

2020年12月24日

各 位

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
(管理会社コード 13064)  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## 上場ETF(管理会社:野村アセットマネジメント)に関する日々の開示事項 (2/2)

野村アセットマネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり2020年12月23日の状況をご報告します。

### 上場ETF銘柄(41銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	<a href="#">NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信</a>	1306	東証
2	<a href="#">NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50連動型上場投信</a>	1309	東証
3	<a href="#">NEXT FUNDS TOPIX Core 30連動型上場投信</a>	1311	東証
4	<a href="#">NEXT FUNDS ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投信</a>	1312	東証
5	<a href="#">NEXT FUNDS 日経300株価指数連動型上場投信</a>	1319	東名札福
6	<a href="#">NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信</a>	1321	東証
7	<a href="#">NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top 40連動型上場投信</a>	1323	東証
8	<a href="#">NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS連動型上場投信</a>	1324	東証
9	<a href="#">NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスバ連動型上場投信</a>	1325	東証
10	<a href="#">NEXT FUNDS 金価格連動型上場投信</a>	1328	東証
11	<a href="#">NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信</a>	1343	東証
12	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信</a>	1357	東証
13	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信</a>	1470	東証
14	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信</a>	1471	東証
15	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信</a>	1472	東証
16	<a href="#">NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信</a>	1480	東証
17	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數連動型上場投信</a>	1489	東証
18	<a href="#">NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信</a>	1545	東証
19	<a href="#">NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株30種平均株価連動型上場投信</a>	1546	東証
20	<a href="#">NEXT FUNDS タイ株式SET50指數連動型上場投信</a>	1559	東証
21	<a href="#">NEXT FUNDS FTSEブルサ・マレーシアKLCI連動型上場投信</a>	1560	東証
22	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信</a>	1570	東証
23	<a href="#">NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信</a>	1571	東証
24	<a href="#">NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信</a>	1577	東証
25	<a href="#">NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信</a>	1591	東証
26	<a href="#">NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信</a>	1598	東証
27	<a href="#">NEXT FUNDS 東証銀行業株価指數連動型上場投信</a>	1615	東証
28	<a href="#">NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50連動型上場投信</a>	1678	東証
29	<a href="#">NEXT FUNDS 日経・JPX白金指數連動型上場投信</a>	1682	東証

#### 上場ETF銘柄(41銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
30	<a href="#">NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス連動型上場投信</a>	1699	東証
31	<a href="#">NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信</a>	2510	東証
32	<a href="#">NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス (除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信</a>	2511	東証
33	<a href="#">NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス (除く日本・為替ヘッジあり)連動型上場投信</a>	2512	東証
34	<a href="#">NEXT FUNDS 外国株式・MSCI KOKUSAI指数(為替ヘッジなし) 連動型上場投信</a>	2513	東証
35	<a href="#">NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジあり) 連動型上場投信</a>	2514	東証
36	<a href="#">NEXT FUNDS 外国REIT・S&amp;P先進国REIT指数 (除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信</a>	2515	東証
37	<a href="#">NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指数(セレクト)連動型上場投信</a>	2518	東証
38	<a href="#">NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信</a>	2519	東証
39	<a href="#">NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信</a>	2520	東証
40	<a href="#">NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信</a>	2529	東証
41	<a href="#">NEXT FUNDS フルームバーク・バークレイズ米国投資適格社債[1-10 年]インデックス(為替ヘッジあり)連動型上場投信</a>	2554	東証

\* 各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

[掲載番号:1]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1306)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

7,676,623,436 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

14,070,035,778,788 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,832.84 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

「TOPIX連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に名称が変更され、「NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信」となりました。

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)
6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS TOPIX Exchange Traded Fund**

TOPIX <sup>( )</sup> TOPIX Index			NEXT FUNDS TOPIX連動型上場投信 NEXT FUNDS TOPIX Exchange Traded Fund□						
Year -Month	Day	Index Value	(A)		(B)		受益権 残存口数	純資産総額 (円)	
			指數終値	日次 騰落率	純資産価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	日次 騰落率	(B) - (A) Return Differential	Unit	NAV
2020-11	26	1,778.25	0.60%		1,846.49	0.60%	0.00%	7,670,958,394	14,164,324,618,917
	27	1,786.52	0.47%		1,854.81	0.45%	-0.01%	7,670,958,394	14,228,152,630,034
	30	1,754.92	-1.77%		1,822.24	-1.76%	0.01%	7,670,958,394	13,978,349,037,312
2020-12	1	1,768.38	0.77%		1,836.14	0.76%	0.00%	7,670,958,394	14,084,949,211,784
	2	1,773.97	0.32%		1,842.02	0.32%	0.00%	7,687,957,094	14,161,391,719,771
	3	1,775.25	0.07%		1,843.41	0.08%	0.00%	7,678,224,813	14,154,133,721,121
	4	1,775.94	0.04%		1,843.98	0.03%	-0.01%	7,686,330,206	14,173,439,383,101
	7	1,760.75	-0.86%		1,828.36	-0.85%	0.01%	7,684,384,882	14,049,819,829,994
	8	1,758.81	-0.11%		1,826.22	-0.12%	-0.01%	7,684,384,882	14,033,374,289,155
	9	1,779.42	1.17%		1,847.76	1.18%	0.01%	7,684,384,882	14,198,936,641,366
	10	1,776.21	-0.18%		1,844.20	-0.19%	-0.01%	7,684,384,882	14,171,535,600,472
	11	1,782.01	0.33%		1,850.19	0.32%	0.00%	7,684,384,882	14,217,567,083,863
	14	1,790.52	0.48%		1,859.13	0.48%	0.01%	7,684,384,882	14,286,272,517,752
	15	1,782.05	-0.47%		1,850.32	-0.47%	0.00%	7,684,384,882	14,218,595,508,744
	16	1,786.83	0.27%		1,855.30	0.27%	0.00%	7,684,384,882	14,256,835,097,023
	17	1,792.58	0.32%		1,861.30	0.32%	0.00%	7,684,384,882	14,302,925,443,019
	18	1,793.24	0.04%		1,862.10	0.04%	0.01%	7,680,493,331	14,301,828,552,681
	21	1,789.05	-0.23%		1,857.55	-0.24%	-0.01%	7,680,493,331	14,266,930,558,797
	22	1,761.12	-1.56%		1,828.65	-1.56%	0.01%	7,680,493,331	14,044,937,252,773
	23	1,765.21	0.23%		1,832.84	0.23%	0.00%	7,676,623,436	14,070,035,778,788

( ) 「TOPIX」について

TOPIXの指數値およびTOPIXの商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指數の算出、指數値の公表、利用など株価指數に関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。

東京証券取引所は、TOPIXの指數値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指數値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。

東京証券取引所は、TOPIXの指數値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。

また東京証券取引所は、TOPIXの指數値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本ファンドは、TOPIXの指數値に連動した投資成果を目標として運用するが、本ファンドの純資産額とTOPIXの間に乖離が発生することがある。

本ファンドは、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。

東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。

以上の項目に限らず、東京証券取引所は本ファンドの発行又は販売に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

(i) The TOPIX Index Value and the TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Index Value or to change the TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX ETF may be substantially deviated from the TOPIX although the investment objective of the TOPIX ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Index Value. (vi) The TOPIX ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the Fund or an advice on investments in the TOPIX ETF to any purchaser of the TOPIX ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX ETF.

