

## 【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】	2022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、2022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。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2022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

## &lt; 更新後 &gt;



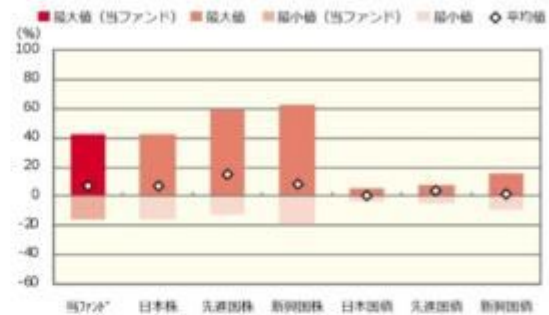
## 投資リスク

### ■ リスクの定量的比較（2017年11月末～2022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	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 15.9	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.7	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	7.1	7.2	15.3	8.4	0.0	3.2	2.0

\* 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。2017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、2017年11月から2022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。  
\* 2017年11月から2022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-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）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
  - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
  - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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プライアーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格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・ショート両方を兼ね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「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は借用できると思わ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。JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JP SI, 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

## &lt; 更新後 &gt;

信託報酬の総額は、により計算した額ににより計算した額を加えた額とします。ただし、により計算した額（税抜）に、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。

日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額。

信託報酬率	年0.11%（税抜年0.10%）以内 （2022年12月27日現在 年0.11%（税抜年0.10%））
-------	---

信託報酬率の配分は下記の通りとします。

支払先の配分（税抜）および役務の内容	
< 委託会社 > 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	年0.074%
< 受託会社 > 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	年0.026%

\* 上記配分は、2022年12月27日現在の信託報酬率における配分です。

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。

## (4) その他の手数料等

## &lt; 更新後 &gt;

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支払われます。なお、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。 )ならば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（2022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（2022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》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
・特定公社債 <sup>(注1)</sup> の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

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

\* 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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

#### 法人の受益者に対する課税

##### 受益権の売却時

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

##### 収益分配金の受取り時

収益分配金の益金不算入の対象となります。

益金不算入の限度は株式の配当金と同様の取扱いとなります。

##### 受益権と現物株式との交換時

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

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

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（2022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2022年10月31日現在の運用状況であります。

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

### (1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	1,125,396,125,020	97.53
現金・預金・その他資産(負債控除後)		28,461,796,336	2.46
合計(純資産総額)		1,153,857,921,356	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	28,302,800,000	2.45



## (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	第一三共	医薬品	4,886,700	4,300.03	21,012,993,552	4,767.00	23,294,898,900	2.01
2	日本	株式	キーエンス	電気機器	347,200	51,930.00	18,030,096,000	56,320.00	19,554,304,000	1.69
3	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	4,059,200	4,335.99	17,600,650,608	4,590.00	18,631,728,000	1.61
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,374,100	3,972.11	17,374,434,715	4,094.00	17,907,565,400	1.55
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,745,700	5,504.00	15,112,332,800	6,400.00	17,572,480,000	1.52
6	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	8,365,500	1,988.30	16,633,189,966	2,059.50	17,228,747,250	1.49
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	4,313,800	3,789.03	16,345,132,130	3,918.00	16,901,468,400	1.46
8	日本	株式	任天堂	その他製品	2,780,000	6,056.00	16,835,680,000	6,070.00	16,874,600,000	1.46
9	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	4,025,200	4,140.99	16,668,312,948	4,173.00	16,797,159,600	1.45
10	日本	株式	H O Y A	精密機器	1,208,300	14,874.78	17,973,205,815	13,875.00	16,765,162,500	1.45
11	日本	株式	K D D I	情報・通信業	3,684,000	4,253.00	15,668,052,000	4,395.00	16,191,180,000	1.40
12	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,388,500	6,539.00	15,618,401,500	6,760.00	16,146,260,000	1.39
13	日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	22,365,100	652.69	14,597,477,119	699.50	15,644,387,450	1.35
14	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,546,300	3,291.00	14,961,873,300	3,373.00	15,334,669,900	1.32
15	日本	株式	ダイキン工業	機械	674,400	23,225.00	15,662,940,000	22,385.00	15,096,444,000	1.30
16	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	5,546,600	2,595.36	14,395,447,492	2,691.00	14,925,900,600	1.29
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	3,699,800	4,206.00	15,561,358,800	4,031.00	14,913,893,800	1.29
18	日本	株式	信越化学工業	化学	958,600	15,454.99	14,815,153,414	15,540.00	14,896,644,000	1.29
19	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,484,400	9,890.90	14,682,056,229	9,988.00	14,826,187,200	1.28
20	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	366,100	38,828.99	14,215,293,239	39,490.00	14,457,289,000	1.25
21	日本	株式	三井物産	卸売業	4,329,800	3,280.99	14,206,030,502	3,293.00	14,258,031,400	1.23
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	3,646,300	3,850.00	14,038,255,000	3,849.00	14,034,608,700	1.21
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	9,011,100	1,467.99	13,228,204,689	1,465.50	13,205,767,050	1.14
24	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,966,200	1,601.07	12,754,451,171	1,606.00	12,793,717,200	1.10
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	1,696,200	7,073.00	11,997,222,600	7,300.00	12,382,260,000	1.07
26	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,039,400	5,486.00	11,188,148,400	5,554.00	11,326,827,600	0.98
27	日本	株式	日本電産	電気機器	1,371,800	8,426.00	11,558,786,800	8,238.00	11,300,888,400	0.97
28	日本	株式	S M C	機械	183,200	63,647.14	11,660,156,048	60,120.00	11,013,984,000	0.95
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	5,375,500	1,968.00	10,578,984,000	2,046.50	11,000,960,750	0.95
30	日本	株式	オリンパス	精密機器	3,496,300	3,020.75	10,561,462,874	3,140.00	10,978,382,000	0.95

## 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	0.03
		鉱業	0.38
		建設業	2.05
		食料品	3.79
		繊維製品	0.36
		パルプ・紙	0.16
		化学	6.66
		医薬品	7.44
		石油・石炭製品	0.67
		ゴム製品	1.00
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.65
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.33
		機械	5.37
		電気機器	16.22
		輸送用機器	5.82
		精密機器	3.53
		その他製品	2.17
		電気・ガス業	1.15
		陸運業	1.30
		海運業	0.69
		倉庫・運輸関連業	0.01
		情報・通信業	9.61
		卸売業	6.07
		小売業	4.02
		銀行業	5.18
		証券、商品先物取引業	0.69
		保険業	2.98
		その他金融業	1.32
不動産業	2.44		
サービス業	3.92		
合 計		97.53	

