

【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】	2020年12月16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兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【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、2020年6月30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、記載事項の一部に変更がありますので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

< 更新後 >

委託会社の概況(2020年10月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・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

・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1-13-1	5,150,693株	100%

3 投資リスク

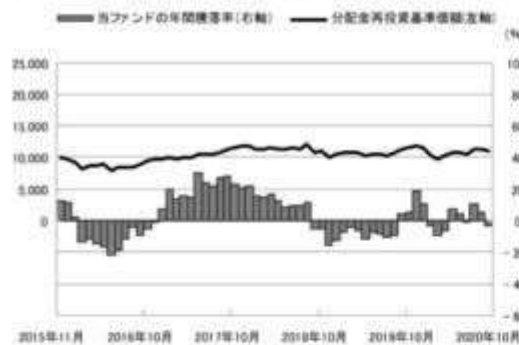
< 更新後 >

リスクの定量的比較

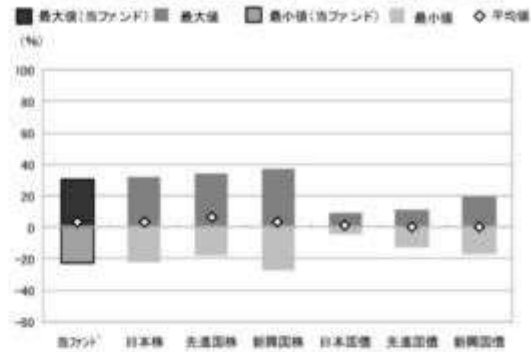
(2015年11月末～2020年10月末:月次)

〈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〉



2015年11月 2016年10月 2017年10月 2018年10月 2019年10月 2020年10月



	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(%)	30.1	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値(%)	△ 22.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	3.4	3.8	6.5	3.7	1.5	0.7	0.5

- ◆ 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。2015年11月末を10,000として指数化しております。
- ◆ 年間騰落率は、2015年11月から2020年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- ◆ 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。
- ◆ 2015年11月から2020年10月の5年間の各月末における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。
- ◆ 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(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、東京証券取引所に所有されています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、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)についての提供、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推薦の可否について、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。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

<更新後>

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0.22%(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、2020年12月16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0.22% (税抜年0.20%)	年0.176% (税抜年0.16%)	年0.132% (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44%(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

<更新後>

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、ファンド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、委託者が負担します。

対象株価指数に係る商標使用料(2020年12月16日現在)

ファンドの純資産総額に対し、最大年0.044%(税抜年0.04%)を乗じて得た額とします。

ファンドの純資産総額	5000億円以下の部分	5000億円超 1兆円以下の部分	1兆円超の部分
------------	-------------	---------------------	---------

商標使用料 (税抜)	年0.04%	年0.035%	年0.03%
---------------	--------	---------	--------

ファンドの上場に係る費用(2020年12月16日現在)

- ・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、0.00825%(税抜0.0075%)。
- ・年間上場料:毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%(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

<更新後>

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》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・特定公社債^(注1)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 <ul style="list-style-type: none"> ・譲渡益 ・譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・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。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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（2020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2020年10月30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	900,471,351,640	98.05
現金・預金・その他資産(負債控除後)		17,876,275,504	1.94
合計(純資産総額)		918,347,627,144	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		17,681,010,500	1.92
----------	----	----	--	----------------	------

(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	2,224,100	7,770.55	17,282,484,388	8,674.00	19,291,843,400	2.10
2	日本	株式	任天堂	その他製品	321,900	57,851.88	18,622,523,315	56,980.00	18,341,862,000	1.99
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	375,700	49,189.19	18,480,380,495	47,250.00	17,751,825,000	1.93
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,473,300	6,956.01	17,204,309,700	6,793.00	16,801,126,900	1.82
5	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	3,683,300	3,877.05	14,280,338,643	3,887.00	14,316,987,100	1.55
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	3,593,200	4,271.89	15,349,783,562	3,970.00	14,265,004,000	1.55
7	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,012,000	7,002.81	14,089,654,552	6,803.00	13,687,636,000	1.49
8	日本	株式	日本電産	電気機器	1,263,300	10,290.88	13,000,472,786	10,500.00	13,264,650,000	1.44
9	日本	株式	ダイキン工業	機械	668,800	18,625.66	12,456,843,201	19,480.00	13,028,224,000	1.41
10	日本	株式	第一三共	医薬品	4,506,500	2,983.42	13,444,798,189	2,748.00	12,383,862,000	1.34
11	日本	株式	H O Y A	精密機器	1,041,400	12,189.16	12,693,794,105	11,800.00	12,288,520,000	1.33
12	日本	株式	信越化学工業	化学	882,800	13,843.78	12,221,296,016	13,890.00	12,262,092,000	1.33
13	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,241,900	2,295.11	12,030,770,636	2,196.00	11,511,212,400	1.25
14	日本	株式	村田製作所	電気機器	1,542,000	6,880.32	10,609,458,688	7,267.00	11,205,714,000	1.22
15	日本	株式	ファナック	電気機器	493,600	20,658.44	10,197,009,914	22,050.00	10,883,880,000	1.18
16	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,354,500	3,666.14	12,298,069,781	3,239.00	10,865,225,500	1.18
17	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	26,117,000	433.83	11,330,513,549	410.20	10,713,193,400	1.16
18	日本	株式	K D D I	情報・通信業	3,755,200	2,738.65	10,284,206,533	2,792.50	10,486,396,000	1.14
19	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,133,000	2,618.22	10,821,117,215	2,435.00	10,063,855,000	1.09
20	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,469,300	3,019.78	10,476,546,263	2,881.00	9,995,053,300	1.08
21	日本	株式	花王	化学	1,256,900	7,771.52	9,768,035,508	7,420.00	9,326,198,000	1.01
22	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	333,100	27,568.56	9,183,087,458	27,900.00	9,293,490,000	1.01
23	日本	株式	S M C	機械	164,700	57,894.83	9,535,278,737	55,300.00	9,107,910,000	0.99
24	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	3,616,200	2,700.79	9,766,608,442	2,500.00	9,040,500,000	0.98
25	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,035,200	1,342.33	9,443,608,630	1,281.50	9,015,608,800	0.98
26	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,522,300	3,675.75	9,271,348,516	3,502.00	8,833,094,600	0.96
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,830,500	4,774.71	8,740,119,233	4,659.00	8,528,299,500	0.92
28	日本	株式	三菱商事	卸売業	3,389,900	2,560.41	8,679,555,846	2,325.50	7,883,212,450	0.85
29	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	533,500	15,065.98	8,037,703,031	14,585.00	7,781,097,500	0.84
30	日本	株式	エムスリー	サービス業	1,106,100	6,483.24	7,171,120,896	7,027.00	7,772,564,700	0.84

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	0.05
		鉱業	0.14
		建設業	2.24
		食料品	3.41
		繊維製品	0.34
		パルプ・紙	0.10
		化学	7.43
		医薬品	6.54
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.44
		非鉄金属	0.58
		金属製品	0.30
		機械	5.47
		電気機器	17.34
		輸送用機器	5.58
		精密機器	3.10
		その他製品	2.85
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	3.58
		空運業	0.39
		情報・通信業	9.29
		卸売業	4.52
		小売業	4.85
		銀行業	4.17
		証券、商品先物取引業	0.84
		保険業	2.42
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.13
サービス業	5.71		
合 計			98.05

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 (2020年12月限)	買建	12,491	日本円	18,523,134,965	17,681,010,500	1.92
----------	-------	---------------------------------	----	--------	-----	----------------	----------------	------