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:2]  
各位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1309)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

93,557 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

3,891,998,511 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

41,600.29 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.04 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は54,979.06(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:3]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1311)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS TOPIX Core 30連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

1,523,386 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,248,970,345 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

819.86 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に  
名称が変更され、「NEXT FUNDS TOPIX Core 30連動型上場  
投信」となりました。

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)
6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS TOPIX Core 30連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund**

TOPIX Core 30 <sup>(i)</sup> TOPIX Core 30 Index			NEXT FUNDS TOPIX Core 30連動型上場投信 NEXT FUNDS TOPIX Core 30 Exchange Traded Fund				
Year -Month	Day	Index Value	Daily Return	(A)		受益權 残存口数	純資産総額 (円)
				指數終値	日次 騰落率		
Year -Month	Day	Index Value	Daily Return	純資産価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	日次 騰落率	受益權 残存口数	純資産総額 (円)
2020-11	26	822.87	0.75%	810.42	0.75%	0.01%	1,234,579,146
	27	826.93	0.49%	814.35	0.48%	-0.01%	1,240,570,889
	30	812.05	-1.80%	799.75	-1.79%	0.01%	1,218,325,599
2020-12	1	814.35	0.28%	801.97	0.28%	-0.01%	1,221,710,783
	2	816.68	0.29%	804.25	0.28%	0.00%	1,225,190,021
	3	817.09	0.05%	804.66	0.05%	0.00%	1,225,810,254
	4	816.32	-0.09%	803.91	-0.09%	0.00%	1,224,662,741
	7	811.63	-0.57%	799.29	-0.57%	0.00%	1,217,632,202
	8	810.04	-0.20%	797.74	-0.19%	0.00%	1,215,260,940
	9	821.75	1.45%	809.24	1.44%	0.00%	1,232,780,395
	10	825.59	0.47%	813.03	0.47%	0.00%	1,238,563,906
	11	827.19	0.19%	814.62	0.20%	0.00%	1,240,977,170
	14	832.98	0.70%	820.34	0.70%	0.00%	1,249,688,628
	15	829.74	-0.39%	817.12	-0.39%	0.00%	1,244,789,921
	16	833.72	0.48%	821.06	0.48%	0.00%	1,250,786,363
	17	842.59	1.06%	829.88	1.07%	0.01%	1,264,225,900
	18	844.02	0.17%	831.26	0.17%	0.00%	1,266,332,114
	21	844.52	0.06%	831.72	0.06%	0.00%	1,267,033,971
	22	832.32	-1.44%	819.70	-1.45%	0.00%	1,248,714,778
	23	832.49	0.02%	819.86	0.02%	0.00%	1,248,970,345

( ) 「TOPIX Core 30」について

TOPIX Core 30の指數値およびTOPIX Core 30の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指數の算出、指數値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及びTOPIX Core 30の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。

東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指數値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIX Core 30の指數値の算出若しくは公表の停止又はTOPIX Core 30の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

東京証券取引所は、TOPIX Core 30の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。

東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指數値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また東京証券取引所は、TOPIX Core 30の指數値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」は、TOPIX Core 30の指數値に連動した投資成果を目標として運用するが、「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の純資産価額とTOPIX Core 30の間に乖離が発生することがある。

「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。

東京証券取引所は「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の購入者又は公衆に対し、「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」の説明投資のアドバイスをする義務を持たない。

以上の項目に限らず、東京証券取引所は「TOPIX Core 30連動型上場投資信託」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ない。

(i) The TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value and the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX Core 30 and TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value or to change the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Core 30 and TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Core 30 and TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX Core 30 ETF may be substantially deviated from the TOPIX Core 30 although the investment objective of the TOPIX Core 30 ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Core 30 Index Value. (vi) The TOPIX Core 30 ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the TOPIX Core 30 ETF or an advice on investments in the TOPIX Core 30 ETF to any purchaser of the TOPIX Core 30 ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX Core 30 ETF.

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:4]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1312)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

110,120 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

2,172,796,836 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

19,731.2 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

「ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託」  
は、2020年9月30日に名称が変更され、「NEXT FUNDS ラッセ  
ル野村小型コア・インデックス連動型上場投信」となりました。

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Russell/Nomura Small Cap Core Index Exchange Traded Fund**

Russell/Nomura Small Cap Core インデックス( ) NEXT FUNDS ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投信

Russell/Nomura Small Cap Core Index			NEXT FUNDS Russell/Nomura Small Cap Core Index Exchange Traded Fund					
Year -Month	Day	(A)	(B)	(B)-(A)	受益権 残存口数 Unit	純資産総額 (円) NAV		
		指數終値 Index Value	日次 騰落率 Daily Return	純資産価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	日次 騰落率 Daily Return	騰落率差 Return Differential		
2020-11	26	205.62	0.34%	19,954.8	0.32%	-0.01%	110,120	2,197,418,068
	27	207.09	0.71%	20,094.7	0.70%	-0.01%	110,120	2,212,831,548
	30	202.23	-2.35%	19,626.3	-2.33%	0.01%	110,120	2,161,253,389
2020-12	1	204.85	1.30%	19,881.0	1.30%	0.00%	110,120	2,189,299,787
	2	205.79	0.46%	19,971.4	0.45%	-0.01%	110,120	2,199,246,008
	3	206.34	0.27%	20,023.4	0.26%	-0.01%	110,120	2,204,972,554
	4	205.96	-0.19%	19,986.1	-0.19%	0.00%	110,120	2,200,866,104
	7	203.16	-1.36%	19,713.7	-1.36%	-0.01%	110,120	2,170,875,959
	8	203.44	0.14%	19,740.2	0.13%	0.00%	110,120	2,173,790,093
	9	205.85	1.18%	19,973.6	1.18%	0.00%	110,120	2,199,495,576
	10	205.06	-0.38%	19,897.8	-0.38%	0.00%	110,120	2,191,141,216
	11	206.32	0.62%	20,019.2	0.61%	-0.01%	110,120	2,204,510,503
	14	207.69	0.67%	20,153.5	0.67%	0.00%	110,120	2,219,299,577
	15	207.22	-0.23%	20,106.4	-0.23%	-0.01%	110,120	2,214,120,483
	16	207.66	0.21%	20,148.4	0.21%	0.00%	110,120	2,218,745,077
	17	207.02	-0.31%	20,087.1	-0.30%	0.00%	110,120	2,211,995,393
	18	207.33	0.15%	20,117.1	0.15%	0.00%	110,120	2,215,299,026
	21	207.20	-0.06%	20,102.4	-0.07%	-0.01%	110,120	2,213,672,948
	22	202.93	-2.06%	19,689.5	-2.05%	0.00%	110,120	2,168,209,252
	23	203.37	0.21%	19,731.2	0.21%	0.00%	110,120	2,172,796,836

( ) 「Russell/Nomura Small Cap Core インデックス」について  
ラッセル・インベストメント（RUSSELL INVESTMENTS）／野村證券株式会社による「ラッセル野村インデックス」の公表若しくは「ラッセル野村インデックス」から派生する有価証券・その他の金融商品に関連する商標の使用許諾は、「ラッセル野村インデックス」に基づき、また、「ラッセル野村インデックス」から派生する有価証券・その他の金融商品に対する投資の魅力に關し、いかなる意味でも、ラッセル・インベストメント／野村證券株式会社による表明又は意見を示唆するものでも暗示するものではありません。ラッセル・インベストメント／野村證券株式会社はいずれも「ラッセル野村インデックス」そのもの、また、それに包含されるか、反映されているデータに関する商品適格性や特定の目的への適合性に対し、若しくは、「ラッセル野村インデックス」そのものまた、それに包含されるか、反映されているデータを利用したいかなる者が得る結果に対し、明示的にせよ默示的にせよいかなる保証も行いません。

NEITHER PUBLICATION BY RUSSELL INVESTMENTS OR THE NOMURA SECURITIES CO., LTD. OF THE RUSSELL/NOMURA INDEXES NOR THEIR LICENSING OF TRADEMARKS FOR USE IN CONNECTION WITH SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS DERIVED FROM A RUSSELL/NOMURA INDEX IN ANY WAY SUGGESTS OR IMPLIES A REPRESENTATION OR OPINION BY RUSSELL INVESTMENTS OR NOMURA SECURITIES CO., LTD. AS TO THE ATTRACTIVENESS OF INVESTMENT IN ANY SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS BASED UPON OR DERIVED FROM ANY RUSSELL/NOMURA INDEX. NEITHER RUSSELL INVESTMENTS NOR NOMURA SECURITIES CO., LTD. ARE THE ISSUER OF ANY SUCH SECURITIES OR OTHER FINANCIAL PRODUCTS AND NEITHER MAKES ANY EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR ANY PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO ANY RUSSELL/NOMURA INDEX OR ANY DATA INCLUDED OR REFLECTED THEREIN, NOR AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY ANY PERSON OR ANY ENTITY FROM THE USE OF THE RUSSELL/NOMURA INDEX OR ANY DATA INCLUDED OR REFLECTED THEREIN.