#### 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 (2022年12月限)	買建	16,360	日本円	28,016,500,000	28,302,800,000	2.45
----------	-------	---------------------------------	----	--------	-----	----------------	----------------	------

## (3) 運用実績

## 純資産の推移

2022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
第17計算期間	(2022年 4月 7日)	1,141,386	1,155,478	17,090.0000	17,301.0000	17,160
第18計算期間	(2022年10月 7日)	1,144,450	1,158,769	17,185.0000	17,400.0000	17,180
	2021年10月末日	1,214,014		18,076.0000		18,060
	11月末日	1,169,791		17,442.0000		17,270
	12月末日	1,209,666		18,063.0000		18,090
	2022年 1月末日	1,147,266		17,154.0000		17,180
	2月末日	1,138,171		17,043.0000		17,065
	3月末日	1,190,174		17,821.0000		17,830
	4月末日	1,144,762		17,166.0000		17,500
	5月末日	1,155,368		17,299.0000		17,250
	6月末日	1,124,393		16,884.0000		16,860
	7月末日	1,167,859		17,537.0000		17,570
	8月末日	1,180,756		17,756.0000		17,750
	9月末日	1,114,022		16,728.0000		16,720
	10月末日	1,153,857		17,376.0000		17,380

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
第17計算期間	2021年10月 8日～2022年 4月 7日	211.0000円
第18計算期間	2022年 4月 8日～2022年10月 7日	215.0000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%
第17計算期間	2021年10月 8日～2022年 4月 7日	1.4%
第18計算期間	2022年 4月 8日～2022年10月 7日	1.8%

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
第17計算期間	2021年10月 8日～2022年 4月 7日	499,001	775,935	66,786,380
第18計算期間	2022年 4月 8日～2022年10月 7日	199,836	388,636	66,597,580

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（2022年10月31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）

2022年10月	215 円
2022年4月	211 円
2021年10月	172 円
2021年4月	163 円
2020年10月	125 円
設定来累計	2,552 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	第一三共	医薬品	2.0
2	キーエンス	電気機器	1.7
3	リクルートホールディングス	サービス業	1.6
4	日本電信電話	情報・通信業	1.6
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5
6	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5
7	武田薬品工業	医薬品	1.5
8	任天堂	その他製品	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.5
10	HOYA	精密機器	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、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。
- ・2022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18期計算期間(2022年4月8日から2022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17期 (2022年 4月 7日現在)	第18期 (2022年10月 7日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	61,737,143,913	98,898,101,586
株式	1,113,569,348,060	1,116,315,558,700
派生商品評価勘定	1,188,198,495	376,522,617
未収入金	14,063,411,275	26,343,500
未収配当金	13,188,418,526	12,360,843,705
未収利息	3,298,834	750,337
その他未収収益	32,436,273	363,995,725
差入委託証拠金	-	1,085,130,984
流動資産合計	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154
資産合計	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	511,611,748	-
前受金	109,577,452	-
未払金	13,959,594,178	-
未払収益分配金	14,091,926,180	14,318,479,700
未払受託者報酬	289,933,471	218,445,586
未払委託者報酬	871,835,870	642,667,719
未払利息	7,696	90,877
有価証券貸借取引受入金	32,435,433,982	69,438,759,315
その他未払費用	126,065,260	358,168,369
流動負債合計	62,395,985,837	84,976,611,566
負債合計	62,395,985,837	84,976,611,566
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	776,458,453,880	774,263,465,080
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	364,927,815,659	370,187,170,508
(分配準備積立金)	55,200,243	18,908,559
元本等合計	1,141,386,269,539	1,144,450,635,588
純資産合計	1,141,386,269,539	1,144,450,635,588
負債純資産合計	1,203,782,255,376	1,229,427,247,154

## (2) 損益及び剰余金計算書

	第17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022年10月 7日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	15,339,298,375	14,992,369,853
有価証券売買等損益	29,666,837,789	5,405,248,009
派生商品取引等損益	832,896,843	911,009,711
その他収益	242,070,502	440,549,205
営業収益合計	14,918,365,755	21,749,176,778
<b>営業費用</b>		
支払利息	7,695,220	2,528,550
受託者報酬	289,933,471	218,445,586
委託者報酬	871,835,870	642,667,719
その他費用	307,796,227	292,146,287
営業費用合計	1,461,870,348	1,150,731,042
営業利益又は営業損失（ ）	16,380,236,103	20,598,445,736
経常利益又は経常損失（ ）	16,380,236,103	20,598,445,736
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,380,236,103	20,598,445,736
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（ ）	397,138,222,644	364,927,815,659
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,965,407,028	1,108,621,357
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,965,407,028	1,108,621,357
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,703,651,730	2,129,232,544
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,703,651,730	2,129,232,544
分配金	14,091,926,180	14,318,479,700
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	364,927,815,659	370,187,170,508

## (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、2022年 4月 8日から2022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17期 2022年 4月 7日現在	第18期 2022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 66,786,380口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,597,580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 17,090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 17,185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 29,888,467,090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 65,752,548,110円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022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>15,589,064,097円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>27,627,894円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>15,616,691,991円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,469,565,568円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>14,147,126,423円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>14,091,926,180円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>55,200,243円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,786,380口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>211円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,589,064,097円	分配準備積立金	B	27,627,894円	配当等収益合計額	C=A+B	15,616,691,991円	経費	D	1,469,565,568円	収益分配可能額	E=C-D	14,147,126,423円	収益分配金	F	14,091,926,180円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	55,200,243円	口数	H	66,786,380口	1口当たり分配金	I=F/H	211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>15,435,447,608円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>55,200,243円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>15,490,647,851円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,153,259,592円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>14,337,388,259円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>14,318,479,700円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>18,908,559円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>66,597,580口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金</td> <td>I=F/H</td> <td>215円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,435,447,608円	分配準備積立金	B	55,200,243円	配当等収益合計額	C=A+B	15,490,647,851円	経費	D	1,153,259,592円	収益分配可能額	E=C-D	14,337,388,259円	収益分配金	F	14,318,479,700円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,908,559円	口数	H	66,597,580口	1口当たり分配金	I=F/H	215円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,589,064,097円																																																											
分配準備積立金	B	27,627,894円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,616,691,991円																																																											
経費	D	1,469,565,568円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,147,126,423円																																																											
収益分配金	F	14,091,926,180円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	55,200,243円																																																											
口数	H	66,786,380口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	211円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,435,447,608円																																																											
分配準備積立金	B	55,200,243円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,490,647,851円																																																											
経費	D	1,153,259,592円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	14,337,388,259円																																																											
収益分配金	F	14,318,479,700円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,908,559円																																																											
口数	H	66,597,580口																																																											
1口当たり分配金	I=F/H	215円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち236,570,561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231,946,888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17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022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17期 2022年 4月 7日現在	第18期 2022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17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022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17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022年10月 7日
期首元本額 779,678,088,564円	期首元本額 776,458,453,880円
期中追加設定元本額 5,801,385,626円	期中追加設定元本額 2,323,293,336円
期中一部交換元本額 9,021,020,310円	期中一部交換元本額 4,518,282,136円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第17期 自 2021年10月 8日 至 2022年 4月 7日	第18期 自 2022年 4月 8日 至 2022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	29,714,176,817	5,494,132,022
合計	29,714,176,817	5,494,132,022

