他の資産			23,225		13,165
投資有価証券		9,216		1,233	
関係会社株式		10,958		8,124	
長期差入保証金		45		44	
長期前払費用		49		37	
前払年金費用		2,777		2,594	
繰延税金資産		-		960	
その他		176		170	
固定資産計			32,083		21,353
資産合計			135,799		115,419

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			118		98
未払金	1		11,855		10,401
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		4,537		5,242	
その他未払金		7,284		5,126	
未払費用	1		8,872		9,461
未払法人税等			1,838		714
前受収益			45		39
賞与引当金			4,809		4,339
流動負債計			27,538		25,055
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			2,708		2,947
時効後支払損引当金			526		538
繰延税金負債			68		-
固定負債計			3,303		3,485
負債合計			30,842		28,540
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			99,606		86,837
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			68,696		55,927
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		68,011		55,242	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		43,405		30,635	

評価・換算差額等		5,349	41
その他有価証券評価差額金		5,349	41
純資産合計		104,956	86,878
負債・純資産合計		135,799	115,419

## ( 2 ) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		104,445	96,594
運用受託報酬		31,351	28,466
その他営業収益		219	266
営業収益計		136,016	125,327
営業費用			
支払手数料		46,531	39,785
広告宣伝費		1,008	1,011
公告費		0	0
調査費		28,068	26,758
調査費		4,900	5,095
委託調査費		23,167	21,662
委託計算費		1,148	1,290
営業雑経費		3,905	4,408
通信費		185	162
印刷費		969	940
協会費		78	76
諸経費		2,672	3,228
営業費用計		80,662	73,254
一般管理費			
給料		11,835	11,269
役員報酬	2	367	301
給料・手当		6,928	6,923
賞与		4,539	4,044
交際費		124	126
旅費交通費		488	469
租税公課		695	898
不動産賃借料		1,230	1,222
退職給付費用		1,063	1,223
固定資産減価償却費		2,589	2,730
諸経費		7,801	8,118
一般管理費計		25,827	26,059
営業利益		29,526	26,012

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	7,323		7,397	
受取利息		4		0	
金銭の信託運用益		-		684	
為替差益		281		-	
その他		382		379	
営業外収益計			7,991		8,461
営業外費用					
支払利息		-		17	
金銭の信託運用損		1,196		-	
時効後支払損引当金繰入額		72		16	
為替差損		-		33	
その他		52		9	
営業外費用計			1,321		77
経常利益			36,196		34,397
特別利益					
投資有価証券等売却益		50		26	
関係会社清算益		-		41	
株式報酬受入益		96		59	
特別利益計			146		126
特別損失					
投資有価証券売却損		95		-	
投資有価証券等評価損		-		6	
固定資産除却損	3	60		9	
特別損失計			156		15
税引前当期純利益			36,186		34,507
法人税、住民税及び事業税			9,806		7,147
法人税等調整額			744		1,722
当期純利益			25,635		25,637

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

当期変動額									
剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による増加							1,668	1,668	1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	6,893	6,893	96,985
当期変動額			
剰余金の配当			19,933
当期純利益			25,635
合併による増加			2,144
吸収分割による増加			1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,543	1,543	1,543
当期変動額合計	1,543	1,543	7,971
当期末残高	5,349	5,349	104,956

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当期変動額									
剰余金の配当							38,407	38,407	38,407
当期純利益							25,637	25,637	25,637

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,769	12,769	12,769
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	5,349	5,349	104,956
当期変動額			
剰余金の配当			38,407
当期純利益			25,637
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	5,308	5,308	5,308
当期変動額合計	5,308	5,308	18,078
当期末残高	41	41	86,878

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に 取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28年4月1日以降に 取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用して おります。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアに ついては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法に よっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の 債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計 上しております。</p>

<p>5．消費税等の会計処理方法</p> <p>6．連結納税制度の適用</p>	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	--

## [会計方針の変更]

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号平成28年6月17日）を当会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。  
なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)
<p>1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p>	<p>1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p>
<p>未払金 5,894百万円</p> <p>未払費用 1,151</p>	<p>未払金 4,438百万円</p> <p>未払費用 938</p>
<p>2．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 641百万円</p> <p>器具備品 3,132</p> <hr/> <p>合計 3,774</p>	<p>2．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 681百万円</p> <p>器具備品 3,331</p> <hr/> <p>合計 4,013</p>

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 7,081百万円 支払利息 -	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 5,252百万円 支払利息 17
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損 建物 1百万円 器具備品 4 ソフトウェア 54 ア 合計 60	3. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 0 ソフトウェア 9 ア 合計 9

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成27年 5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年 3月31日
効力発生日	平成27年 6月26日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成28年 5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年 3月31日
効力発生日	平成28年 6月24日

