

【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】	2021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兼代表取締役社長 小池 広靖
【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、2021年6月29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。

第一部【証券情報】

(1) ファンドの名称

< 訂正前 >

NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

(以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「JPX日経400ETF」とします。)

< 訂正後 >

NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

(以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「NF・JPX_400 ETF」とします。)

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

（1）ファンドの目的及び基本的性格

<更新後>

JPX日経インデックス400（「対象株価指数」といいます。）に連動する投資成果（基準価額の変動率が対象株価指数の変動率に一致することをいいます。）を目指します。

JPX日経インデックス400は、東京証券取引所（市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ）^{（注）}に上場する全ての普通株式のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社日本取引所グループ、株式会社東京証券取引所および株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。2013年8月30日を起算日とし、その日の指数値を10,000ポイントとして計算されています。

（注）2022年4月4日以降、「東京証券取引所（市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQ）」が「東京証券取引所（プライム市場、スタンダード市場、グロース市場）」に変更になります。

ファンドの受益権は、金融商品取引所において時価により株式と同様に売買することができます。

信託金の限度額

ファンドの信託の限度額は、5兆円相当です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託の限度額を変更することができます。

ファンドは契約型の追加型株式投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品設計となっております。

受益権を上場します。

株式の組入比率を高位に維持するために、現金による解約は行なえないこととしていることからこれに代わる換金手段として、金融商品取引所により流通市場を提供するものです。

金融商品取引所での売買

いつでも下記の金融商品取引所で売買することができます。

東京証券取引所

売買単位は1口以上1口単位です。

手数料は申込みの取り扱いの第一種金融商品取引業者等が独自に定める金額とします。

取引方法は原則として株式と同様です。詳しくは取り扱いの第一種金融商品取引業者等へお問い合わせください。

ファンドの設定は株式によって行ないます。

ファンドの設定は原則として株式^{（ ）}によって行ないます。

受益権の取得（追加設定）については、原則として、委託者が事前に提示する現物株式のポートフォリオ（以下「指定株式ポートフォリオ」といいます。）による設定に限定します。

投資家は指定株式ポートフォリオをもって受益権を取得します。なお、指定株式ポートフォリオの

時価評価額が、取得する受益権の評価額に満たない場合は、その差額に相当する金銭にて設定するものとします。

また、投資家が指定株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社またはその子会社を以下「発行会社等」といいます。）である場合には、原則として、指定株式ポートフォリオの時価総額のうち当該発行会社の株式の時価総額に相当する金額および、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.15%の額)を当該株式に代えて金銭にて設定するものとします。

()ファンドの設定は、以下に示す要件をすべて満たす、委託者の指定する有価証券等(これを「信託適格有価証券等」といいます。)によって行なわれます。

- 1.原則として対象株価指数に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式であること
- 2.原則として有価証券の株数の比率が、運用の基本方針に沿ったものであること
- 3.投資信託及び投資法人に関する法律施行令ならびに同法律施行規則に定めるものであること

追加設定は一定口数以上の申込みでないと行なうことはできません。

対象株価指数に連動する投資成果という目的の支障とならないようにするために、追加設定をポートフォリオを組成するために必要な金額以上の場合に限定するものです。

受益権と株式を交換することができます。

一定口数以上の受益権を有する投資家は、それに相当する信託財産中の有価証券ポートフォリオと交換することができます。

基準価額と金融商品取引所での時価との間に乖離が生じたときに、合理的な裁定が入り、そうした乖離が収斂することにより、金融商品取引所での円滑な価格形成が行なわれることを期待するものです。

なお、投資家が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、交換必要口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとします。

収益分配金の支払いは、名義登録によって受益者を確定する方法で行なわれます。

< 商品分類 >

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に網掛け表示しております。

(NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信)

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
---------	--------	-------------------	------	------

単 位 型	国 内	株 式	MMF	インデックス型
	海 外	債 券	MRF	
	追 加 型	内 外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	ETF

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式	年1回	グローバル	
一般 大型株 中小型株	年2回	日本	日経225
債券	年4回	北米	
一般	年6回	欧州	
公債	(隔月)	アジア	T O P I X
社債	年12回	オセアニア	
その他債券 クレジット属性 ()	(毎月)	中南米	
不動産投信	日々	アフリカ	その他 (JPX日経インデックス 400)
その他資産 ()	その他 ()	中近東 (中東)	
資産複合 ()		エマージング	
資産配分固定型 資産配分変更型			

(3) ファンドの仕組み

< 更新後 >

委託会社の概況(2021年11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 >



投資リスク

■ リスクの定量的比較（2016年11月末～2021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 (%)	42.7	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 15.9	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 7.9	△ 9.4
平均値 (%)	9.8	10.1	15.6	13.7	0.2	3.0	4.1

* 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。2016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、2016年11月から2021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。

※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。

* 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。
* 2016年11月から2021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。



投資リスク

<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-KOKUSAJ 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・ディバーシファイド（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（旧東京証券取引所）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、旧東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、旧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、旧東京証券取引所は、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-KOKUSAJ 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-KOKUSAJ 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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 LLC 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 LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
 - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを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、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「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）についての推奨、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPST, 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 LLC 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、2021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0.22% (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、信託財産中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(2021年12月27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（2021年12月27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（2021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2021年10月29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	1,183,264,439,040	97.46
現金・預金・その他資産(負債控除後)		30,749,855,289	2.53
合計(純資産総額)		1,214,014,294,329	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		30,626,290,000	2.52
----------	----	----	--	----------------	------

(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	リクルートホールディングス	サービス業	3,398,800	6,742.76	22,917,314,868	7,572.00	25,735,713,600	2.11
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,596,200	11,697.51	18,671,574,319	13,140.00	20,974,068,000	1.72
3	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	378,100	46,412.39	17,548,525,430	52,850.00	19,982,585,000	1.64
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	284,200	62,230.00	17,685,766,000	68,510.00	19,470,542,000	1.60
5	日本	株式	H O Y A	精密機器	1,162,700	16,326.10	18,982,366,040	16,725.00	19,446,157,500	1.60
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,964,100	3,109.20	18,543,621,147	3,188.00	19,013,550,800	1.56
7	日本	株式	ダイキン工業	機械	759,100	23,577.00	17,897,307,892	24,890.00	18,893,999,000	1.55
8	日本	株式	日本電産	電気機器	1,444,000	11,594.25	16,742,099,731	12,570.00	18,151,080,000	1.49
9	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	8,889,200	1,869.27	16,616,359,680	2,006.50	17,836,179,800	1.46
10	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,715,000	6,273.95	17,033,778,821	6,554.00	17,794,110,000	1.46
11	日本	株式	信越化学工業	化学	862,800	18,375.00	15,853,950,000	20,255.00	17,476,014,000	1.43
12	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	26,969,400	650.79	17,551,415,826	622.50	16,788,451,500	1.38
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	4,397,700	3,496.76	15,377,738,822	3,612.00	15,884,492,400	1.30
14	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,691,500	3,332.08	15,632,459,957	3,349.00	15,711,833,500	1.29
15	日本	株式	村田製作所	電気機器	1,750,300	8,505.17	14,886,604,445	8,653.00	15,145,345,900	1.24
16	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	4,068,000	3,903.66	15,880,117,286	3,721.00	15,137,028,000	1.24
17	日本	株式	K D D I	情報・通信業	4,262,600	3,616.00	15,413,561,600	3,528.00	15,038,452,800	1.23
18	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	4,385,300	3,221.00	14,125,051,300	3,203.00	14,046,115,900	1.15
19	日本	株式	第一三共	医薬品	4,682,500	2,889.86	13,531,797,806	2,867.00	13,424,727,500	1.10
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	4,104,800	3,182.06	13,061,738,559	3,242.00	13,307,761,600	1.09
21	日本	株式	任天堂	その他製品	263,500	50,150.00	13,214,525,000	50,200.00	13,227,700,000	1.08
22	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	672,800	17,421.42	11,721,135,557	17,940.00	12,070,032,000	0.99
23	日本	株式	S M C	機械	174,500	62,622.61	10,927,646,634	67,940.00	11,855,530,000	0.97
24	日本	株式	三井物産	卸売業	4,557,400	2,457.24	11,198,648,880	2,592.00	11,812,780,800	0.97
25	日本	株式	ファナック	電気機器	522,900	22,424.72	11,725,886,425	22,310.00	11,665,899,000	0.96
26	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,935,500	6,024.96	11,661,318,700	5,998.00	11,609,129,000	0.95
27	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,516,000	1,565.50	11,766,298,000	1,505.00	11,311,580,000	0.93
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,295,800	4,801.19	11,022,588,684	4,782.00	10,978,515,600	0.90
29	日本	株式	デンソー	輸送用機器	1,311,900	7,197.84	9,442,858,374	8,223.00	10,787,753,700	0.88
30	日本	株式	富士通	電気機器	536,100	19,181.70	10,283,312,078	19,625.00	10,520,962,500	0.86

