

## 【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】	2018年12月27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】	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、2018年6月27日付をもって提出した有価証券届出書（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(2018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

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

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

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

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%

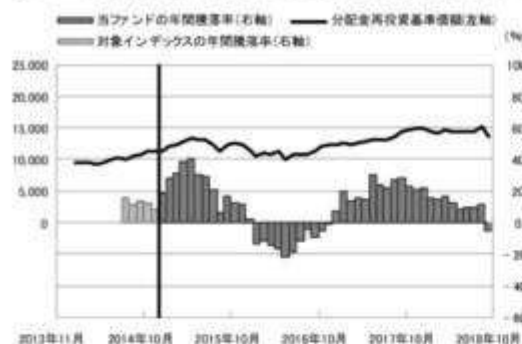
## 3 投資リスク

## &lt; 更新後 &gt;

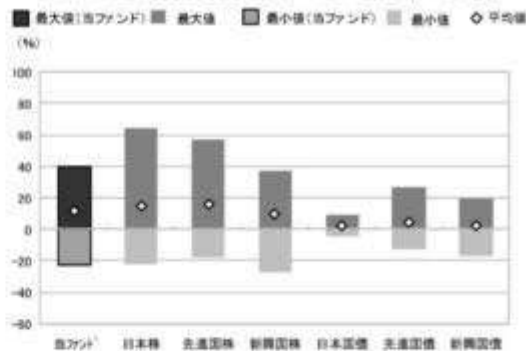
## リスクの定量的比較

(2013年11月末～2018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	64.2	57.1	37.2	9.3	26.6	19.3
最小値(%)	△ 22.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	11.3	14.5	15.4	9.7	2.1	4.8	2.2

- ※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2018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。
- ※2013年11月から2018年10月の5年間で(当ファンドは2014年8月から2018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：FTSE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、知的財産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、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、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。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLDにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLDの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLD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)については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格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は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示唆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 LLD(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)、「指数スポンサー」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)についての援助、保障または販売促進を行いません。証券成り又は金融商品全般、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他の用途について、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。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, 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、FTSE Fixed Income LLD 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、2018年12月27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。

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

## 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;

2018年12月27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;

2018年12月27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》
・特定公社債 <sup>(注1)</sup> の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	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 ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

(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、2015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（2018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2018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	653,174,825,940	97.46
現金・預金・その他資産(負債控除後)		16,969,616,487	2.53
合計(純資産総額)		670,144,442,427	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	16,733,728,500	2.49

## (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	ソニー	電気機器	1,832,200	6,584.85	12,064,775,500	6,140.00	11,249,708,000	1.67
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,337,100	731.24	11,946,498,833	684.80	11,187,646,080	1.66
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,199,900	11,049.79	13,258,643,021	9,048.00	10,856,695,200	1.62
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,241,300	4,716.98	10,572,167,274	4,414.00	9,893,098,200	1.47
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,987,000	3,321.13	9,920,215,310	3,241.00	9,680,867,000	1.44
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	48,182,800	199.58	9,616,360,822	194.00	9,347,463,200	1.39
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,961,400	5,058.92	9,922,565,688	4,750.00	9,316,650,000	1.39
8	日本	株式	キーエンス	電気機器	165,700	64,917.93	10,756,901,209	55,300.00	9,163,210,000	1.36
9	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,325,100	6,993.50	9,267,086,850	6,615.00	8,765,536,500	1.30
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	3,108,800	2,975.94	9,251,623,870	2,814.50	8,749,717,600	1.30
11	日本	株式	三菱商事	卸売業	2,484,800	3,610.16	8,970,541,005	3,180.00	7,901,664,000	1.17
12	日本	株式	任天堂	その他製品	221,400	41,084.42	9,096,092,784	35,160.00	7,784,424,000	1.16
13	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,460,900	3,688.88	9,077,964,792	3,037.00	7,473,753,300	1.11
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,484,200	5,107.44	7,580,472,372	4,893.00	7,262,190,600	1.08
15	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	2,533,100	2,966.99	7,515,695,940	2,844.50	7,205,402,950	1.07
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	321,900	23,493.01	7,562,400,180	21,650.00	6,969,135,000	1.03
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,285,300	5,613.94	7,215,597,082	5,346.00	6,871,213,800	1.02
18	日本	株式	ファナック	電気機器	341,600	21,285.92	7,271,272,335	19,735.00	6,741,476,000	1.00
19	日本	株式	花王	化学	872,800	8,861.16	7,734,020,448	7,531.00	6,573,056,800	0.98
20	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,419,300	4,548.78	6,456,096,560	4,570.00	6,486,201,000	0.96
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	377,200	17,085.58	6,444,680,882	17,165.00	6,474,638,000	0.96
22	日本	株式	ダイキン工業	機械	490,800	14,871.58	7,298,976,294	13,125.00	6,441,750,000	0.96
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	639,300	10,222.97	6,535,547,760	9,875.00	6,313,087,500	0.94
24	日本	株式	日本電産	電気機器	432,600	15,608.02	6,752,030,532	14,490.00	6,268,374,000	0.93
25	日本	株式	キヤノン	電気機器	1,935,400	3,611.23	6,989,191,797	3,222.00	6,235,858,800	0.93
26	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,083,600	2,939.98	6,125,762,840	2,906.50	6,055,983,400	0.90
27	日本	株式	信越化学工業	化学	620,500	9,902.95	6,144,785,004	9,469.00	5,875,514,500	0.87
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	3,314,800	1,973.23	6,540,862,804	1,747.00	5,790,955,600	0.86
29	日本	株式	日立製作所	電気機器	1,618,500	3,790.54	6,134,988,990	3,462.00	5,603,247,000	0.83
30	日本	株式	三井物産	卸売業	2,917,200	2,093.47	6,107,076,925	1,885.50	5,500,380,600	0.82

## 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	0.09
		鉱業	0.37



建設業	2.77
食料品	4.10
繊維製品	0.41
パルプ・紙	0.19
化学	7.00
医薬品	5.63
石油・石炭製品	0.98
ゴム製品	0.86
ガラス・土石製品	0.72
鉄鋼	0.90
非鉄金属	0.79
金属製品	0.31
機械	4.78
電気機器	13.93
輸送用機器	6.84
精密機器	1.77
その他製品	1.84
電気・ガス業	1.71
陸運業	4.82
空運業	0.72
情報・通信業	7.53
卸売業	5.06
小売業	4.79
銀行業	6.24
証券、商品先物取引業	1.07
保険業	3.03
その他金融業	1.30
不動産業	2.61
サービス業	4.16
合 計	97.46

## 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 (2018年12月限)	買建	11,489	日本円	18,290,488,000	16,733,728,500	2.49

## (3) 運用実績

## 純資産の推移

2018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
第9計算期間	(2018年 4月 7日)	597,108	602,908	15,236.0000	15,384.0000	15,250
第10計算期間	(2018年10月 7日)	721,635	728,212	15,910.0000	16,055.0000	15,920
	2017年10月末日	548,812		15,647.0000		15,650
	11月末日	567,244		15,894.0000		15,910
	12月末日	580,118		16,110.0000		16,120
	2018年 1月末日	601,579		16,284.0000		16,270
	2月末日	611,356		15,647.0000		15,670
	3月末日	601,552		15,350.0000		15,340
	4月末日	631,181		15,736.0000		15,730
	5月末日	628,578		15,476.0000		15,480
	6月末日	643,749		15,357.0000		15,320
	7月末日	695,007		15,542.0000		15,540
	8月末日	718,315		15,376.0000		15,380
	9月末日	737,976		16,271.0000		16,310
	10月末日	670,144		14,608.0000		14,600