(3) 運用実績

純資産の推移

2020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
第11計算期間	(2019年 4月 7日)	727,050	735,380	14,489.0000	14,655.0000	14,480
第12計算期間	(2019年10月 7日)	797,394	805,875	14,103.0000	14,253.0000	14,090
第13計算期間	(2020年 4月 7日)	740,948	750,796	12,639.0000	12,807.0000	12,650
第14計算期間	(2020年10月 7日)	948,747	956,728	14,861.0000	14,986.0000	14,840
	2019年10月末日	842,790		14,952.0000		14,940
	11月末日	856,787		15,221.0000		15,220
	12月末日	857,168		15,438.0000		15,440
	2020年 1月末日	851,723		15,149.0000		15,150
	2月末日	781,644		13,636.0000		13,640
	3月末日	748,926		12,776.0000		12,790
	4月末日	784,446		13,157.0000		13,110
	5月末日	852,457		14,108.0000		14,060
	6月末日	862,102		14,100.0000		14,030
	7月末日	841,648		13,544.0000		13,570
	8月末日	922,594		14,658.0000		14,610
	9月末日	943,802		14,783.0000		14,730
	10月末日	918,347		14,250.0000		14,280

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
第11計算期間	2018年10月 8日～2019年 4月 7日	166.0000円
第12計算期間	2019年 4月 8日～2019年10月 7日	150.0000円
第13計算期間	2019年10月 8日～2020年 4月 7日	168.0000円
第14計算期間	2020年 4月 8日～2020年10月 7日	125.0000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%
第11計算期間	2018年10月 8日～2019年 4月 7日	7.9%
第12計算期間	2019年 4月 8日～2019年10月 7日	1.6%
第13計算期間	2019年10月 8日～2020年 4月 7日	9.2%
第14計算期間	2020年 4月 8日～2020年10月 7日	18.6%

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
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
第11計算期間	2018年10月 8日～2019年 4月 7日	5,695,205	873,475	50,178,056
第12計算期間	2019年 4月 8日～2019年10月 7日	8,386,829	2,024,401	56,540,484
第13計算期間	2019年10月 8日～2020年 4月 7日	5,195,369	3,113,856	58,621,997
第14計算期間	2020年 4月 8日～2020年10月 7日	6,094,300	872,987	63,843,310

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。

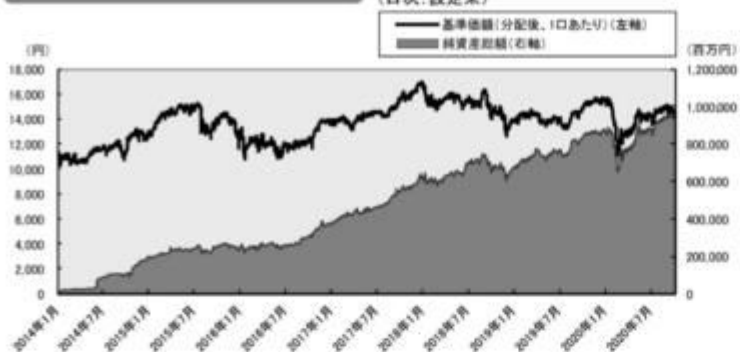
参考情報

< 更新後 >

運用実績 (2020年10月30日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



分配の推移

(1口あたり、課税前)

2020年10月	125 円
2020年4月	168 円
2019年10月	150 円
2019年4月	166 円
2018年10月	145 円
設定来累計	1,791 円

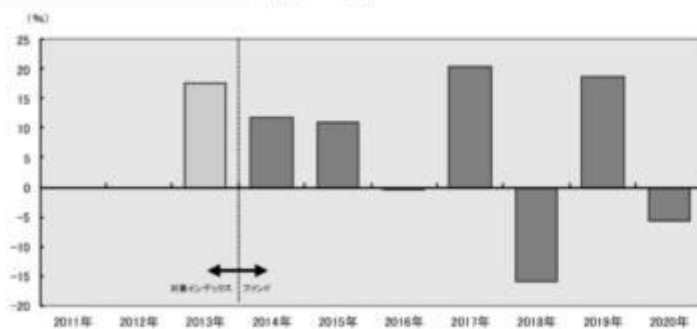
主要な資産の状況

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	2.1
2	任天堂	その他製品	2.0
3	キーエンス	電気機器	1.9
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.8
5	NTTドコモ	情報・通信業	1.6
6	リクルートホールディングス	サービス業	1.6
7	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5
8	日本電産	電気機器	1.4
9	ダイキン工業	機械	1.4
10	第一三共	医薬品	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、2011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。
- ・2020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14期計算期間(2020年4月8日から2020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13期 (2020年 4月 7日現在)	第14期 (2020年10月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	75,869,274,144	69,246,177,380
株式	715,983,637,960	930,087,181,580
派生商品評価勘定	1,167,296,142	383,866,450
未収入金	9,989,996,620	269,211,600
未収配当金	9,178,670,157	7,929,272,671
未収利息	8,540,431	6,057,680
その他未収収益	74,210,990	82,183,745
差入委託証拠金	1,137,336,918	616,470,500
流動資産合計	813,408,963,362	1,008,620,421,606
資産合計	813,408,963,362	1,008,620,421,606
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,457,000	24,709,500
未払収益分配金	9,848,495,496	7,980,413,750
未払受託者報酬	213,861,028	221,319,076
未払委託者報酬	646,179,689	667,298,523
未払利息	68,386	28,855
有価証券貸借取引受入金	61,659,746,016	50,704,650,401
その他未払費用	91,084,492	274,253,881
流動負債合計	72,460,892,107	59,872,673,986
負債合計	72,460,892,107	59,872,673,986
純資産の部		
元本等		
元本	681,539,337,122	742,242,322,060
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	59,408,734,133	206,505,425,560
(分配準備積立金)	65,456,419	52,907,267
元本等合計	740,948,071,255	948,747,747,620
純資産合計	740,948,071,255	948,747,747,620
負債純資産合計	813,408,963,362	1,008,620,421,606

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日	第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年10月 7日
営業収益		
受取配当金	10,770,371,640	8,873,804,882
有価証券売買等損益	84,167,373,237	131,160,106,078
派生商品取引等損益	1,198,965,468	4,042,308,151
その他収益	176,553,991	199,688,249
営業収益合計	74,419,413,074	144,275,907,360
営業費用		
支払利息	11,687,114	10,608,776
受託者報酬	213,861,028	221,319,076
委託者報酬	646,179,689	667,298,523
その他費用	237,094,368	227,619,710
営業費用合計	1,085,447,971	1,105,628,533
営業利益又は営業損失()	75,504,861,045	143,170,278,827
経常利益又は経常損失()	75,504,861,045	143,170,278,827
当期純利益又は当期純損失()	75,504,861,045	143,170,278,827
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()	140,054,813,438	59,408,734,133
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,144,402,670	14,080,544,858
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,144,402,670	14,080,544,858
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,437,125,434	2,173,718,508
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,437,125,434	2,173,718,508
分配金	9,848,495,496	7,980,413,750
期末剰余金又は期末欠損金()	59,408,734,133	206,505,425,560