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.04
		鉱業	0.25
		建設業	2.45
		食料品	3.71
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.19
		化学	7.68
		医薬品	6.22
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.77
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.32
		機械	5.90
		電気機器	18.18
		輸送用機器	6.30
		精密機器	3.43
		その他製品	1.79
		電気・ガス業	1.10
		陸運業	1.67
		海運業	0.50
		倉庫・運輸関連業	0.02
		情報・通信業	7.39
		卸売業	5.60
		小売業	3.92
		銀行業	4.68
		証券、商品先物取引業	0.87
保険業	2.53		
その他金融業	1.37		
不動産業	2.29		
サービス業	5.72		
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 (2021年12月限)	買建	17,062	日本円	29,977,934,000	30,626,290,000	2.52
----------	-------	---------------------------------	----	--------	-----	----------------	----------------	------

(3) 運用実績

純資産の推移

2021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
第15計算期間	(2021年 4月 7日)	1,186,530	1,197,411	17,773.0000	17,936.0000	17,790
第16計算期間	(2021年10月 7日)	1,176,816	1,188,351	17,548.0000	17,720.0000	17,570
	2020年10月末日	918,347		14,250.0000		14,280
	11月末日	1,036,024		16,000.0000		16,000
	12月末日	1,062,575		16,408.0000		16,390
	2021年 1月末日	1,075,087		16,474.0000		16,480
	2月末日	1,112,432		16,943.0000		16,900
	3月末日	1,190,919		17,839.0000		17,850
	4月末日	1,143,601		17,155.0000		17,140
	5月末日	1,164,746		17,447.0000		17,430
	6月末日	1,175,926		17,588.0000		17,590
	7月末日	1,143,932		17,134.0000		17,150
	8月末日	1,184,167		17,737.0000		17,710
	9月末日	1,242,315		18,525.0000		18,530
	10月末日	1,214,014		18,076.0000		18,060

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
第15計算期間	2020年10月 8日～2021年 4月 7日	163.0000円
第16計算期間	2021年 4月 8日～2021年10月 7日	172.0000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%
第15計算期間	2020年10月 8日～2021年 4月 7日	20.7%
第16計算期間	2021年 4月 8日～2021年10月 7日	0.3%

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
第15計算期間	2020年10月 8日～2021年 4月 7日	3,893,850	978,228	66,758,932
第16計算期間	2021年 4月 8日～2021年10月 7日	499,092	194,710	67,063,314

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。

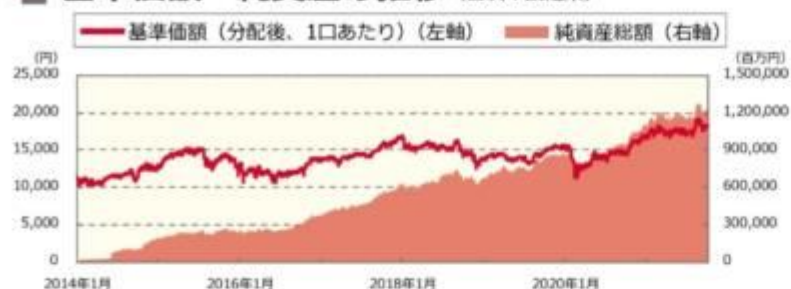
参考情報

< 更新後 >



運用実績（2021年10月29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）

2021年10月	172 円
2021年4月	163 円
2020年10月	125 円
2020年4月	168 円
2019年10月	150 円
設定来累計	2,126 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	リクルートホールディングス	サービス業	2.1
2	ソニーグループ	電気機器	1.7
3	東京エレクトロン	電気機器	1.6
4	キーエンス	電気機器	1.6
5	HOYA	精密機器	1.6
6	日本電信電話	情報・通信業	1.6
7	ダイキン工業	機械	1.6
8	日本電産	電気機器	1.5
9	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5
10	日立製作所	電気機器	1.5

■ 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、2012年は対象インデックスが存在しないことから、記載を行なっておりません。
- ・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。
- ・2021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2【管理及び運営】

2 換金（解約）手続等

<訂正前>

(a)信託の一部解約(解約請求制)

受益者は、自己に帰属する受益権について、信託期間中においてこの信託の一部解約の実行を請求することはできません。

(b)受益権と信託財産に属する株式との交換

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、交換請求受付日の午後3時までに、一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換（「交換」といいます。）を請求することができます。ただし、交換の請求を行なう受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合の時限は、午後2時とします。

上記にかかわらず、委託者は、次の各号の期日または期間における交換請求については、原則として、当該交換請求の受付けを停止します。ただし、委託者は、次に該当する期日および期間における交換請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間（第5号に掲げるものを除きます。）における交換請求については、当該交換請求の受付けを行なうことができます。

1. 毎月最終営業日およびその前営業日
2. 対象株価指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
3. 対象株価指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々5営業日前から起算して7営業日以内
4. ファンドの決算日の前月最終営業日の2営業日前からファンドの決算日の前営業日まで
5. 前各号のほか、委託者が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

なお、交換請求の受付けを停止した場合には、受益者は当該受付け停止以前に行なった当日の交換の請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該交換は、当該受付け停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受付けたものとします。

- ・交換の単位は、信託財産に属する銘柄の株式の構成比率に相当する比率により構成され、委託者が対象株価指数に連動すると想定する、1単位の現物株式のポートフォリオを構成する銘柄の株式につき取引所売買単位の整数倍の株数と交換するために必要な口数を基礎として委託者が別に定めるもの（以下「最小交換口数」といいます。）とし、10万口とします。

なお、対象株価指数の値上がりなどにより、基準とする口数は変更されることがあります。

- ・受益者が、交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。

- ・販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消に係る手続きを行なうものとします。なお、清算機関の業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを清算機関が負担する場合には、清算機関が振替受益権の抹消に係る手続きを行ないます。振替機関は、当該抹消に係る手続きおよび交換株式に係る振替請求が行なわれた後に、当該交換に係る受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る当該口数の減少の記載または記録が行な

われます。

委託者は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものととして取扱うこととし、受託者は、委託者の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび交換株式の振替日における抹消の確認をもって、当該振替受益権を受け入れ抹消したものととして取り扱います。

- ・ 交換の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。
- ・ 販売会社は、受益者が交換を行なうとき、当該受益者から販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。
- ・ 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で交換請求の受付けを停止すること、およびすでに受付けた交換請求の受付けを取り消す場合があります。
また、交換請求の受付けを停止した場合には、受益者は当該受付け停止以前に行なった当日の交換の請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該交換は、当該受付け停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受付けたものとして信託約款の規定に準じて計算されたものとします。
- ・ 交換の請求を行なう受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合、当該交換の請求を当該受益者から受付けた販売会社（販売会社が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等に該当する場合に、当該販売会社が自己勘定で交換を請求するときを含むものとします。）は、交換の請求を取次ぐ際に委託者にその旨を通知するものとします。
また、当該通知が交換の請求の取次ぎの際に行なわれなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取次いだ販売会社はその責を負うものとします。

(交換で交付する銘柄・株数の計算)

受益者が交換によって取得できる個別銘柄の株数は、交換請求受付日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍(以下「単位株数」といいます。)とします。

なお、具体的な計算方法は、原則として以下の通りです。

交換請求受付日における、信託財産中の株式時価総額のうち、交換口数分の概算株式時価総額を計算します。

上記 で求めた時価総額に、ファンドが保有している銘柄の時価構成比率を乗じ、銘柄毎の時価で除した各銘柄の株数を計算します。

上記 で求めた各銘柄の株数を、単位株数の整数倍に、単位株数未滿を四捨五入することにより調整します。(これを「仮交換ポートフォリオ」とします。)

上記 で求めた仮交換ポートフォリオに各銘柄の時価を乗じ、仮交換ポートフォリオの時価総額を計算します。

上記 で求めた仮交換ポートフォリオの時価総額が上記 で求めた交換口数分の概算株式時価総額を下回っている場合は、当該仮交換ポートフォリオを交換ポートフォリオとします。

逆に、上回っている場合は仮交換ポートフォリオについて、以下の調整を行ないます。

()上記 における四捨五入の結果、繰り上げた金額(「繰り上げた株数×当該銘柄の株価」

をいい、以下「繰上金額」といいます。)が一番大きい銘柄を1単位株数分減じ、これを新たな仮交換ポートフォリオとします。

()新たな仮交換ポートフォリオの時価総額が上記 で求めた交換口数分の概算株式時価総額を下回っている場合は、当該仮交換ポートフォリオを交換ポートフォリオとします。

逆に、上回っている場合は、 における繰上金額が次に大きい銘柄を1単位株数分減じ、これを新たな仮交換ポートフォリオとします。

()上記()を繰り返します。

原則として、上記 で求めた交換ポートフォリオを構成する銘柄・株数が交換で交付する銘柄・株数となります。

なお、交換を請求した受益者が複数いる場合等において、四捨五入による丸め誤差の影響等により、各受益者毎の交換株数の合計がファンドで保有する株数を超えてしまう銘柄が生じた場合等には、交換ポートフォリオから当該銘柄を1単位株数分減じる等の調整を行なう場合があります。