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
第9計算期間	2017年10月 8日～2018年 4月 7日	148.0000円
第10計算期間	2018年 4月 8日～2018年10月 7日	145.0000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%
第9計算期間	2017年10月 8日～2018年 4月 7日	3.2%
第10計算期間	2018年 4月 8日～2018年10月 7日	5.4%

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

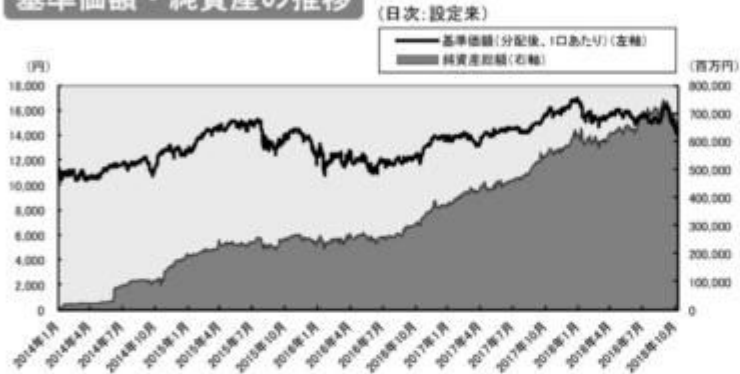
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2014年 1月24日～2014年 4月 7日	2,098,932		2,098,932
第2計算期間	2014年 4月 8日～2014年10月 7日	6,693,631	196,877	8,595,686
第3計算期間	2014年10月 8日～2015年 4月 7日	12,092,932	5,801,234	14,887,384
第4計算期間	2015年 4月 8日～2015年10月 7日	5,893,491	3,727,008	17,053,867
第5計算期間	2015年10月 8日～2016年 4月 7日	5,893,904	2,746,309	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
第9計算期間	2017年10月 8日～2018年 4月 7日	11,692,627	7,636,419	39,189,425
第10計算期間	2018年 4月 8日～2018年10月 7日	9,592,741	3,425,840	45,356,326

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

&lt; 更新後 &gt;

**運用実績** (2018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)

2018年10月	145 円
2018年4月	148 円
2017年10月	127 円
2017年4月	132 円
2016年10月	109 円
設定来累計	1,182 円

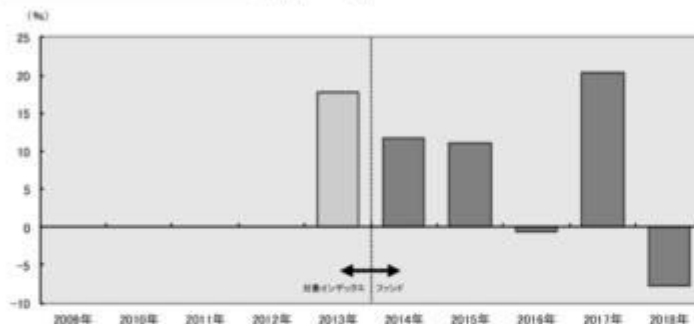
**主要な資産の状況**

## 銘柄別投資比率(上位)

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	ソニー	電気機器	1.7
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.7
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.5
5	本田技研工業	輸送用機器	1.4
6	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.4
7	日本電信電話	情報・通信業	1.4
8	キーエンス	電気機器	1.4
9	トヨタ自動車	輸送用機器	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、2009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。
- ・2018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10期計算期間(2018年4月8日から2018年10月7日まで)の財務諸表について、EY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9期 (2018年 4月 7日現在)	第10期 (2018年10月 7日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	42,431,776,764	60,828,936,617
株式	584,547,267,200	703,144,954,720
派生商品評価勘定	182,561,157	831,919,592
未収入金	5,822,298,200	6,570,497,110
未収配当金	5,441,699,757	6,008,875,038
未収利息	4,104,969	5,177,379
その他未収収益	119,420,901	48,529,568
差入委託証拠金	217,129,036	-
流動資産合計	638,766,257,984	777,438,890,024
資産合計	638,766,257,984	777,438,890,024
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	49,314,708
前受金	-	285,941,112
未払収益分配金	5,800,034,900	6,576,667,270
未払受託者報酬	155,081,586	174,502,468
未払委託者報酬	467,362,816	525,935,942
未払利息	140,174	315,876
有価証券貸借取引受入金	35,167,305,599	47,978,405,905
その他未払費用	68,251,832	211,963,282
流動負債合計	41,658,176,907	55,803,046,563
負債合計	41,658,176,907	55,803,046,563
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	455,616,255,050	527,312,646,076
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	141,491,826,027	194,323,197,385
(分配準備積立金)	11,720,631	25,337,168
元本等合計	597,108,081,077	721,635,843,461
純資産合計	597,108,081,077	721,635,843,461
負債純資産合計	638,766,257,984	777,438,890,024

## (2) 損益及び剰余金計算書

	第9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日	第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年10月 7日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	6,403,315,137	7,372,065,441
有価証券売買等損益	6,813,300,340	29,354,108,177
派生商品取引等損益	375,423,509	603,961,959
その他収益	164,527,397	90,034,518
営業収益合計	13,756,566,383	37,420,170,095
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,901,670	2,133,878
受託者報酬	155,081,586	174,502,468
委託者報酬	467,362,816	525,935,942
その他費用	175,114,792	173,511,620
営業費用合計	792,657,524	871,816,152
営業利益又は営業損失( )	12,963,908,859	36,548,353,943
経常利益又は経常損失( )	12,963,908,859	36,548,353,943
当期純利益又は当期純損失( )	12,963,908,859	36,548,353,943
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( )	115,351,934,151	141,491,826,027
剰余金増加額又は欠損金減少額	50,299,012,043	36,376,567,445
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	50,299,012,043	36,376,567,445
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,322,994,126	13,516,882,760
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,322,994,126	13,516,882,760
分配金	5,800,034,900	6,576,667,270
期末剰余金又は期末欠損金( )	141,491,826,027	194,323,197,385