(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、2020年 4月 8日から2020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13期 2020年 4月 7日現在	第14期 2020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 58,621,997口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 63,843,310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 12,639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 14,861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 61,322,373,310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 48,714,357,960円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日	第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年10月 7日																																																												
<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="172 1272 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>10,958,612,745円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>52,474,255円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>11,011,087,000円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,097,135,085円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>9,913,951,915円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>9,848,495,496円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>65,456,419円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>58,621,997口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>168円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち173,256,388円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	10,958,612,745円	分配準備積立金	B	52,474,255円	配当等収益合計額	C=A+B	11,011,087,000円	経費	D	1,097,135,085円	収益分配可能額	E=C-D	9,913,951,915円	収益分配金	F	9,848,495,496円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	65,456,419円	口数	H	58,621,997口	1口当たり分配金	I=F/H	168円	<p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1" data-bbox="834 1272 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>9,084,101,907円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>65,456,419円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>9,149,558,326円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,116,237,309円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>8,033,321,017円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>7,980,413,750円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>52,907,267円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>63,843,310口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>125円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2. その他費用 その他費用のうち180,389,616円は、対象指数についての商標使用料であります。</p>	項目			当期配当等収益額	A	9,084,101,907円	分配準備積立金	B	65,456,419円	配当等収益合計額	C=A+B	9,149,558,326円	経費	D	1,116,237,309円	収益分配可能額	E=C-D	8,033,321,017円	収益分配金	F	7,980,413,750円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,907,267円	口数	H	63,843,310口	1口当たり分配金	I=F/H	125円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	10,958,612,745円																																																											
分配準備積立金	B	52,474,255円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	11,011,087,000円																																																											
経費	D	1,097,135,085円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	9,913,951,915円																																																											
収益分配金	F	9,848,495,496円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	65,456,419円																																																											
口数	H	58,621,997口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	168円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	9,084,101,907円																																																											
分配準備積立金	B	65,456,419円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	9,149,558,326円																																																											
経費	D	1,116,237,309円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	8,033,321,017円																																																											
収益分配金	F	7,980,413,750円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,907,267円																																																											
口数	H	63,843,310口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	125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13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日</p>	<p style="text-align: center;">第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020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13期 2020年 4月 7日現在</p>	<p style="text-align: center;">第14期 2020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ん。</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13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日	第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020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13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日	第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年10月 7日
期首元本額 657,339,666,984円	期首元本額 681,539,337,122円
期中追加設定元本額 60,401,359,994円	期中追加設定元本額 70,852,331,800円
期中一部交換元本額 36,201,689,856円	期中一部交換元本額 10,149,346,862円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第13期 自 2019年10月 8日 至 2020年 4月 7日	第14期 自 2020年 4月 8日 至 2020年10月 7日
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	86,737,466,485	129,460,874,270
合計	86,737,466,485	129,460,874,270

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13期(2020年 4月 7日現在)	第14期(2020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	23,486,736,918	-	24,655,750,000	1,165,839,142	18,131,795,500	-	18,493,010,000	359,156,950
合計	23,486,736,918	-	24,655,750,000	1,165,839,142	18,131,795,500	-	18,493,010,000	359,156,950

(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(2020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	705,400	446.00	314,608,400	貸付有価証券 300株
		マルハニチロ	101,900	2,345.00	238,955,500	貸付有価証券 1,000株
		国際石油開発帝石	2,594,200	580.00	1,504,636,000	貸付有価証券 1,664,700株
		安藤・間	420,000	743.00	312,060,000	貸付有価証券 800株
		東急建設	206,600	473.00	97,721,800	貸付有価証券 1,600株
		コムシスホールディングス	250,100	2,886.00	721,788,600	貸付有価証券 6,700株
		大成建設	543,200	3,640.00	1,977,248,000	貸付有価証券 200株
		大林組	1,629,000	956.00	1,557,324,000	
		清水建設	1,653,200	791.00	1,307,681,200	貸付有価証券 11,500株

長谷工コーポレーション	630,600	1,397.00	880,948,200	貸付有価証券 33,800株
鹿島建設	1,278,900	1,261.00	1,612,692,900	
西松建設	125,500	2,100.00	263,550,000	貸付有価証券 4,400株
三井住友建設	393,500	449.00	176,681,500	貸付有価証券 3,000株
前田建設工業	408,000	779.00	317,832,000	貸付有価証券 700株
戸田建設	676,500	715.00	483,697,500	貸付有価証券 48,100株
熊谷組	75,500	2,664.00	201,132,000	
大東建託	177,800	9,357.00	1,663,674,600	貸付有価証券 3,000株
N I P P O	134,800	2,898.00	390,650,400	貸付有価証券 100株
五洋建設	645,800	674.00	435,269,200	貸付有価証券 5,600株
住友林業	412,600	1,715.00	707,609,000	貸付有価証券 18,100株
大和ハウス工業	1,611,700	2,925.50	4,715,028,350	貸付有価証券 200株
積水ハウス	1,766,700	1,859.50	3,285,178,650	貸付有価証券 103,400株
協和エクシオ	247,000	2,727.00	673,569,000	貸付有価証券 1,200株
九電工	114,300	3,030.00	346,329,000	貸付有価証券 100株
森永製菓	122,400	4,200.00	514,080,000	貸付有価証券 100株
江崎グリコ	143,500	4,710.00	675,885,000	貸付有価証券 13,700株
カルビー	237,600	3,435.00	816,156,000	貸付有価証券 1,200株
ヤクルト本社	358,600	5,480.00	1,965,128,000	貸付有価証券 11,900株
明治ホールディングス	344,700	7,860.00	2,709,342,000	
日本ハム	199,300	4,510.00	898,843,000	貸付有価証券 2,800株
アサヒグループホールディングス	1,139,000	3,740.00	4,259,860,000	貸付有価証券 451,800株（35,200株）

キリンホールディングス	2,211,100	1,980.00	4,377,978,000	貸付有価証券 781,600株
サントリー食品インター ナショナル	348,800	3,935.00	1,372,528,000	貸付有価証券 53,700株
キッコーマン	375,200	5,490.00	2,059,848,000	貸付有価証券 36,500株
味の素	1,151,400	2,142.00	2,466,298,800	貸付有価証券 500株
キューピー	290,300	2,299.00	667,399,700	貸付有価証券 900株
アリアケジャパン	47,600	7,100.00	337,960,000	
ニチレイ	248,300	2,744.00	681,335,200	
東洋水産	268,200	5,500.00	1,475,100,000	貸付有価証券 3,200株
日清食品ホールディング ス	221,600	9,660.00	2,140,656,000	貸付有価証券 500株
日本たばこ産業	2,795,400	1,991.50	5,567,039,100	貸付有価証券 1,503,000株
帝人	415,000	1,700.00	705,500,000	
東レ	3,683,600	498.80	1,837,379,680	貸付有価証券 100株
ゴールドウイン	92,200	8,160.00	752,352,000	貸付有価証券 200株
王子ホールディングス	2,126,700	491.00	1,044,209,700	貸付有価証券 300株
クラレ	801,200	1,061.00	850,073,200	貸付有価証券 359,200株
旭化成	3,372,100	939.40	3,167,750,740	
昭和電工	386,300	2,018.00	779,553,400	貸付有価証券 100,300株
住友化学	3,737,700	364.00	1,360,522,800	貸付有価証券 100株
日産化学	280,600	5,500.00	1,543,300,000	貸付有価証券 4,800株
東ソー	786,400	1,746.00	1,373,054,400	
トクヤマ	146,600	2,577.00	377,788,200	
デンカ	185,700	3,220.00	597,954,000	
信越化学工業	873,600	13,840.00	12,090,624,000	貸付有価証券 400株
エア・ウォーター	473,200	1,506.00	712,639,200	
日本酸素ホールディング	488,900	1,674.00	818,418,600	貸付有価証券