交換により交付する銘柄は、必ずしも対象株価指数を構成する全ての銘柄になる訳ではありません。また、交換により交付する個別銘柄の構成比は、必ずしも対象株価指数を構成する個別銘柄の構成比と等しくなる訳ではありません。

(交換する受益権口数の確定)

委託者は、受益者が最小交換口数の整数倍の振替受益権をもって交換の請求を行ない、その請求を受付けた場合には、受益者から提示された口数の受益権から受益者が取得できる個別銘柄の株式の株数を計算し、交換に要する受益権の口数(1口未満の端数があるときは、1口に切上げます。以下「交換必要口数」といいます。)を確定します。

委託者は、受託者に対し、交換必要口数の受益権と信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。ただし、交換の請求を行なった受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、交換必要口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、交換請求受付日の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値(終値のないものについてはそれに準ずる価額とし、店頭売買有価証券市場で取引される銘柄の株式については最終価格又はこれに準ずるものとして合理的に算出した価格とします。)に上記「交換で交付する銘柄・株数の計算」に基づき計算された株数を乗じて得た金額とします。

(交換による株式の交付等)

受託者は、交換のための振替受益権の抹消の申請の手続きが行なわれたことを確認したときには、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式に係る振替請求を行なうものとします。ただし、清算機関の業務方法書に定めるところにより、交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを清算機関が負担する場合には、受託者は、振替受益権の抹消に係る手続きにかかわらず、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式に係る振替請求を行なうものとします。受益者への交換株式の交付に際しては、原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る株数の増加の記載または記録が行なわれます。

(c) 受益権の買取り(買取請求制)

販売会社は、次の各号に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、第2号の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

2 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行なうときは、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者と協議に基づいて受益権の買取りを停止すること、およびすでに受付けた受益権の買取りを取り消す場合があります。

また、受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行なった当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして計算されたものとします。

上記(a)、(b)及び(c)の詳細については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

<訂正後>

(a) 信託の一部解約(解約請求制)

受益者は、自己に帰属する受益権について、信託期間中においてこの信託の一部解約の実行を請求することはできません。

(b) 受益権と信託財産に属する株式との交換

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、交換請求受付日の午後3時までに、一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換(「交換」といいます。)を請求することができます。ただし、交換の請求を行なう受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合の時限は、午後2時とします。

上記にかかわらず、委託者は、次の各号の期日または期間における交換請求については、原則として、当該交換請求の受け付けを停止します。ただし、委託者は、次に該当する期日および期間における交換請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間(第5号に掲げるものを除きます。)における交換請求については、当該交換請求の受け付けを行なうことができます。

1. 毎月最終営業日およびその前営業日

2. 対象株価指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日

3. 対象株価指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々5営業日前から起算して7営業日以内

4. ファンドの決算日の前月最終営業日の2営業日前からファンドの決算日の前営業日まで

5. 前各名のほか、委託者が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

なお、交換請求の受け付けを停止した場合には、受益者は当該受け付け停止以前に行なった当日の交換の請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該交換は、当該受け付け停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受け付けたものとして扱います。

- ・ 交換の単位は、信託財産に属する銘柄の株式の構成比率に相当する比率により構成され、委託者が対象株価指数に連動すると想定する、1単位の現物株式のポートフォリオを構成する銘柄の株式につき取引所売買単位の整数倍の株数と交換するために必要な口数を基礎として委託者が別に定めるもの（以下「最小交換口数」といいます。）とし、10万口以上10万口単位とします。

なお、対象株価指数の値上がりなどにより、基準とする口数は変更されることがあります。

- ・ 受益者が、交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。

- ・ 販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消に係る手続きを行なうものとします。なお、清算機関の業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを清算機関が負担する場合には、清算機関が振替受益権の抹消に係る手続きを行ないません。振替機関は、当該抹消に係る手続きおよび交換株式に係る振替請求が行なわれた後に、当該交換に係る受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

委託者は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものととして取扱うこととし、受託者は、委託者の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび交換株式の振替日における抹消の確認をもって、当該振替受益権を受け入れ抹消したものととして取り扱います。

- ・ 交換の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。
- ・ 販売会社は、受益者が交換を行なうとき、当該受益者から販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

- ・ 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で交換請求の受け付けを停止すること、およびすでに受け付けた交換請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、交換請求の受け付けを停止した場合には、受益者は当該受け付け停止以前に行なった当日の交換の請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該交換は、当該受け付け停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受け付けたものとして信託約款の規定に準じて計算されたものとします。

- ・ 交換の請求を行なう受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合、当該交換の請求を当該受益者から受け付けた販売会社（販売会社が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社

等に該当する場合に、当該販売会社が自己勘定で交換を請求するときを含むものとします。)は、交換の請求を取次ぐ際に委託者にその旨を通知するものとします。

また、当該通知が交換の請求の取次ぎの際に行なわれなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取次いだ販売会社がその責を負うものとします。

(交換で交付する銘柄・株数の計算)

受益者が交換によって取得できる個別銘柄の株数は、交換請求受付日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍(以下「単位株数」といいます。)とします。

なお、具体的な計算方法は、原則として以下の通りです。

交換請求受付日における、信託財産中の株式時価総額のうち、交換口数分の概算株式時価総額を計算します。

上記で求めた時価総額に、ファンドが保有している銘柄の時価構成比率を乗じ、銘柄毎の時価で除した各銘柄の株数を計算します。

上記で求めた各銘柄の株数を、単位株数の整数倍に、単位株数未滿を四捨五入することにより調整します。(これを「仮交換ポートフォリオ」とします。)

上記で求めた仮交換ポートフォリオに各銘柄の時価を乗じ、仮交換ポートフォリオの時価総額を計算します。

上記で求めた仮交換ポートフォリオの時価総額が上記で求めた交換口数分の概算株式時価総額を下回っている場合は、当該仮交換ポートフォリオを交換ポートフォリオとします。

逆に、上回っている場合は仮交換ポートフォリオについて、以下の調整を行いません。

()上記における四捨五入の結果、繰り上げた金額(「繰り上げた株数×当該銘柄の株価」をいい、以下「繰上金額」といいます。)が一番大きい銘柄を1単位株数分減じ、これを新たな仮交換ポートフォリオとします。

()新たな仮交換ポートフォリオの時価総額が上記で求めた交換口数分の概算株式時価総額を下回っている場合は、当該仮交換ポートフォリオを交換ポートフォリオとします。

逆に、上回っている場合は、()における繰上金額が次に大きい銘柄を1単位株数分減じ、これを新たな仮交換ポートフォリオとします。

()上記()を繰り返します。

原則として、上記で求めた交換ポートフォリオを構成する銘柄・株数が交換で交付する銘柄・株数となります。

なお、交換を請求した受益者が複数いる場合等において、四捨五入による丸め誤差の影響等により、各受益者毎の交換株数の合計がファンドで保有する株数を超過してしまう銘柄が生じた場合等には、交換ポートフォリオから当該銘柄を1単位株数分減じる等の調整を行なう場合があります。

交換により交付する銘柄は、必ずしも対象株価指数を構成する全ての銘柄になる訳ではありません。また、交換により交付する個別銘柄の構成比は、必ずしも対象株価指数を構成する個別銘柄の構成比と等しくなる訳ではありません。

(交換する受益権口数の確定)

委託者は、受益者が最小交換口数の整数倍の振替受益権をもって交換の請求を行ない、その請求を交付した場合には、受益者から提示された口数の受益権から受益者が取得できる個別銘柄の株式の株数を計算し、交換に要する受益権の口数(1口未滿の端数があるときは、1口に切上げます。以下「交換必

要口数」といいます。)を確定します。

委託者は、受託者に対し、交換必要口数の受益権と信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。ただし、交換の請求を行なった受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、交換必要口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、交換請求受付日の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とし、店頭売買有価証券市場で取引される銘柄の株式については最終価格又はこれに準ずるものとして合理的に算出した価格とします。）に上記「交換で交付する銘柄・株数の計算」に基づき計算された株数を乗じて得た金額とします。

(交換による株式の交付等)

受託者は、交換のための振替受益権の抹消の申請の手続きが行なわれたことを確認したときには、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式に係る振替請求を行なうものとします。ただし、清算機関の業務方法書に定めるところにより、交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを清算機関が負担する場合には、受託者は、振替受益権の抹消に係る手続きにかかわらず、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式に係る振替請求を行なうものとします。受益者への交換株式の交付に際しては、原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る株数の増加の記載または記録が行なわれます。

(c) 受益権の買取り(買取請求制)

販売会社は、次の各号に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、第2号の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

- 1 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
- 2 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行なうときは、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者と協議に基づいて受益権の買取りを停止すること、およびすでに受付けた受益権の買取りを取り消す場合があります。

また、受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行なった当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして計算されたものとします。