## (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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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、2018年 4月 8日から2018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9期 2018年 4月 7日現在	第10期 2018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 39,189,425口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 45,356,326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 15,236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 15,910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 33,796,203,260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 44,887,286,750円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日	第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年10月 7日																																																												
1. 分配金の計算過程 <table border="1" data-bbox="172 1279 754 1720"> <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>6,572,744,204円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>36,570,521円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>6,609,314,725円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>797,559,194円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>5,811,755,531円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>5,800,034,900円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>11,720,631円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>39,189,425口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>148円</td> </tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち124,978,974円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	6,572,744,204円	分配準備積立金	B	36,570,521円	配当等収益合計額	C=A+B	6,609,314,725円	経費	D	797,559,194円	収益分配可能額	E=C-D	5,811,755,531円	収益分配金	F	5,800,034,900円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,720,631円	口数	H	39,189,425口	1口当たり分配金	I=F/H	148円	1. 分配金の計算過程 <table border="1" data-bbox="834 1279 1417 1720"> <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>7,464,233,837円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>11,720,631円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>7,475,954,468円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>873,950,030円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>6,602,004,438円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>6,576,667,270円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>25,337,168円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>45,356,326口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>145円</td> </tr> </tbody> </table> 2. その他費用 その他費用のうち140,411,830円は、対象指数についての商標使用料であります。	項目			当期配当等収益額	A	7,464,233,837円	分配準備積立金	B	11,720,631円	配当等収益合計額	C=A+B	7,475,954,468円	経費	D	873,950,030円	収益分配可能額	E=C-D	6,602,004,438円	収益分配金	F	6,576,667,270円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,337,168円	口数	H	45,356,326口	1口当たり分配金	I=F/H	145円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	6,572,744,204円																																																											
分配準備積立金	B	36,570,521円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	6,609,314,725円																																																											
経費	D	797,559,194円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	5,811,755,531円																																																											
収益分配金	F	5,800,034,900円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,720,631円																																																											
口数	H	39,189,425口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	148円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	7,464,233,837円																																																											
分配準備積立金	B	11,720,631円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	7,475,954,468円																																																											
経費	D	873,950,030円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	6,602,004,438円																																																											
収益分配金	F	6,576,667,270円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,337,168円																																																											
口数	H	45,356,326口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	145円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日</p>	<p style="text-align: center;">第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年10月 7日</p>
<p>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。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 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。 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。 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。 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 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。 市場リスクの管理 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。 信用リスクの管理 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。 流動性リスクの管理 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>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第9期 2018年 4月 7日現在</p>	<p style="text-align: center;">第10期 2018年10月 7日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 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ぬ。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</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。 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。 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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日	第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018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9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日	第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年10月 7日
期首元本額 408,458,780,842円	期首元本額 455,616,255,050円
期中追加設定元本額 135,938,481,502円	期中追加設定元本額 111,525,206,866円
期中一部交換元本額 88,781,007,294円	期中一部交換元本額 39,828,815,840円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第9期 自 2017年10月 8日 至 2018年 4月 7日	第10期 自 2018年 4月 8日 至 2018年10月 7日
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	952,571,824	27,899,718,833
合計	952,571,824	27,899,718,833

## 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

	第9期(2018年 4月 7日現在)	第10期(2018年10月 7日現在)
--	--------------------	---------------------

種類	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	12,308,989,035	-	12,492,876,000	182,561,157	17,673,164,888	-	18,457,648,000	782,604,884
合計	12,308,989,035	-	12,492,876,000	182,561,157	17,673,164,888	-	18,457,648,000	782,604,884

## (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(2018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	444,000	713.00	316,572,000	貸付有価証券 100株
		マルハニチロ	74,800	4,175.00	312,290,000	貸付有価証券 26,200株
		国際石油開発帝石	1,918,400	1,426.00	2,735,638,400	
		安藤・間	322,000	848.00	273,056,000	貸付有価証券 1,800株
		東急建設	151,700	1,106.00	167,780,200	貸付有価証券 800株
		コムシスホールディングス	138,700	3,255.00	451,468,500	
		大成建設	392,800	5,120.00	2,011,136,000	
		大林組	1,183,200	1,069.00	1,264,840,800	
		清水建設	1,206,800	1,014.00	1,223,695,200	
		長谷工コーポレーション	460,400	1,471.00	677,248,400	
		鹿島建設	866,900	1,616.00	1,400,910,400	

西松建設	91,200	2,879.00	262,564,800	貸付有価証券 300株
三井住友建設	284,500	777.00	221,056,500	
前田建設工業	281,300	1,472.00	414,073,600	
戸田建設	458,600	821.00	376,510,600	貸付有価証券 16,000株
熊谷組	61,900	3,160.00	195,604,000	貸付有価証券 9,000株
大東建託	140,600	14,885.00	2,092,831,000	
N I P P O	91,400	2,045.00	186,913,000	
前田道路	123,500	2,300.00	284,050,000	
五洋建設	469,000	752.00	352,688,000	
住友林業	252,200	1,979.00	499,103,800	
大和ハウス工業	1,165,400	3,336.00	3,887,774,400	
積水ハウス	1,283,600	1,691.00	2,170,567,600	貸付有価証券 73,300株
協和エクシオ	141,700	3,260.00	461,942,000	貸付有価証券 400株
九電工	77,800	4,460.00	346,988,000	
森永製菓	82,900	4,410.00	365,589,000	
江崎グリコ	98,700	5,670.00	559,629,000	
カルビー	161,000	3,735.00	601,335,000	貸付有価証券 42,900株
ヤクルト本社	205,700	9,230.00	1,898,611,000	
明治ホールディングス	233,700	7,740.00	1,808,838,000	
日本ハム	152,800	4,165.00	636,412,000	貸付有価証券 20,900株
アサヒグループホールディングス	740,100	4,907.00	3,631,670,700	貸付有価証券 150,600株
キリンホールディングス	1,598,700	2,820.00	4,508,334,000	貸付有価証券 365,100株
サントリー食品インターナショナル	236,500	4,670.00	1,104,455,000	貸付有価証券 95,000株
キッコーマン	254,300	6,480.00	1,647,864,000	貸付有価証券 4,900株
味の素	812,700	1,902.50	1,546,161,750	
キューピー	196,800	2,618.00	515,222,400	貸付有価証券 40,300株
ニチレイ	168,300	2,895.00	487,228,500	
東洋水産	193,900	4,370.00	847,343,000	

日清食品ホールディングス	138,700	7,710.00	1,069,377,000	
日本たばこ産業	2,040,700	2,941.00	6,001,698,700	貸付有価証券 302,300株
帝人	303,000	2,158.00	653,874,000	貸付有価証券 14,000株
東レ	2,675,400	852.10	2,279,708,340	
王子ホールディングス	1,552,500	849.00	1,318,072,500	
クラレ	581,900	1,677.00	975,846,300	貸付有価証券 393,500株
旭化成	2,300,100	1,708.50	3,929,720,850	貸付有価証券 161,500株
昭和電工	229,100	5,800.00	1,328,780,000	貸付有価証券 157,100株
住友化学	2,714,700	640.00	1,737,408,000	
日産化学	211,800	6,150.00	1,302,570,000	貸付有価証券 5,900株
東ソー	533,100	1,654.00	881,747,400	
デンカ	135,500	3,885.00	526,417,500	
信越化学工業	607,700	9,924.00	6,030,814,800	
エア・ウォーター	304,100	2,052.00	624,013,200	貸付有価証券 1,000株
大陽日酸	284,100	1,806.00	513,084,600	
日本パーカライジング	188,500	1,486.00	280,111,000	貸付有価証券 900株
三菱瓦斯化学	304,000	2,312.00	702,848,000	
三井化学	335,300	2,811.00	942,528,300	
J S R	370,800	2,066.00	766,072,800	貸付有価証券 1,600株
三菱ケミカルホールディングス	2,470,100	1,065.50	2,631,891,550	
ダイセル	497,300	1,366.00	679,311,800	
積水化学工業	753,800	2,052.00	1,546,797,600	貸付有価証券 900株
日本ゼオン	311,000	1,230.00	382,530,000	
アイカ工業	103,400	4,550.00	470,470,000	
宇部興産	185,800	2,952.00	548,481,600	
日立化成	182,200	2,185.00	398,107,000	貸付有価証券 1,700株
ダイキョーニシカワ	72,700	1,269.00	92,256,300	貸付有価証券