## 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17期(2022年 4月 7日現在)				第18期(2022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	26,999,766,048	-	27,679,038,500	676,586,747	27,637,277,983	-	28,016,500,000	376,522,617
合計	26,999,766,048	-	27,679,038,500	676,586,747	27,637,277,983	-	28,016,500,000	376,522,617

## （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(2022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	798,000	541.00	431,718,000	
		I N P E X	2,724,500	1,500.00	4,086,750,000	貸付有価証券 1,061,100株
		ウエストホールディングス	72,300	4,005.00	289,561,500	貸付有価証券 49,100株
		ショーボンドホールディングス	100,300	6,450.00	646,935,000	貸付有価証券 4,300株
		ミライト・ワン	276,700	1,477.00	408,685,900	
		安藤・間	391,200	881.00	344,647,200	
		コムシスホールディングス	277,000	2,487.00	688,899,000	
		大成建設	552,400	4,060.00	2,242,744,000	
		大林組	1,842,900	949.00	1,748,912,100	
		清水建設	1,704,200	728.00	1,240,657,600	
		長谷工コーポレーション	531,900	1,578.00	839,338,200	
		鹿島建設	1,350,300	1,403.00	1,894,470,900	貸付有価証券 200株
		西松建設	120,100	3,835.00	460,583,500	貸付有価証券 19,400株
		戸田建設	760,700	747.00	568,242,900	貸付有価証券 1,000株
		熊谷組	98,100	2,549.00	250,056,900	貸付有価証券 300株
五洋建設	730,500	734.00	536,187,000	貸付有価証券 14,200株		

住友林業	395,300	2,308.00	912,352,400	貸付有価証券 201,800株
大和ハウス工業	1,570,800	2,994.50	4,703,760,600	貸付有価証券 300株
積水ハウス	1,883,400	2,472.00	4,655,764,800	貸付有価証券 923,500株
関電工	322,700	839.00	270,745,300	
エクシオグループ	275,400	2,168.00	597,067,200	
九電工	125,300	2,886.00	361,615,800	
インフロニア・ホールディングス	691,000	1,025.00	708,275,000	貸付有価証券 11,900株
森永製菓	127,800	3,950.00	504,810,000	貸付有価証券 300株
カルビー	289,500	3,015.00	872,842,500	貸付有価証券 6,800株
森永乳業	103,400	4,185.00	432,729,000	貸付有価証券 9,800株
ヤクルト本社	403,300	8,400.00	3,387,720,000	
明治ホールディングス	349,800	6,310.00	2,207,238,000	貸付有価証券 300株
プリマハム	79,400	2,073.00	164,596,200	貸付有価証券 1,900株
日本ハム	222,500	3,715.00	826,587,500	貸付有価証券 3,300株
アサヒグループホールディングス	1,195,400	4,552.00	5,441,460,800	貸付有価証券 458,400株
キリンホールディングス	2,334,600	2,243.00	5,236,507,800	貸付有価証券 577,700株
宝ホールディングス	353,100	1,070.00	377,817,000	貸付有価証券 1,300株
サントリー食品インターナショナル	364,300	5,060.00	1,843,358,000	貸付有価証券 120,500株
キッコーマン	380,900	8,170.00	3,111,953,000	
味の素	1,266,100	4,025.00	5,096,052,500	貸付有価証券 900株
キューピー	278,000	2,360.00	656,080,000	貸付有価証券 8,500株
カゴメ	241,000	2,998.00	722,518,000	貸付有価証券 101,300株
ニチレイ	237,000	2,336.00	553,632,000	
東洋水産	283,200	5,890.00	1,668,048,000	

日清食品ホールディングス	204,800	9,930.00	2,033,664,000	
日本たばこ産業	3,405,600	2,390.50	8,141,086,800	貸付有価証券 496,500株
帝人	544,500	1,410.00	767,745,000	
東レ	3,846,600	746.30	2,870,717,580	
ゴールドウイン	102,500	7,810.00	800,525,000	
王子ホールディングス	2,391,700	540.00	1,291,518,000	
大王製紙	265,700	1,178.00	312,994,600	
レンゴー	479,300	855.00	409,801,500	貸付有価証券 1,100株
クラレ	836,700	1,026.00	858,454,200	貸付有価証券 7,600株
旭化成	3,834,300	983.90	3,772,567,770	
住友化学	4,228,100	505.00	2,135,190,500	貸付有価証券 2,700株
日産化学	277,600	6,650.00	1,846,040,000	
東ソー	766,500	1,649.00	1,263,958,500	
トクヤマ	184,100	1,805.00	332,300,500	貸付有価証券 2,900株
デンカ	208,800	3,250.00	678,600,000	
信越化学工業	982,400	15,455.00	15,182,992,000	
エア・ウォーター	496,600	1,757.00	872,526,200	
日本酸素ホールディングス	510,600	2,391.00	1,220,844,600	貸付有価証券 500株
三菱瓦斯化学	480,300	1,963.00	942,828,900	
三井化学	482,500	2,864.00	1,381,880,000	
三菱ケミカルグループ	3,847,400	677.90	2,608,152,460	貸付有価証券 169,900株
KHネオケム	87,600	2,825.00	247,470,000	貸付有価証券 10,300株
ダイセル	833,300	859.00	715,804,700	貸付有価証券 100株
積水化学工業	1,183,900	1,849.00	2,189,031,100	
日本ゼオン	450,900	1,365.00	615,478,500	
アイカ工業	146,100	3,215.00	469,711,500	
UBE	292,100	1,959.00	572,223,900	
日油	179,000	5,300.00	948,700,000	
花王	1,306,600	5,757.00	7,522,096,200	貸付有価証券