上記(a)、(b)及び(c)の詳細については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

第3【ファンドの経理状況】

NEXT FUNDS J P X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16期計算期間(2021年4月8日から2021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15期 (2021年 4月 7日現在)	第16期 (2021年10月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,654,568,830	45,816,384,238
株式	1,165,742,046,540	1,146,727,567,830
派生商品評価勘定	437,447,070	-
未収入金	435,052,000	11,495,745,500
未収配当金	10,138,297,534	10,424,991,647
未収利息	1,771,499	2,619,825
その他未収収益	63,295,328	33,336,199
差入委託証拠金	780,962,890	3,123,362,106
流動資産合計	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345
資産合計		
	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	72,410,490	1,665,669,636
未払収益分配金	10,881,705,916	11,534,890,008
未払受託者報酬	264,865,106	289,924,316
未払委託者報酬	796,743,253	871,446,893
未払利息	14,531	19,569
有価証券貸借取引受入金	15,583,007,848	26,081,742,090
その他未払費用	124,498,935	364,003,625
流動負債合計	27,723,246,079	40,807,696,137
負債合計		
	27,723,246,079	40,807,696,137
純資産の部		
元本等		
元本	776,139,343,432	779,678,088,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	410,390,852,180	397,138,222,644
(分配準備積立金)	5,403,102	27,627,894
元本等合計	1,186,530,195,612	1,176,816,311,208
純資産合計		
	1,186,530,195,612	1,176,816,311,208
負債純資産合計		
	1,214,253,441,691	1,217,624,007,345

(2) 損益及び剰余金計算書

	第15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021年10月 7日
営業収益		
受取配当金	11,975,272,039	12,887,071,302
有価証券売買等損益	185,729,967,332	14,956,046,809
派生商品取引等損益	3,727,021,442	431,895,326
その他収益	206,994,287	120,545,493
営業収益合計	201,639,255,100	2,380,325,340
営業費用		
支払利息	6,785,422	5,113,068
受託者報酬	264,865,106	289,924,316
委託者報酬	796,743,253	871,446,893
その他費用	293,241,638	294,243,854
営業費用合計	1,348,064,575	1,450,501,995
営業利益又は営業損失（ ）	200,291,190,525	3,830,827,335
経常利益又は経常損失（ ）	200,291,190,525	3,830,827,335
当期純利益又は当期純損失（ ）	200,291,190,525	3,830,827,335
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（ ）	206,505,425,560	410,390,852,180
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,797,189,773	3,266,205,567
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,797,189,773	3,266,205,567
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,321,247,762	1,153,117,760
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,321,247,762	1,153,117,760
分配金	10,881,705,916	11,534,890,008
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	410,390,852,180	397,138,222,644

(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、2021年 4月 8日から2021年10月7日までとなっております。
-------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第15期 2021年 4月 7日現在	第16期 2021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 66,758,932口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 67,063,314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 17,773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 17,548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 14,802,079,080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 24,780,907,160円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021年10月 7日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,189,051,748円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>52,907,267円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>12,241,959,015円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,354,849,997円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>10,887,109,018円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>10,881,705,916円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>5,403,102円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,758,932口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>163円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	12,189,051,748円	分配準備積立金	B	52,907,267円	配当等収益合計額	C=A+B	12,241,959,015円	経費	D	1,354,849,997円	収益分配可能額	E=C-D	10,887,109,018円	収益分配金	F	10,881,705,916円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,403,102円	口数	H	66,758,932口	1口当たり分配金	I=F/H	163円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>13,012,729,863円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>5,403,102円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>13,018,132,965円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,455,615,063円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>11,562,517,902円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>11,534,890,008円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>27,627,894円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>67,063,314口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>172円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	13,012,729,863円	分配準備積立金	B	5,403,102円	配当等収益合計額	C=A+B	13,018,132,965円	経費	D	1,455,615,063円	収益分配可能額	E=C-D	11,562,517,902円	収益分配金	F	11,534,890,008円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,627,894円	口数	H	67,063,314口	1口当たり分配金	I=F/H	172円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	12,189,051,748円																																																											
分配準備積立金	B	52,907,267円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	12,241,959,015円																																																											
経費	D	1,354,849,997円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	10,887,109,018円																																																											
収益分配金	F	10,881,705,916円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,403,102円																																																											
口数	H	66,758,932口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	163円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	13,012,729,863円																																																											
分配準備積立金	B	5,403,102円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	13,018,132,965円																																																											
経費	D	1,455,615,063円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	11,562,517,902円																																																											
収益分配金	F	11,534,890,008円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,627,894円																																																											
口数	H	67,063,314口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	172円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち217,860,453円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち236,869,127円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021年10月 7日
1. 金融商品に対する取組方針	1. 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第15期 2021年 4月 7日現在	第16期 2021年10月 7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021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15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021年10月 7日
期首元本額 742,242,322,060円	期首元本額 776,139,343,432円
期中追加設定元本額 45,269,900,100円	期中追加設定元本額 5,802,443,592円
期中一部交換元本額 11,372,878,728円	期中一部交換元本額 2,263,698,460円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第15期 自 2020年10月 8日 至 2021年 4月 7日	第16期 自 2021年 4月 8日 至 2021年10月 7日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
株式	179,929,759,692	12,136,664,154
合計	179,929,759,692	12,136,664,154

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第15期(2021年 4月 7日現在)				第16期(2021年10月 7日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	20,310,175,890	-	20,677,140,000	365,036,580	31,675,925,106	-	30,013,074,000	1,665,669,636
合計	20,310,175,890	-	20,677,140,000	365,036,580	31,675,925,106	-	30,013,074,000	1,665,669,636

（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(2021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	749,100	627.00	469,685,700	
		I N P E X	3,236,300	895.00	2,896,488,500	貸付有価証券 349,300株
		ミライト・ホールディングス	279,700	2,127.00	594,921,900	貸付有価証券 1,500株
		安藤・間	517,300	795.00	411,253,500	貸付有価証券 135,000株
		東急建設	236,300	796.00	188,094,800	貸付有価証券 4,500株
		コムシスホールディングス	286,000	2,856.00	816,816,000	貸付有価証券 400株
		東建コーポレーション	24,800	9,430.00	233,864,000	
		大成建設	579,800	3,620.00	2,098,876,000	貸付有価証券 300株
		大林組	1,862,900	951.00	1,771,617,900	
		清水建設	1,745,100	856.00	1,493,805,600	
		長谷工コーポレーション	610,200	1,461.00	891,502,200	貸付有価証券 2,000株
		鹿島建設	1,365,000	1,446.00	1,973,790,000	貸付有価証券 43,900株
		西松建設	133,300	3,485.00	464,550,500	貸付有価証券 82,200株(23,200株)
		三井住友建設	450,000	511.00	229,950,000	貸付有価証券 600株
		戸田建設	773,600	757.00	585,615,200	
熊谷組	86,300	2,856.00	246,472,800			

大東建託	203,400	12,840.00	2,611,656,000	貸付有価証券 4,100株
N I P P O	154,100	4,040.00	622,564,000	
五洋建設	791,200	774.00	612,388,800	貸付有価証券 3,500株
住友林業	476,600	2,029.00	967,021,400	貸付有価証券 158,100株
大和ハウス工業	1,720,200	3,621.00	6,228,844,200	貸付有価証券 9,400株
積水ハウス	2,020,400	2,303.50	4,653,991,400	貸付有価証券 4,100株
関電工	302,900	920.00	278,668,000	貸付有価証券 600株
エクシオグループ	282,500	2,660.00	751,450,000	
九電工	130,700	3,615.00	472,480,500	
インフロニア・ホールディングス	717,800	926.00	664,682,800	
森永製菓	139,900	4,085.00	571,491,500	貸付有価証券 1,400株
カルビー	271,700	2,715.00	737,665,500	
森永乳業	110,300	6,560.00	723,568,000	
ヤクルト本社	410,100	5,700.00	2,337,570,000	
明治ホールディングス	394,200	7,210.00	2,842,182,000	
プリマハム	83,900	2,766.00	232,067,400	貸付有価証券 1,200株
日本ハム	227,900	4,040.00	920,716,000	貸付有価証券 7,200株
アサヒグループホールディングス	1,402,600	5,595.00	7,847,547,000	貸付有価証券 88,800株
キリンホールディングス	2,191,400	2,108.50	4,620,566,900	貸付有価証券 309,300株
サントリー食品インターナショナル	398,900	4,645.00	1,852,890,500	貸付有価証券 16,600株
伊藤園	181,000	7,210.00	1,305,010,000	貸付有価証券 16,500株
キッコーマン	429,100	8,620.00	3,698,842,000	貸付有価証券 100株
味の素	1,417,900	3,222.00	4,568,473,800	
キューピー	332,000	2,539.00	842,948,000	貸付有価証券 2,700株
カゴメ	226,200	2,871.00	649,420,200	貸付有価証券