				400株
日油	142,400	3,660.00	521,184,000	貸付有価証券 600株
花王	865,800	8,871.00	7,680,511,800	貸付有価証券 182,100株
日本ペイントホールディングス	284,600	4,135.00	1,176,821,000	貸付有価証券 134,900株（1,900株）
関西ペイント	387,500	2,004.00	776,550,000	貸付有価証券 60,900株
D I C	156,000	3,845.00	599,820,000	貸付有価証券 30,100株
資生堂	699,700	8,084.00	5,656,374,800	貸付有価証券 131,300株
ライオン	490,500	2,320.00	1,137,960,000	貸付有価証券 180,500株
コーセー	59,600	20,500.00	1,221,800,000	
シーズ・ホールディングス	42,500	4,030.00	171,275,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	150,300	3,985.00	598,945,500	貸付有価証券 7,700株
小林製薬	98,700	7,890.00	778,743,000	貸付有価証券 57,100株
日東電工	265,900	8,652.00	2,300,566,800	
ニフコ	129,300	3,050.00	394,365,000	
ユニ・チャーム	746,600	3,498.00	2,611,606,800	貸付有価証券 273,800株
協和発酵キリン	441,200	2,072.00	914,166,400	
武田薬品工業	1,297,300	4,556.00	5,910,498,800	貸付有価証券 877,200株
アステラス製薬	3,463,000	1,975.50	6,841,156,500	
大日本住友製薬	261,000	2,739.00	714,879,000	貸付有価証券 39,000株
塩野義製薬	496,100	7,498.00	3,719,757,800	
田辺三菱製薬	429,600	1,885.00	809,796,000	貸付有価証券 3,900株
中外製薬	367,100	7,040.00	2,584,384,000	貸付有価証券 63,300株
科研製薬	63,500	5,950.00	377,825,000	
エーザイ	421,500	10,910.00	4,598,565,000	
小野薬品工業	831,600	3,209.00	2,668,604,400	
久光製薬	104,000	8,690.00	903,760,000	貸付有価証券

				36,900株
参天製薬	667,500	1,785.00	1,191,487,500	
ツムラ	125,900	3,945.00	496,675,500	貸付有価証券 900株
沢井製薬	70,800	6,180.00	437,544,000	
第一三共	1,007,600	4,858.00	4,894,920,800	
大塚ホールディングス	670,800	5,717.00	3,834,963,600	貸付有価証券 130,100株
出光興産	295,600	6,310.00	1,865,236,000	
J X T Gホールディングス	5,619,600	860.30	4,834,541,880	
コスモエネルギーホールディングス	101,900	4,760.00	485,044,000	
横浜ゴム	203,900	2,410.00	491,399,000	貸付有価証券 29,500株
ブリヂストン	1,082,300	4,315.00	4,670,124,500	貸付有価証券 264,000株
住友ゴム工業	316,300	1,674.00	529,486,200	貸付有価証券 1,600株
A G C	355,000	4,620.00	1,640,100,000	貸付有価証券 111,000株
太平洋セメント	222,400	3,585.00	797,304,000	
T O T O	270,900	4,865.00	1,317,928,500	
日本碍子	429,700	1,831.00	786,780,700	
日本特殊陶業	296,900	3,305.00	981,254,500	貸付有価証券 200株
ニチアス	96,400	2,929.00	282,355,600	
新日鐵住金	1,558,400	2,367.00	3,688,732,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	940,400	2,582.00	2,428,112,800	
東京製鐵	186,500	827.00	154,235,500	貸付有価証券 5,100株
日立金属	375,100	1,404.00	526,640,400	貸付有価証券 1,100株
日本軽金属ホールディングス	1,016,600	244.00	248,050,400	
三菱マテリアル	230,000	3,435.00	790,050,000	
住友金属鉱山	445,100	3,923.00	1,746,127,300	
D O W Aホールディングス	88,100	3,630.00	319,803,000	貸付有価証券 36,400株

古河電気工業	115,900	3,665.00	424,773,500	貸付有価証券 400株
住友電気工業	1,301,900	1,722.00	2,241,871,800	
SUMCO	384,800	1,627.00	626,069,600	貸付有価証券 109,300株(83,900 株)
三和ホールディングス	334,000	1,347.00	449,898,000	
リンナイ	62,100	8,390.00	521,019,000	
東プレ	65,000	2,780.00	180,700,000	
日本発條	346,900	1,149.00	398,588,100	貸付有価証券 300株
アマダホールディングス	537,400	1,164.00	625,533,600	
オーエスジー	171,400	2,563.00	439,298,200	
DMG森精機	220,300	1,888.00	415,926,400	貸付有価証券 152,200株(7,200株)
ディスコ	47,100	18,230.00	858,633,000	
ナブテスコ	191,500	3,000.00	574,500,000	貸付有価証券 77,600株
三井海洋開発	37,000	3,615.00	133,755,000	
SMC	110,500	36,320.00	4,013,360,000	
小松製作所	1,700,200	3,400.00	5,780,680,000	
住友重機械工業	201,500	4,040.00	814,060,000	
日立建機	164,600	3,770.00	620,542,000	
ハーモニック・ドライ ブ・システムズ	52,600	4,255.00	223,813,000	貸付有価証券 35,500株(23,200株)
クボタ	1,888,700	1,967.00	3,715,072,900	貸付有価証券 366,300株(101,500 株)
荏原製作所	156,000	3,855.00	601,380,000	貸付有価証券 80,700株
ダイキン工業	480,700	14,910.00	7,167,237,000	
椿本チエイン	41,900	5,340.00	223,746,000	
ダイフク	179,200	5,560.00	996,352,000	
タダノ	169,900	1,347.00	228,855,300	貸付有価証券 200株
平和	109,100	2,457.00	268,058,700	貸付有価証券 2,500株
竹内製作所	58,900	2,991.00	176,169,900	貸付有価証券 100株
T P R	39,500	3,010.00	118,895,000	

ホシザキ	102,900	11,660.00	1,199,814,000	貸付有価証券 39,400株
日本精工	723,200	1,308.00	945,945,600	
ジェイテクト	375,300	1,705.00	639,886,500	
T H K	219,500	2,827.00	620,526,500	
マキタ	459,200	5,380.00	2,470,496,000	
三菱重工業	590,100	4,458.00	2,630,665,800	
コニカミノルタ	824,300	1,222.00	1,007,294,600	
ブラザー工業	430,000	2,308.00	992,440,000	貸付有価証券 10,700株
ミネベアミツミ	653,700	1,980.00	1,294,326,000	
日立製作所	1,690,900	3,797.00	6,420,347,300	
三菱電機	3,521,100	1,532.50	5,396,085,750	貸付有価証券 2,600株
富士電機	212,200	4,465.00	947,473,000	貸付有価証券 17,500株
安川電機	408,200	3,360.00	1,371,552,000	貸付有価証券 214,800株（2,000株）
日本電産	423,700	15,640.00	6,626,668,000	
オムロン	374,200	4,895.00	1,831,709,000	
日本電気	455,600	3,150.00	1,435,140,000	
富士通	362,100	7,678.00	2,780,203,800	
ルネサスエレクトロニクス	364,700	733.00	267,325,100	貸付有価証券 186,400株
セイコーエプソン	524,300	1,943.00	1,018,714,900	
アルバック	80,900	4,155.00	336,139,500	貸付有価証券 11,200株
エレコム	31,600	2,925.00	92,430,000	貸付有価証券 2,600株
パナソニック	4,022,600	1,334.50	5,368,159,700	
富士通ゼネラル	107,500	1,893.00	203,497,500	貸付有価証券 13,600株
ソニー	1,794,100	6,596.00	11,833,883,600	
T D K	184,200	11,320.00	2,085,144,000	
アルプス電気	303,400	2,942.00	892,602,800	
クラリオン	37,100	1,750.00	64,925,000	貸付有価証券 25,000株
ヒロセ電機	57,500	11,990.00	689,425,000	貸付有価証券 13,200株