ス				24,600株
三菱瓦斯化学	473,300	2,007.00	949,913,100	貸付有価証券 400株
三井化学	461,900	2,616.00	1,208,330,400	貸付有価証券 4,800株
J S R	474,100	2,513.00	1,191,413,300	貸付有価証券 1,100株
三菱ケミカルホールディングス	3,400,900	627.20	2,133,044,480	貸付有価証券 239,600株
ダイセル	662,400	806.00	533,894,400	貸付有価証券 28,000株
積水化学工業	1,075,900	1,759.00	1,892,508,100	貸付有価証券 1,500株
アイカ工業	152,600	3,700.00	564,620,000	貸付有価証券 100株
宇部興産	256,900	1,835.00	471,411,500	貸付有価証券 1,600株
ダイキョーニシカワ	107,300	609.00	65,345,700	貸付有価証券 2,100株
日油	191,600	4,080.00	781,728,000	
花王	1,243,700	7,772.00	9,666,036,400	貸付有価証券 27,100株
日本ペイントホールディングス	419,800	10,650.00	4,470,870,000	貸付有価証券 17,000株
関西ペイント	571,600	2,585.00	1,477,586,000	貸付有価証券 26,600株
D I C	214,800	2,654.00	570,079,200	貸付有価証券 7,800株
資生堂	1,032,200	6,455.00	6,662,851,000	貸付有価証券 237,300株
ライオン	675,400	2,095.00	1,414,963,000	貸付有価証券 600株
コーセー	97,700	13,730.00	1,341,421,000	貸付有価証券 6,300株
ポーラ・オルビスホールディングス	221,700	2,000.00	443,400,000	貸付有価証券 19,700株
小林製薬	145,600	10,320.00	1,502,592,000	貸付有価証券 300株
日東電工	358,400	7,050.00	2,526,720,000	貸付有価証券 200株
ニフコ	190,700	2,995.00	571,146,500	貸付有価証券 800株

ユニ・チャーム	1,101,400	4,665.00	5,138,031,000	貸付有価証券 81,600株(24,000株)
協和キリン	522,500	2,788.00	1,456,730,000	貸付有価証券 7,200株
武田薬品工業	3,319,500	3,667.00	12,172,606,500	
アステラス製薬	4,503,900	1,505.00	6,778,369,500	貸付有価証券 9,000株
大日本住友製薬	385,000	1,348.00	518,980,000	貸付有価証券 600株
塩野義製薬	653,300	5,424.00	3,543,499,200	貸付有価証券 2,100株
日本新薬	136,000	8,190.00	1,113,840,000	
中外製薬	1,624,700	4,613.00	7,494,741,100	貸付有価証券 44,300株(300株)
科研製薬	88,900	4,670.00	415,163,000	貸付有価証券 1,700株
エーザイ	621,800	9,450.00	5,876,010,000	貸付有価証券 200株
小野薬品工業	1,192,900	3,197.00	3,813,701,300	貸付有価証券 9,700株
久光製薬	137,300	5,300.00	727,690,000	貸付有価証券 14,100株
参天製薬	968,000	2,099.00	2,031,832,000	貸付有価証券 400株
沢井製薬	106,700	5,150.00	549,505,000	貸付有価証券 500株
第一三共	4,459,400	2,985.00	13,311,309,000	貸付有価証券 11,700株
大塚ホールディングス	1,079,600	4,307.00	4,649,837,200	貸付有価証券 1,400株
ペプチドリーム	264,000	4,850.00	1,280,400,000	貸付有価証券 101,300株
出光興産	576,500	2,258.00	1,301,737,000	貸付有価証券 7,700株
E N E O Sホールディングス	7,814,400	385.00	3,008,544,000	貸付有価証券 300株
コスモエネルギーホールディングス	150,400	1,593.00	239,587,200	貸付有価証券 2,600株
横浜ゴム	300,800	1,550.00	466,240,000	貸付有価証券 39,700株
ブリヂストン	1,381,200	3,477.00	4,802,432,400	貸付有価証券 774,200株

住友ゴム工業	466,600	1,018.00	474,998,800	貸付有価証券 308,600株
A G C	476,800	3,195.00	1,523,376,000	貸付有価証券 224,900株
太平洋セメント	328,100	2,793.00	916,383,300	
東海カーボン	507,900	1,184.00	601,353,600	貸付有価証券 129,900株（70,100株）
T O T O	371,100	4,860.00	1,803,546,000	貸付有価証券 2,200株
日本碍子	623,600	1,523.00	949,742,800	貸付有価証券 200株
日本特殊陶業	395,100	1,931.00	762,938,100	貸付有価証券 500株
ニチアス	142,200	2,476.00	352,087,200	
日本製鉄	2,298,900	1,072.00	2,464,420,800	貸付有価証券 36,300株
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,387,300	782.00	1,084,868,600	貸付有価証券 136,300株
日立金属	553,400	1,652.00	914,216,800	貸付有価証券 11,500株
日本軽金属ホールディング ス	129,970	1,700.00	220,949,000	貸付有価証券 2,800株
住友金属鉱山	656,600	3,270.00	2,147,082,000	貸付有価証券 16,600株
D O W Aホールディング ス	130,000	3,125.00	406,250,000	貸付有価証券 1,200株
古河電気工業	159,600	2,547.00	406,501,200	貸付有価証券 4,700株
住友電気工業	1,920,600	1,230.50	2,363,298,300	貸付有価証券 2,400株
S U M C O	657,400	1,509.00	992,016,600	貸付有価証券 432,100株
三和ホールディングス	484,300	1,165.00	564,209,500	貸付有価証券 300株
リンナイ	99,900	10,360.00	1,034,964,000	貸付有価証券 1,600株
東プレ	95,800	1,178.00	112,852,400	貸付有価証券 800株
アマダ	637,100	1,023.00	651,753,300	
オーエスジー	253,300	1,764.00	446,821,200	貸付有価証券 24,400株

D M G 森精機	325,000	1,514.00	492,050,000	貸付有価証券 47,900株(2,600株)
ディスコ	69,700	26,880.00	1,873,536,000	貸付有価証券 100株
ナブテスコ	302,700	3,955.00	1,197,178,500	貸付有価証券 7,800株
三井海洋開発	54,600	1,650.00	90,090,000	貸付有価証券 1,600株
S M C	163,000	57,900.00	9,437,700,000	貸付有価証券 500株
小松製作所	2,352,900	2,450.50	5,765,781,450	
住友重機械工業	297,300	2,521.00	749,493,300	貸付有価証券 800株
日立建機	208,200	3,790.00	789,078,000	貸付有価証券 8,100株
ハーモニック・ドライ ブ・システムズ	108,700	6,730.00	731,551,000	貸付有価証券 72,800株
クボタ	2,755,900	1,976.50	5,447,036,350	貸付有価証券 672,000株
ダイキン工業	661,800	18,620.00	12,322,716,000	貸付有価証券 3,100株
ダイフク	265,400	10,740.00	2,850,396,000	貸付有価証券 200株
竹内製作所	86,900	2,379.00	206,735,100	貸付有価証券 100株
T P R	69,900	1,338.00	93,526,200	貸付有価証券 800株
日本精工	978,000	859.00	840,102,000	貸付有価証券 8,800株
ジェイテクト	498,300	881.00	439,002,300	貸付有価証券 8,400株
T H K	323,800	2,712.00	878,145,600	貸付有価証券 147,400株
マキタ	677,400	5,040.00	3,414,096,000	貸付有価証券 10,300株
三菱重工業	870,500	2,342.00	2,038,711,000	貸付有価証券 1,900株
I H I	374,200	1,467.00	548,951,400	貸付有価証券 6,700株
コニカミノルタ	1,134,900	301.00	341,604,900	貸付有価証券 152,400株
ブラザー工業	634,300	1,722.00	1,092,264,600	貸付有価証券