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 34,973百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 6,790円

基準日 平成28年3月31日

効力発生日 平成28年6月24日

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額 87百万円

1株当たり配当額 16円89銭

効力発生日 平成28年10月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成29年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 25,598百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,970円

基準日 平成29年3月31日

効力発生日 平成29年6月23日

## 金融商品関係

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-

(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-
(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-
(6)関係会社株式	3,064	180,880	177,816
資産計	112,127	289,944	177,816
(7)未払金	11,855	11,855	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,537	4,537	-
その他未払金	7,284	7,284	-
(8)未払費用	8,872	8,872	-
(9)未払法人税等	1,838	1,838	-
負債計	22,566	22,566	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

    その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっており

ます。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	208	-	-	-
金銭の信託	55,341	-	-	-
未収委託者報酬	14,131	-	-	-
未収運用受託報酬	7,309	-	-	-
有価証券	24,100	-	-	-
合計	101,091	-	-	-

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	127	127	-
(2)金銭の信託	52,247	52,247	-
(3)未収委託者報酬	16,287	16,287	-
(4)未収運用受託報酬	7,481	7,481	-
(5)有価証券及び投資有価証券	15,700	15,700	-
その他有価証券	15,700	15,700	-
資産計	91,843	91,843	-
(6)未払金	10,401	10,401	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	5,242	5,242	-
その他未払金	5,126	5,126	-
(7)未払費用	9,461	9,461	-
(8)未払法人税等	714	714	-
負債計	20,578	20,578	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

### (2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

## (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	127	-	-	-
金銭の信託	52,247	-	-	-
未収委託者報酬	16,287	-	-	-
未収運用受託報酬	7,481	-	-	-
有価証券	15,700	-	-	-
合計	91,843	-	-	-

## 有価証券関係

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	180,880	177,816
合計	3,064	180,880	177,816

## 4．その他有価証券(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	7,971	282	7,688
小計	7,971	282	7,688
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	24,100	24,100	-
小計	24,100	24,100	-
合計	32,071	24,382	7,688

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	135	-	95
合計	135	-	95

## 当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(平成29年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
----	-----------------------	---------------	-------------

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	15,700	15,700	-
小計	15,700	15,700	-
合計	15,700	15,700	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）  
該当事項はありません。

#### 退職給付関係

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,117 百万円
期待運用収益	402
数理計算上の差異の発生額	711
事業主からの拠出額	511
退職給付の支払額	555
年金資産の期末残高	15,764