				11,400株
アリアケジャパン	54,500	6,930.00	377,685,000	
ニチレイ	284,000	2,919.00	828,996,000	
東洋水産	306,700	4,875.00	1,495,162,500	貸付有価証券 3,700株
日清食品ホールディングス	233,900	8,830.00	2,065,337,000	貸付有価証券 100株
日本たばこ産業	3,196,700	2,181.00	6,972,002,700	貸付有価証券 714,800株
帝人	547,600	1,524.00	834,542,400	貸付有価証券 13,000株
東レ	4,212,400	707.40	2,979,851,760	
ゴールドウイン	96,300	6,610.00	636,543,000	
王子ホールディングス	2,619,100	553.00	1,448,362,300	
大王製紙	280,500	2,024.00	567,732,000	貸付有価証券 300株
レンゴー	599,900	869.00	521,313,100	貸付有価証券 19,900株
クラレ	850,800	1,036.00	881,428,800	貸付有価証券 5,900株
旭化成	3,856,200	1,136.00	4,380,643,200	
昭和電工	504,500	2,598.00	1,310,691,000	貸付有価証券 73,700株
住友化学	4,579,600	552.00	2,527,939,200	貸付有価証券 205,600株
日産化学	316,500	6,100.00	1,930,650,000	
東ソー	899,300	1,960.00	1,762,628,000	
トクヤマ	172,800	2,123.00	366,854,400	
デンカ	212,300	3,720.00	789,756,000	
信越化学工業	926,300	18,375.00	17,020,762,500	
エア・ウォーター	593,200	1,671.00	991,237,200	
日本酸素ホールディングス	479,200	2,650.00	1,269,880,000	貸付有価証券 200株
三菱瓦斯化学	582,900	2,144.00	1,249,737,600	
三井化学	502,200	3,525.00	1,770,255,000	貸付有価証券 600株
三菱ケミカルホールディングス	3,889,200	949.90	3,694,351,080	貸付有価証券 108,800株
ダイセル	782,200	858.00	671,127,600	貸付有価証券 4,400株

積水化学工業	1,217,400	1,789.00	2,177,928,600	貸付有価証券 9,300株
日本ゼオン	524,700	1,466.00	769,210,200	
アイカ工業	162,100	3,535.00	573,023,500	貸付有価証券 200株
宇部興産	293,800	2,182.00	641,071,600	貸付有価証券 4,200株
日油	219,100	6,000.00	1,314,600,000	貸付有価証券 200株
花王	1,314,000	6,640.00	8,724,960,000	貸付有価証券 75,900株
日本ペイントホールディングス	2,185,900	1,171.00	2,559,688,900	貸付有価証券 185,600株
関西ペイント	653,600	2,660.00	1,738,576,000	貸付有価証券 12,100株
D I C	245,700	3,025.00	743,242,500	貸付有価証券 700株
富士フイルムホールディングス	1,044,000	8,572.00	8,949,168,000	
資生堂	1,106,600	7,814.00	8,646,972,400	貸付有価証券 30,200株
ライオン	717,100	1,872.00	1,342,411,200	貸付有価証券 200株
ファンケル	216,400	3,730.00	807,172,000	貸付有価証券 900株
コーセー	111,700	13,700.00	1,530,290,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	253,600	2,527.00	640,847,200	貸付有価証券 7,100株
小林製薬	166,500	8,720.00	1,451,880,000	貸付有価証券 100株
日東電工	359,100	7,420.00	2,664,522,000	
エフピコ	109,200	3,925.00	428,610,000	貸付有価証券 500株
ニフコ	218,100	3,385.00	738,268,500	
ユニ・チャーム	1,145,000	4,697.00	5,378,065,000	貸付有価証券 30,300株
協和キリン	697,100	3,685.00	2,568,813,500	貸付有価証券 4,400株
武田薬品工業	4,627,500	3,221.00	14,905,177,500	
アステラス製薬	5,150,400	1,931.50	9,947,997,600	
大日本住友製薬	440,300	1,835.00	807,950,500	貸付有価証券

				1,900株
塩野義製薬	747,000	7,291.00	5,446,377,000	貸付有価証券 10,700株
日本新薬	168,400	8,630.00	1,453,292,000	貸付有価証券 100株
中外製薬	1,858,000	3,878.00	7,205,324,000	貸付有価証券 69,900株
科研製薬	101,700	4,495.00	457,141,500	貸付有価証券 1,600株
エーザイ	656,300	8,034.00	5,272,714,200	
ロート製薬	283,100	3,355.00	949,800,500	
小野薬品工業	1,364,200	2,390.50	3,261,120,100	貸付有価証券 400株
参天製薬	1,033,800	1,506.00	1,556,902,800	
JCRファーマ	167,400	2,902.00	485,794,800	貸付有価証券 800株
東和薬品	85,500	3,170.00	271,035,000	
第一三共	4,668,100	2,890.00	13,490,809,000	
大塚ホールディングス	1,234,600	4,764.00	5,881,634,400	貸付有価証券 41,600株
ペプチドリーム	311,700	2,949.00	919,203,300	貸付有価証券 76,000株
サワイグループホールディングス	130,100	5,080.00	660,908,000	
出光興産	659,200	3,035.00	2,000,672,000	貸付有価証券 31,000株
E N E O Sホールディングス	8,936,200	450.60	4,026,651,720	貸付有価証券 642,200株
コスモエネルギーホールディングス	187,600	2,559.00	480,068,400	
横浜ゴム	344,000	1,967.00	676,648,000	貸付有価証券 1,000株
TOYO TIRE	312,600	1,882.00	588,313,200	貸付有価証券 400株
ブリヂストン	1,711,100	5,130.00	8,777,943,000	貸付有価証券 244,100株
住友ゴム工業	533,600	1,401.00	747,573,600	貸付有価証券 23,900株
A G C	545,300	5,530.00	3,015,509,000	貸付有価証券 5,400株
太平洋セメント	337,500	2,349.00	792,787,500	

東海カーボン	497,800	1,368.00	680,990,400	貸付有価証券 2,700株
TOTO	424,300	5,170.00	2,193,631,000	
日本碍子	653,700	1,814.00	1,185,811,800	
日本特殊陶業	451,900	1,683.00	760,547,700	貸付有価証券 35,200株
ニチアス	150,100	2,542.00	381,554,200	
三井金属鉱業	158,500	3,080.00	488,180,000	
住友金属鉱山	750,900	3,974.00	2,984,076,600	
住友電気工業	2,049,900	1,461.50	2,995,928,850	
アサヒホールディングス	220,500	2,021.00	445,630,500	貸付有価証券 22,800株
SUMCO	749,200	2,111.00	1,581,561,200	貸付有価証券 468,100株（24,600 株）
三和ホールディングス	553,800	1,351.00	748,183,800	貸付有価証券 2,000株
リンナイ	114,200	11,490.00	1,312,158,000	貸付有価証券 400株
日本製鋼所	178,300	2,889.00	515,108,700	
三浦工業	254,200	4,190.00	1,065,098,000	貸付有価証券 600株
アマダ	861,000	1,107.00	953,127,000	
FUJII	234,500	2,619.00	614,155,500	貸付有価証券 100株
オーエスジー	271,700	1,815.00	493,135,500	貸付有価証券 1,600株
DMG森精機	348,400	1,884.00	656,385,600	貸付有価証券 9,000株
ディスコ	79,900	29,290.00	2,340,271,000	貸付有価証券 2,800株
オプトラン	73,600	2,197.00	161,699,200	貸付有価証券 400株
ナブテスコ	334,900	3,925.00	1,314,482,500	
SMC	173,900	62,610.00	10,887,879,000	
小松製作所	2,691,400	2,636.50	7,095,876,100	
住友重機械工業	340,000	2,840.00	965,600,000	
日立建機	277,700	3,085.00	856,704,500	
クボタ	2,897,600	2,266.00	6,565,961,600	貸付有価証券 235,700株

荏原製作所	246,600	5,750.00	1,417,950,000	
ダイキン工業	756,800	23,575.00	17,841,560,000	貸付有価証券 1,800株
ダイフク	326,900	9,770.00	3,193,813,000	
竹内製作所	99,400	2,509.00	249,394,600	貸付有価証券 600株
ホシザキ	173,600	9,680.00	1,680,448,000	貸付有価証券 1,900株
日本精工	1,220,000	763.00	930,860,000	貸付有価証券 1,100株
マキタ	774,600	5,500.00	4,260,300,000	
三菱重工業	933,300	2,932.50	2,736,902,250	
I H I	399,400	2,670.00	1,066,398,000	貸付有価証券 300株
ブラザー工業	725,400	2,350.00	1,704,690,000	貸付有価証券 100株
ミネベアミツミ	1,023,900	2,591.00	2,652,924,900	貸付有価証券 100株
日立製作所	2,705,600	6,273.00	16,972,228,800	貸付有価証券 30,200株
三菱電機	5,940,000	1,493.50	8,871,390,000	
富士電機	357,900	4,720.00	1,689,288,000	貸付有価証券 500株
安川電機	639,400	5,130.00	3,280,122,000	貸付有価証券 41,300株
日本電産	1,336,700	11,530.00	15,412,151,000	貸付有価証券 3,700株
オムロン	494,500	10,040.00	4,964,780,000	
M C J	187,700	1,213.00	227,680,100	貸付有価証券 4,400株
日本電気	754,800	5,830.00	4,400,484,000	貸付有価証券 19,600株
富士通	534,500	19,180.00	10,251,710,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,214,100	1,299.00	4,175,115,900	貸付有価証券 9,100株
セイコーエプソン	737,000	2,126.00	1,566,862,000	貸付有価証券 1,800株
ワコム	430,000	685.00	294,550,000	貸付有価証券 290,900株
アルバック	109,200	5,940.00	648,648,000	
エレコム	136,100	1,717.00	233,683,700	貸付有価証券

