

2023年8月期 決算短信 (2023年2月16日～2023年8月15日)

2023年9月21日

ファンド名	NZAM 上場投信 日経 225	上場取引所	東証
コード番号	2525	売買単位	1口
連動対象指標	日経平均株価		
主要投資資産	株式		
管理会社	農林中金全共連アセットマネジメント株式会社		
URL	https://www.ja-asset.co.jp/		
代表者	代表取締役社長	牛窪	克彦
問合せ先責任者	企画部 ディスクロージャーグループ	田原	輝行 (TEL) 03-5210-8692
有価証券報告書提出予定日	2023年11月15日		
分配金支払開始予定日	2023年9月22日		

I ファンドの運用状況

1. 2023年8月期の運用状況 (2023年2月16日～2023年8月15日)

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2023年8月期	196,924	(98.7)	2,605	(1.3)	199,530	(100.0)
2023年2月期	172,674	(97.9)	3,733	(2.1)	176,408	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数 (①)	設定口数 (②)	交換口数 (③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2023年8月期	6,360	405	637	6,129
2023年2月期	6,417	399	456	6,360

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③) (①-②)	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
2023年8月期	201,520	1,990	199,530	32,555
2023年2月期	178,285	1,877	176,408	27,734

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2023年8月期	296
2023年2月期	260

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

2. 会計方針の変更

- | | |
|-----------------|---|
| ① 会計基準等の改正に伴う変更 | 無 |
| ② ①以外の変更 | 無 |

II 財務諸表等

NZAM 上場投信 日経 225

(1) 【貸借対照表】

	第8期 2023年2月15日現在	第9期 2023年8月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,051,829,135	4,151,643,901
株式	172,674,713,000	196,924,566,870
派生商品評価勘定	19,762,620	10,484,600
未収入金	-	7,624,480
未収配当金	292,685,000	225,419,000
前払金	-	8,060,000
差入委託証拠金	246,390,000	192,960,000
流動資産合計	178,285,379,755	201,520,758,851
資産合計	178,285,379,755	201,520,758,851
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,260,240	5,821,320
前受金	20,711,200	-
未払金	12,026,400	-
未払収益分配金	1,653,770,560	1,814,194,360
未払受託者報酬	48,721,553	50,937,950
未払委託者報酬	82,826,576	86,594,460
未払利息	3,857	4,735
その他未払費用	38,708,417	33,117,906
流動負債合計	1,877,028,803	1,990,670,731
負債合計	1,877,028,803	1,990,670,731
純資産の部		
元本等		
元本	132,835,939,904	127,998,766,940
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	43,572,411,048	71,531,321,180
(分配準備積立金)	4,431,215	3,853,718
元本等合計	176,408,350,952	199,530,088,120
純資産合計	176,408,350,952	199,530,088,120
負債純資産合計	178,285,379,755	201,520,758,851

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第8期	第9期
	自 2022年8月16日 至 2023年2月15日	自 2023年2月16日 至 2023年8月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,828,359,920	1,984,954,376
受取利息	12,450	26,256
有価証券売買等損益	△7,969,453,923	28,885,554,470
派生商品取引等損益	△255,393,010	669,756,020
その他収益	53,954	94,674
営業収益合計	△6,396,420,609	31,540,385,796
営業費用		
支払利息	963,330	753,474
受託者報酬	48,721,553	50,937,950
委託者報酬	82,826,576	86,594,460
その他費用	38,888,915	33,172,559
営業費用合計	171,400,374	171,458,443
営業利益又は営業損失 (△)	△6,567,820,983	31,368,927,353
経常利益又は経常損失 (△)	△6,567,820,983	31,368,927,353
当期純利益又は当期純損失 (△)	△6,567,820,983	31,368,927,353
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 (△)	52,658,078,704	43,572,411,048
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,528,696,039	4,763,853,197
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,528,696,039	4,763,853,197
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,392,772,152	6,359,676,058
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,392,772,152	6,359,676,058
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1,653,770,560	1,814,194,360
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	43,572,411,048	71,531,321,180