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:5]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1319)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 日経300株価指数連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

8,485,656 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

2,952,568,501 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

347.95 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は369.81(2020年12月23日現在)です

「日経300株価指数連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に名称が変更され、「NEXT FUNDS 日経300株価指数連動型上場投信」となりました。

以 上

[掲載番号:6]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1321)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

273,537,960 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

7,471,683,439,678 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

27,315.0 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

「日経225連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に名称が  
変更され、「NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信」となりまし  
た。

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)
6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund**

日経平均(日経225) <sup>(i)</sup> Nikkei Average			NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信 NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund□					
Year -Month	Day	Index Value	(A) 指數終値	純資產価額 (一口当たり) NAV	(B) 日次 騰落率 Daily Return	(B)-(A) 騰落率差 Return Differential	受益権 残存口数 Unit Outstanding	純資産総額 (円) NAV
			日次 騰落率 Daily Return	(per Unit)	Daily Return	Differential	Outstanding	NAV
2020-11	26	26,537.31	0.91%	27,332.9	0.91%	0.00%	277,740,150	7,591,430,226,018
	27	26,644.71	0.40%	27,442.0	0.40%	-0.01%	276,878,595	7,598,103,112,685
	30	26,433.62	-0.79%	27,225.0	-0.79%	0.00%	276,125,185	7,517,509,711,251
2020-12	1	26,787.54	1.34%	27,589.0	1.34%	0.00%	276,071,335	7,616,534,313,656
	2	26,800.98	0.05%	27,603.5	0.05%	0.00%	276,071,335	7,620,547,889,961
	3	26,809.37	0.03%	27,612.0	0.03%	0.00%	276,071,335	7,622,894,664,448
	4	26,751.24	-0.22%	27,551.8	-0.22%	0.00%	276,071,335	7,606,248,895,857
	7	26,547.44	-0.76%	27,341.2	-0.76%	0.00%	276,233,115	7,552,552,678,137
	8	26,467.08	-0.30%	27,258.3	-0.30%	0.00%	276,233,115	7,529,648,588,883
	9	26,817.94	1.33%	27,619.9	1.33%	0.00%	274,346,552	7,577,419,405,070
	10	26,756.24	-0.23%	27,553.9	-0.24%	-0.01%	274,184,807	7,554,849,717,113
	11	26,652.52	-0.39%	27,446.7	-0.39%	0.00%	274,184,807	7,525,477,739,131
	14	26,732.44	0.30%	27,530.4	0.30%	0.01%	274,130,916	7,546,945,384,625
	15	26,687.84	-0.17%	27,484.0	-0.17%	0.00%	273,915,202	7,528,287,018,997
	16	26,757.40	0.26%	27,554.8	0.26%	0.00%	273,861,276	7,546,203,904,373
	17	26,806.67	0.18%	27,606.5	0.19%	0.00%	273,969,146	7,563,323,420,342
	18	26,763.39	-0.16%	27,562.0	-0.16%	0.00%	273,915,217	7,549,656,877,541
	21	26,714.42	-0.18%	27,510.2	-0.19%	0.00%	273,537,960	7,525,082,220,233
	22	26,436.39	-1.04%	27,223.0	-1.04%	0.00%	273,537,960	7,446,527,106,670
	23	26,524.79	0.33%	27,315.0	0.34%	0.00%	273,537,960	7,471,683,439,678

( )「日経平均」について

「日経平均」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」自体及び「日経平均」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。

「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。

日経225連動型上場投資信託は、弊社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンド受益証券の取引に関して、一切の責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

(i) Nikkei Average is copyrightable works calculated through such methodology as independently developed by Nikkei, and Nikkei owns copyrights and any other intellectual property rights subsisting in Nikkei Average and the methodology to calculate Nikkei Average.

(ii) Nikkei owns any and all rights to trademarks and any other intellectual property rights to such marks referring to "Nikkei" or Nikkei Average.

(iii) The Nikkei 225 ETF shall be managed under the responsibilities of the relevant investment trust management companies and other participants. Nikkei shall not be liable for management of the Nikkei 225 ETF or any other transactions of beneficiary certificates.

(iv) Nikkei shall not be obligated to publish continuously Nikkei Average. Nikkei shall not be liable for any error, delay or discontinuance of publication of Nikkei Average.

(v) Nikkei shall have the rights to make any changes in composition of stocks, calculation method and any other elements or contents of Nikkei Average. Nikkei shall also have the right to discontinue publishing Nikkei Average.

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換口数は  
以下の通りです。

交換口数：55,080口の整数倍

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:7]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1323)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 南アフリカ株式指數・FTSE/JSE Africa Top40  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

1,014,404 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

415,751,244 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

409.85 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は378,755.09(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:8]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1324)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

8,663,550 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,182,177,357 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

136.45 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.96 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は140,075.72(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:9]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1325)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

12,579,416 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

2,271,077,324 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

180.54 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.01 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は2,340,888.13(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:10]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1328)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 金価格連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

1,250,958 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

6,192,287,144 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

4,950.04 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.52 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指標の終値は6,255.29(2020年12月23日現在)です

「金価格連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に名称が変更され、「NEXT FUNDS 金価格連動型上場投信」となりました。

以 上

#### <商品先物取引の特性とロールオーバーの影響について>

商品先物取引においては、通常、需給動向や保管コスト等が織り込まれて、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに価格差が生じます。

限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が高い状態（以下「コンタンゴ（順鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて減価の影響を受けることになり、現在取引している商品先物取引を次限月以降の限月に乗換えること（以下「ロールオーバー」といいます。）に伴って損失が発生する場合があります。

一方、限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が低い状態（「バックワーデーション（逆鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて増価の影響を受けることになり、ロールオーバーに伴って収益が発生する場合があります。

#### <留意すべき投資スタイル>

（中長期的な投資）

上記のとおり、商品先物取引は、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに形成される価格の違いにより、異なる影響を受けます。

商品先物市場がコンタンゴ（順鞘）の場合、ETFが利用する先物取引の価格は時間の経過とともに継続的に減価の影響を受けるため、中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。

[掲載番号:11]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1343)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 東証REIT指数連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

194,034,853 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

358,026,209,946 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,845.16 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)

6. 設定に係る有価証券のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXTFUNDS 東証REIT指数連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS REIT INDEX ETF**

東証REIT指数( ) TSE REIT Index				NEXTFUNDS 東証REIT指数連動型上場投信 NEXT FUNDS REIT INDEX ETF				
Year -Month	Day	(A) 指數終値 Index Value	(A) 日次 騰落率 Daily Return	(B) 純資產価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	(B) 日次 騰落率 Daily Return	(B)-(A) 騰落率差 Return Differential	受益權 残存口数 Unit Outstanding	純資產總額 (円) NAV
2020-11	26	1,691.51	0.46%	1,803.18	0.46%	0.00%	188,988,943	340,780,593,441
	27	1,697.38	0.35%	1,814.50	0.63%	0.28%	188,988,943	342,919,894,229
	30	1,687.98	-0.55%	1,804.43	-0.55%	0.00%	188,988,943	341,016,888,478
2020-12	1	1,703.47	0.92%	1,820.97	0.92%	0.00%	191,179,343	348,132,146,926
	2	1,689.64	-0.81%	1,806.18	-0.81%	0.00%	191,179,343	345,304,039,368
	3	1,687.69	-0.12%	1,804.11	-0.11%	0.00%	191,179,343	344,907,814,671
	4	1,700.17	0.74%	1,817.44	0.74%	0.00%	191,179,343	347,456,232,418
	7	1,682.88	-1.02%	1,798.94	-1.02%	0.00%	191,179,343	343,920,504,177
	8	1,702.78	1.18%	1,820.23	1.18%	0.00%	191,179,343	347,989,857,932
	9	1,699.32	-0.20%	1,816.53	-0.20%	0.00%	191,379,443	347,645,910,827
	10	1,693.98	-0.31%	1,810.82	-0.31%	0.00%	191,779,643	347,278,331,589
	11	1,710.03	0.95%	1,827.96	0.95%	0.00%	194,774,843	356,040,145,000
	14	1,716.12	0.36%	1,834.44	0.35%	0.00%	195,174,243	358,035,292,715
	15	1,713.09	-0.18%	1,831.25	-0.17%	0.00%	195,174,243	357,413,237,924
	16	1,729.28	0.95%	1,848.55	0.94%	0.00%	195,174,243	360,789,862,068
	17	1,733.08	0.22%	1,852.62	0.22%	0.00%	195,974,243	363,065,011,133
	18	1,715.56	-1.01%	1,833.89	-1.01%	0.00%	193,834,853	355,472,643,322
	21	1,707.67	-0.46%	1,825.43	-0.46%	0.00%	194,034,853	354,196,278,735
	22	1,715.30	0.45%	1,833.56	0.45%	0.00%	194,034,853	355,773,977,607
	23	1,726.16	0.63%	1,845.16	0.63%	0.00%	194,034,853	358,026,209,946