				7,900株（7,800株）
パナソニック	6,334,900	1,256.50	7,959,801,850	貸付有価証券 24,000株
アンリツ	357,100	1,984.00	708,486,400	貸付有価証券 241,600株
ソニーグループ	1,591,300	11,695.00	18,610,253,500	
T D K	860,400	3,635.00	3,127,554,000	貸付有価証券 300株
横河電機	594,500	1,940.00	1,153,330,000	
アズビル	401,700	4,410.00	1,771,497,000	貸付有価証券 400株
日本光電工業	245,500	3,615.00	887,482,500	
堀場製作所	109,800	7,310.00	802,638,000	貸付有価証券 24,100株
アドバンテスト	441,700	9,090.00	4,015,053,000	
キーエンス	306,900	62,230.00	19,098,387,000	貸付有価証券 200株
シスメックス	463,600	13,200.00	6,119,520,000	
レーザーテック	260,800	23,660.00	6,170,528,000	貸付有価証券 4,200株
スタンレー電気	415,700	2,672.00	1,110,750,400	貸付有価証券 9,900株
カシオ計算機	477,700	1,623.00	775,307,100	貸付有価証券 23,400株
ファナック	521,300	22,425.00	11,690,152,500	
浜松ホトニクス	426,100	6,380.00	2,718,518,000	
京セラ	905,400	6,576.00	5,953,910,400	
太陽誘電	264,200	6,150.00	1,624,830,000	
村田製作所	1,744,900	8,505.00	14,840,374,500	貸付有価証券 140,800株（64,100 株）
小糸製作所	355,800	6,320.00	2,248,656,000	貸付有価証券 2,300株
S C R E E Nホールディ ングス	103,000	9,010.00	928,030,000	
東京エレクトロン	347,900	45,890.00	15,965,131,000	
トヨタ紡織	173,100	1,914.00	331,313,400	
豊田自動織機	480,700	8,620.00	4,143,634,000	
デンソー	1,307,900	7,196.00	9,411,648,400	貸付有価証券 13,600株

いすゞ自動車	1,577,200	1,469.00	2,316,906,800	
トヨタ自動車	8,861,800	1,869.00	16,562,704,200	貸付有価証券 100株
日野自動車	741,800	1,088.00	807,078,400	貸付有価証券 200株
アイシン	434,800	3,970.00	1,726,156,000	貸付有価証券 1,200株
本田技研工業	4,677,100	3,332.00	15,584,097,200	貸付有価証券 3,300株
スズキ	1,177,500	4,708.00	5,543,670,000	貸付有価証券 7,400株
S U B A R U	1,702,300	2,042.50	3,476,947,750	
ヤマハ発動機	775,100	3,030.00	2,348,553,000	貸付有価証券 600株
豊田合成	191,800	2,164.00	415,055,200	
シマノ	239,400	29,905.00	7,159,257,000	貸付有価証券 14,700株
テイ・エス テック	275,900	1,431.00	394,812,900	貸付有価証券 1,200株
テルモ	1,821,000	4,890.00	8,904,690,000	貸付有価証券 100株
島津製作所	764,400	4,525.00	3,458,910,000	
ブイ・テクノロジー	27,800	4,240.00	117,872,000	
東京精密	100,300	4,170.00	418,251,000	
オリンパス	3,115,100	2,307.00	7,186,535,700	
H O Y A	1,159,100	16,325.00	18,922,307,500	
朝日インテック	651,200	2,780.00	1,810,336,000	貸付有価証券 26,200株
バンダイナムコホールディングス	491,300	7,910.00	3,886,183,000	
パイロットコーポレーション	100,300	4,115.00	412,734,500	貸付有価証券 1,200株
ヤマハ	353,300	6,660.00	2,352,978,000	
ピジョン	359,000	2,680.00	962,120,000	貸付有価証券 177,500株
任天堂	266,300	50,150.00	13,354,945,000	
中部電力	1,817,300	1,315.00	2,389,749,500	貸付有価証券 200株
関西電力	2,250,700	1,112.50	2,503,903,750	貸付有価証券 121,300株
中国電力	856,800	1,019.00	873,079,200	貸付有価証券

				10,400株
東北電力	1,391,200	810.00	1,126,872,000	貸付有価証券 73,000株
九州電力	1,311,800	856.00	1,122,900,800	貸付有価証券 112,200株
北海道電力	555,900	545.00	302,965,500	
電源開発	472,600	1,636.00	773,173,600	貸付有価証券 7,600株
イーレックス	87,300	2,486.00	217,027,800	貸付有価証券 59,000株(26,300株)
レノバ	101,400	4,400.00	446,160,000	貸付有価証券 1,600株
東京瓦斯	1,138,600	2,032.00	2,313,635,200	
大阪瓦斯	1,075,900	2,011.00	2,163,634,900	貸付有価証券 500株
東海旅客鉄道	493,900	16,845.00	8,319,745,500	
阪急阪神ホールディングス	750,300	3,350.00	2,513,505,000	
日本通運	194,800	7,430.00	1,447,364,000	
ヤマトホールディングス	788,300	2,716.00	2,141,022,800	
山九	144,300	5,080.00	733,044,000	
センコーグループホールディングス	310,300	1,003.00	311,230,900	貸付有価証券 5,200株
日立物流	116,000	4,685.00	543,460,000	貸付有価証券 300株
丸和運輸機関	118,800	1,538.00	182,714,400	貸付有価証券 24,500株
九州旅客鉄道	435,200	2,583.00	1,124,121,600	
S Gホールディングス	1,063,000	2,910.00	3,093,330,000	貸付有価証券 3,600株
日本郵船	470,400	7,750.00	3,645,600,000	
商船三井	333,700	7,090.00	2,365,933,000	貸付有価証券 300株
近鉄エクスプレス	106,200	2,696.00	286,315,200	
N E C ネットエスアイ	192,800	2,009.00	387,335,200	
システナ	207,900	2,030.00	422,037,000	
日鉄ソリューションズ	84,400	3,600.00	303,840,000	
T I S	582,900	2,882.00	1,679,917,800	
コーエーテクモホールディングス	155,000	4,920.00	762,600,000	貸付有価証券 6,500株

ネクソン	1,313,000	1,709.00	2,243,917,000	
ティーガイア	62,000	1,983.00	122,946,000	貸付有価証券 3,800株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	158,000	2,011.00	317,738,000	貸付有価証券 66,200株
GMOペイメントゲート ウェイ	113,000	13,520.00	1,527,760,000	貸付有価証券 600株
ラクス	233,900	3,395.00	794,090,500	貸付有価証券 21,700株
アカツキ	23,300	3,110.00	72,463,000	
野村総合研究所	1,012,500	3,945.00	3,994,312,500	
インフォコム	53,100	2,263.00	120,165,300	貸付有価証券 4,600株
オービック	183,700	20,670.00	3,797,079,000	
ジャストシステム	82,900	5,650.00	468,385,000	貸付有価証券 700株
Zホールディングス	8,009,000	690.60	5,531,015,400	貸付有価証券 209,300株
トレンドマイクロ	311,400	5,940.00	1,849,716,000	貸付有価証券 900株
日本オラクル	118,300	9,700.00	1,147,510,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	265,600	3,395.00	901,712,000	
大塚商会	315,400	5,430.00	1,712,622,000	
電通国際情報サービス	84,100	3,880.00	326,308,000	
東映アニメーション	23,200	19,980.00	463,536,000	貸付有価証券 15,700株（1,600株）
デジタルガレージ	96,300	4,750.00	457,425,000	
日本ユニシス	202,200	2,893.00	584,964,600	
USEN - NEXT HOLDINGS	55,400	3,215.00	178,111,000	
日本電信電話	5,945,800	3,109.00	18,485,492,200	貸付有価証券 3,100株
KDDI	4,674,500	3,616.00	16,902,992,000	貸付有価証券 6,600株
光通信	68,700	17,810.00	1,223,547,000	
東宝	343,900	5,100.00	1,753,890,000	貸付有価証券 900株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,551,900	2,058.00	3,193,810,200	
スクウェア・エニックス	248,600	5,820.00	1,446,852,000	貸付有価証券