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、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、原則として計算期間末日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。 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。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第8期 (2023年2月15日現在)	第9期 (2023年8月15日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

項目		第8期 2023年2月15日現在	第9期 2023年8月15日現在
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	134,014,444,908円	132,835,939,904円
	期中追加設定元本額	8,345,058,444円	8,467,668,408円
	期中一部交換元本額	9,523,563,448円	13,304,841,372円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	6,360,656口	6,129,035口
3.	1口当たり純資産額	27,734円	32,555円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期 自2022年8月16日 至2023年2月15日		第9期 自2023年2月16日 至2023年8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	1,827,462,994円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,175,825円	B. 分配準備積立金額	4,431,215円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,828,638,819円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,988,753,047円
	D. 経費	170,437,044円	D. 経費	170,704,969円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,658,201,775円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,818,048,078円
	F. 収益分配金	1,653,770,560円	F. 収益分配金	1,814,194,360円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	4,431,215円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	3,853,718円
	H. 口数	6,360,656口	H. 口数	6,129,035口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	260円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	296円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	第8期 自 2022年8月16日 至 2023年2月15日	第9期 自 2023年2月16日 至 2023年8月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権等であります。 当ファンドが保有する有価証券は、全て売買目的で保有しており、デリバティブ取引は、ヘッジ目的以外にも利用する場合があります。また、これらの詳細は、「(重要な会計方針に係る事項に関する注記) 有価証券の評価基準及び評価方法、デリバティブ等の評価基準及び評価方法」に記載しております。 当該金融商品は、株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、価格変動リスク等に晒されています。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っています。 ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、運用管理会議を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。	フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っています。 ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、コンプライアンス委員会を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 2023年2月15日現在	第9期 2023年8月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計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。	同左
2. 時価の算定方法	株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 先物取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権 短期で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

第8期(自 2022年8月16日 至 2023年2月15日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△7,355,830,690
合計	△7,355,830,690

第9期(自 2023年2月16日 至 2023年8月15日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	27,036,069,325
合計	27,036,069,325

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第8期 (2023年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,595,108,800	—	3,594,640,000	△468,800
合計		3,595,108,800	—	3,594,640,000	△468,800

第9期 (2023年8月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,446,320,000	—	2,451,000,000	4,680,000
合計		2,446,320,000	—	2,451,000,000	4,680,000

(注) 時価の算定方法

1. 先物取引の時価評価については、原則として計算日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。
2. 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額は含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

①株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
ニッセイ	207,000	766.00	158,562,000	
I N P E X	82,800	2,025.00	167,670,000	
コムシスホールディングス	207,000	3,134.00	648,738,000	
大成建設	41,400	4,833.00	200,086,200	
大林組	207,000	1,270.00	262,890,000	
清水建設	207,000	990.30	204,992,100	
長谷工コーポレーション	41,400	1,763.00	72,988,200	
鹿島建設	103,500	2,302.50	238,308,750	
大和ハウス工業	207,000	3,867.00	800,469,000	
積水ハウス	207,000	2,893.00	598,851,000	
日揮ホールディングス	207,000	1,975.50	408,928,500	
日清製粉グループ本社	207,000	1,788.50	370,219,500	
明治ホールディングス	82,800	3,711.00	307,270,800	
日本ハム	103,500	4,408.00	456,228,000	
サッポロホールディングス	41,400	4,094.00	169,491,600	
アサヒグループホールディングス	207,000	5,570.00	1,152,990,000	
キリンホールディングス	207,000	2,003.00	414,621,000	
宝ホールディングス	207,000	1,297.50	268,582,500	
キッコーマン	207,000	7,900.00	1,635,300,000	
味の素	207,000	5,843.00	1,209,501,000	
ニチレイ	103,500	3,377.00	349,519,500	
日本たばこ産業	207,000	3,103.00	642,321,000	
帝人	41,400	1,471.00	60,899,400	
東レ	207,000	800.00	165,600,000	
王子ホールディングス	207,000	585.90	121,281,300	
日本製紙	20,700	1,261.00	26,102,700	
クラレ	207,000	1,471.50	304,600,500	
旭化成	207,000	931.60	192,841,200	
レゾナック・ホールディングス	20,700	2,310.00	47,817,000	
住友化学	207,000	405.50	83,938,500	
日産化学	207,000	6,358.00	1,316,106,000	
東ソー	103,500	1,854.50	191,940,750	