				3,600株
ミネベアミツミ	964,300	2,017.00	1,944,993,100	貸付有価証券 400株
日立製作所	2,495,900	3,676.00	9,174,928,400	貸付有価証券 18,400株
三菱電機	5,194,300	1,442.00	7,490,180,600	貸付有価証券 1,600株
富士電機	313,000	3,315.00	1,037,595,000	貸付有価証券 100株
安川電機	559,100	4,220.00	2,359,402,000	貸付有価証券 10,200株
東芝テック	65,100	4,455.00	290,020,500	貸付有価証券 3,600株
日本電産	1,250,100	10,290.00	12,863,529,000	貸付有価証券 14,700株
日新電機	121,700	1,106.00	134,600,200	
オムロン	465,700	8,080.00	3,762,856,000	貸付有価証券 300株
日本電気	630,100	6,020.00	3,793,202,000	貸付有価証券 100株
富士通	500,800	14,045.00	7,033,736,000	貸付有価証券 200株
ルネサスエレクトロニクス	2,222,000	834.00	1,853,148,000	貸付有価証券 87,300株
セイコーエプソン	644,500	1,202.00	774,689,000	貸付有価証券 16,300株
アルバック	95,500	3,895.00	371,972,500	貸付有価証券 29,600株
エレコム	59,000	4,895.00	288,805,000	
パナソニック	5,934,600	912.70	5,416,509,420	貸付有価証券 100株
富士通ゼネラル	141,000	2,950.00	415,950,000	貸付有価証券 13,600株
ソニー	2,200,900	7,770.00	17,100,993,000	貸付有価証券 15,300株
T D K	250,800	11,710.00	2,936,868,000	
アルプスアルパイン	459,700	1,527.00	701,961,900	貸付有価証券 100株
ヒロセ電機	80,000	14,680.00	1,174,400,000	貸付有価証券 3,400株
横河電機	476,500	1,703.00	811,479,500	貸付有価証券 100株

アズビル	327,800	4,125.00	1,352,175,000	貸付有価証券 400株
日本光電工業	214,600	3,510.00	753,246,000	貸付有価証券 1,300株
堀場製作所	102,900	5,520.00	568,008,000	貸付有価証券 3,700株
アドバンテスト	386,200	5,210.00	2,012,102,000	貸付有価証券 1,700株
キーエンス	371,700	49,190.00	18,283,923,000	貸付有価証券 800株
シスメックス	371,400	10,010.00	3,717,714,000	貸付有価証券 2,500株
O B A R A G R O U P	30,300	3,605.00	109,231,500	貸付有価証券 20,300株(18,900株)
レーザーテック	228,100	8,870.00	2,023,247,000	貸付有価証券 6,300株
スタンレー電気	364,200	3,110.00	1,132,662,000	
カシオ計算機	459,500	1,687.00	775,176,500	貸付有価証券 74,100株
ファナック	488,500	20,655.00	10,089,967,500	
浜松ホトニクス	372,600	5,260.00	1,959,876,000	
京セラ	730,800	6,036.00	4,411,108,800	貸付有価証券 500株
太陽誘電	231,000	3,430.00	792,330,000	貸付有価証券 41,500株
村田製作所	1,525,900	6,878.00	10,495,140,200	貸付有価証券 500株
小糸製作所	311,200	5,280.00	1,643,136,000	貸付有価証券 300株
S C R E E Nホールディ ングス	90,100	5,880.00	529,788,000	貸付有価証券 500株
キャノン	2,581,200	1,749.00	4,514,518,800	貸付有価証券 1,400,700株
東京エレクトロン	329,600	27,560.00	9,083,776,000	貸付有価証券 1,200株
トヨタ紡織	151,300	1,564.00	236,633,200	貸付有価証券 100株
豊田自動織機	420,400	6,930.00	2,913,372,000	貸付有価証券 14,500株
デンソー	1,143,700	4,840.00	5,535,508,000	貸付有価証券 400株
川崎重工業	404,200	1,461.00	590,536,200	貸付有価証券

				51,600株
いすゞ自動車	1,505,100	997.10	1,500,735,210	
トヨタ自動車	1,991,000	7,003.00	13,942,973,000	
日野自動車	648,700	801.00	519,608,700	貸付有価証券 300株
アイシン精機	427,700	3,475.00	1,486,257,500	貸付有価証券 200株
マツダ	1,528,400	629.00	961,363,600	貸付有価証券 119,500株
本田技研工業	4,089,900	2,618.50	10,709,403,150	貸付有価証券 55,600株
スズキ	1,029,600	4,811.00	4,953,405,600	貸付有価証券 500株
S U B A R U	1,612,600	2,130.00	3,434,838,000	貸付有価証券 4,600株
ヤマハ発動機	734,100	1,649.00	1,210,530,900	貸付有価証券 206,700株
豊田合成	167,700	2,529.00	424,113,300	貸付有価証券 500株
シマノ	194,400	21,390.00	4,158,216,000	貸付有価証券 73,000株
テイ・エス テック	120,600	3,045.00	367,227,000	
テルモ	1,469,900	4,106.00	6,035,409,400	貸付有価証券 51,400株
島津製作所	620,700	3,160.00	1,961,412,000	貸付有価証券 25,700株
ブイ・テクノロジー	24,300	4,590.00	111,537,000	貸付有価証券 7,900株
東京精密	94,200	3,450.00	324,990,000	貸付有価証券 1,300株
ニコン	793,200	716.00	567,931,200	貸付有価証券 52,800株
オリンパス	2,874,200	2,169.00	6,234,139,800	貸付有価証券 3,100株
H O Y A	1,030,500	12,190.00	12,561,795,000	貸付有価証券 800株
朝日インテック	588,400	3,400.00	2,000,560,000	貸付有価証券 14,700株
バンダイナムコホール ディングス	537,000	7,780.00	4,177,860,000	貸付有価証券 2,900株
パイロットコーポレー ション	91,900	3,040.00	279,376,000	

タカラトミー	232,900	989.00	230,338,100	貸付有価証券 3,100株
ヤマハ	308,900	5,110.00	1,578,479,000	貸付有価証券 400株
ビジョン	333,500	4,860.00	1,620,810,000	貸付有価証券 62,400株（8,100株）
任天堂	318,500	57,860.00	18,428,410,000	貸付有価証券 200株
中部電力	1,589,200	1,301.50	2,068,343,800	
関西電力	1,968,100	1,030.50	2,028,127,050	貸付有価証券 9,600株
東北電力	1,297,600	1,007.00	1,306,683,200	貸付有価証券 14,100株
九州電力	1,070,600	966.00	1,034,199,600	貸付有価証券 64,200株
電源開発	413,300	1,603.00	662,519,900	貸付有価証券 16,700株
東京瓦斯	998,900	2,390.00	2,387,371,000	
大阪瓦斯	1,008,000	2,032.00	2,048,256,000	
東武鉄道	541,400	3,265.00	1,767,671,000	貸付有価証券 700株
相鉄ホールディングス	221,600	2,844.00	630,230,400	貸付有価証券 2,500株
東急	1,310,100	1,381.00	1,809,248,100	貸付有価証券 1,800株
小田急電鉄	772,600	2,674.00	2,065,932,400	貸付有価証券 11,300株
京王電鉄	269,500	6,520.00	1,757,140,000	貸付有価証券 100株
京成電鉄	361,500	3,000.00	1,084,500,000	貸付有価証券 9,100株
東日本旅客鉄道	914,300	6,555.00	5,993,236,500	貸付有価証券 11,300株
西日本旅客鉄道	462,900	5,299.00	2,452,907,100	
東海旅客鉄道	431,900	15,420.00	6,659,898,000	貸付有価証券 1,700株
西武ホールディングス	678,200	1,181.00	800,954,200	貸付有価証券 6,600株
近鉄グループホールディングス	492,000	4,580.00	2,253,360,000	貸付有価証券 38,700株
阪急阪神ホールディングス	656,100	3,460.00	2,270,106,000	貸付有価証券 500株