ス・ホールディングス				700株
カブコン	499,600	2,900.00	1,448,840,000	貸付有価証券 2,600株
S C S K	403,500	2,242.00	904,647,000	
コナミホールディングス	211,700	6,120.00	1,295,604,000	貸付有価証券 600株
ソフトバンクグループ	2,213,500	5,949.00	13,168,111,500	貸付有価証券 4,600株
双日	646,340	1,880.00	1,215,119,200	貸付有価証券 82,600株
アルフレッサ ホールディングス	606,800	1,638.00	993,938,400	
神戸物産	454,100	3,600.00	1,634,760,000	貸付有価証券 287,200株
ダイワボウホールディングス	266,600	1,848.00	492,676,800	貸付有価証券 19,400株
T O K A I ホールディングス	283,400	877.00	248,541,800	
シップヘルスケアホールディングス	206,300	2,806.00	578,877,800	貸付有価証券 7,700株
コメダホールディングス	127,600	2,056.00	262,345,600	
メディカルホールディングス	586,300	2,077.00	1,217,745,100	貸付有価証券 1,500株
日本ライフライン	189,000	1,299.00	245,511,000	
伊藤忠商事	4,092,100	3,182.00	13,021,062,200	
丸紅	5,769,200	916.20	5,285,741,040	
豊田通商	587,700	4,530.00	2,662,281,000	
兼松	233,800	1,336.00	312,356,800	
三井物産	4,542,800	2,457.00	11,161,659,600	
住友商事	3,692,200	1,565.50	5,780,139,100	
三菱商事	3,562,100	3,480.00	12,396,108,000	
岩谷産業	140,400	6,530.00	916,812,000	
P A L T A C	93,800	5,080.00	476,504,000	貸付有価証券 1,000株
日鉄物産	41,700	4,860.00	202,662,000	
ミスミグループ本社	734,100	4,425.00	3,248,392,500	
ローソン	148,000	5,420.00	802,160,000	貸付有価証券 1,800株
エービーシー・マート	91,300	6,070.00	554,191,000	貸付有価証券 1,500株

日本マクドナルドホールディングス	269,700	5,110.00	1,378,167,000	貸付有価証券 155,100株
セリア	139,900	3,950.00	552,605,000	貸付有価証券 10,000株
ビックカメラ	347,000	1,035.00	359,145,000	貸付有価証券 66,900株（11,100株）
MonotaRO	739,600	2,429.00	1,796,488,400	貸付有価証券 79,100株
マツキヨココカラ&カンパニー	241,800	5,470.00	1,322,646,000	
ZOZO	344,900	3,965.00	1,367,528,500	
ウエルシアホールディングス	309,300	4,120.00	1,274,316,000	貸付有価証券 2,300株
クリエイティブSDホールディングス	86,300	3,670.00	316,721,000	貸付有価証券 7,400株（2,300株）
コスモス薬品	59,000	18,780.00	1,108,020,000	貸付有価証券 3,400株
セブン&アイ・ホールディングス	2,288,800	4,801.00	10,988,528,800	貸付有価証券 99,000株
ツルハホールディングス	127,600	13,780.00	1,758,328,000	貸付有価証券 700株
クスリのアオキホールディングス	58,200	7,450.00	433,590,000	貸付有価証券 12,000株（1,400株）
FOOD & LIFE COMPANIE	342,500	4,795.00	1,642,287,500	貸付有価証券 1,200株
ノジマ	104,100	2,788.00	290,230,800	貸付有価証券 1,200株
良品計画	673,200	2,244.00	1,510,660,800	貸付有価証券 2,900株
コーナン商事	83,200	3,630.00	302,016,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,169,800	2,388.00	2,793,482,400	
ゼンショーホールディングス	314,200	2,566.00	806,237,200	貸付有価証券 32,300株
ワークマン	75,500	6,160.00	465,080,000	貸付有価証券 51,000株
スギホールディングス	116,800	8,020.00	936,736,000	貸付有価証券 2,500株
ライフコーポレーション	54,700	4,045.00	221,261,500	
丸井グループ	495,000	2,136.00	1,057,320,000	
イズミ	119,000	3,605.00	428,995,000	貸付有価証券 11,400株

ヤオコー	66,400	6,580.00	436,912,000	貸付有価証券 17,700株
ケーズホールディングス	498,000	1,196.00	595,608,000	貸付有価証券 1,700株
アインホールディングス	84,900	6,360.00	539,964,000	貸付有価証券 4,400株
ニトリホールディングス	232,200	20,805.00	4,830,921,000	貸付有価証券 15,600株
ファーストリテイリング	78,300	71,470.00	5,596,101,000	貸付有価証券 5,100株
サンドラッグ	220,100	3,445.00	758,244,500	
めぶきフィナンシャルグループ	3,044,300	248.00	754,986,400	貸付有価証券 100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,569,400	460.00	1,641,924,000	貸付有価証券 25,700株
新生銀行	477,700	1,903.00	909,063,100	貸付有価証券 124,800株（31,900株）
あおぞら銀行	349,100	2,718.00	948,853,800	貸付有価証券 41,000株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	28,678,800	650.80	18,664,163,040	貸付有価証券 86,400株
りそなホールディングス	6,524,400	454.10	2,962,730,040	貸付有価証券 13,800株
三井住友トラスト・ホールディングス	1,107,400	3,859.00	4,273,456,600	貸付有価証券 3,000株
三井住友フィナンシャルグループ	4,054,500	3,904.00	15,828,768,000	貸付有価証券 176,700株
千葉銀行	1,955,200	744.00	1,454,668,800	貸付有価証券 500株
ふくおかフィナンシャルグループ	528,800	2,144.00	1,133,747,200	貸付有価証券 600株
セブン銀行	1,957,500	254.00	497,205,000	貸付有価証券 15,300株
みずほフィナンシャルグループ	7,961,200	1,565.50	12,463,258,600	貸付有価証券 192,600株
F P G	197,100	677.00	133,436,700	貸付有価証券 15,600株
GMOフィナンシャルホールディングス	108,700	846.00	91,960,200	貸付有価証券 2,000株
SBIホールディングス	722,200	2,719.00	1,963,661,800	
ジャフコグループ	74,600	6,980.00	520,708,000	貸付有価証券

				700株(700株)
大和証券グループ本社	4,387,700	656.10	2,878,769,970	貸付有価証券 37,700株
野村ホールディングス	8,945,300	548.10	4,902,918,930	貸付有価証券 244,200株
S O M P Oホールディングス	1,032,800	4,936.00	5,097,900,800	貸付有価証券 46,700株
M S & A Dインシュアランスグループホール	1,422,800	3,705.00	5,271,474,000	貸付有価証券 25,300株
第一生命ホールディングス	2,883,500	2,484.50	7,164,055,750	貸付有価証券 25,500株
東京海上ホールディングス	1,929,600	6,025.00	11,625,840,000	貸付有価証券 4,700株
T & Dホールディングス	1,751,100	1,560.00	2,731,716,000	
全国保証	152,400	5,150.00	784,860,000	貸付有価証券 89,800株
芙蓉総合リース	61,400	7,590.00	466,026,000	
みずほリース	90,400	3,500.00	316,400,000	貸付有価証券 24,100株
東京センチュリー	136,100	6,030.00	820,683,000	貸付有価証券 4,900株
イオンフィナンシャルサービス	358,500	1,492.00	534,882,000	貸付有価証券 8,900株
アコム	1,155,700	397.00	458,812,900	貸付有価証券 8,600株
オリエントコーポレーション	1,584,900	165.00	261,508,500	貸付有価証券 4,600株
オリックス	3,556,800	2,115.50	7,524,410,400	貸付有価証券 100株
三菱H C キャピタル	2,026,300	585.00	1,185,385,500	貸付有価証券 170,000株
日本取引所グループ	1,582,700	2,725.50	4,313,648,850	
いちご	652,400	351.00	228,992,400	貸付有価証券 800株
ヒューリック	1,242,900	1,125.00	1,398,262,500	貸付有価証券 524,400株
野村不動産ホールディングス	336,500	2,758.00	928,067,000	
サムティ	83,300	2,253.00	187,674,900	貸付有価証券 56,400株
プレサンスコーポレーション	96,400	1,776.00	171,206,400	貸付有価証券 800株

