

2021年8月期 決算短信 (2021年2月16日～2021年8月15日)

2021年9月17日

ファンド名	NZAM 上場投信 JPX 日経 400	上場取引所	東証
コード番号	2526	売買単位	1口
連動対象指標	JPX日経インデックス 400		
主要投資資産	株式		
管理会社	農林中金全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 ディスクロージャグループ	田原	輝行 (TEL) 03-5210-8779
有価証券報告書提出予定日	2021年11月15日		
分配金支払開始予定日	2021年9月22日		

I ファンドの運用状況

1. 2021年8月期の運用状況 (2021年2月16日～2021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	%
2021年8月期	44,741	(96.2)	1,770	(3.8)	46,511	(100.0)
2021年2月期	42,906	(96.4)	1,594	(3.6)	44,500	(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
2021年8月期	2,498	329	210	2,618
2021年2月期	1,724	880	105	2,498

(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
2021年8月期	47,003	492	46,511	17,765
2021年2月期	44,930	429	44,500	17,810

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2021年8月期	171
2021年2月期	106

(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 JPX 日経 400

(1) 【貸借対照表】

	第4期 2021年2月15日現在	第5期 2021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	1,722,196,258	2,109,274,520
株式	42,906,673,160	44,741,334,280
派生商品評価勘定	140,639,640	1,742,152
未収入金	22,552,560	-
未収配当金	52,963,075	60,538,491
前払金	-	5,751,200
差入委託証拠金	85,767,500	85,214,000
流動資産合計	44,930,792,193	47,003,854,643
資産合計	44,930,792,193	47,003,854,643
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,165,000
前受金	136,352,500	-
未払金	-	661,440
未払収益分配金	264,854,038	447,712,542
未払受託者報酬	4,884,707	7,111,027
未払委託者報酬	15,177,422	22,094,916
未払利息	714	3,943
その他未払費用	8,702,885	13,266,198
流動負債合計	429,972,266	492,015,066
負債合計	429,972,266	492,015,066
純資産の部		
元本等		
元本	35,098,157,281	36,777,883,494
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	9,402,662,646	9,733,956,083
(分配準備積立金)	1,603,498	2,169,572
元本等合計	44,500,819,927	46,511,839,577
純資産合計	44,500,819,927	46,511,839,577
負債純資産合計	44,930,792,193	47,003,854,643

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第4期	第5期
	自 2020年8月16日 至 2021年2月15日	自 2021年2月16日 至 2021年8月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	294,851,845	490,963,694
受取利息	19,796	2,760
有価証券売買等損益	6,326,788,808	4,190,926
派生商品取引等損益	233,993,814	10,001,160
その他収益	52,380	130,782
営業収益合計	6,855,706,643	505,289,322
営業費用		
支払利息	174,848	346,479
受託者報酬	4,884,707	7,111,027
委託者報酬	15,177,422	22,094,916
その他費用	8,721,570	13,266,198
営業費用合計	28,958,547	42,818,620
営業利益又は営業損失 (△)	6,826,748,096	462,470,702
経常利益又は経常損失 (△)	6,826,748,096	462,470,702
当期純利益又は当期純損失 (△)	6,826,748,096	462,470,702
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 (△)	1,135,975,656	9,402,662,646
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,895,475,066	1,116,827,519
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	1,895,475,066	1,116,827,519
剰余金減少額又は欠損金増加額	190,682,134	800,292,242
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	190,682,134	800,292,242
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	264,854,038	447,712,542
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	9,402,662,646	9,733,956,083

(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)