横河電機	352,400	2,495.00	879,238,000	
日本光電工業	145,500	3,805.00	553,627,500	
堀場製作所	69,700	5,790.00	403,563,000	貸付有価証券 26,000株
アドバンテスト	196,400	2,263.00	444,453,200	
キーエンス	162,300	65,200.00	10,581,960,000	
シスメックス	274,300	9,460.00	2,594,878,000	
O B A R A G R O U P	20,500	5,420.00	111,110,000	
スタンレー電気	268,800	3,885.00	1,044,288,000	
カシオ計算機	283,200	1,866.00	528,451,200	貸付有価証券 36,700株
ファナック	334,600	21,345.00	7,142,037,000	貸付有価証券 5,900株
浜松ホトニクス	252,600	4,280.00	1,081,128,000	
京セラ	578,000	6,627.00	3,830,406,000	
村田製作所	369,400	17,110.00	6,320,434,000	貸付有価証券 1,200株
小糸製作所	210,900	7,190.00	1,516,371,000	
S C R E E Nホールディ ングス	66,600	6,400.00	426,240,000	貸付有価証券 24,500株
キヤノン	1,895,500	3,617.00	6,856,023,500	貸付有価証券 679,800株
東京エレクトロン	234,800	15,200.00	3,568,960,000	貸付有価証券 6,100株
トヨタ紡織	102,600	2,110.00	216,486,000	
豊田自動織機	285,000	6,440.00	1,835,400,000	
デンソー	781,300	5,679.00	4,437,002,700	
川崎重工業	274,000	3,260.00	893,240,000	
日産自動車	4,152,800	1,037.00	4,306,453,600	貸付有価証券 134,600株
いすゞ自動車	1,020,300	1,731.50	1,766,649,450	
トヨタ自動車	1,415,700	7,002.00	9,912,731,400	
日野自動車	502,500	1,234.00	620,085,000	
N O K	189,300	1,897.00	359,102,100	貸付有価証券 51,300株
アイシン精機	289,900	5,190.00	1,504,581,000	
マツダ	1,105,100	1,341.50	1,482,491,650	
本田技研工業	3,120,600	3,326.00	10,379,115,600	貸付有価証券 1,800株

スズキ	697,900	6,200.00	4,326,980,000	貸付有価証券 600株
S U B A R U	1,093,100	3,454.00	3,775,567,400	貸付有価証券 6,300株
ヤマハ発動機	497,300	3,120.00	1,551,576,000	貸付有価証券 172,200株（28,700 株）
豊田合成	127,900	2,683.00	343,155,700	
シマノ	141,900	17,270.00	2,450,613,000	貸付有価証券 24,500株
テイ・エス テック	81,800	3,790.00	310,022,000	
テルモ	539,700	6,920.00	3,734,724,000	貸付有価証券 3,700株
島津製作所	420,800	3,410.00	1,434,928,000	
オリンパス	524,500	4,435.00	2,326,157,500	貸付有価証券 100株
H O Y A	708,900	6,841.00	4,849,584,900	
朝日インテック	169,600	5,290.00	897,184,000	貸付有価証券 32,600株（32,600株）
バンダイナムコホール ディングス	364,000	4,160.00	1,514,240,000	
パイロットコーポレー ション	61,400	6,730.00	413,222,000	
アシックス	349,600	1,713.00	598,864,800	貸付有価証券 228,500株
ヤマハ	230,400	5,530.00	1,274,112,000	
ピジョン	212,800	6,100.00	1,298,080,000	貸付有価証券 79,600株
任天堂	216,800	41,180.00	8,927,824,000	
中部電力	1,077,300	1,751.00	1,886,352,300	貸付有価証券 16,700株
関西電力	1,436,700	1,726.00	2,479,744,200	
東北電力	824,600	1,552.00	1,279,779,200	貸付有価証券 600株
九州電力	777,600	1,387.00	1,078,531,200	貸付有価証券 2,700株
電源開発	280,200	3,190.00	893,838,000	
東京瓦斯	740,100	2,799.50	2,071,909,950	
大阪瓦斯	683,300	2,192.00	1,497,793,600	
東邦瓦斯	174,400	4,350.00	758,640,000	
東武鉄道	371,400	3,280.00	1,218,192,000	

相鉄ホールディングス	150,200	3,730.00	560,246,000	
東京急行電鉄	956,400	1,953.00	1,867,849,200	
小田急電鉄	523,700	2,651.00	1,388,328,700	
京王電鉄	196,700	6,170.00	1,213,639,000	
京成電鉄	245,000	3,905.00	956,725,000	
東日本旅客鉄道	626,100	10,235.00	6,408,133,500	貸付有価証券 1,800株
西日本旅客鉄道	315,600	7,757.00	2,448,109,200	貸付有価証券 1,000株
東海旅客鉄道	315,300	23,540.00	7,422,162,000	貸付有価証券 8,400株
西武ホールディングス	448,800	2,132.00	956,841,600	
近鉄グループホールディングス	333,500	4,505.00	1,502,417,500	
阪急阪神ホールディングス	444,800	3,970.00	1,765,856,000	
京阪ホールディングス	198,000	4,370.00	865,260,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	356,100	2,810.00	1,000,641,000	貸付有価証券 12,800株
日本通運	130,900	7,090.00	928,081,000	
ヤマトホールディングス	584,600	3,436.00	2,008,685,600	
山九	85,600	6,360.00	544,416,000	貸付有価証券 100株
日立物流	73,300	3,075.00	225,397,500	
日本航空	610,500	4,000.00	2,442,000,000	貸付有価証券 6,600株
A N Aホールディングス	647,700	3,777.00	2,446,362,900	貸付有価証券 2,700株
新日鉄住金ソリューションズ	51,800	3,650.00	189,070,000	
T I S	115,200	5,450.00	627,840,000	
ネクソン	879,400	1,449.00	1,274,250,600	貸付有価証券 163,200株
コロプラ	98,600	713.00	70,301,800	貸付有価証券 34,800株（15,900株）
ティーガイア	34,600	2,842.00	98,333,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	832,700	224.00	186,524,800	貸付有価証券 563,200株（4,500株）
野村総合研究所	219,500	5,580.00	1,224,810,000	

オービック	108,900	10,690.00	1,164,141,000	
ヤフー	2,491,600	400.00	996,640,000	貸付有価証券 234,100株
トレンドマイクロ	184,000	6,980.00	1,284,320,000	貸付有価証券 60,400株
日本オラクル	56,000	8,870.00	496,720,000	貸付有価証券 11,900株
伊藤忠テクノソリューションズ	157,400	2,356.00	370,834,400	
大塚商会	186,900	4,055.00	757,879,500	貸付有価証券 107,600株
日本ユニシス	95,900	2,840.00	272,356,000	
日本テレビホールディングス	317,300	1,986.00	630,157,800	貸付有価証券 7,200株
日本電信電話	2,015,700	5,062.00	10,203,473,400	
KDDI	3,044,900	2,978.50	9,069,234,650	
光通信	40,700	21,400.00	870,980,000	
NTTドコモ	2,480,900	2,970.00	7,368,273,000	
GMOインターネット	125,800	1,812.00	227,949,600	貸付有価証券 37,900株（2,600株）
東宝	227,300	3,580.00	813,734,000	貸付有価証券 88,800株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,073,300	1,543.00	1,656,101,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	160,700	4,360.00	700,652,000	
カプコン	148,100	2,807.00	415,716,700	
SCSK	79,700	5,180.00	412,846,000	
コナミホールディングス	141,200	4,425.00	624,810,000	
ソフトバンクグループ	1,273,200	11,075.00	14,100,690,000	
双日	2,052,300	417.00	855,809,100	
アルフレッサホールディングス	385,400	3,050.00	1,175,470,000	
神戸物産	26,200	6,250.00	163,750,000	貸付有価証券 17,900株
シップヘルスケアホールディングス	72,200	4,355.00	314,431,000	貸付有価証券 300株
第一興商	68,800	5,480.00	377,024,000	
メディカルホールディングス	347,500	2,413.00	838,517,500	