トクヤマ	41,400	2,325.00	96,255,000
デンカ	41,400	2,623.00	108,592,200
信越化学工業	1,035,000	4,559.00	4,718,565,000
三井化学	41,400	4,108.00	170,071,200
三菱ケミカルグループ	103,500	857.80	88,782,300
UBE	20,700	2,464.00	51,004,800
花王	207,000	5,751.00	1,190,457,000
DIC	20,700	2,462.00	50,963,400
富士フイルムホールディングス	207,000	8,341.00	1,726,587,000
資生堂	207,000	6,374.00	1,319,418,000
日東電工	207,000	9,709.00	2,009,763,000
協和キリン	207,000	2,706.00	560,142,000
武田薬品工業	207,000	4,449.00	920,943,000
アステラス製薬	1,035,000	2,213.50	2,290,972,500
住友ファーマ	207,000	505.00	104,535,000
塩野義製薬	207,000	6,309.00	1,305,963,000
中外製薬	621,000	4,288.00	2,662,848,000
エーザイ	207,000	9,535.00	1,973,745,000
第一三共	621,000	4,381.00	2,720,601,000
大塚ホールディングス	207,000	5,618.00	1,162,926,000
出光興産	82,800	3,058.00	253,202,400
ENEOSホールディングス	207,000	532.00	110,124,000
横浜ゴム	103,500	2,952.00	305,532,000
ブリヂストン	207,000	5,592.00	1,157,544,000
AGC	41,400	4,888.00	202,363,200
日本板硝子	20,700	806.00	16,684,200
日本電気硝子	62,100	2,505.00	155,560,500
住友大阪セメント	20,700	4,045.00	83,731,500
太平洋セメント	20,700	2,822.00	58,415,400
東海カーボン	207,000	1,133.00	234,531,000
TOTO	103,500	3,951.00	408,928,500
日本碍子	207,000	1,911.00	395,577,000
日本製鉄	20,700	3,390.00	70,173,000
神戸製鋼所	20,700	1,770.00	36,639,000
JFEホールディングス	20,700	2,251.00	46,595,700
大太平洋金属	20,700	1,497.00	30,987,900
三井金属鉱業	20,700	3,550.00	73,485,000
三菱マテリアル	20,700	2,360.00	48,852,000

住友金属鉱山	103,500	4,436.00	459,126,000
DOWAホールディングス	41,400	4,649.00	192,468,600
古河電気工業	20,700	2,385.00	49,369,500
住友電気工業	207,000	1,780.50	368,563,500
フジクラ	207,000	1,164.00	240,948,000
SUMCO	20,700	1,900.50	39,340,350
日本製鋼所	41,400	2,998.50	124,137,900
オークマ	41,400	6,802.00	281,602,800
アマダ	207,000	1,446.50	299,425,500
SMC	20,700	70,440.00	1,458,108,000
小松製作所	207,000	4,057.00	839,799,000
住友重機械工業	41,400	3,454.00	142,995,600
日立建機	207,000	4,323.00	894,861,000
クボタ	207,000	2,194.50	454,261,500
荏原製作所	41,400	6,786.00	280,940,400
ダイキン工業	207,000	24,680.00	5,108,760,000
日本精工	207,000	845.20	174,956,400
NTN	207,000	290.30	60,092,100
ジェイテクト	207,000	1,280.00	264,960,000
三井E&S	20,700	490.00	10,143,000
日立造船	41,400	861.00	35,645,400
三菱重工業	20,700	7,771.00	160,859,700
IHI	20,700	3,473.00	71,891,100
コニカミノルタ	207,000	464.10	96,068,700
ミネベアミツミ	207,000	2,504.00	518,328,000
日立製作所	41,400	9,350.00	387,090,000
三菱電機	207,000	1,844.00	381,708,000
富士電機	41,400	6,652.00	275,392,800
安川電機	207,000	5,768.00	1,193,976,000
ニデック	165,600	7,786.00	1,289,361,600
オムロン	207,000	7,013.00	1,451,691,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,400	2,681.50	111,014,100
日本電気	20,700	7,263.00	150,344,100
富士通	20,700	18,140.00	375,498,000
ルネサスエレクトロニクス	207,000	2,462.50	509,737,500
セイコーエプソン	414,000	2,353.50	974,349,000
パナソニック ホールディングス	207,000	1,609.00	333,063,000
シャープ	207,000	880.70	182,304,900