( )「東証REIT指数」について

東証REIT指数の指數値、東証REIT指数 の商標は、株式会社東京証券取引所（以下（株）東京証券取引所という。）の知的財産であり、この指數の算出、指數値の公表、利用など株価指數に関するすべての権利及び東証REIT指數 の商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有する。

（株）東京証券取引所は、東証REIT指數の指數値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指數 の指數値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指數 の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

（株）東京証券取引所は、東証REIT指數の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。

（株）東京証券取引所は、東証REIT指數 の指數値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、（株）東京証券取引所は、東証REIT指數 の指數値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本件ETFは、東証REIT指數 の指數値に連動した投資成果を目標として運用するが、本件ETFの純資產価額と東証REIT指數 の間に乖離が発生することがある。

本件ETFは、（株）東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。

（株）東京証券取引所は、本件ETFの購入者又は公衆に対し、本件ETFの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。

以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は本件ETFの発行等又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:12]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1357)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

539,900,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

287,575,970,666 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

532.65 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.39 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は777.56(2020年12月23日現在)です

以 上

### **・日経平均ダブルインバース・インデックスに内在する性質に関する注意点**

日経平均ダブルインバース・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の「-2倍」（マイナス2倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の「-2倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の「-2倍」との差（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（日経ダブルインバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

### **・指標の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点**

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:13]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1470)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

**NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項**

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

60,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,476,026,521 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

24,600.44 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.05 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は19,627.09(2020年12月23日現在)です

以 上

## ・JPX日経400レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注意点

JPX日経400レバレッジ・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJPX日経インデックス400の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400の2倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の2倍との差（ずれ）は、当該期間中のJPX日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、JPX日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信（JPX日経400レバレッジ指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## ・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:14]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1471)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス 連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

280,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,061,059,519 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

3,789.50 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.03 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は4,830.76(2020年12月23日現在)です

以 上

## ・JPX日経400インバース・インデックスに内在する性質に関する注意点

JPX日経400インバース・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJPX日経インデックス400の騰落率の「-1倍」（マイナス1倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400インバース・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400の「-1倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400インバース・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の「-1倍」との差（ずれ）は、当該期間中のJPX日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、JPX日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信（JPX日経400インバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## ・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:15]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1472)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス 連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

240,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

267,236,401 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,113.49 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.05 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は1,797.45(2020年12月23日現在)です

以 上

## ・JPX日経400ダブルインバース・インデックスに内在する性質に関する注意点

JPX日経400ダブルインバース・インデックスは、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間のJPX日経インデックス400の騰落率の「-2倍」（マイナス2倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400の「-2倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間におけるJPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の「-2倍」との差（ずれ）は、当該期間中のJPX日経インデックス400の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、JPX日経インデックス400の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（JPX日経400ダブルインバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

## ・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、JPX日経インデックス400の値動きとJPX日経インデックス400先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:16]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1480)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 野村企業価値分配指數連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

407,014 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

7,289,669,498 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

17,910.1 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.01 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 野村企業価値分配指數連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund**

野村企業価値分配指数( ) NEXT FUNDS 野村企業価値分配指數連動型上場投信

Nomura Enterprise Value Allocation Index				NEXT FUNDS Nomura Enterprise Value Allocation Index Exchange Traded Fund				
Year -Month	Day	(A) 指數終値 <i>Index Value</i>	日次 騰落率 <i>Daily Return</i>	(B) 純資產価額 (一口当たり) <i>NAV</i>	日次 騰落率 <i>Daily Return</i>	(B)-(A) 騰落率差 <i>Differential</i>	受益權 残存口数 <i>Unit Outstanding</i>	純資產総額 (円) <i>NAV</i>
		(per Unit)						
2020-11	26	18022.22	0.86%	18,041.8	0.85%	-0.01%	485,418	8,757,825,658
	27	18102.73	0.45%	18,120.6	0.44%	-0.01%	485,418	8,796,085,730
	30	17843.73	-1.43%	17,861.6	-1.43%	0.00%	485,418	8,670,335,496
	1	17967.74	0.69%	17,985.2	0.69%	0.00%	485,418	8,730,327,745
	2	18023.40	0.31%	18,040.9	0.31%	0.00%	485,418	8,757,381,113
	3	18010.40	-0.07%	18,028.4	-0.07%	0.00%	407,014	7,337,803,931
	4	18025.00	0.08%	18,041.7	0.07%	-0.01%	407,014	7,343,209,422
	7	17889.24	-0.75%	17,906.2	-0.75%	0.00%	407,014	7,288,075,495
	8	17863.09	-0.15%	17,879.2	-0.15%	0.00%	407,014	7,277,082,345
	9	18059.69	1.10%	18,077.2	1.11%	0.01%	407,014	7,357,689,665
	10	17958.53	-0.56%	17,975.6	-0.56%	0.00%	407,014	7,316,321,074
	11	18005.72	0.26%	18,022.5	0.26%	0.00%	407,014	7,335,415,700
	14	18079.98	0.41%	18,097.4	0.42%	0.00%	407,014	7,365,909,509
2020-12	15	18016.91	-0.35%	18,033.9	-0.35%	0.00%	407,014	7,340,031,222
	16	18065.08	0.27%	18,082.2	0.27%	0.00%	407,014	7,359,698,221
	17	18128.66	0.35%	18,146.1	0.35%	0.00%	407,014	7,385,708,492
	18	18126.23	-0.01%	18,144.6	-0.01%	0.01%	407,014	7,385,113,159
	21	18049.04	-0.43%	18,066.1	-0.43%	-0.01%	407,014	7,353,155,776
	22	17821.51	-1.26%	17,837.7	-1.26%	0.00%	407,014	7,260,180,823
	23	17894.95	0.41%	17,910.1	0.41%	-0.01%	407,014	7,289,669,498

( ) 「野村企業価値分配指數」について

野村企業価値分配指數は、野村證券株式会社が公表している指數で、その知的財産権およびその他一切の権利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、対象指數の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指數を用いて運用される当ETFの運用成果等に關し一切責任を負いません。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換口数は  
以下の通りです。

交換口数：4万口以上4万口単位

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:17]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1489)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

841,382 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

24,627,111,088 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

29,269.8 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數運動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index Exchange Traded Fund**

日経平均高配当株50指數( ) NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數運動型上場投信

Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index			NEXT FUNDS Nikkei 225 High Dividend Yield Stock 50 Index Exchange Traded Fund					
Year -Month	Day	Index Value	(A)	(B)	(B)-(A)	受益權 残存口数 Unit	純資產總額 (円) NAV	
			指數終值 NAV	日次 騰落率 Daily Return	純資產価額 (一口当たり) NAV	日次 騰落率 Daily Return	騰落率差 Return Differential	
2020-11	26	29640.36	-0.49%	29,615.3	-0.48%	0.01%	896,456	26,548,782,083
	27	29678.93	0.13%	29,652.8	0.13%	0.00%	896,456	26,582,412,237
	30	28704.49	-3.28%	28,697.1	-3.22%	0.06%	862,812	24,760,203,807
2020-12	1	29008.32	1.06%	28,994.5	1.04%	-0.02%	862,812	25,016,796,203
	2	29433.42	1.47%	29,410.7	1.44%	-0.03%	862,812	25,375,909,520
	3	29545.47	0.38%	29,519.8	0.37%	-0.01%	766,472	22,626,120,369
	4	29701.58	0.53%	29,672.3	0.52%	-0.01%	766,472	22,742,980,641
	7	29618.16	-0.28%	29,588.7	-0.28%	0.00%	806,424	23,861,043,346
	8	29525.35	-0.31%	29,496.4	-0.31%	0.00%	811,418	23,933,926,062
	9	29739.71	0.73%	29,708.6	0.72%	-0.01%	811,418	24,106,071,709
	10	29689.78	-0.17%	29,657.6	-0.17%	0.00%	811,418	24,064,670,986
	11	29758.70	0.23%	29,726.0	0.23%	0.00%	811,418	24,120,222,484
	14	29921.79	0.55%	29,887.9	0.54%	0.00%	811,418	24,251,546,092
	15	29744.04	-0.59%	29,710.2	-0.59%	0.00%	811,418	24,107,378,628
	16	29926.28	0.61%	29,891.7	0.61%	0.00%	811,418	24,254,697,227
	17	29812.82	-0.38%	29,778.2	-0.38%	0.00%	811,418	24,162,587,495
	18	30000.29	0.63%	29,965.0	0.63%	0.00%	806,425	24,164,551,158
	21	29940.70	-0.20%	29,904.7	-0.20%	0.00%	841,382	25,161,269,999
	22	29526.28	-1.38%	29,490.9	-1.38%	0.00%	841,382	24,813,071,306
	23	29305.03	-0.75%	29,269.8	-0.75%	0.00%	841,382	24,627,111,088