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

## 及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	15,775 百万円
年金資産	15,764

	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、191百万円でした。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	993
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)																																																																																				
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,490</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">839</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">460</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">1,676</td> </tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">240</td> </tr> <tr> <td>減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">177</td> </tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td> <td style="text-align: right;">163</td> </tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">350</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式譲渡益</td> <td style="text-align: right;">120</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">89</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">251</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">6,678</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">1,453</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">5,224</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td>    その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">2,403</td> </tr> <tr> <td>    前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">861</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">3,264</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,959</td> </tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,490	退職給付引当金	839	投資有価証券評価減	460	関係会社株式評価減	1,676	ゴルフ会員権評価減	240	減価償却超過額	177	時効後支払損引当金	163	子会社株式売却損	148	未払事業税	350	関係会社株式譲渡益	120	未払社会保険料	89	その他	251	繰延税金資産小計	6,678	評価性引当額	1,453	繰延税金資産合計	5,224	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	2,403	前払年金費用	861	繰延税金負債合計	3,264	繰延税金資産の純額	1,959	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,345</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">913</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">417</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">247</td> </tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">212</td> </tr> <tr> <td>減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">171</td> </tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td> <td style="text-align: right;">166</td> </tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">110</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式譲渡益</td> <td style="text-align: right;">88</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">85</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">274</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">4,183</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">739</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">3,444</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td>    その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">18</td> </tr> <tr> <td>    前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">804</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">822</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">2,621</td> </tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,345	退職給付引当金	913	投資有価証券評価減	417	関係会社株式評価減	247	ゴルフ会員権評価減	212	減価償却超過額	171	時効後支払損引当金	166	子会社株式売却損	148	未払事業税	110	関係会社株式譲渡益	88	未払社会保険料	85	その他	274	繰延税金資産小計	4,183	評価性引当額	739	繰延税金資産合計	3,444	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	18	前払年金費用	804	繰延税金負債合計	822	繰延税金資産の純額	2,621
繰延税金資産	百万円																																																																																				
賞与引当金	1,490																																																																																				
退職給付引当金	839																																																																																				
投資有価証券評価減	460																																																																																				
関係会社株式評価減	1,676																																																																																				
ゴルフ会員権評価減	240																																																																																				
減価償却超過額	177																																																																																				
時効後支払損引当金	163																																																																																				
子会社株式売却損	148																																																																																				
未払事業税	350																																																																																				
関係会社株式譲渡益	120																																																																																				
未払社会保険料	89																																																																																				
その他	251																																																																																				
繰延税金資産小計	6,678																																																																																				
評価性引当額	1,453																																																																																				
繰延税金資産合計	5,224																																																																																				
繰延税金負債																																																																																					
その他有価証券評価差額金	2,403																																																																																				
前払年金費用	861																																																																																				
繰延税金負債合計	3,264																																																																																				
繰延税金資産の純額	1,959																																																																																				
繰延税金資産	百万円																																																																																				
賞与引当金	1,345																																																																																				
退職給付引当金	913																																																																																				
投資有価証券評価減	417																																																																																				
関係会社株式評価減	247																																																																																				
ゴルフ会員権評価減	212																																																																																				
減価償却超過額	171																																																																																				
時効後支払損引当金	166																																																																																				
子会社株式売却損	148																																																																																				
未払事業税	110																																																																																				
関係会社株式譲渡益	88																																																																																				
未払社会保険料	85																																																																																				
その他	274																																																																																				
繰延税金資産小計	4,183																																																																																				
評価性引当額	739																																																																																				
繰延税金資産合計	3,444																																																																																				
繰延税金負債																																																																																					
その他有価証券評価差額金	18																																																																																				
前払年金費用	804																																																																																				
繰延税金負債合計	822																																																																																				
繰延税金資産の純額	2,621																																																																																				
<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">33.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">6.2%</td> </tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">29.1%</td> </tr> </table>	法定実効税率	33.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%	タックスヘイブン税制	0.8%	外国税額控除	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">31.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.1%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">6.2%</td> </tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td> <td style="text-align: right;">0.5%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">25.7%</td> </tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%	タックスヘイブン税制	0.7%	外国税額控除	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	その他	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%																																												
法定実効税率	33.0%																																																																																				
(調整)																																																																																					
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%																																																																																				
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%																																																																																				
タックスヘイブン税制	0.8%																																																																																				
外国税額控除	0.2%																																																																																				
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%																																																																																				
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%																																																																																				
その他	0.4%																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																																																																				
法定実効税率	31.0%																																																																																				
(調整)																																																																																					
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%																																																																																				
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%																																																																																				
タックスヘイブン税制	0.7%																																																																																				
外国税額控除	0.2%																																																																																				
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.5%																																																																																				
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-																																																																																				
その他	0.2%																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%																																																																																				
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32%から31%となります。</p> <p>この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>																																																																																					

## セグメント情報等

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接20.8%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	5,058	未払費用	279

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,084	未払手数料	3,865
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	2,412	未払費用	669

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

		(百万円)
		(株)野村総合研究所
流動資産合計		239,155
固定資産合計		324,634
流動負債合計		122,933
固定負債合計		55,456
純資産合計		385,400
売上高		352,003
税引前当期純利益		56,508
当期純利益		40,179

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

#### 1. 関連当事者との取引

##### (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等  役員の兼任	資金の借入(*1)	24,500	短期借入金	-
							資金の返済	24,500		
							借入金利息の支払	17	未払費用	-

##### (イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	-	サービス・製品の購入	自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2)	787	未払費用	-

##### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-----	-------	--------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*3）	33,019	未払手数料	4,486
---------	----------	--------	-----------------	-----	---	---	-----------------------	--------	-------	-------

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(\*2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。なお、株式会社野村総合研究所は、平成28年10月27日より関連当事者に該当しないこととなったため、取引金額は関連当事者であった期間について、期末残高は関連当事者でなくなった時点について記載しております。

(\*3) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	20,377円23銭	1株当たり純資産額	16,867円41銭
1株当たり当期純利益	4,977円07銭	1株当たり当期純利益	4,977円49銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,635百万円	損益計算書上の当期純利益	25,637百万円
普通株式に係る当期純利益	25,635百万円	普通株式に係る当期純利益	25,637百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

&lt; 更新後 &gt;

## (1) 受託者

(a)名称	(b)資本の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

\* 平成29年10月末現在

## (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円	
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
ドイツ証券株式会社	72,728百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440百万円	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149百万円	
U B S 証券株式会社	61,450百万円	

\* 平成29年10月末現在

SMBC日興証券株式会社は、平成30年1月1日付をもってSMBCフレンド証券株式会社と合併し、SMBC日興証券株式会社となる予定です。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年11月10日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中 徹	桐
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	大久保	照代

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信の平成29年4月8日から平成29年10月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信の平成29年10月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。