ソニーグループ	207,000	12,220.00	2,529,540,000
TDK	621,000	5,177.00	3,214,917,000
アルプスアルパイン	207,000	1,185.50	245,398,500
横河電機	207,000	2,837.50	587,362,500
アドバンテスト	414,000	18,120.00	7,501,680,000
キーエンス	20,700	59,790.00	1,237,653,000
カシオ計算機	207,000	1,276.00	264,132,000
ファナック	1,035,000	4,094.00	4,237,290,000
京セラ	414,000	7,334.00	3,036,276,000
太陽誘電	207,000	4,007.00	829,449,000
村田製作所	165,600	8,072.00	1,336,723,200
SCREENホールディングス	41,400	14,485.00	599,679,000
キヤノン	310,500	3,579.00	1,111,279,500
リコー	207,000	1,193.00	246,951,000
東京エレクトロン	621,000	20,610.00	12,798,810,000
デンソー	207,000	9,752.00	2,018,664,000
川崎重工業	20,700	3,588.00	74,271,600
日産自動車	207,000	608.80	126,021,600
いすゞ自動車	103,500	1,778.50	184,074,750
トヨタ自動車	1,035,000	2,419.00	2,503,665,000
日野自動車	207,000	579.30	119,915,100
三菱自動車工業	20,700	566.10	11,718,270
マツダ	41,400	1,411.50	58,436,100
本田技研工業	414,000	4,503.00	1,864,242,000
スズキ	207,000	5,232.00	1,083,024,000
SUBARU	207,000	2,620.50	542,443,500
ヤマハ発動機	207,000	3,828.00	792,396,000
テルモ	828,000	4,315.00	3,572,820,000
ニコン	207,000	1,532.50	317,227,500
オリンパス	828,000	1,970.00	1,631,160,000
HOYA	103,500	16,265.00	1,683,427,500
シチズン時計	207,000	880.00	182,160,000
バンダイナムコホールディングス	621,000	3,412.00	2,118,852,000
凸版印刷	103,500	3,276.00	339,066,000
大日本印刷	103,500	3,909.00	404,581,500
ヤマハ	207,000	4,580.00	948,060,000
任天堂	207,000	6,294.00	1,302,858,000
東京電力ホールディングス	20,700	600.90	12,438,630