伊藤忠商事	2,545,100	2,272.50	5,783,739,750	
丸紅	2,849,900	1,043.00	2,972,445,700	
豊田通商	387,100	4,400.00	1,703,240,000	
兼松	147,800	1,680.00	248,304,000	貸付有価証券 500株
三井物産	2,857,200	2,098.00	5,994,405,600	
日立ハイテクノロジーズ	120,500	3,755.00	452,477,500	貸付有価証券 2,200株
住友商事	2,187,600	1,916.00	4,191,441,600	
三菱商事	2,433,600	3,617.00	8,802,331,200	
阪和興業	64,800	3,805.00	246,564,000	貸付有価証券 3,700株
岩谷産業	76,900	4,015.00	308,753,500	貸付有価証券 40,000株（35,900株）
東邦ホールディングス	102,700	2,946.00	302,554,200	貸付有価証券 67,400株（59,600株）
PALTA C	48,600	5,430.00	263,898,000	
日鉄住金物産	27,100	5,360.00	145,256,000	貸付有価証券 100株
ミスミグループ本社	402,900	2,937.00	1,183,317,300	
ローソン	87,700	7,170.00	628,809,000	貸付有価証券 59,200株（37,500株）
エービーシー・マート	63,200	6,200.00	391,840,000	貸付有価証券 44,000株
アダストリア	53,300	1,736.00	92,528,800	貸付有価証券 36,000株
セリア	82,900	3,855.00	319,579,500	貸付有価証券 700株
ビックカメラ	185,100	1,508.00	279,130,800	
Monotaro	219,100	3,290.00	720,839,000	貸付有価証券 149,600株（1,600株）
J・フロント リテイリング	414,100	1,735.00	718,463,500	貸付有価証券 71,600株
マツモトキヨシホールディングス	143,400	4,460.00	639,564,000	
ZOZO	340,700	3,215.00	1,095,350,500	
ウエルシアホールディングス	91,700	6,020.00	552,034,000	貸付有価証券 18,600株
クリエイトSDホールディングス	51,100	2,985.00	152,533,500	
すかいらーくホールディングス	323,200	1,672.00	540,390,400	貸付有価証券

ングス				64,200株（64,100株）
コスモス薬品	17,500	24,890.00	435,575,000	貸付有価証券 1,700株
セブン & アイ・ホールディングス	1,453,600	5,114.00	7,433,710,400	貸付有価証券 507,500株
ツルハホールディングス	75,300	13,070.00	984,171,000	貸付有価証券 31,400株
クスリのアオキホールディングス	27,600	8,780.00	242,328,000	貸付有価証券 18,600株
ノジマ	61,500	2,358.00	145,017,000	
良品計画	46,000	32,150.00	1,478,900,000	貸付有価証券 18,300株
ドンキホーテホールディングス	224,800	5,630.00	1,265,624,000	貸付有価証券 78,900株
ゼンショーホールディングス	179,900	2,163.00	389,123,700	
ユナイテッドアローズ	42,900	4,700.00	201,630,000	
スギホールディングス	76,200	5,590.00	425,958,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	110,800	12,770.00	1,414,916,000	貸付有価証券 27,000株（700株）
日本瓦斯	63,700	5,450.00	347,165,000	
しまむら	40,400	9,430.00	380,972,000	貸付有価証券 2,700株
丸井グループ	317,900	2,463.00	782,987,700	貸付有価証券 7,500株
イオン	1,334,500	2,692.00	3,592,474,000	貸付有価証券 933,900株（111,400株）
イズミ	62,700	7,040.00	441,408,000	
ヤオコー	39,400	6,770.00	266,738,000	
ケーズホールディングス	308,900	1,393.00	430,297,700	
アインホールディングス	46,500	8,730.00	405,945,000	貸付有価証券 32,300株（32,300株）
ニトリホールディングス	137,600	15,815.00	2,176,144,000	貸付有価証券 61,500株
ファーストリテイリング	46,400	57,750.00	2,679,600,000	貸付有価証券 24,800株
サンドラッグ	130,500	4,040.00	527,220,000	
めぶきフィナンシャルグループ	1,804,600	399.00	720,035,400	貸付有価証券 100株
九州フィナンシャルグループ	759,900	557.00	423,264,300	貸付有価証券

ループ				900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,073,800	578.00	1,198,656,400	
新生銀行	283,200	1,870.00	529,584,000	貸付有価証券 180,400株
あおぞら銀行	206,900	4,020.00	831,738,000	貸付有価証券 2,900株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,001,000	732.70	11,723,932,700	
りそなホールディングス	3,811,200	652.90	2,488,332,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	682,800	4,729.00	3,228,961,200	
三井住友フィナンシャルグループ	2,331,800	4,722.00	11,010,759,600	貸付有価証券 14,700株
千葉銀行	1,230,100	803.00	987,770,300	貸付有価証券 1,300株
静岡銀行	874,200	1,057.00	924,029,400	
広島銀行	512,700	765.00	392,215,500	貸付有価証券 500株
セブン銀行	1,303,600	340.00	443,224,000	貸付有価証券 83,900株
みずほフィナンシャルグループ	47,191,500	199.80	9,428,861,700	
F P G	111,100	1,096.00	121,765,600	貸付有価証券 13,100株
S B Iホールディングス	392,800	3,375.00	1,325,700,000	貸付有価証券 28,100株
大和証券グループ本社	2,972,500	693.30	2,060,834,250	
野村ホールディングス	5,974,800	562.40	3,360,227,520	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	384,500	673.00	258,768,500	貸付有価証券 79,700株
松井証券	170,100	1,195.00	203,269,500	
S O M P Oホールディングス	681,100	4,785.00	3,259,063,500	
M S & A Dインシュアランスグループホール	908,000	3,819.00	3,467,652,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	285,400	2,605.00	743,467,000	貸付有価証券 2,000株
第一生命ホールディングス	1,964,600	2,447.00	4,807,376,200	
東京海上ホールディングス	1,308,400	5,618.00	7,350,591,200	貸付有価証券 25,700株

T & Dホールディングス	1,074,100	1,995.50	2,143,366,550	
全国保証	97,900	4,400.00	430,760,000	貸付有価証券 28,400株
芙蓉総合リース	39,700	6,760.00	268,372,000	
東京センチュリー	69,900	6,770.00	473,223,000	
イオンフィナンシャル サービス	246,500	2,298.00	566,457,000	貸付有価証券 4,800株
オリエントコーポレー ション	751,400	172.00	129,240,800	貸付有価証券 520,200株
日立キャピタル	95,500	3,110.00	297,005,000	
オリックス	2,317,000	1,836.50	4,255,170,500	
三菱UFJリース	881,400	673.00	593,182,200	
日本取引所グループ	996,800	1,996.00	1,989,612,800	貸付有価証券 3,800株
いちご	496,700	399.00	198,183,300	
ヒューリック	724,900	1,029.00	745,922,100	貸付有価証券 412,900株
野村不動産ホールディ ングス	231,200	2,246.00	519,275,200	
プレサンスコーポレー ション	48,100	1,416.00	68,109,600	
オープンハウス	56,600	5,540.00	313,564,000	
東急不動産ホールディ ングス	840,700	675.00	567,472,500	
飯田グループホールディ ングス	289,700	2,008.00	581,717,600	貸付有価証券 200株
パーク24	202,700	3,445.00	698,301,500	貸付有価証券 29,200株（400株）
三井不動産	1,734,200	2,629.50	4,560,078,900	
三菱地所	2,584,900	1,841.50	4,760,093,350	
東京建物	379,500	1,275.00	483,862,500	貸付有価証券 149,500株
住友不動産	832,800	3,935.00	3,277,068,000	
レオパレス21	414,400	622.00	257,756,800	
スターツコーポレーショ ン	47,200	2,395.00	113,044,000	
イオンモール	223,800	1,848.00	413,582,400	貸付有価証券 76,900株
エヌ・ティ・ティ都市開 発	215,900	1,301.00	280,885,900	貸付有価証券 2,300株