京阪ホールディングス	292,100	4,370.00	1,276,477,000	
名古屋鉄道	539,300	2,902.00	1,565,048,600	貸付有価証券 116,100株
日本通運	170,300	6,160.00	1,049,048,000	貸付有価証券 100株
ヤマトホールディングス	862,400	2,692.00	2,321,580,800	貸付有価証券 13,800株
山九	136,700	4,215.00	576,190,500	貸付有価証券 900株
日立物流	90,100	3,395.00	305,889,500	貸付有価証券 60,300株
日本航空	870,000	2,020.00	1,757,400,000	貸付有価証券 2,400株
A N Aホールディングス	899,300	2,480.00	2,230,264,000	貸付有価証券 602,500株（215,700 株）
日鉄ソリューションズ	76,400	3,230.00	246,772,000	貸付有価証券 900株
T I S	509,700	2,224.00	1,133,572,800	
ネクソン	1,285,700	2,585.00	3,323,534,500	貸付有価証券 44,200株
コロプラ	167,200	925.00	154,660,000	貸付有価証券 109,000株（27,500 株）
ティーガイア	45,200	1,959.00	88,546,800	貸付有価証券 300株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	122,800	2,179.00	267,581,200	貸付有価証券 40,900株
G M Oペイメントゲート ウェイ	107,800	11,390.00	1,227,842,000	貸付有価証券 4,000株
アカツキ	18,000	4,845.00	87,210,000	貸付有価証券 2,400株（1,800株）
野村総合研究所	722,600	3,115.00	2,250,899,000	
オービック	176,700	18,350.00	3,242,445,000	
Zホールディングス	7,000,000	745.00	5,215,000,000	貸付有価証券 12,900株
トレンドマイクロ	272,000	6,310.00	1,716,320,000	貸付有価証券 38,100株
日本オラクル	103,400	11,000.00	1,137,400,000	貸付有価証券 2,200株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	232,200	3,850.00	893,970,000	貸付有価証券 1,200株

大塚商会	275,800	5,330.00	1,470,014,000	貸付有価証券 21,600株
デジタルガレージ	91,800	3,700.00	339,660,000	貸付有価証券 34,600株
日本ユニシス	159,200	3,420.00	544,464,000	貸付有価証券 900株
日本テレビホールディングス	425,500	1,167.00	496,558,500	貸付有価証券 22,200株
日本電信電話	5,187,200	2,295.50	11,907,217,600	貸付有価証券 3,100株
K D D I	3,716,000	2,738.50	10,176,266,000	貸付有価証券 10,200株
光通信	52,600	25,050.00	1,317,630,000	貸付有価証券 200株
N T T ドコモ	3,644,700	3,877.00	14,130,501,900	貸付有価証券 26,600株
東宝	300,800	4,465.00	1,343,072,000	貸付有価証券 14,400株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,357,100	1,329.00	1,803,585,900	貸付有価証券 4,000株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	217,400	6,720.00	1,460,928,000	貸付有価証券 200株
カブコン	240,300	5,920.00	1,422,576,000	貸付有価証券 3,100株
S C S K	117,600	5,790.00	680,904,000	貸付有価証券 6,800株
コナミホールディングス	185,100	4,595.00	850,534,500	貸付有価証券 1,000株
ソフトバンクグループ	2,447,500	6,955.00	17,022,362,500	貸付有価証券 64,600株
双日	2,825,700	243.00	686,645,100	貸付有価証券 110,400株
アルフレッサ ホールディングス	568,500	2,302.00	1,308,687,000	貸付有価証券 400株
神戸物産	176,500	5,710.00	1,007,815,000	貸付有価証券 118,200株
ダイワボウホールディングス	43,500	6,550.00	284,925,000	
T O K A I ホールディングス	270,300	1,034.00	279,490,200	貸付有価証券 1,700株
シップヘルスケアホールディングス	82,000	5,180.00	424,760,000	貸付有価証券 13,200株

コメダホールディングス	111,500	1,934.00	215,641,000	貸付有価証券 20,600株
第一興商	101,500	3,600.00	365,400,000	貸付有価証券 4,800株
メディカルホールディングス	552,100	2,085.00	1,151,128,500	貸付有価証券 4,000株
日本ライフライン	151,500	1,400.00	212,100,000	貸付有価証券 1,900株
伊藤忠商事	3,578,400	2,701.50	9,667,047,600	貸付有価証券 2,900株
丸紅	5,325,400	618.90	3,295,890,060	貸付有価証券 25,000株
豊田通商	571,000	3,095.00	1,767,245,000	
兼松	190,800	1,306.00	249,184,800	貸付有価証券 2,700株
三井物産	4,429,700	1,849.00	8,190,515,300	
住友商事	3,227,900	1,280.00	4,131,712,000	
三菱商事	3,354,500	2,561.00	8,590,874,500	
岩谷産業	115,500	3,950.00	456,225,000	貸付有価証券 49,200株
PALTA C	82,000	5,390.00	441,980,000	
日鉄物産	36,500	3,110.00	113,515,000	
ミスミグループ本社	641,300	2,994.00	1,920,052,200	貸付有価証券 600株
ローソン	129,400	5,070.00	656,058,000	貸付有価証券 86,600株
エービーシー・マート	79,900	5,490.00	438,651,000	貸付有価証券 53,100株
日本マクドナルドホールディングス	214,400	5,140.00	1,102,016,000	貸付有価証券 139,200株（79,100株）
セリア	122,300	4,160.00	508,768,000	貸付有価証券 900株
ビックカメラ	303,400	1,208.00	366,507,200	貸付有価証券 137,100株
MonotaRO	363,800	5,240.00	1,906,312,000	貸付有価証券 113,300株
J・フロント リテイリング	610,900	824.00	503,381,600	貸付有価証券 120,900株
マツモトキヨシホールディングス	211,500	4,060.00	858,690,000	貸付有価証券 4,400株

Z O Z O	351,800	2,973.00	1,045,901,400	貸付有価証券 26,500株
ウエルシアホールディングス	304,300	4,410.00	1,341,963,000	貸付有価証券 38,400株(18,800株)
クリエイイトSDホールディングス	86,200	3,535.00	304,717,000	貸付有価証券 500株(500株)
すかいらーくホールディングス	573,300	1,538.00	881,735,400	貸付有価証券 384,100株
コスモス薬品	45,200	17,480.00	790,096,000	貸付有価証券 200株
セブン&アイ・ホールディングス	2,001,400	3,431.00	6,866,803,400	貸付有価証券 982,400株
ツルハホールディングス	111,400	15,040.00	1,675,456,000	貸付有価証券 1,800株
クスリのアオキホールディングス	45,800	8,380.00	383,804,000	貸付有価証券 16,300株
ノジマ	91,000	2,850.00	259,350,000	
良品計画	679,200	1,800.00	1,222,560,000	貸付有価証券 69,500株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,124,700	2,405.00	2,704,903,500	貸付有価証券 428,500株
ゼンショーホールディングス	245,100	2,547.00	624,269,700	貸付有価証券 18,500株
ワークマン	52,800	8,690.00	458,832,000	貸付有価証券 35,300株
ユナイテッドアローズ	53,600	1,547.00	82,919,200	貸付有価証券 4,200株
スギホールディングス	102,100	7,400.00	755,540,000	貸付有価証券 3,600株
ファミリーマート	408,700	2,325.00	950,227,500	貸付有価証券 44,000株(5,200株)
しまむら	59,500	10,590.00	630,105,000	貸付有価証券 1,400株
丸井グループ	468,900	2,097.00	983,283,300	貸付有価証券 8,300株
イオン	1,968,700	2,939.50	5,786,993,650	貸付有価証券 332,100株
イズミ	104,000	3,730.00	387,920,000	貸付有価証券 3,000株
ヤオコー	58,100	7,540.00	438,074,000	貸付有価証券 36,400株
ケーズホールディングス	493,700	1,395.00	688,711,500	