( )「日経平均高配当株50指數」について

「日経平均高配当株50指數」(以下「日経高配当株50」という。)は、株式会社日本経済新聞社(以下「日本経済新聞社」という。)によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日本経済新聞社は日経高配当株50自体及び日経高配当株50を算出する手法、さらには、日経高配当株50の構成銘柄の基礎となる「日経平均株価」に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。日経高配当株50を対象とする「NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數運動型上場投信」は、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、その運用及び「NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指數運動型上場投信」の取引に関して、日本経済新聞社は一切の義務ないし責任を負いません。日本経済新聞社は、日経高配当株50を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。日本経済新聞社は、日経高配当株50及び日経平均株価の計算方法、その他日経高配当株50の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:18]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1545)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS NASDAQ－100®連動型上場投信に関する日々の開示事項

### 1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

2,405,000 口

### 2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

32,104,370,619 円

### 3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

13,349.01 円

### 4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率 (2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は1,318,175.09(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:19]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1546)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

**NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株30種平均株価  
連動型上場投信に関する日々の開示事項**

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

524,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

15,896,534,910 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

30,336.90 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は3,111,107.89(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:20]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1559)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS タイ株式SET50指數連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

584,458,691 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

2,922.29 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.01 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は3,107.58(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:21]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1560)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS FTSEブルサ・マレーシアKLCI連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

120,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

493,044,584 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

4,108.70 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は41,630.17(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:22]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1570)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

**NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項**

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

5,760,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

155,202,215,657 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

26,944.83 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.39 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は22,951.40(2020年12月23日現在)です

以 上

#### ・日経平均レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注意点

日経平均レバレッジ・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の2倍となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の2倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均レバレッジ・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の2倍との差（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、N E X T F U N D S 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（日経レバレッジ指数 E T F ）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

#### ・指標の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:23]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1571)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

117,270,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

133,264,347,622 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,136.39 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.20 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は1,457.62(2020年12月23日現在)です

以 上

#### ・日経平均インバース・インデックスに内在する性質に関する注意点

日経平均インバース・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の「-1倍」（マイナス1倍）となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均インバース・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の「-1倍」とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均インバース・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の「-1倍」との差（ずれ）は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性がありますが、一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信（日経インバース指数ETF）は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

#### ・指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、日経平均の値動きと日経平均先物の値動きの差異の影響などにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

[掲載番号:24]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1577)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

3,338,187 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

64,131,694,897 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

19,211.5 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund**

野村日本株高配当70( ) NEXT FUNDS 野村日本株高配当70連動型上場投信

Nomura Japan Equity High Dividend 70			NEXT FUNDS Nomura Japan Equity High Dividend 70 Exchange Traded Fund					
Year -Month	Day	(A)	(B)	(B)-(A)	受益権 残存口数 Unit	純資産総額 (円) NAV		
		指數終値 Index Value	日次 騰落率 Daily Return	純資産価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	日次 騰落率 Daily Return	騰落率差 Return Differential		
2020-11	26	19694.97	-0.72%	19,585.4	-0.71%	0.01%	3,436,422	67,303,702,272
	27	19762.92	0.35%	19,651.8	0.34%	-0.01%	3,436,422	67,531,759,614
	30	19168.29	-3.01%	19,054.9	-3.04%	-0.03%	3,436,422	65,480,836,961
2020-12	1	19408.04	1.25%	19,289.7	1.23%	-0.02%	3,456,330	66,671,420,249
	2	19641.85	1.20%	19,518.5	1.19%	-0.02%	3,456,330	67,462,545,027
	3	19731.24	0.46%	19,605.3	0.44%	-0.01%	3,496,336	68,546,886,423
	4	19825.79	0.48%	19,698.5	0.48%	0.00%	3,398,093	66,937,171,746
	7	19747.13	-0.40%	19,620.1	-0.40%	0.00%	3,398,093	66,670,769,847
	8	19671.39	-0.38%	19,545.0	-0.38%	0.00%	3,458,116	67,588,856,227
	9	19859.60	0.96%	19,730.8	0.95%	-0.01%	3,458,116	68,231,466,027
	10	19768.72	-0.46%	19,640.2	-0.46%	0.00%	3,458,116	67,917,950,377
	11	19775.52	0.03%	19,646.7	0.03%	0.00%	3,438,124	67,547,805,741
	14	19911.84	0.69%	19,781.4	0.69%	0.00%	3,418,132	67,615,378,920
	15	19759.31	-0.77%	19,629.8	-0.77%	0.00%	3,418,132	67,097,291,636
	16	19857.88	0.50%	19,727.4	0.50%	0.00%	3,418,132	67,430,913,898
	17	19765.72	-0.46%	19,635.8	-0.46%	0.00%	3,418,132	67,117,600,758
	18	19871.24	0.53%	19,740.3	0.53%	0.00%	3,358,182	66,291,368,911
	21	19760.20	-0.56%	19,629.5	-0.56%	0.00%	3,358,182	65,919,281,163
	22	19466.44	-1.49%	19,337.7	-1.49%	0.00%	3,358,182	64,939,675,472
	23	19339.45	-0.65%	19,211.5	-0.65%	0.00%	3,338,187	64,131,694,897

( )「野村日本株高配当70」について

野村日本株高配当70は、野村證券株式会社が公表している指数で、そ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、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用される当ETFの運用成果等に關し一切責任を負いません。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:25]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1591)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

64,660,530 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,035,393,195,444 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

16,012.8 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund**

JPX日経インデックス400( ) NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

		JPX-Nikkei Index 400		NEXT FUNDS JPX-Nikkei Index 400 Exchange Traded Fund				
Year -Month	Day	(A)		(B)	(B)-(A)	受益権	純資産総額	
		指數終値	日次 騰落率	純資産価額 (一口当たり)	日次 騰落率	騰落率差	残存口数 Unit	(円) NAV
		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Differential	Outstanding	NAV
2020-11	26	16155.04	0.63%	16,203.4	0.63%	0.00%	64,750,019	1,049,170,303,389
	27	16233.44	0.49%	16,279.2	0.47%	-0.02%	64,750,019	1,054,075,460,773
	30	15954.48	-1.72%	16,000.4	-1.71%	0.01%	64,750,019	1,036,024,256,841
2020-12	1	16077.09	0.77%	16,122.9	0.77%	0.00%	64,750,019	1,043,955,553,441
	2	16130.47	0.33%	16,176.7	0.33%	0.00%	64,750,019	1,047,439,735,225
	3	16122.68	-0.05%	16,169.0	-0.05%	0.00%	64,357,595	1,040,597,989,100
	4	16136.54	0.09%	16,182.1	0.08%	0.00%	64,357,595	1,041,443,531,406
	7	16005.73	-0.81%	16,051.4	-0.81%	0.00%	64,457,566	1,034,636,169,245
	8	15972.15	-0.21%	16,016.8	-0.22%	-0.01%	64,457,566	1,032,401,283,462
	9	16149.31	1.11%	16,196.1	1.12%	0.01%	64,557,540	1,045,580,113,108
	10	16091.40	-0.36%	16,135.2	-0.38%	-0.02%	64,557,540	1,041,649,573,997
	11	16129.69	0.24%	16,174.0	0.24%	0.00%	64,657,520	1,045,771,537,379
	14	16195.06	0.41%	16,239.7	0.41%	0.00%	64,657,520	1,050,017,995,479
	15	16109.84	-0.53%	16,154.4	-0.53%	0.00%	64,757,480	1,046,119,136,227
	16	16147.92	0.24%	16,192.2	0.23%	0.00%	64,757,480	1,048,563,465,848
	17	16190.43	0.26%	16,234.7	0.26%	0.00%	64,757,480	1,051,319,958,640
	18	16191.97	0.01%	16,237.0	0.01%	0.00%	64,560,606	1,048,267,463,892
	21	16149.67	-0.26%	16,193.6	-0.27%	-0.01%	64,660,530	1,047,088,273,561
	22	15922.86	-1.40%	15,966.1	-1.40%	0.00%	64,660,530	1,032,377,982,079
	23	15969.41	0.29%	16,012.8	0.29%	0.00%	64,660,530	1,035,393,195,444