ミクシィ	85,500	2,687.00	229,738,500	貸付有価証券 14,100株（14,000株）
日本M&Aセンター	232,900	3,445.00	802,340,500	貸付有価証券 400株
パーソルホールディングス	310,500	2,672.00	829,656,000	
総合警備保障	133,900	4,935.00	660,796,500	
カカクコム	253,300	2,135.00	540,795,500	貸付有価証券 33,100株
ディップ	47,400	2,684.00	127,221,600	貸付有価証券 33,000株
エムスリー	708,200	2,380.00	1,685,516,000	貸付有価証券 64,600株
ディー・エヌ・エー	181,400	1,985.00	360,079,000	
博報堂D Yホールディングス	467,500	2,020.00	944,350,000	
電通	409,900	5,580.00	2,287,242,000	貸付有価証券 80,100株
オリエンタルランド	397,600	11,365.00	4,518,724,000	
リゾートトラスト	142,400	1,826.00	260,022,400	貸付有価証券 100株
ユー・エス・エス	410,900	2,102.00	863,711,800	
サイバーエージェント	207,300	5,480.00	1,136,004,000	貸付有価証券 1,600株
楽天	1,568,300	852.00	1,336,191,600	貸付有価証券 739,800株
エン・ジャパン	38,000	5,500.00	209,000,000	
テクノプロ・ホールディングス	63,400	6,780.00	429,852,000	
リクルートホールディングス	2,595,700	3,694.00	9,588,515,800	
リログループ	183,900	3,075.00	565,492,500	貸付有価証券 600株
カナモト	47,300	4,055.00	191,801,500	
セコム	357,100	9,524.00	3,401,020,400	
メイテック	39,400	5,340.00	210,396,000	
イオンディライト	41,500	4,085.00	169,527,500	
小計	銘柄数：400 組入時価比率：97.4%		703,144,954,720 100.0%	
合計			703,144,954,720	

(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(2018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

2018年10月31日現在

資産総額	765,293,530,427円
負債総額	95,149,088,000円
純資産総額( - )	670,144,442,427円
発行済口数	45,873,928口
1口当たり純資産額( / )	14,608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

2018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。

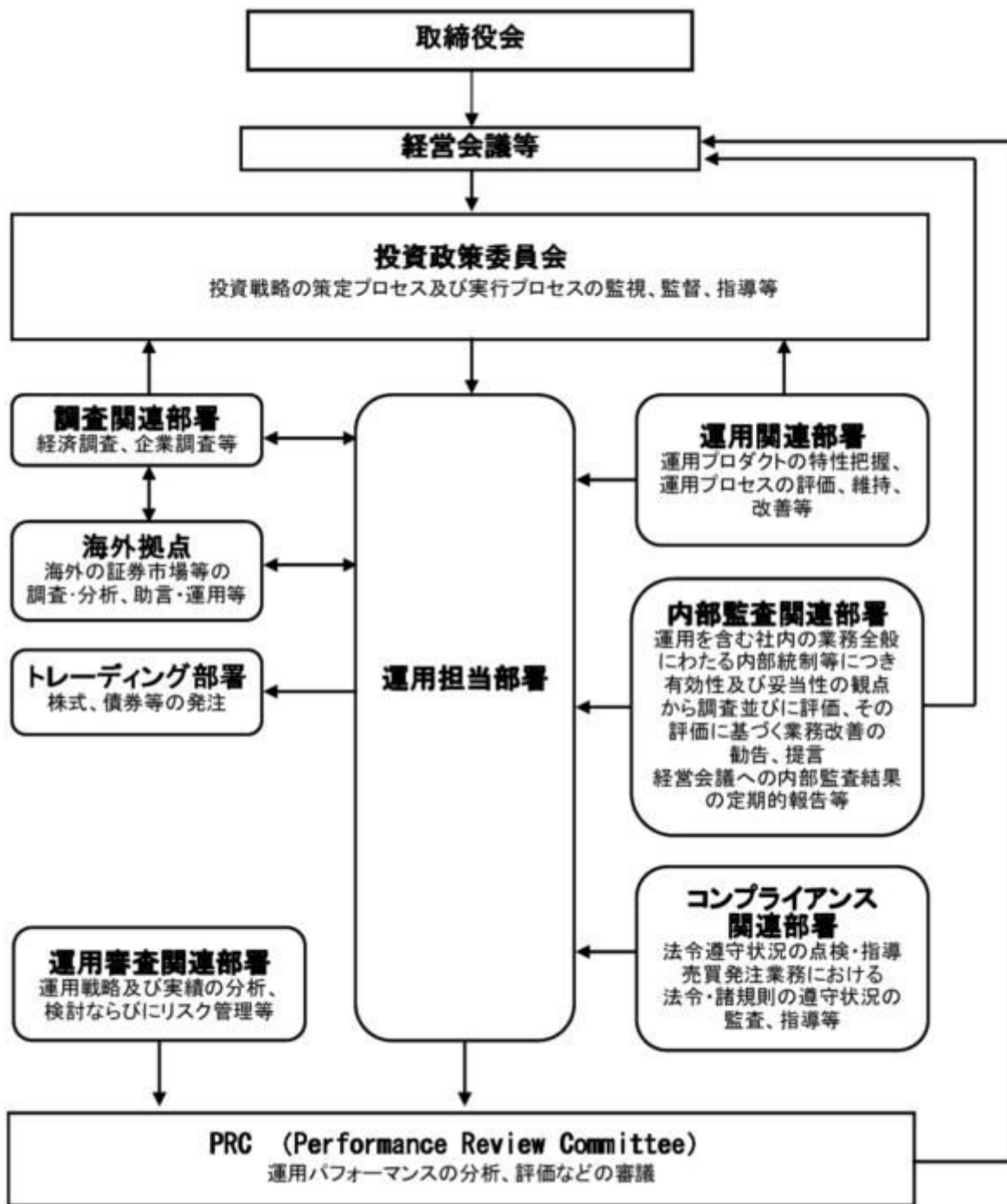
###### 代表執行役・執行役

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2018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	1,022	26,818,553
単位型株式投資信託	130	677,339
追加型公社債投資信託	14	5,319,847
単位型公社債投資信託	402	1,739,789
合計	1,568	34,555,529

### 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(2017年4月1日から2018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 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018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			127		919
金銭の信託			52,247		47,936
有価証券			15,700		22,600
前払金			33		0
前払費用			2		26
未収入金			495		464
未収委託者報酬			16,287		24,059
未収運用受託報酬			7,481		6,764
繰延税金資産			1,661		2,111
その他			42		181
貸倒引当金			11		15
流動資産計			94,066		105,048
固定資産					
有形固定資産			1,001		874
建物	2	377		348	