				437,900株
日本ペイントホールディングス	2,328,800	984.00	2,291,539,200	貸付有価証券 971,900株
関西ペイント	535,600	2,110.00	1,130,116,000	貸付有価証券 500株
富士フイルムホールディングス	1,112,200	6,961.00	7,742,024,200	
資生堂	1,100,300	5,236.00	5,761,170,800	貸付有価証券 139,800株
ライオン	632,200	1,599.00	1,010,887,800	貸付有価証券 15,500株
ファンケル	256,100	2,871.00	735,263,100	
コーセー	107,100	15,930.00	1,706,103,000	貸付有価証券 29,500株(8,900株)
小林製薬	161,200	8,410.00	1,355,692,000	貸付有価証券 65,300株
タカラバイオ	165,600	1,767.00	292,615,200	
デクセリアルズ	164,800	3,385.00	557,848,000	
日東電工	382,500	8,170.00	3,125,025,000	
エフピコ	116,300	3,600.00	418,680,000	
ニフコ	211,200	3,125.00	660,000,000	
ユニ・チャーム	1,097,800	4,774.00	5,240,897,200	貸付有価証券 265,900株
協和キリン	636,600	3,395.00	2,161,257,000	貸付有価証券 273,200株
武田薬品工業	4,322,600	3,789.00	16,378,331,400	貸付有価証券 300株
アステラス製薬	5,410,600	1,968.00	10,648,060,800	
住友ファーマ	390,900	1,036.00	404,972,400	
塩野義製薬	734,600	7,046.00	5,175,991,600	
日本新薬	138,000	7,650.00	1,055,700,000	
中外製薬	1,649,500	3,777.00	6,230,161,500	貸付有価証券 461,900株
科研製薬	90,300	3,840.00	346,752,000	貸付有価証券 900株
エーザイ	699,200	7,806.00	5,457,955,200	
ロート製薬	301,600	4,645.00	1,400,932,000	
小野薬品工業	1,220,000	3,413.00	4,163,860,000	
参天製薬	1,102,200	993.00	1,094,484,600	
JCRファーマ	178,400	2,247.00	400,864,800	

東和薬品	91,100	2,215.00	201,786,500	
第一三共	4,590,600	4,277.00	19,633,996,200	
大塚ホールディングス	1,205,600	4,656.00	5,613,273,600	貸付有価証券 274,600株
ペプチドリーム	255,400	1,766.00	451,036,400	貸付有価証券 54,400株（2,000株）
出光興産	643,800	3,375.00	2,172,825,000	
E N E O S ホールディングス	9,520,200	490.10	4,665,850,020	
コスモエネルギーホールディングス	249,800	3,920.00	979,216,000	貸付有価証券 1,100株
横浜ゴム	299,800	2,277.00	682,644,600	貸付有価証券 119,000株
TOYO TIRE	302,800	1,645.00	498,106,000	貸付有価証券 800株
ブリヂストン	1,682,700	4,902.00	8,248,595,400	貸付有価証券 697,000株
住友ゴム工業	516,800	1,204.00	622,227,200	貸付有価証券 188,500株
A G C	536,200	4,650.00	2,493,330,000	貸付有価証券 315,900株
太平洋セメント	359,500	2,055.00	738,772,500	
東海カーボン	442,000	999.00	441,558,000	貸付有価証券 37,400株
T O T O	382,500	4,960.00	1,897,200,000	貸付有価証券 700株
日本碍子	623,200	1,894.00	1,180,340,800	
日本特殊陶業	441,300	2,729.00	1,204,307,700	
M A R U W A	21,900	17,440.00	381,936,000	
ニチアス	133,200	2,338.00	311,421,600	
日本製鉄	2,614,100	2,085.50	5,451,705,550	
J F E ホールディングス	1,448,700	1,413.00	2,047,013,100	貸付有価証券 94,200株
東京製鐵	182,800	1,340.00	244,952,000	
三井金属鉱業	168,900	3,075.00	519,367,500	貸付有価証券 2,100株
住友金属鉱山	685,700	4,244.00	2,910,110,800	貸付有価証券 1,300株
D O W A ホールディングス	146,200	5,170.00	755,854,000	貸付有価証券 1,600株
住友電気工業	2,183,900	1,548.50	3,381,769,150	



アサヒホールディングス	250,600	2,037.00	510,472,200	貸付有価証券 6,100株
SUMCO	1,032,000	1,822.00	1,880,304,000	貸付有価証券 319,000株
三和ホールディングス	590,000	1,277.00	753,430,000	
リンナイ	108,100	10,700.00	1,156,670,000	
三浦工業	246,200	3,065.00	754,603,000	
アマダ	987,800	1,039.00	1,026,324,200	貸付有価証券 200株
FUJI	249,900	1,955.00	488,554,500	
DMG森精機	321,700	1,719.00	553,002,300	貸付有価証券 213,400株（156,700株）
ディスコ	92,200	32,600.00	3,005,720,000	
オプトラン	78,400	2,171.00	170,206,400	貸付有価証券 100株
ナブテスコ	333,000	3,095.00	1,030,635,000	貸付有価証券 20,700株
SMC	185,300	63,650.00	11,794,345,000	
小松製作所	2,868,200	2,716.00	7,790,031,200	
住友重機械工業	338,100	2,772.00	937,213,200	貸付有価証券 3,700株
日立建機	253,600	2,810.00	712,616,000	貸付有価証券 200株
ローツェ	31,200	7,960.00	248,352,000	貸付有価証券 3,000株（1,000株）
クボタ	2,829,900	2,053.50	5,811,199,650	貸付有価証券 1,314,500株
荏原製作所	217,100	4,920.00	1,068,132,000	貸付有価証券 74,000株
ダイキン工業	691,100	23,225.00	16,050,797,500	
ダイフク	298,500	7,270.00	2,170,095,000	
竹内製作所	96,300	2,775.00	267,232,500	
ホシザキ	341,600	4,230.00	1,444,968,000	貸付有価証券 153,900株
マキタ	715,200	2,868.50	2,051,551,200	
三菱重工業	928,000	4,870.00	4,519,360,000	
IHI	395,100	3,145.00	1,242,589,500	
イビデン	304,400	4,435.00	1,350,014,000	貸付有価証券 400株