( ) 「JPX日経インデックス400」について

「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」といいます。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400指数」を算出する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属しています。

「NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び「NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信」の取引に関して、一切の責任を負いません。

「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。

「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:26]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1598)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

154,028 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

2,618,884,981 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

17,002.7 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.02 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信**  
**NEXT FUNDS Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund**

Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス(配当除く)( ) NEXT FUNDS R/Nファンダメンタル・インデックス上場投信

Russell/Nomura Fundamental Prime Index			NEXT FUNDS Russell/Nomura Fundamental Index Exchange Traded Fund					
Year -Month	Day	Index Value	(A)	(B)	(B)-(A)	受益権 残存口数 Unit Outstanding	純資産総額 (円) NAV	
			指數終値 Daily Return	純資産価額 NAV (per Unit)	日次 騰落率 Daily Return	騰落率差 Return Differential		
2020-11	26	171.13	0.02%	17,194.7	0.04%	0.01%	154,028	2,648,463,831
	27	171.28	0.08%	17,206.4	0.07%	-0.01%	154,028	2,650,274,214
	30	166.84	-2.59%	16,767.4	-2.55%	0.04%	154,028	2,582,654,621
	1	168.56	1.03%	16,937.2	1.01%	-0.02%	154,028	2,608,807,661
	2	170.30	1.04%	17,108.6	1.01%	-0.02%	154,028	2,635,199,502
	3	170.94	0.37%	17,170.9	0.36%	-0.01%	154,028	2,644,794,118
	4	171.53	0.35%	17,227.1	0.33%	-0.02%	154,028	2,653,463,240
	7	170.35	-0.69%	17,109.3	-0.68%	0.00%	154,028	2,635,309,093
	8	169.68	-0.39%	17,041.7	-0.40%	0.00%	154,028	2,624,896,243
	9	171.76	1.22%	17,251.4	1.23%	0.01%	154,028	2,657,198,359
2020-12	10	171.57	-0.11%	17,229.5	-0.13%	-0.01%	154,028	2,653,824,729
	11	172.14	0.33%	17,285.7	0.33%	-0.01%	154,028	2,662,484,851
	14	173.38	0.72%	17,409.7	0.72%	-0.01%	154,028	2,681,580,417
	15	172.35	-0.60%	17,305.5	-0.60%	0.00%	154,028	2,665,529,385
	16	173.19	0.49%	17,389.9	0.49%	0.00%	154,028	2,678,532,945
	17	172.53	-0.38%	17,326.1	-0.37%	0.01%	154,028	2,668,707,405
	18	173.32	0.46%	17,404.0	0.45%	-0.01%	154,028	2,680,704,117
	21	172.94	-0.22%	17,364.1	-0.23%	-0.01%	154,028	2,674,550,210
	22	170.37	-1.49%	17,106.0	-1.49%	0.00%	154,028	2,634,808,305
	23	169.31	-0.62%	17,002.7	-0.60%	0.02%	154,028	2,618,884,981

( ) 「Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックス」について

Russell/Nomura ファンダメンタル・プライム・インデックスは野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社、Russell InvestmentsおよびResearch Affiliates, LLCに帰属します。なお、野村證券株式会社、Russell InvestmentsおよびResearch Affiliates, LLCは、当インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当インデックスを用いて行う事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換口数は  
以下の通りです。

交換口数：10万口以上10万口単位

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:27]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1615)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 東証銀行業株価指数連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

319,377,166 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

38,641,706,945 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

120.99 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.01 %

「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」は、2020年9月30日に名称が変更され、「NEXT FUNDS 東証銀行業株価指数連動型上場投信」となりました。

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)
6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 東証銀行業株価指数連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS TOPIX Banks Exchange Traded Fund**

東証銀行業株価指数( ) TOPIX Banks Index				NEXT FUNDS 東証銀行業株価指数連動型上場投信 NEXT FUNDS TOPIX Banks Exchange Traded Fund				
Year -Month	Day	(A) 指數終値 Index Value	日次 騰落率 Daily Return	(B) 純資產価額 (一口当たり) NAV (per Unit)	日次 騰落率 Daily Return	(B) - (A) 騰落率差 Return Differential	受益權 残存口数 Unit Outstanding	純資產総額 (円) NAV
2020-11	26	125.04	-0.18%	129.23	-0.19%	0.00%	151,656,066	19,599,122,452
	27	123.80	-0.99%	127.98	-0.97%	0.02%	153,655,266	19,664,800,337
	30	119.18	-3.73%	123.31	-3.65%	0.08%	153,655,266	18,947,535,020
2020-12	1	119.88	0.59%	124.02	0.58%	-0.01%	155,650,866	19,303,791,605
	2	121.29	1.18%	125.46	1.16%	-0.02%	247,460,966	31,046,054,527
	3	121.02	-0.22%	125.18	-0.22%	0.00%	247,460,966	30,977,434,442
	4	120.83	-0.16%	124.98	-0.16%	0.00%	252,454,166	31,552,502,914
	7	119.96	-0.72%	124.10	-0.70%	0.02%	252,454,166	31,329,572,264
	8	119.00	-0.80%	123.11	-0.80%	0.00%	318,378,366	39,196,579,740
	9	119.15	0.13%	123.26	0.12%	0.00%	318,378,366	39,243,116,241
	10	118.46	-0.58%	122.56	-0.57%	0.01%	318,378,366	39,019,780,061
	11	120.01	1.31%	124.14	1.29%	-0.02%	318,378,366	39,524,817,274
	14	120.67	0.55%	124.82	0.55%	0.00%	318,378,366	39,739,303,160
	15	119.46	-1.00%	123.58	-0.99%	0.01%	318,378,366	39,343,765,815
	16	119.70	0.20%	123.83	0.20%	0.00%	319,377,166	39,546,923,283
	17	118.85	-0.71%	122.95	-0.71%	0.00%	319,377,166	39,266,199,669
	18	119.29	0.37%	123.40	0.37%	0.00%	319,377,166	39,412,345,338
	21	120.10	0.68%	124.22	0.66%	-0.01%	319,377,166	39,674,550,319
	22	118.46	-1.37%	122.55	-1.34%	0.02%	319,377,166	39,139,383,631
	23	116.94	-1.28%	120.99	-1.27%	0.01%	319,377,166	38,641,706,945

( )「東証銀行業株価指数」について

東証銀行業株価指数の指数值および東証銀行業株価指数の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指數の算出、指數値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利及び東証銀行業株価指数の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有する。

東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指數値の算出若しくは公表の方法の変更、東証銀行業株価指数の指數値の算出若しくは公表の停止又は東証銀行業株価指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではない。

東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指數値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また東京証券取引所は、東証銀行業株価指数の指數値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」は、東証銀行業株価指数の指數値に連動した投資成果を目標として運用するが、

「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の純資產価額と東証銀行業株価指数の間に乖離が発生することがある。

「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。

東京証券取引所は「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の購入者又は公衆に対し、「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。

以上の項目に限らず、東京証券取引所は「東証銀行業株価指数連動型上場投資信託」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ない。

(i) The TOPIX Banks and TOPIX Index Value and the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks are the intellectual property rights owned by the Tokyo Stock Exchange. All rights relating to the TOPIX Banks and TOPIX, including calculation, publication and use of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value as well as those relating to the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks belong to the Tokyo Stock Exchange. (ii) The Tokyo Stock Exchange reserves the rights to change the methods of calculation or publication, to cease the calculation or publication of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value or to change the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks or cease the use thereof. (iii) The Tokyo Stock Exchange makes no warranty or representation as to the results derived from the use of the TOPIX Banks and TOPIX Trademarks. (iv) The Tokyo Stock Exchange does not guarantee the accuracy or completeness of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value and data contained therein. Further, the Tokyo Stock Exchange shall not be liable for the miscalculation, incorrect publication, delayed or interrupted publication of the TOPIX Banks and TOPIX Index Value. (v) There is a possibility that the net asset value of the TOPIX Banks ETF may be substantially deviated from the TOPIX Banks although the investment objective of the TOPIX Banks ETF is to seek investment results that generally correspond to the TOPIX Banks Index Value. (vi) The TOPIX Banks ETF is not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Tokyo Stock Exchange. (vii) The Tokyo Stock Exchange does not bear any obligation to give an explanation of the TOPIX Banks ETF or an advice on investments in the TOPIX Banks ETF to any purchaser of the TOPIX Banks ETF or to the public. (viii) Including but not limited to the foregoing, the Tokyo Stock Exchange shall not be responsible for any damage resulting from the issue and sale of the TOPIX Banks ETF.