アインホールディングス	62,800	7,540.00	473,512,000	貸付有価証券 8,200株
ニトリホールディングス	221,500	21,630.00	4,791,045,000	貸付有価証券 14,100株
ファーストリテイリング	68,400	66,490.00	4,547,916,000	貸付有価証券 8,600株
サンドラッグ	192,400	3,940.00	758,056,000	貸付有価証券 300株
めぶきフィナンシャルグループ	2,662,100	237.00	630,917,700	貸付有価証券 96,900株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,926,200	382.00	1,117,808,400	貸付有価証券 89,100株
新生銀行	376,000	1,332.00	500,832,000	貸付有価証券 8,400株
あおぞら銀行	305,200	1,789.00	546,002,800	貸付有価証券 67,300株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	25,844,300	433.90	11,213,841,770	
りそなホールディングス	5,570,000	368.20	2,050,874,000	貸付有価証券 454,000株
三井住友トラスト・ホールディングス	968,400	2,892.00	2,800,612,800	貸付有価証券 6,600株
三井住友フィナンシャルグループ	3,433,100	3,020.00	10,367,962,000	貸付有価証券 800株
千葉銀行	1,709,800	594.00	1,015,621,200	貸付有価証券 35,600株
セブン銀行	1,711,700	259.00	443,330,300	貸付有価証券 57,200株
みずほフィナンシャルグループ	6,961,680	1,342.50	9,346,055,400	貸付有価証券 871,600株
F P G	158,000	565.00	89,270,000	貸付有価証券 101,400株（4,500株）
S B Iホールディングス	579,000	2,660.00	1,540,140,000	
大和証券グループ本社	4,111,000	450.00	1,849,950,000	貸付有価証券 5,900株
野村ホールディングス	9,014,700	494.10	4,454,163,270	貸付有価証券 10,400株
松井証券	292,700	932.00	272,796,400	貸付有価証券 25,700株
S O M P Oホールディングス	963,300	3,812.00	3,672,099,600	
M S & A Dインシュアラ	1,339,600	2,894.00	3,876,802,400	貸付有価証券

ンスグループホール				300株
第一生命ホールディングス	2,899,100	1,586.00	4,597,972,600	貸付有価証券 1,400株
東京海上ホールディングス	1,811,400	4,774.00	8,647,623,600	
T & Dホールディングス	1,531,300	1,098.00	1,681,367,400	貸付有価証券 82,900株
全国保証	144,400	4,275.00	617,310,000	貸付有価証券 60,700株（13,100株）
芙蓉総合リース	53,700	6,510.00	349,587,000	貸付有価証券 100株
東京センチュリー	103,200	5,940.00	613,008,000	貸付有価証券 9,500株
イオンフィナンシャルサービス	313,500	1,059.00	331,996,500	貸付有価証券 156,000株
オリエントコーポレーション	1,385,900	118.00	163,536,200	貸付有価証券 5,900株
オリックス	3,178,600	1,380.50	4,388,057,300	
三菱UFJリース	1,300,300	494.00	642,348,200	貸付有価証券 4,100株
日本取引所グループ	1,470,500	2,800.00	4,117,400,000	貸付有価証券 14,400株
いちご	652,000	333.00	217,116,000	貸付有価証券 5,200株
ヒューリック	1,062,400	1,033.00	1,097,459,200	貸付有価証券 270,000株
野村不動産ホールディングス	311,200	2,038.00	634,225,600	貸付有価証券 1,600株
プレサンスコーポレーション	84,300	1,452.00	122,403,600	貸付有価証券 3,000株（2,600株）
オープンハウス	161,400	3,790.00	611,706,000	貸付有価証券 400株
東急不動産ホールディングス	1,393,100	490.00	682,619,000	
飯田グループホールディングス	427,400	2,095.00	895,403,000	貸付有価証券 4,200株
パーク24	275,000	1,785.00	490,875,000	貸付有価証券 28,500株
三井不動産	2,490,500	1,909.00	4,754,364,500	
三菱地所	3,589,700	1,632.00	5,858,390,400	
東京建物	506,000	1,286.00	650,716,000	貸付有価証券 300株

住友不動産	1,151,700	3,062.00	3,526,505,400	貸付有価証券 27,600株
スターツコーポレーション	69,700	2,436.00	169,789,200	
イオンモール	256,900	1,617.00	415,407,300	貸付有価証券 1,500株
日本空港ビルデング	163,500	4,710.00	770,085,000	貸付有価証券 94,500株
ミクシィ	126,200	3,080.00	388,696,000	貸付有価証券 7,700株
ジェイエイシーリクルートメント	33,300	1,339.00	44,588,700	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
日本M&Aセンター	379,800	6,210.00	2,358,558,000	
UTグループ	78,100	3,670.00	286,627,000	貸付有価証券 48,900株（19,600株）
エス・エム・エス	154,500	3,135.00	484,357,500	貸付有価証券 1,400株
パーソルホールディングス	496,300	1,693.00	840,235,900	貸付有価証券 10,600株
総合警備保障	197,500	5,030.00	993,425,000	貸付有価証券 1,500株
カカクコム	366,700	2,979.00	1,092,399,300	貸付有価証券 59,500株
ディップ	67,900	2,351.00	159,632,900	貸付有価証券 16,500株（500株）
ベネフィット・ワン	180,600	2,677.00	483,466,200	貸付有価証券 10,900株
エムスリー	1,094,600	6,480.00	7,093,008,000	貸付有価証券 9,900株
アウトソーシング	284,300	1,091.00	310,171,300	貸付有価証券 55,000株
ディー・エヌ・エー	210,000	1,924.00	404,040,000	貸付有価証券 3,300株
博報堂DYホールディングス	690,300	1,438.00	992,651,400	
電通グループ	558,200	3,055.00	1,705,301,000	貸付有価証券 62,000株
オリエンタルランド	527,900	15,065.00	7,952,813,500	貸付有価証券 6,900株
リゾートトラスト	227,500	1,695.00	385,612,500	貸付有価証券 3,300株
ユー・エス・エス	555,700	1,936.00	1,075,835,200	貸付有価証券

				1,600株
	サイバーエージェント	305,800	6,290.00	1,923,482,000
				貸付有価証券 3,900株
	楽天	2,313,600	1,193.00	2,760,124,800
				貸付有価証券 1,549,800株
	エン・ジャパン	88,200	2,750.00	242,550,000
				貸付有価証券 100株
	テクノプロ・ホールディングス	99,100	6,820.00	675,862,000
				貸付有価証券 2,400株
	リクルートホールディングス	3,555,700	4,272.00	15,189,950,400
				貸付有価証券 11,700株
	リログループ	271,300	2,562.00	695,070,600
				貸付有価証券 2,100株
	カナモト	87,500	2,401.00	210,087,500
				貸付有価証券 26,100株
	セコム	526,700	9,387.00	4,944,132,900
				貸付有価証券 2,000株
	メイテック	60,800	5,320.00	323,456,000
				貸付有価証券 200株
	小計 銘柄数：396			930,087,181,580
	組入時価比率：98.0%			100.0%
	合計			930,087,181,580