ブラザー工業	721,300	2,630.00	1,897,019,000	
ミネベアミツミ	1,006,900	2,245.00	2,260,490,500	
日立製作所	2,563,400	6,539.00	16,762,072,600	
三菱電機	5,906,300	1,347.00	7,955,786,100	貸付有価証券 8,200株
富士電機	352,000	5,520.00	1,943,040,000	
安川電機	628,800	4,385.00	2,757,288,000	貸付有価証券 259,900株
日本電産	1,405,900	8,426.00	11,846,113,400	
オムロン	526,800	7,055.00	3,716,574,000	
M C J	220,000	991.00	218,020,000	貸付有価証券 147,400株
日本電気	750,500	4,770.00	3,579,885,000	
富士通	569,400	16,235.00	9,244,209,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,459,200	1,308.00	4,524,633,600	貸付有価証券 974,800株
セイコーエプソン	706,700	2,115.00	1,494,670,500	貸付有価証券 6,900株
ワコム	484,900	692.00	335,550,800	貸付有価証券 54,000株
アルバック	126,100	5,670.00	714,987,000	貸付有価証券 76,500株
エレコム	145,000	1,473.00	213,585,000	貸付有価証券 400株
パナソニック ホールディングス	6,749,400	1,052.00	7,100,368,800	
シャープ	601,100	859.00	516,344,900	貸付有価証券 402,700株（43,600株）
アンリツ	400,400	1,642.00	657,456,800	
ソニーグループ	1,487,400	9,891.00	14,711,873,400	
T D K	916,600	4,775.00	4,376,765,000	貸付有価証券 17,400株
横河電機	580,600	2,416.00	1,402,729,600	
アズビル	367,000	4,125.00	1,513,875,000	貸付有価証券 2,000株
日本光電工業	242,700	3,225.00	782,707,500	貸付有価証券 300株
堀場製作所	117,000	6,020.00	704,340,000	貸付有価証券 15,000株
アドバンテスト	470,500	7,340.00	3,453,470,000	

キーエンス	355,800	51,930.00	18,476,694,000	貸付有価証券 25,900株
シスメックス	453,200	7,959.00	3,607,018,800	
フェローテックホールディングス	147,400	2,509.00	369,826,600	貸付有価証券 98,700株
レーザーテック	259,400	17,075.00	4,429,255,000	貸付有価証券 110,500株
カシオ計算機	391,400	1,352.00	529,172,800	貸付有価証券 6,000株
ファナック	555,400	20,995.00	11,660,623,000	
浜松ホトニクス	421,600	6,580.00	2,774,128,000	
新光電気工業	185,900	3,420.00	635,778,000	貸付有価証券 14,900株
京セラ	890,300	7,571.00	6,740,461,300	
太陽誘電	281,400	3,905.00	1,098,867,000	貸付有価証券 4,100株
村田製作所	1,726,200	7,073.00	12,209,412,600	
小糸製作所	631,800	2,113.00	1,334,993,400	貸付有価証券 500株
S C R E E Nホールディングス	99,800	8,280.00	826,344,000	貸付有価証券 1,500株
東京エレクトロン	372,500	38,830.00	14,464,175,000	
トヨタ紡織	221,200	1,891.00	418,289,200	
豊田自動織機	448,100	7,420.00	3,324,902,000	
デンソー	1,238,500	7,159.00	8,866,421,500	
いすゞ自動車	1,833,000	1,680.00	3,079,440,000	
トヨタ自動車	7,858,700	1,985.50	15,603,448,850	
アイシン	463,200	3,925.00	1,818,060,000	貸付有価証券 400株
本田技研工業	4,626,800	3,291.00	15,226,798,800	貸付有価証券 100株
スズキ	1,254,500	4,825.00	6,052,962,500	
S U B A R U	1,662,400	2,280.50	3,791,103,200	
ヤマハ発動機	825,700	2,844.00	2,348,290,800	貸付有価証券 380,400株
豊田合成	178,800	2,333.00	417,140,400	
シマノ	214,900	23,945.00	5,145,780,500	貸付有価証券 44,500株
テイ・エス テック	267,200	1,505.00	402,136,000	

テルモ	1,790,800	4,339.00	7,770,281,200	
島津製作所	756,200	3,965.00	2,998,333,000	
東京精密	98,800	4,465.00	441,142,000	
オリンパス	3,031,800	3,012.00	9,131,781,600	貸付有価証券 86,300株
H O Y A	1,206,000	14,880.00	17,945,280,000	
朝日インテック	693,800	2,526.00	1,752,538,800	貸付有価証券 71,800株
バンダイナムコホールディングス	523,400	9,711.00	5,082,737,400	貸付有価証券 600株
パイロットコーポレーション	82,200	5,930.00	487,446,000	貸付有価証券 2,200株
ヤマハ	368,000	5,390.00	1,983,520,000	貸付有価証券 2,300株
ピジョン	334,600	2,075.00	694,295,000	貸付有価証券 52,400株
任天堂	2,812,400	6,056.00	17,031,894,400	
中部電力	1,787,200	1,255.00	2,242,936,000	貸付有価証券 6,900株
関西電力	2,213,300	1,147.00	2,538,655,100	
九州電力	1,211,200	731.00	885,387,200	貸付有価証券 4,100株
北海道電力	549,900	442.00	243,055,800	
電源開発	467,600	2,015.00	942,214,000	貸付有価証券 2,500株
イーレックス	81,500	2,799.00	228,118,500	
レノバ	124,200	3,695.00	458,919,000	貸付有価証券 82,900株（73,800株）
東京瓦斯	1,110,800	2,488.00	2,763,670,400	
大阪瓦斯	1,064,300	2,182.00	2,322,302,600	
S B S ホールディングス	46,800	2,876.00	134,596,800	貸付有価証券 100株
東海旅客鉄道	445,200	16,940.00	7,541,688,000	
ヤマトホールディングス	820,900	2,220.00	1,822,398,000	貸付有価証券 400株
山九	145,600	4,345.00	632,632,000	
センコーグループホールディングス	277,700	994.00	276,033,800	
日立物流	115,700	8,590.00	993,863,000	貸付有価証券 4,100株（2,900株）