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:28]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1678)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

37,490,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

6,370,112,657 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

169.91 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.43 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は18,987.48(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:29]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1682)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 日経・JPX白金指数連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

2,290,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

411,111,403 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

179.52 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.01 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は195.31(2020年12月23日現在)です

「日経・東商取白金指数」は、「日経・JPX白金指数」に名称が  
変更となりました。

「NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信」は、  
2020年7月27日に名称が変更され、「NEXT FUNDS 日経・JPX  
白金指数連動型上場投信」となりました。

以 上

#### <対象指数と商品の現物価格を参照する指標の差異について>

対象指数は、商品の現物価格ではなく、商品先物取引の価格を参照しています。商品先物取引の価格に織り込まれる（商品を受渡すまでの）保管コストは、商品先物取引の値動きに減価要因として寄与することから、対象指数の値動きは、商品の現物価格を参照した場合の値動きを下回ることがあります。

#### <商品先物取引の特性とロールオーバーの影響について>

商品先物取引においては、通常、需給動向や保管コスト等が織り込まれて、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに価格差が生じます。

限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が高い状態（以下「コンタンゴ（順鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて減価の影響を受けます。この場合、対象指数は、参考する先物取引を次限月以降の限月に乗換えること（以下「ロールオーバー」といいます。）を定期的に繰り返すことから、継続的に減価の影響を受けることになります。

一方、限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が低い状態（「バックワードーション（逆鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて増価の影響を受けます。この場合、対象指数は、参考する先物取引のロールオーバーを定期的に繰り返すことから、継続的に増価の影響を受けることになります。

#### <留意すべき投資スタイル>

（中長期的な投資）

上記のとおり、商品先物取引は、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに形成される価格の違いにより、対象指数が受ける影響が異なります。

特に、商品先物市場がコンタンゴ（順鞘）の場合、対象指数は時間の経過とともに継続的に減価の影響を受けるため、中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。

[掲載番号:30]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 1699)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス 連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

514,390,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

59,190,622,525 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

115.07 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.01 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は21,803.81(2020年12月23日現在)です

以 上

#### <対象指数と商品の現物価格を参照する指標の差異について>

対象指標は、商品の現物価格ではなく、商品先物取引の価格を参考しています。商品先物取引の価格に織り込まれる（商品を受渡すまでの）保管コストは、商品先物取引の値動きに減価要因として寄与することから、対象指標の値動きは、商品の現物価格を参考した場合の値動きを下回ることがあります。

#### <商品先物取引の特性とロールオーバーの影響について>

商品先物取引においては、通常、需給動向や保管コスト等が織り込まれて、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに価格差が生じます。

限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が高い状態（以下「コンタンゴ（順鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて減価の影響を受けます。この場合、対象指標は、参考する先物取引を次限月以降の限月に乗換えること（以下「ロールオーバー」といいます。）を定期的に繰り返すことから、継続的に減価の影響を受けることになります。

一方、限月までの期間が短い先物取引の価格よりも限月までの期間が長い先物取引の価格の方が低い状態（「バックワーデーション（逆鞘）」といいます。）の場合、先物価格は、時間の経過とともに受渡し期限に近づくにつれて増価の影響を受けます。この場合、対象指標は、参考する先物取引のロールオーバーを定期的に繰り返すことから、継続的に増価の影響を受けることになります。

#### <留意すべき投資スタイル>

（中長期的な投資）

上記のとおり、商品先物取引は、限月（商品の受渡し期限の月）ごとに形成される価格の違いにより、対象指標が受ける影響が異なります。

特に、商品先物市場がコンタンゴ（順鞘）の場合、対象指標は時間の経過とともに継続的に減価の影響を受けるため、中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。

[掲載番号:31]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2510)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

3,480,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

3,478,124,095 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

999.46 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は387.98(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:32]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2511)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

8,410,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

8,440,361,297 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,003.61 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は496.23(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:33]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2512)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジあり)  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

12,790,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

13,544,070,942 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,058.96 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.01 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は430.12(2020年12月23日現在)です

以 上

#### **<価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異>**

対象指数は、外貨建資産について一定のルールに基づいて対円で為替ヘッジを行なった場合の値動きを表します。そのため、為替ヘッジを行なわない場合と比較して為替変動の影響が低減し、現地通貨建ての指数と類似した値動きとなります。ただし、一定のルールの下では、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、対象指数は、為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムの影響を受けるため、現地通貨建ての指数とは値動きに差異が生じます。

#### **<為替ヘッジコスト／プレミアムについて>**

為替ヘッジで用いる為替予約取引等において、その取引価格には、対象通貨間の金利差等に応じた為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムが反映されます。例えば、対円で為替ヘッジを行なう場合、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジコストが発生します。また、逆に円金利がヘッジ対象通貨の金利より高い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジプレミアムが発生します。また、為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジコスト（もしくは為替ヘッジプレミアム）が予想以上に高くなる場合があります。

#### **<留意すべき投資スタイル等>**

為替ヘッジにより為替変動リスクが低減するため、円建ての投資成果については、為替変動の影響が低減したものとなります。

[掲載番号:34]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2513)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 外国株式・MSCI KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

2,760,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

3,370,899,788 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,221.34 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.03 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は1,413,875.90(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:35]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2514)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジあり)連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

1,200,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

1,537,273,630 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,281.06 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は1,073.32(2020年12月23日現在)です

以 上

#### **<価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異>**

対象指数は、外貨建資産について一定のルールに基づいて対円で為替ヘッジを行なった場合の値動きを表します。そのため、為替ヘッジを行なわない場合と比較して為替変動の影響が低減し、現地通貨建ての指数と類似した値動きとなります。ただし、一定のルールの下では、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、対象指数は、為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムの影響を受けるため、現地通貨建ての指数とは値動きに差異が生じます。

#### **<為替ヘッジコスト／プレミアムについて>**

為替ヘッジで用いる為替予約取引等において、その取引価格には、対象通貨間の金利差等に応じた為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムが反映されます。例えば、対円で為替ヘッジを行なう場合、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジコストが発生します。また、逆に円金利がヘッジ対象通貨の金利より高い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジプレミアムが発生します。また、為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジコスト（もしくは為替ヘッジプレミアム）が予想以上に高くなる場合があります。

#### **<留意すべき投資スタイル等>**

為替ヘッジにより為替変動リスクが低減するため、円建ての投資成果については、為替変動の影響が低減したものとなります。

[掲載番号:36]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2515)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)  
連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

5,390,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

4,794,693,135 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

889.55 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.04 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は121,122.76(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:37]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2518)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指數(セレクト)連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

4,560,806 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

4,695,378,166 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,029.51 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)  
(別紙参照)
6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)  
(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指數（セレクト）運動型上場投信**  
**NEXT FUNDS MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund**