<p>第5期 (2021年8月15日現在)</p>
<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目		第4期 2021年2月15日現在	第5期 2021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	24,220,216,669円	35,098,157,281円
	期中追加設定元本額	12,363,663,708円	4,635,271,201円
	期中一部交換元本額	1,485,723,096円	2,955,544,988円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,498,623口	2,618,202口
3.	担保資産 代用有価証券として、担保を供している資産は次の通りであります。		
	株式	16,912,000円	19,930,000円
	合計	16,912,000円	19,930,000円
4.	1口当たり純資産額	17,810円	17,765円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 自2020年8月16日 至2021年2月15日		第5期 自2021年2月16日 至2021年8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	294,749,173円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	492,062円	B. 分配準備積立金額	1,603,498円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	295,241,235円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	492,354,255円
	D. 経費	28,783,699円	D. 経費	42,472,141円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	266,457,536円	E. 収益分配可能額 (C-D)	449,882,114円
	F. 収益分配金	264,854,038円	F. 収益分配金	447,712,542円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	1,603,498円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	2,169,572円
	H. 口数	2,498,623口	H. 口数	2,618,202口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	106円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	171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4期 自 2020年8月16日 至 2021年2月15日	第5期 自 2021年2月16日 至 2021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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年2月15日現在	第5期 2021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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第4期(自 2020年8月16日 至 2021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	5,964,233,386
合計	5,964,233,386

第5期(自 2021年2月16日 至 2021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	56,445,048
合計	56,445,048

(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4期 (2021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	1,416,501,000	—	1,557,160,000	140,659,000
合計		1,416,501,000	—	1,557,160,000	140,659,000

第5期 (2021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	1,734,685,200	—	1,735,284,000	598,800
合計		1,734,685,200	—	1,735,284,000	598,800

(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	
日本水産	28,800	583.00	16,790,400	
マルハニチロ	4,500	2,390.00	10,755,000	
I N P E X	118,700	799.00	94,841,300	
安藤・間	18,800	836.00	15,716,800	
東急建設	8,900	755.00	6,719,500	
コムスホールディングス	10,600	3,020.00	32,012,000	
東建コーポレーション	600	10,200.00	6,120,000	
大成建設	21,100	3,610.00	76,171,000	
大林組	67,800	941.00	63,799,800	
清水建設	63,900	836.00	53,420,400	
長谷工コーポレーション	22,500	1,536.00	34,560,000	
鹿島建設	50,100	1,464.00	73,346,400	
西松建設	4,800	3,435.00	16,488,000	
三井住友建設	16,600	479.00	7,951,400	
前田建設工業	16,500	839.00	13,843,500	
戸田建設	28,000	792.00	22,176,000	
熊谷組	2,900	2,763.00	8,012,700	
大東建託	7,400	12,260.00	90,724,000	
N I P P O	5,300	3,080.00	16,324,000	
五洋建設	29,000	705.00	20,445,000	
住友林業	17,500	2,044.00	35,770,000	
大和ハウス工業	63,100	3,397.00	214,350,700	
積水ハウス	73,900	2,203.50	162,838,650	
協和エクシオ	10,200	2,729.00	27,835,800	
九電工	4,700	3,825.00	17,977,500	
森永製菓	4,800	3,860.00	18,528,000	
寿スピリッツ	2,100	6,530.00	13,713,000	
カルビー	9,600	2,599.00	24,950,400	
森永乳業	4,200	6,770.00	28,434,000	
ヤクルト本社	15,200	6,560.00	99,712,000	
明治ホールディングス	14,300	6,640.00	94,952,000	
日本ハム	8,600	4,135.00	35,561,000	