A Z - C O M丸和ホールディングス	101,300	1,485.00	150,430,500	貸付有価証券 33,800株
S Gホールディングス	1,006,600	2,039.00	2,052,457,400	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	195,800	7,500.00	1,468,500,000	貸付有価証券 55,100株（12,000株）
日本郵船	1,503,500	2,563.00	3,853,470,500	貸付有価証券 1,019,400株（38,400株）
商船三井	924,200	2,775.00	2,564,655,000	貸付有価証券 619,200株
川崎汽船	553,700	2,124.00	1,176,058,800	貸付有価証券 373,300株（3,800株）
三井倉庫ホールディングス	58,700	3,180.00	186,666,000	
N E C ネットズエスアイ	205,400	1,627.00	334,185,800	
システナ	885,900	428.00	379,165,200	
日鉄ソリューションズ	107,900	3,555.00	383,584,500	
T I S	542,800	4,025.00	2,184,770,000	
コーエーテクモホールディングス	396,200	2,404.00	952,464,800	貸付有価証券 92,400株（41,800株）
ネクソン	1,361,000	2,730.00	3,715,530,000	貸付有価証券 547,900株
ティーガイア	55,100	1,673.00	92,182,300	貸付有価証券 400株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	161,300	2,291.00	369,538,300	貸付有価証券 2,800株
G M O ペイメントゲートウェイ	120,300	11,040.00	1,328,112,000	貸付有価証券 400株
インターネットイニシアティブ	330,800	2,224.00	735,699,200	
ラクス	284,800	1,487.00	423,497,600	貸付有価証券 78,100株（9,400株）
チェンジ	129,000	1,991.00	256,839,000	貸付有価証券 84,100株
野村総合研究所	1,079,900	3,540.00	3,822,846,000	
インフォコム	67,900	2,005.00	136,139,500	
オービック	195,700	20,620.00	4,035,334,000	貸付有価証券 700株
ジャストシステム	88,300	3,270.00	288,741,000	
Zホールディングス	8,957,200	398.80	3,572,131,360	貸付有価証券 327,000株

トレンドマイクロ	304,300	7,740.00	2,355,282,000	貸付有価証券 99,600株
日本オラクル	100,800	8,090.00	815,472,000	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠テクノソリューションズ	282,900	3,445.00	974,590,500	
大塚商会	298,700	4,635.00	1,384,474,500	貸付有価証券 126,900株
電通国際情報サービス	64,000	4,570.00	292,480,000	貸付有価証券 900株
東映アニメーション	24,800	12,690.00	314,712,000	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
デジタルガレージ	102,900	3,710.00	381,759,000	貸付有価証券 1,300株
ネットワンシステムズ	229,000	2,946.00	674,634,000	
B I P R O G Y	193,900	3,235.00	627,266,500	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	47,200	2,072.00	97,798,400	貸付有価証券 31,500株
日本電信電話	4,235,900	3,968.00	16,808,051,200	
K D D I	3,847,900	4,253.00	16,365,118,700	貸付有価証券 600株
ソフトバンク	9,405,700	1,468.00	13,807,567,600	貸付有価証券 3,000株
光通信	70,800	18,000.00	1,274,400,000	
GMOインターネットグループ	195,800	2,682.00	525,135,600	
東宝	366,400	5,170.00	1,894,288,000	貸付有価証券 180,100株
エヌ・ティ・ティ・データ	1,653,400	1,970.00	3,257,198,000	貸付有価証券 9,900株（9,900株）
D T S	115,700	3,480.00	402,636,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	288,900	6,610.00	1,909,629,000	
カブコン	576,000	3,810.00	2,194,560,000	
S C S K	429,900	2,209.00	949,649,100	貸付有価証券 300株
N S D	194,500	2,518.00	489,751,000	貸付有価証券 200株
コナミグループ	225,600	6,510.00	1,468,656,000	貸付有価証券 100株
ソフトバンクグループ	3,152,500	5,504.00	17,351,360,000	

双日	639,300	2,227.00	1,423,721,100	
アルフレッサホールディングス	646,400	1,728.00	1,116,979,200	
神戸物産	430,100	3,445.00	1,481,694,500	貸付有価証券 185,700株(28,100株)
ダイワボウホールディングス	265,000	2,015.00	533,975,000	
TOKAIホールディングス	301,900	876.00	264,464,400	
シップヘルスケアホールディングス	179,800	2,865.00	515,127,000	貸付有価証券 33,300株
メディカルホールディングス	576,500	1,904.00	1,097,656,000	貸付有価証券 2,300株
伊藤忠商事	3,736,800	3,850.00	14,386,680,000	
丸紅	5,399,400	1,364.50	7,367,481,300	貸付有価証券 100株
豊田通商	556,500	4,760.00	2,648,940,000	
兼松	215,800	1,476.00	318,520,800	
三井物産	4,380,400	3,281.00	14,372,092,400	貸付有価証券 4,400株
住友商事	3,688,100	1,904.00	7,022,142,400	貸付有価証券 2,600株
三菱商事	4,086,800	4,206.00	17,189,080,800	
阪和興業	108,100	3,715.00	401,591,500	
岩谷産業	138,100	5,550.00	766,455,000	貸付有価証券 2,500株
PALTAC	87,400	4,335.00	378,879,000	貸付有価証券 200株
日鉄物産	38,100	5,250.00	200,025,000	
ミスミグループ本社	782,600	3,380.00	2,645,188,000	
ローソン	137,900	4,570.00	630,203,000	貸付有価証券 89,600株
エービーシー・マート	97,300	6,650.00	647,045,000	
日本マクドナルドホールディングス	313,500	4,980.00	1,561,230,000	貸付有価証券 185,300株
セリア	149,000	2,513.00	374,437,000	貸付有価証券 4,900株
Monotaro	788,000	2,342.00	1,845,496,000	貸付有価証券 84,000株
マツキヨココカラ&カン	365,200	6,350.00	2,319,020,000	

パニー				
Z O Z O	428,600	3,085.00	1,322,231,000	
ウエルシアホールディングス	329,500	3,115.00	1,026,392,500	貸付有価証券 78,000株
クリエイティブSDホールディングス	91,900	3,230.00	296,837,000	貸付有価証券 300株
ネクステージ	126,800	3,030.00	384,204,000	貸付有価証券 19,700株（15,900株）
コスモス薬品	62,900	14,730.00	926,517,000	貸付有価証券 3,400株
セブン&アイ・ホールディングス	2,090,000	5,486.00	11,465,740,000	貸付有価証券 703,800株
ツルハホールディングス	136,000	8,760.00	1,191,360,000	貸付有価証券 4,200株
クスリのアオキホールディングス	55,800	7,500.00	418,500,000	貸付有価証券 1,400株
FOOD & LIFE COMPANIE	319,300	2,350.00	750,355,000	
ノジマ	201,500	1,312.00	264,368,000	貸付有価証券 4,200株
良品計画	717,200	1,195.00	857,054,000	貸付有価証券 69,600株
コーナン商事	88,600	3,360.00	297,696,000	貸付有価証券 3,000株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,246,500	2,674.00	3,333,141,000	貸付有価証券 328,400株
ゼンショーホールディングス	304,300	3,710.00	1,128,953,000	貸付有価証券 46,600株（14,200株）
ワークマン	64,300	4,725.00	303,817,500	貸付有価証券 43,000株
スギホールディングス	124,400	5,940.00	738,936,000	貸付有価証券 4,000株
日本瓦斯	297,800	2,070.00	616,446,000	
ライフコーポレーション	48,600	2,582.00	125,485,200	貸付有価証券 300株
丸井グループ	451,000	2,496.00	1,125,696,000	
イズミ	98,600	3,210.00	316,506,000	
ヤオコー	70,800	6,480.00	458,784,000	貸付有価証券 14,500株（1,400株）
ケーズホールディングス	530,500	1,198.00	635,539,000	
ニトリホールディングス	247,300	12,775.00	3,159,257,500	貸付有価証券