中部電力	20,700	1,826.00	37,798,200
関西電力	20,700	1,900.00	39,330,000
東京瓦斯	41,400	3,289.00	136,164,600
大阪瓦斯	41,400	2,282.50	94,495,500
東武鉄道	41,400	4,017.00	166,303,800
東急	103,500	1,847.50	191,216,250
小田急電鉄	103,500	2,184.00	226,044,000
京王電鉄	41,400	5,028.00	208,159,200
京成電鉄	103,500	5,753.00	595,435,500
東日本旅客鉄道	20,700	8,105.00	167,773,500
西日本旅客鉄道	20,700	6,156.00	127,429,200
東海旅客鉄道	20,700	18,395.00	380,776,500
ヤマトホールディングス	207,000	2,671.00	552,897,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	20,700	7,791.00	161,273,700
日本郵船	62,100	3,839.00	238,401,900
商船三井	62,100	4,058.00	252,001,800
川崎汽船	62,100	4,951.00	307,457,100
日本航空	207,000	3,108.00	643,356,000
ANAホールディングス	20,700	3,383.00	70,028,100
三菱倉庫	103,500	3,816.00	394,956,000
ネクソン	414,000	2,740.50	1,134,567,000
Zホールディングス	82,800	417.70	34,585,560
トレンドマイクロ	207,000	6,276.00	1,299,132,000
日本電信電話	2,070,000	164.00	339,480,000
KDDI	1,242,000	4,233.00	5,257,386,000
ソフトバンク	207,000	1,623.00	335,961,000
東宝	20,700	5,484.00	113,518,800
NTTデータグループ	1,035,000	1,881.00	1,946,835,000
コナミグループ	207,000	8,382.00	1,735,074,000
ソフトバンクグループ	1,242,000	6,675.00	8,290,350,000
双日	20,700	3,106.00	64,294,200
伊藤忠商事	207,000	5,710.00	1,181,970,000
丸紅	207,000	2,428.00	502,596,000
豊田通商	207,000	8,384.00	1,735,488,000
三井物産	207,000	5,582.00	1,155,474,000
住友商事	207,000	2,970.50	614,893,500
三菱商事	207,000	7,170.00	1,484,190,000
J. フロント リテイリング	103,500	1,605.50	166,169,250

三越伊勢丹ホールディングス	207,000	1,787.00	369,909,000
セブン&アイ・ホールディングス	207,000	6,116.00	1,266,012,000
高島屋	103,500	2,239.00	231,736,500
丸井グループ	207,000	2,467.00	510,669,000
イオン	207,000	3,121.00	646,047,000
ファーストリテイリング	621,000	34,160.00	21,213,360,000
しずおかフィナンシャルグループ	207,000	1,156.50	239,395,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	207,000	624.30	129,230,100
あおぞら銀行	20,700	2,816.50	58,301,550
三菱UFJフィナンシャル・グループ	207,000	1,121.50	232,150,500
りそなホールディングス	20,700	721.30	14,930,910
三井住友トラスト・ホールディングス	20,700	5,257.00	108,819,900
三井住友フィナンシャルグループ	20,700	6,401.00	132,500,700
千葉銀行	207,000	983.90	203,667,300
ふくおかフィナンシャルグループ	41,400	3,349.00	138,648,600
みずほフィナンシャルグループ	20,700	2,311.00	47,837,700
大和証券グループ本社	207,000	773.90	160,197,300
野村ホールディングス	207,000	539.00	111,573,000
松井証券	207,000	782.00	161,874,000
SOMPOホールディングス	41,400	6,195.00	256,473,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	62,100	5,136.00	318,945,600
第一生命ホールディングス	20,700	2,706.50	56,024,550
東京海上ホールディングス	310,500	3,106.00	964,413,000
T&Dホールディングス	41,400	2,239.00	92,694,600
クレディセゾン	207,000	2,104.50	435,631,500
オリックス	207,000	2,615.00	541,305,000
日本取引所グループ	207,000	2,636.50	545,755,500
東急不動産ホールディングス	207,000	873.80	180,876,600
三井不動産	207,000	3,027.00	626,589,000
三菱地所	207,000	1,719.00	355,833,000
東京建物	103,500	1,861.50	192,665,250
住友不動産	207,000	3,664.00	758,448,000
エムスリー	496,800	2,886.50	1,434,013,200
ディー・エヌ・エー	62,100	1,502.50	93,305,250
電通グループ	207,000	4,200.00	869,400,000
オリエンタルランド	207,000	5,359.00	1,109,313,000
サイバーエージェント	165,600	903.50	149,619,600

楽天グループ	207,000	574.00	118,818,000	
リクルートホールディングス	621,000	4,960.00	3,080,160,000	
日本郵政	207,000	1,084.00	224,388,000	
セコム	207,000	10,030.00	2,076,210,000	
合 計	45,105,300		196,924,566,870	

②株式以外の有価証券

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

当表に記載すべき内容は、「(3) 注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に開示しておりますので、記載を省略しております。