MSCI日本株女性活躍指數（セレクト）( ) NEXT FUNDS MSCI日本株女性活躍指數（セレクト）運動型上場投信

		NEXT FUNDS MSCI Japan Empowering Women Select Index Exchange Traded Fund						
Year -Month	Day	(A)		(B)		受益權 残存口数 <i>Unit</i>	純資產総額 (円) <i>NAV</i>	
		指數終値 <i>Index Value</i>	日次 騰落率 <i>Daily Return</i>	純資產価額 (一口当たり) <i>NAV</i>	日次 騰落率 <i>Daily Return</i>			
				(per Unit)	Differential			
2020-11	26	2245.38	0.67%	1,054.04	0.66%	-0.01%	6,034,081	6,360,191,352
	27	2253.55	0.36%	1,057.84	0.36%	0.00%	6,034,081	6,383,094,547
	30	2220.29	-1.48%	1,042.08	-1.49%	-0.01%	5,541,370	5,774,536,040
2020-12	1	2233.56	0.60%	1,048.18	0.59%	-0.01%	5,541,370	5,808,373,564
	2	2231.67	-0.08%	1,047.31	-0.08%	0.00%	5,541,370	5,803,505,286
	3	2227.88	-0.17%	1,045.54	-0.17%	0.00%	4,560,806	4,768,508,465
	4	2222.87	-0.23%	1,043.18	-0.23%	0.00%	4,560,806	4,757,761,625
	7	2207.54	-0.69%	1,036.03	-0.69%	0.00%	4,560,806	4,725,139,069
	8	2204.58	-0.13%	1,034.64	-0.13%	0.00%	4,560,806	4,718,775,324
	9	2223.03	0.84%	1,043.28	0.84%	0.00%	4,560,806	4,758,175,762
	10	2211.08	-0.54%	1,037.68	-0.54%	0.00%	4,560,806	4,732,662,641
	11	2216.25	0.23%	1,040.11	0.23%	0.00%	4,560,806	4,743,730,633
	14	2222.34	0.27%	1,042.94	0.27%	0.00%	4,560,806	4,756,661,052
	15	2209.80	-0.56%	1,037.05	-0.56%	0.00%	4,560,806	4,729,799,709
	16	2210.52	0.03%	1,037.41	0.03%	0.00%	4,560,806	4,731,406,295
	17	2216.45	0.27%	1,040.16	0.27%	0.00%	4,560,806	4,743,988,594
	18	2211.84	-0.21%	1,038.02	-0.21%	0.00%	4,560,806	4,734,229,419
	21	2208.90	-0.13%	1,036.62	-0.13%	0.00%	4,560,806	4,727,829,701
	22	2178.67	-1.37%	1,022.44	-1.37%	0.00%	4,560,806	4,663,167,501
	23	2193.80	0.69%	1,029.51	0.69%	0.00%	4,560,806	4,695,378,166

( ) 「MSCI日本株女性活躍指數（セレクト）」について

「MSCI日本株女性活躍指數（セレクト）」は、MSCIが開発した指數です。同指數に対する著作権、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、同指數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。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換口数は  
以下の通りです。

交換口数：50万口以上50万口単位

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:38]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2519)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・  
ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信  
に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

590,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

607,166,238 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,029.10 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.01 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は98,429.14(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:39]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2520)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・  
インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

540,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

600,522,869 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,112.08 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.01 %

乖離率の算定基礎となる円換算対象指数の終値は305,389.47(2020年12月23日現在)です

以 上

[掲載番号:40]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2529)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

## NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信 に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

6,872,738 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

6,425,515,286 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

934.93 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

0.00 %

5. 交換に係る交換口数  
(交換可能日分のみ)

(別紙参照)

6. 設定に係る株式のポートフォリオ  
(設定可能日分のみ)

(別紙参照)

以 上

**NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信**  
**NEXT FUNDS Nomura Shareholder Yield 70 Exchange Traded Fund**

野村株主還元70( ) NEXT FUNDS 野村株主還元70連動型上場投信

		Nomura Shareholder Yield 70		NEXT FUNDS Nomura Shareholder Yield 70 Exchange Traded Fund				
Year -Month	Day	(A) 指數終値 <i>Index Value</i>	日次 騰落率 <i>Daily Return</i>	純資産価額 (一口当たり) <i>NAV</i>	(B) 日次 騰落率 <i>Daily Return</i>	(B)-(A) 騰落率差 <i>Differential</i>	受益権 残存口数 <i>Unit Outstanding</i>	純資産総額 (円) <i>NAV</i>
		Index Value	Daily Return	NAV (per Unit)	Daily Return	Differential	Unit Outstanding	NAV
		17108.67	-0.24%	945.69	-0.24%	0.00%	7,961,167	7,528,829,687
2020-11	26	17148.30	0.23%	947.85	0.23%	0.00%	6,872,738	6,514,294,155
	27	16734.99	-2.41%	925.29	-2.38%	0.03%	6,872,738	6,359,241,820
	30	16902.38	1.00%	934.40	0.98%	-0.02%	6,872,738	6,421,858,046
	1	17065.82	0.97%	943.29	0.95%	-0.02%	6,872,738	6,482,985,384
	2	17161.00	0.56%	948.49	0.55%	-0.01%	6,872,738	6,518,754,590
	3	17220.26	0.35%	951.74	0.34%	0.00%	6,872,738	6,541,053,318
	7	17109.52	-0.64%	945.62	-0.64%	0.00%	6,872,738	6,498,988,253
	8	17051.02	-0.34%	942.39	-0.34%	0.00%	6,872,738	6,476,809,795
	9	17230.95	1.06%	952.29	1.05%	0.00%	6,872,738	6,544,828,818
	10	17181.79	-0.29%	949.56	-0.29%	0.00%	6,872,738	6,526,067,645
	11	17207.01	0.15%	950.94	0.15%	0.00%	6,872,738	6,535,559,895
	14	17311.76	0.61%	956.70	0.61%	0.00%	6,872,738	6,575,138,219
	15	17188.28	-0.71%	949.87	-0.71%	0.00%	6,872,738	6,528,198,990
	16	17279.38	0.53%	954.89	0.53%	0.00%	6,872,738	6,562,698,957
	17	17195.81	-0.48%	950.27	-0.48%	0.00%	6,872,738	6,530,941,193
	18	17310.22	0.67%	956.57	0.66%	0.00%	6,872,738	6,574,269,855
	21	17218.75	-0.53%	951.49	-0.53%	0.00%	6,872,738	6,539,355,777
	22	16982.43	-1.37%	938.43	-1.37%	0.00%	6,872,738	6,449,597,975
	23	16919.09	-0.37%	934.93	-0.37%	0.00%	6,872,738	6,425,515,286

( )「野村株主還元70」について

野村株主還元70の知的財産権およびその他一切の権利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、野村株主還元70の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、野村株主還元70を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関する一切責任を負いません。

2020年12月24日

### 交換に係わる交換口数

交換申込日(2020年12月28日)、交換受付日(2020年12月29日)分の交換は  
交換不可日のため受け付けておりません。

### 設定ポートフォリオ

設定申込日(2020年12月28日)、設定受付日(2020年12月29日)分の設定は  
設定不可日のため受け付けておりません。

以上

[掲載番号:41]  
各 位

2020年12月24日

会 社 名 野村アセットマネジメント株式会社  
代 表 者 名 CEO兼代表取締役社長 中川 順子  
(コード番号 2554)  
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳  
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS ブルームバーグ・バークレイズ米国投資適格社債(1-10年)  
インデックス(為替ヘッジあり)連動型上場投信に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数(2020年12月23日現在)

660,000 口

2. 上場ETFの純資産総額(2020年12月23日現在)

678,353,917 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額(2020年12月23日現在)

1,027.81 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指数の終値の変動率に係る乖離率  
(2020年12月23日現在)

-0.02 %

乖離率の算定基礎となる対象指数の終値は240.96(2020年12月23日現在)です

以 上

#### **<価格形成及び為替ヘッジがない場合との差異>**

対象指数は、外貨建資産について一定のルールに基づいて対円で為替ヘッジを行なった場合の値動きを表します。そのため、為替ヘッジを行なわない場合と比較して為替変動の影響が低減し、現地通貨建ての指数と類似した値動きとなります。ただし、一定のルールの下では、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、対象指数は、為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムの影響を受けるため、現地通貨建ての指数とは値動きに差異が生じます。

#### **<為替ヘッジコスト／プレミアムについて>**

為替ヘッジで用いる為替予約取引等において、その取引価格には、対象通貨間の金利差等に応じた為替ヘッジコストもしくは為替ヘッジプレミアムが反映されます。例えば、対円で為替ヘッジを行なう場合、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジコストが発生します。また、逆に円金利がヘッジ対象通貨の金利より高い場合には、その金利差相当分の為替ヘッジプレミアムが発生します。また、為替及び金利の動向等によっては、為替ヘッジコスト（もしくは為替ヘッジプレミアム）が予想以上に高くなる場合があります。

#### **<留意すべき投資スタイル等>**

為替ヘッジにより為替変動リスクが低減するため、円建ての投資成果については、為替変動の影響が低減したものとなります。