(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証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(2020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

2020年10月30日現在

資産総額	999,719,429,818円
負債総額	81,371,802,674円
純資産総額（ - ）	918,347,627,144円
発行済口数	64,445,981口
1口当たり純資産額（ / ）	14,250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

2020年10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

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

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。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

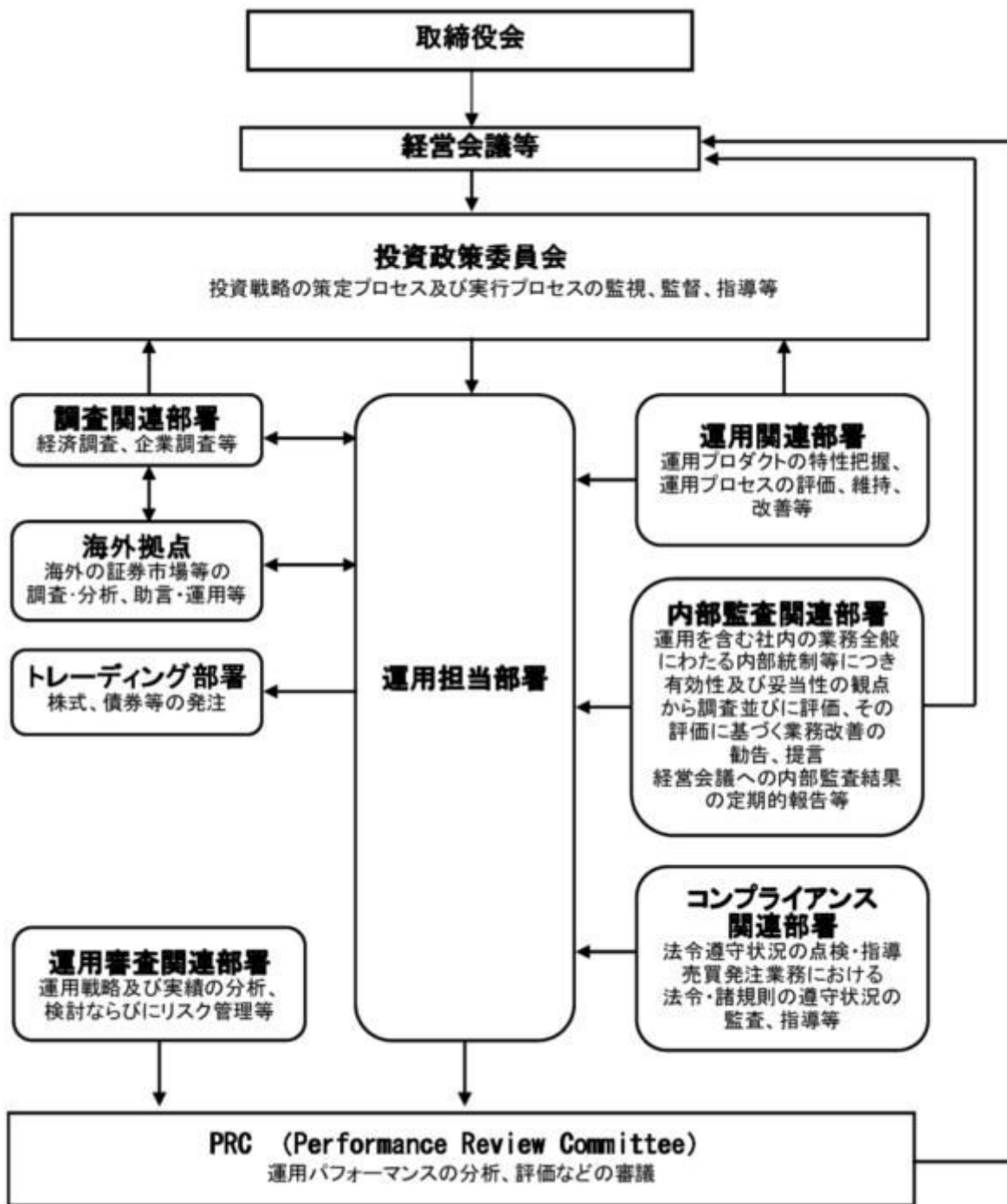
代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締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、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議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員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および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や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

< 更新後 >

「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2020年9月30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	991	31,472,667
単位型株式投資信託	189	830,380
追加型公社債投資信託	14	5,687,903
単位型公社債投資信託	472	1,630,568
合計	1,666	39,621,517

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(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020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		1,562	2,626
金銭の信託		45,493	41,524
有価証券		19,900	24,399
前払費用		27	106
未収入金		500	522
未収委託者報酬		25,246	23,936
未収運用受託報酬		5,933	4,336
その他		269	71
貸倒引当金		15	14
流動資産計		98,917	97,509
固定資産			
有形固定資産			
建物	2	320	295
器具備品	2	393	349

無形固定資産		6,438		5,894
ソフトウェア	6,437		5,893	
その他	0		0	
投資その他の資産		18,608		16,486
投資有価証券	1,562		1,437	
関係会社株式	12,631		10,171	
従業員長期貸付金	-		16	
長期差入保証金	235		329	
長期前払費用	22		19	
前払年金費用	2,001		1,545	
繰延税金資産	2,694		2,738	
その他	168		229	
貸倒引当金	-		0	
投資損失引当金	707		-	
固定資産計		25,761		23,026
資産合計		124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020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			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
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			56,014		54,360
利益剰余金			685		685
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	

繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
經常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(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	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653

当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
-------	--------	--------	-------	--------	-----	--------	--------	--------	--------

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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								
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	(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。 <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> (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。	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	(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。 (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>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 従業員からの退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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 確定給付型企業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業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まいります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「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 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
---	---

[未適用の会計基準等]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31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 2020年3月31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せん。

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。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(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。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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 1,434百万円	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 1,296百万円

2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額		2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	
建物	736百万円	建物	761百万円
器具備品	3,106	器具備品	2,347
合計	3,842	合計	3,109

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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 6,531百万円 支払利息 1	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 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。	

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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

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

(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

2019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	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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

2019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 25,650百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 4,980円
基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28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

2020年5月19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 23,950百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 4,650円
基準日 2020年3月31日
効力発生日 2020年6月30日

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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

2019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	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

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1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）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。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

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	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

2020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	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

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

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパー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1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）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。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

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	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019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(2019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(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019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	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020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(2020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(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020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	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019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	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

(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	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

(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	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

(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	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
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、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761
(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	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413
(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	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(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	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
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	0.6%
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、202百万円でした。	

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020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	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

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	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.4%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.6%	外国税額控除	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	1.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019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	1	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)	34,646	未払手数料	6,410

(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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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

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(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(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) 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) コマーシャル・ペーパーの購入については、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. 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88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	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
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

< 更新後 >

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本の額 [*]	(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。

* 2020年9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	
SMB 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	

ＪＰ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
東海東京証券株式会社	6,000百万円
ＢＮＰ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ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円
ＢｏｆＡ証券株式会社	83,140百万円
モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社	62,149百万円
ＵＢＳ証券株式会社	32,100百万円

* 2020年9月末現在

独立監査人の監査報告書

2020年11月13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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 小林 弘 幸
業務執行社員

監査意見

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2020年4月8日から2020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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。
監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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

2020年6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

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
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

監査意見

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。