オープンハウス	186,000	6,270.00	1,166,220,000	貸付有価証券 300株
東急不動産ホールディングス	1,593,100	647.00	1,030,735,700	
飯田グループホールディングス	488,700	2,726.00	1,332,196,200	
三井不動産	2,670,200	2,528.00	6,750,265,600	貸付有価証券 300株
三菱地所	3,848,900	1,710.00	6,581,619,000	貸付有価証券 5,600株
東京建物	578,600	1,640.00	948,904,000	貸付有価証券 3,500株
住友不動産	1,317,000	3,958.00	5,212,686,000	貸付有価証券 16,300株
スターツコーポレーション	69,700	2,635.00	183,659,500	
日本エスコン	109,100	789.00	86,079,900	貸付有価証券 1,200株
イオンモール	293,800	1,615.00	474,487,000	貸付有価証券 21,500株
カチタス	145,100	3,860.00	560,086,000	
ミクシィ	144,300	2,510.00	362,193,000	貸付有価証券 600株
日本M&Aセンターホールディングス	931,000	3,125.00	2,909,375,000	
UTグループ	81,900	3,205.00	262,489,500	貸付有価証券 35,000株（100株）
エス・エム・エス	192,800	3,910.00	753,848,000	貸付有価証券 8,300株
パーソルホールディングス	567,500	2,822.00	1,601,485,000	貸付有価証券 2,400株
総合警備保障	225,800	4,855.00	1,096,259,000	
カカクコム	419,300	3,745.00	1,570,278,500	
ディップ	88,700	4,115.00	365,000,500	貸付有価証券 19,000株
ベネフィット・ワン	206,500	5,150.00	1,063,475,000	貸付有価証券 12,500株
エムスリー	1,001,500	7,260.00	7,270,890,000	貸付有価証券 400株
アウトソーシング	325,100	1,845.00	599,809,500	貸付有価証券 21,600株
博報堂DYホールディング	790,000	1,810.00	1,429,900,000	貸付有価証券

	グス				2,600株
	オリエンタルランド	603,700	17,360.00	10,480,232,000	貸付有価証券 21,200株
	ユー・エス・エス	635,500	1,774.00	1,127,377,000	貸付有価証券 2,700株
	フルキャストホールディングス	48,400	2,471.00	119,596,400	貸付有価証券 600株
	エン・ジャパン	100,900	4,125.00	416,212,500	貸付有価証券 400株
	テクノプロ・ホールディングス	339,900	3,285.00	1,116,571,500	貸付有価証券 41,700株
	アイ・アールジャパン ホールディングス	23,000	11,480.00	264,040,000	貸付有価証券 2,300株
	ジャパンマテリアル	174,500	1,332.00	232,434,000	貸付有価証券 200株
	リクルートホールディングス	3,146,200	6,688.00	21,041,785,600	貸付有価証券 10,200株
	ベルシステム24ホールディングス	95,100	1,593.00	151,494,300	貸付有価証券 1,100株
	ベイクレント・コンサルティング	37,300	44,100.00	1,644,930,000	
	ジャパンエレベーター サービスホールディング	163,700	2,359.00	386,168,300	
	リログループ	310,300	2,294.00	711,828,200	貸付有価証券 101,900株
	カナモト	100,000	2,546.00	254,600,000	貸付有価証券 67,700株
	セコム	559,300	7,959.00	4,451,468,700	
	メイテック	68,600	6,050.00	415,030,000	貸付有価証券 100株
	イオンディライト	69,900	3,470.00	242,553,000	
	小計 銘柄数：400 組入時価比率：97.4%			1,146,727,567,830	100.0%
	合計			1,146,727,567,830	

(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(2021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

2021年10月29日現在

資産総額	1,328,084,040,903円
負債総額	114,069,746,574円
純資産総額（ - ）	1,214,014,294,329円
発行済口数	67,163,118口
1口当たり純資産額（ / ）	18,076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

2021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2021年10月29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	995	39,430,487
単体型株式投資信託	199	808,755
追加型公社債投資信託	14	6,329,638
単体型公社債投資信託	508	1,590,266
合計	1,716	48,159,145

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(2020年4月1日から2021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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021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			2,626		4,281
金銭の信託			41,524		35,912
有価証券			24,399		30,400
前払費用			106		167
未収入金			522		632
未収委託者報酬			23,936		24,499
未収運用受託報酬			4,336		4,347
その他			71		268
貸倒引当金			14		14
流動資産計			97,509		100,496
固定資産					
有形固定資産					
建物	2	295		1,935	
器具備品	2	349		731	
無形固定資産					
ソフトウェア		5,893		5,428	
その他		0		0	

投資その他の資産		16,486		16,487
投資有価証券		1,437	1,767	
関係会社株式		10,171	9,942	
従業員長期貸付金		16	-	
長期差入保証金		329	330	
長期前払費用		19	15	
前払年金費用		1,545	1,301	
繰延税金資産		2,738	3,008	
その他		229	122	
貸倒引当金		0	-	
固定資産計		23,026		24,583
資産合計		120,536		125,080

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2020年3月31日)	(2021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		157	123
未払金		15,279	16,948
未払収益分配金		0	0
未払償還金		3	8
未払手数料		6,948	7,256
関係会社未払金		7,262	8,671
その他未払金		1,063	1,011
未払費用	1	10,290	9,171
未払法人税等		1,564	2,113
前受収益		26	22
賞与引当金		3,985	3,795
その他		67	-
流動負債計		31,371	32,175
固定負債			
退職給付引当金		3,311	3,299
時効後支払損引当金		572	580
資産除去債務		-	1,371
固定負債計		3,883	5,250
負債合計		35,254	37,425
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		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		54,360	56,686
利益準備金		685	685
その他利益剰余金		53,675	56,001
別途積立金		24,606	24,606
繰越利益剰余金		29,069	31,395
評価・換算差額等		10	57
その他有価証券評価差額金		10	57

純資産合計		85,281	87,654
負債・純資産合計		120,536	125,080

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,736	106,355
運用受託報酬		17,170	16,583
その他営業収益		340	428
営業収益計		133,247	123,367
営業費用			
支払手数料		39,435	34,739
広告宣伝費		1,006	1,005
公告費		-	0
調査費		26,833	24,506
調査費		5,696	5,532
委託調査費		21,136	18,974
委託計算費		1,342	1,358
営業雑経費		5,823	4,149
通信費		75	73
印刷費		958	976
協会費		92	88
諸経費		4,696	3,011
営業費用計		74,440	65,760
一般管理費			
給料		11,418	10,985
役員報酬		109	147
給料・手当		7,173	7,156
賞与		4,134	3,682
交際費		86	35
旅費交通費		391	64
租税公課		1,029	1,121
不動産賃借料		1,227	1,147
退職給付費用		1,486	1,267
固定資産減価償却費		2,348	2,700
諸経費		10,067	10,739
一般管理費計		28,055	28,063
営業利益		30,751	29,542

	前事業年度	当事業年度
	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021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	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
經常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	2	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			34		290
当期純利益			23,996		26,276

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(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		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	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
	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	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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(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	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、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: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15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おります。</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>
---	--

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[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。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021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 1,296百万円	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 1,256百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 761百万円 器具備品 2,347 合計 3,109	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990

損益計算書関係

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

<p>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</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 ア 合計 67</p>	<p>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 4,334百万円</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソフトウェア 102 ア 合計 105</p>
--	--

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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

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

(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

2021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	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

金融商品関係

前事業年度（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、過年度に計上してあ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	-	-	-

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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

2021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	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-

未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

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1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）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618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）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	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021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(2021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(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021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	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
<p>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。</p>
<p>2．確定給付制度</p>

(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(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	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349

(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	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182

(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	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
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	0.8%
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、206百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021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 1,235	賞与引当金 1,176
退職給付引当金 1,026	退職給付引当金 1,022
関係会社株式評価減 762	関係会社株式評価減 784
未払事業税 285	未払事業税 430
投資有価証券評価減 462	投資有価証券評価減 428
減価償却超過額 171	減価償却超過額 223
時効後支払損引当金 177	時効後支払損引当金 179
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 148
ゴルフ会員権評価減 167	ゴルフ会員権評価減 135
未払社会保険料 97	未払社会保険料 95
その他 219	その他 341
繰延税金資産小計 4,754	繰延税金資産小計 4,968
評価性引当額 1,532	評価性引当額 1,530
繰延税金資産合計 3,222	繰延税金資産合計 3,437
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 4	その他有価証券評価差額金 25
前払年金費用 478	前払年金費用 403
繰延税金負債合計 483	繰延税金負債合計 429
繰延税金資産の純額 2,738	繰延税金資産の純額 3,008
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 0.0%	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 4.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.5%
タックスヘイブン税制 2.6%	タックスヘイブン税制 1.9%
外国税額控除 0.7%	外国税額控除 0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2%	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 0.4%	その他 0.3%
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 29.4%

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）				
	前事業年度		当事業年度	
	自	2019年4月 1日	自	2020年4月 1日
	至	2020年3月31日	至	2021年3月31日
期首残高		-		-
有形固定資産の取得に伴う増加		-		1,371
時の経過による調整額		-		-
期末残高		-		1,371

セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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 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

(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	野村證券株式会社	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(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマースャル・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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	野村證券株式会社	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)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,557円31銭	1株当たり純資産額	17,018円01銭
1株当たり当期純利益	4,658円88銭	1株当たり当期純利益	5,101円61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	23,996百万円	損益計算書上の当期純利益	26,276百万円
普通株式に係る当期純利益	23,996百万円	普通株式に係る当期純利益	26,276百万円
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。

* 2021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
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円	
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
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	
B o f A 証券株式会社	83,140百万円	
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	

* 2021年10月末現在

独立監査人の監査報告書

2021年11月12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 根津昌史
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2021年4月8日から2021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2021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

2021年6月7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 津村 健二郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水 永 真太郎

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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2021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。

監査人は、監査等委員会に対して、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

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。