				4,400株
ファーストリテイリング	83,400	79,890.00	6,662,826,000	貸付有価証券 13,700株
サンドラッグ	234,500	3,600.00	844,200,000	
めぶきフィナンシャルグループ	2,567,700	287.00	736,929,900	貸付有価証券 300株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,089,600	446.00	1,377,961,600	
新生銀行	407,200	2,290.00	932,488,000	貸付有価証券 78,800株
あおぞら銀行	348,600	2,572.00	896,599,200	貸付有価証券 200株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,626,000	652.70	14,767,990,200	
りそなホールディングス	6,604,400	534.50	3,530,051,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,032,300	4,258.00	4,395,533,400	
三井住友フィナンシャルグループ	4,050,400	4,141.00	16,772,706,400	貸付有価証券 12,800株
千葉銀行	1,762,600	793.00	1,397,741,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	450,700	2,586.00	1,165,510,200	
セブン銀行	1,853,700	255.00	472,693,500	貸付有価証券 500株
みずほフィナンシャルグループ	7,483,600	1,602.00	11,988,727,200	
GMOフィナンシャルホールディングス	115,800	715.00	82,797,000	貸付有価証券 73,400株（52,400株）
ジャフコグループ	216,000	2,246.00	485,136,000	貸付有価証券 27,600株
大和証券グループ本社	4,008,500	580.20	2,325,731,700	貸付有価証券 202,000株
野村ホールディングス	9,529,900	488.90	4,659,168,110	
マネックスグループ	525,500	478.00	251,189,000	貸付有価証券 116,100株（4,700株）
SOMPOホールディングス	888,100	5,992.00	5,321,495,200	
MS&ADインシュアランスグループホール	1,283,100	3,882.00	4,980,994,200	
第一生命ホールディングス	3,039,600	2,317.00	7,042,753,200	貸付有価証券 460,100株
東京海上ホールディング	5,210,600	2,592.00	13,505,875,200	貸付有価証券

ス				1,800株
T & Dホールディングス	1,388,700	1,404.00	1,949,734,800	
全国保証	148,900	4,950.00	737,055,000	貸付有価証券 27,800株
芙蓉総合リース	53,600	8,190.00	438,984,000	貸付有価証券 300株
みずほリース	77,000	3,215.00	247,555,000	貸付有価証券 8,900株
東京センチュリー	96,700	4,935.00	477,214,500	
イオンフィナンシャル サービス	339,500	1,453.00	493,293,500	貸付有価証券 144,600株
アコム	1,231,200	317.00	390,290,400	
オリエントコーポレー ション	168,920	1,155.00	195,102,600	貸付有価証券 113,000株
オリックス	3,708,400	2,120.50	7,863,662,200	貸付有価証券 200株
三菱HCキャピタル	2,017,500	642.00	1,295,235,000	貸付有価証券 100株
日本取引所グループ	1,454,000	1,992.50	2,897,095,000	貸付有価証券 3,600株
大東建託	203,100	14,420.00	2,928,702,000	
ヒューリック	1,207,000	1,094.00	1,320,458,000	貸付有価証券 291,200株
野村不動産ホールディン グス	323,300	3,410.00	1,102,453,000	貸付有価証券 200株
プレサンスコーポレー ション	68,000	1,544.00	104,992,000	貸付有価証券 500株
オープンハウスグループ	189,400	5,150.00	975,410,000	
東急不動産ホールディン グス	1,697,200	796.00	1,350,971,200	
飯田グループホールディ ングス	509,900	2,064.00	1,052,433,600	
ケイアイスター不動産	28,000	4,435.00	124,180,000	貸付有価証券 16,200株(2,800株)
三井不動産	2,435,600	2,915.50	7,100,991,800	貸付有価証券 600株
三菱地所	3,554,100	1,937.00	6,884,291,700	
東京建物	493,200	2,133.00	1,051,995,600	貸付有価証券 155,700株(29,900 株)
住友不動産	1,122,500	3,415.00	3,833,337,500	

スターツコーポレーション	84,900	2,726.00	231,437,400	
日本エスコン	116,200	829.00	96,329,800	貸付有価証券 2,200株
イオンモール	313,000	1,603.00	501,739,000	貸付有価証券 53,000株
カチタス	154,500	3,175.00	490,537,500	貸付有価証券 100株
UTグループ	87,200	2,287.00	199,426,400	
エス・エム・エス	205,500	3,035.00	623,692,500	
パーソルホールディングス	604,600	2,874.00	1,737,620,400	
総合警備保障	220,500	3,705.00	816,952,500	
カカクコム	443,700	2,610.00	1,158,057,000	
ディップ	106,300	3,755.00	399,156,500	貸付有価証券 29,400株
ベネフィット・ワン	218,900	2,193.00	480,047,700	貸付有価証券 6,700株
エムスリー	1,067,200	4,231.00	4,515,323,200	貸付有価証券 128,600株
博報堂DYホールディングス	765,400	1,090.00	834,286,000	貸付有価証券 2,500株
パリュエコマース	40,600	2,277.00	92,446,200	
H.U.グループホールディングス	158,000	2,729.00	431,182,000	
ビー・エム・エル	76,900	3,350.00	257,615,000	
ユー・エス・エス	677,000	2,371.00	1,605,167,000	
サイバーエージェント	1,292,200	1,279.00	1,652,723,800	
フルキャストホールディングス	51,600	2,768.00	142,828,800	貸付有価証券 1,400株
エン・ジャパン	107,400	2,334.00	250,671,600	
テクノプロ・ホールディングス	362,100	3,230.00	1,169,583,000	貸付有価証券 2,200株
ジャパンマテリアル	185,900	1,921.00	357,113,900	貸付有価証券 9,500株
リクルートホールディングス	4,131,000	4,336.00	17,912,016,000	
ベルシステム24ホールディングス	86,900	1,377.00	119,661,300	貸付有価証券 8,200株
ベイカレント・コンサルティング	42,700	40,950.00	1,748,565,000	貸付有価証券 26,300株（7,300株）