器具備品	2	624		525	
無形固定資産			7,185		7,157
ソフトウェア		7,184		7,156	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,165		13,825
投資有価証券		1,233		1,184	
関係会社株式		8,124		9,033	
従業員長期貸付金		-		36	
長期差入保証金		44		54	
長期前払費用		37		36	
前払年金費用		2,594		2,350	
繰延税金資産		960		962	
その他		170		168	
貸倒引当金		-		0	
固定資産計			21,353		21,857
資産合計			115,419		126,906

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			98		133
未払金	1		10,401		17,853
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		5,242		7,884	
関係会社未払金		4,438		7,930	
その他未払金		687		2,005	
未払費用	1		9,461		12,441
未払法人税等			714		2,241
前受収益			39		33
賞与引当金			4,339		4,626
流動負債計			25,055		37,329
固定負債					
退職給付引当金			2,947		2,938
時効後支払損引当金			538		548
固定負債計			3,485		3,486
負債合計			28,540		40,816
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,837		86,078
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			55,927		55,168
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,242		54,483	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,635		29,876	

評価・換算差額等		41	11
その他有価証券評価差額金		41	11
純資産合計		86,878	86,090
負債・純資産合計		115,419	126,906

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		96,594	115,907
運用受託報酬		28,466	26,200
その他営業収益		266	338
営業収益計		125,327	142,447
営業費用			
支払手数料		39,785	45,252
広告宣伝費		1,011	1,079
公告費		0	0
調査費		26,758	30,516
調査費		5,095	5,830
委託調査費		21,662	24,685
委託計算費		1,290	1,376
営業雑経費		4,408	5,464
通信費		162	125
印刷費		940	966
協会費		76	79
諸経費		3,228	4,293
営業費用計		73,254	83,689
一般管理費			
給料		11,269	11,716
役員報酬	2	301	425
給料・手当		6,923	6,856
賞与		4,044	4,433
交際費		126	132
旅費交通費		469	482
租税公課		898	1,107
不動産賃借料		1,222	1,221
退職給付費用		1,223	1,119
固定資産減価償却費		2,730	2,706
諸経費		8,118	9,122
一般管理費計		26,059	27,609
営業利益		26,012	31,148

		前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	7,397		4,031	
受取利息		0		4	
金銭の信託運用益		684		-	
その他		379		362	
営業外収益計			8,461		4,398
営業外費用					
支払利息		17		2	
金銭の信託運用損		-		312	
時効後支払損引当金繰入額		16		13	
為替差損		33		46	
その他		9		31	
営業外費用計			77		405
経常利益			34,397		35,141
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		20	
関係会社清算益		41		-	
株式報酬受入益		59		75	
特別利益計			126		95
特別損失					
投資有価証券等評価損		6		2	
固定資産除却損	3	9		58	
特別損失計			15		60
税引前当期純利益			34,507		35,176
法人税、住民税及び事業税			7,147		10,775
法人税等調整額			1,722		439
当期純利益			25,637		24,840

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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		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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(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	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

## [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。)</p> <p>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、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016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。</p> <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <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>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
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>(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>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>(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いません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	---

## 【未適用の会計基準等】

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

日)

### (1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いが見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

### (2) 適用予定日

2019年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

**[ 表示方法の変更に関する注記 ]**

(貸借対照表)

前事業年度において、流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「関係会社未払金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「その他未払金」に表示していた4,438百万円は、「関係会社未払金」4,438百万円として組み替えております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
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。 未払費用 938百万円	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。 未払費用 1,781百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 681百万円 器具備品 3,331 合計 4,013	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200

損益計算書関係

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018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 5,252百万円 支払利息 17	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 4,026百万円 支払利息 2
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		3. 固定資産除却損	
建物	-百万円	建物	4百万円
器具備品	0	器具備品	0
ソフトウェア	9	ソフトウェア	53
ア		ア	
合計	9	合計	58

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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

2016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 2016年3月31日

効力発生日 2016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

2016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 2016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 2016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 2016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

2017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	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017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	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年5月14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	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

#### 金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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、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

2017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	-
関係会社未払金	4,438	4,438	-
その他未払金	687	687	-
(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	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	15,700	-	-	-



合計	91,843	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018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

2018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	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

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1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）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	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

#### 有価証券関係

前事業年度（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月 31日）

##### 1．売買目的有価証券(2017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(2017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(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

##### 4．その他有価証券(2017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 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2018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(2018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(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018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	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年4月1日 至 2018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 2016年4月1日 至 2017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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398

## (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	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

## (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	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929 百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
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	887

## (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	47%
株式	41%
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	0.5%
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、195百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
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	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
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,345	賞与引当金 1,434
退職給付引当金 913	退職給付引当金 910
投資有価証券評価減 417	投資有価証券評価減 417
未払事業税 110	未払事業税 409
関係会社株式評価減 247	関係会社株式評価減 247
ゴルフ会員権評価減 212	ゴルフ会員権評価減 207
減価償却超過額 171	減価償却超過額 171
時効後支払損引当金 166	時効後支払損引当金 169
子会社株式売却損 148	子会社株式売却損 148
未払子会社役務提供費用 -	未払子会社役務提供費用 121
未払社会保険料 85	未払社会保険料 107
関係会社株式譲渡益 88	関係会社株式譲渡益 -
その他 274	その他 197
繰延税金資産小計 4,183	繰延税金資産小計 4,543
評価性引当額 739	評価性引当額 735
繰延税金資産合計 3,444	繰延税金資産合計 3,808
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 18	その他有価証券評価差額金 5
前払年金費用 804	前払年金費用 728
繰延税金負債合計 822	繰延税金負債合計 733
繰延税金資産の純額 2,621	繰延税金資産の純額 3,074
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	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
法定実効税率 31.0%	法定実効税率 31.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%	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%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.4%
タックスヘイブン税制 0.7%	タックスヘイブン税制 1.8%
外国税額控除 0.2%	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%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.3%
その他 0.2%	その他 0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 25.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.3%

## セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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 2017年4月1日 至 2018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 2016年4月1日 至 2017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(*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、2016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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	2	未払費用	-

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (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(*2)	37,482	未払手数料	6,691

## (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) 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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,867円41銭	1株当たり純資産額	16,714円33銭
1株当たり当期純利益	4,977円49銭	1株当たり当期純利益	4,822円68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おりません。		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おりません。	
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	25,637百万円	損益計算書上の当期純利益	24,840百万円
普通株式に係る当期純利益	25,637百万円	普通株式に係る当期純利益	24,840百万円
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

【重要な後発事象】

当社は、2018年4月6日付で、香港の金融持株会社である8 Limited（エイト・リミテッド、以下「エイト・リミテッド」）の株式の14.9%を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社（以下「エイト証券」）の株式の78.3%を取得しました。当社のエイト・リミテッド及びエイト証券に対する出資額は、それぞれ約11億円及び約16億円であり、いずれも4月上旬に払込みを行っております。

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

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額*	(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。

\* 2018年10月末現在

(2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額*	(c) 事業の内容
--------	------------	-----------

野村証券株式会社	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	32,100百万円	

\* 2018年10月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2018年11月16日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 菅原和信  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 大久保照代  
業務執行社員

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2018年4月8日から2018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2018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

2018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 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 雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津 村 健二郎

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2017年4月1日から2018年3月31日までの第59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2018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。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2018年4月6日付でエイト・リミテッドの株式を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社の株式を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 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。