	ジャパンエレベーター サービスホールディング	191,800	1,905.00	365,379,000	貸付有価証券 2,000株
	リログループ	330,700	2,235.00	739,114,500	貸付有価証券 12,900株
	トランス・コスモス	76,700	3,730.00	286,091,000	貸付有価証券 3,200株
	セコム	595,900	8,523.00	5,078,855,700	貸付有価証券 100株
	メイテック	215,300	2,463.00	530,283,900	
	イオンディライト	69,700	2,941.00	204,987,700	貸付有価証券 700株
	小計 銘柄数：400 組入時価比率：97.5%			1,116,315,558,700 100.0%	
	合計			1,116,315,558,700	

(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(2022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

2022年10月31日現在

資産総額	1,287,108,443,621円
負債総額	133,250,522,265円
純資産総額( - )	1,153,857,921,356円
発行済口数	66,404,267口
1口当たり純資産額( / )	17,376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

2022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

## &lt;更新後&gt;

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

委託者の運用する証券投資信託は2022年10月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,002	39,135,228
単体型株式投資信託	201	741,191
追加型公社債投資信託	14	6,282,006
単体型公社債投資信託	489	1,175,581
合計	1,706	47,334,005

### 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(2021年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022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		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産			
建物	2	1,935	1,219
器具備品	2	731	525
無形固定資産		5,429	5,210

ソフトウェア		5,428		5,209	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	1		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			87,596		86,232
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			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174



純資産合計		87,654	86,407
負債・純資産合計		125,080	124,440

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		106,355	115,733
運用受託報酬		16,583	17,671
その他営業収益		428	530
営業収益計		123,367	133,935
営業費用			
支払手数料		34,739	39,087
広告宣伝費		1,005	804
公告費		0	0
調査費		24,506	26,650
調査費		5,532	4,867
委託調査費		18,974	21,783
委託計算費		1,358	1,384
営業雑経費		4,149	3,094
通信費		73	72
印刷費		976	918
協会費		88	79
諸経費		3,011	2,023
営業費用計		65,760	71,021
一般管理費			
給料		10,985	12,033
役員報酬		147	229
給料・手当		7,156	7,375
賞与		3,682	4,427
交際費		35	47
旅費交通費		64	65
租税公課		1,121	1,049
不動産賃借料		1,147	1,432
退職給付費用		1,267	1,212
固定資産減価償却費		2,700	2,525
諸経費		10,739	11,190
一般管理費計		28,063	29,556
営業利益		29,542	33,357

	前事業年度	当事業年度
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022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	4,540		3,530	
受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			290		171
当期純利益			26,276		24,904

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(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		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	29,069	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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									

当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(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	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

## [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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法						
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5. 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>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> (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	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						

## 6．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。

## (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。

## (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。

## 7．収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

## 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

## 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

## 8．消費税等の会計処理方法

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。

9. 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>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。

## [ 会計方針の変更 ]

## （収益認識に関する会計基準等の適用）

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。

これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識に関する注記」については記載しておりません。

## （時価の算定に関する会計基準の適用）

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「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 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

## [ 未適用の会計基準等 ]

・「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 2021年6月17日）

## (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## (2) 適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「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、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023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

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022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 1,256百万円	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 1,223百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207

損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022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 4,334百万円	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 3,525百万円
2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 2 ソフトウェア 102 合計 105	2. 固定資産除却損 建物 346百万円 器具備品 28 ソフトウェア - 合計 374

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

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

## (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

2022年5月18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	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

## 金融商品関係

前事業年度（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	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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

2022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。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2) その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

(注) 1 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注) 2 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）1.2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

- ( ) 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。  
2 非上場株式等について、当事業年度において727百万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	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（ ）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

( ) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 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。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。

## デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

## 有価証券関係

前事業年度（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)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

## 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	-

非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載しておりません。

## 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2022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(2022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(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2022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	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載してありません。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

デリバティブ取引関係

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	121	121

## 退職給付関係

前事業年度(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。

## 当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

## (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	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	672
年金資産の期末残高	19,687

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	18,807 百万円
年金資産	19,687
	879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959
(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	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。	

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022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	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,176	賞与引当金	1,381
退職給付引当金	1,022	退職給付引当金	990
関係会社株式評価減	784	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	430	未払事業税	285
投資有価証券評価減	428	投資有価証券評価減	110
減価償却超過額	223	減価償却超過額	272
時効後支払損引当金	179	時効後支払損引当金	182
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	135	ゴルフ会員権評価減	92
資産除去債務	425	資産除去債務	348
未払社会保険料	95	未払社会保険料	114
その他	358	その他	84
繰延税金資産小計	5,410	繰延税金資産小計	5,376
評価性引当額	1,530	評価性引当額	1,795
繰延税金資産合計	3,879	繰延税金資産合計	3,581
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	361	資産除去債務に対応する除去費用	233
関係会社株式評価益	80	関係会社株式評価益	81
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	78
前払年金費用	403	前払年金費用	402
繰延税金負債合計	871	繰延税金負債合計	796
繰延税金資産の純額	3,008	繰延税金資産の純額	2,784
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	3.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%
タックスヘイブン税制	1.9%	タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	0.5%	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	0.4%
その他	0.3%	その他	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%

### 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	2020年4月 1日 至 2021年3月31日	自	2021年4月 1日 至 2022年3月31日
期首残高		-		1,371
有形固定資産の取得に伴う増加		1,371		48
資産除去債務の履行による減少		-		296
期末残高		1,371		1,123

## 収益認識に関する注記

### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

前事業年度（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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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 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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

種類	会社等の名称	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)
子会社	ノムラ・エーエム・ファイナンス・インク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息の受取	9	未収利息	4

## （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）	29,119	未払手数料	6,013

## （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. 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10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	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

&lt; 更新後 &gt;

## (1) 受託者

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

\* 2022年10月末現在

## (2) 販売会社

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

\* 2022年10月末現在



## 独立監査人の監査報告書

2022年12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 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2022年4月8日から2022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2022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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2022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 湯原 尚指定有限責任社員  
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2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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2022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。

### その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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、継続企業的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. 上記の監査報告書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。