アサヒグループホールディングス	51,400	5,032.00	258,644,800
キリンホールディングス	80,400	1,946.00	156,458,400
サントリー食品インターナショナル	14,200	4,280.00	60,776,000
伊藤園	6,700	6,770.00	45,359,000
キッコーマン	15,700	7,230.00	113,511,000
味の素	51,900	3,015.00	156,478,500
キューピー	11,700	2,490.00	29,133,000
カゴメ	8,900	2,890.00	25,721,000
アリアケジャパン	2,100	6,160.00	12,936,000
ニチレイ	10,000	2,591.00	25,910,000
東洋水産	11,200	4,220.00	47,264,000
日清食品ホールディングス	8,600	8,090.00	69,574,000
日本たばこ産業	117,100	2,161.00	253,053,100
帝人	20,200	1,650.00	33,330,000
東レ	154,300	739.10	114,043,130
ゴールドウイン	3,600	6,740.00	24,264,000
王子ホールディングス	95,900	622.00	59,649,800
クラレ	31,200	1,066.00	33,259,200
旭化成	140,900	1,198.00	168,798,200
昭和電工	15,200	3,370.00	51,224,000
住友化学	167,700	566.00	94,918,200
日産化学	11,600	5,570.00	64,612,000
東ソー	32,400	1,963.00	63,601,200
トクヤマ	6,400	2,385.00	15,264,000
デンカ	7,300	3,860.00	28,178,000
信越化学工業	39,200	17,930.00	702,856,000
エア・ウォーター	21,700	1,827.00	39,645,900
日本酸素ホールディングス	17,800	2,530.00	45,034,000
三菱瓦斯化学	21,200	2,152.00	45,622,400
三井化学	18,300	3,890.00	71,187,000
J S R	21,200	3,590.00	76,108,000
三菱ケミカルホールディングス	142,300	956.50	136,109,950
KHネオケム	3,600	2,945.00	10,602,000
ダイセル	28,500	891.00	25,393,500
積水化学工業	45,100	1,967.00	88,711,700
アイカ工業	6,000	3,740.00	22,440,000
宇部興産	11,000	2,275.00	25,025,000
日油	7,900	6,250.00	49,375,000

花王	48,200	6,765.00	326,073,000
日本ペイントホールディングス	80,200	1,372.00	110,034,400
関西ペイント	23,800	2,862.00	68,115,600
D I C	9,200	3,050.00	28,060,000
資生堂	40,600	7,609.00	308,925,400
ライオン	26,300	1,826.00	48,023,800
ファンケル	7,800	3,660.00	28,548,000
コーセー	4,200	14,460.00	60,732,000
ポーラ・オルビスホールディングス	9,200	2,646.00	24,343,200
小林製薬	6,300	8,590.00	54,117,000
日東電工	13,100	8,440.00	110,564,000
ニフコ	7,600	3,625.00	27,550,000
ユニ・チャーム	42,000	4,775.00	200,550,000
協和キリン	25,600	3,460.00	88,576,000
武田薬品工業	152,900	3,674.00	561,754,600
アステラス製薬	188,700	1,788.50	337,489,950
大日本住友製薬	16,200	1,900.00	30,780,000
塩野義製薬	27,300	6,536.00	178,432,800
日本新薬	6,200	8,630.00	53,506,000
中外製薬	68,100	4,108.00	279,754,800
科研製薬	4,000	5,020.00	20,080,000
エーザイ	24,100	9,179.00	221,213,900
ロート製薬	10,400	3,290.00	34,216,000
小野薬品工業	50,000	2,507.50	125,375,000
久光製薬	6,400	4,535.00	29,024,000
参天製薬	37,800	1,625.00	61,425,000
第一三共	162,200	2,296.50	372,492,300
大塚ホールディングス	45,300	4,686.00	212,275,800
サワイグループホールディングス	4,500	4,845.00	21,802,500
出光興産	23,900	2,623.00	62,689,700
E N E O Sホールディングス	327,200	457.50	149,694,000
コスモエネルギーホールディングス	6,800	2,478.00	16,850,400
横浜ゴム	12,000	2,053.00	24,636,000
TOYO TIRE	11,400	2,059.00	23,472,600
ブリヂストン	62,800	5,144.00	323,043,200
住友ゴム工業	18,900	1,399.00	26,441,100
A G C	20,200	4,940.00	99,788,000
太平洋セメント	13,100	2,644.00	34,636,400

東海カーボン	18,300	1,633.00	29,883,900
TOTO	15,500	5,950.00	92,225,000
日本碍子	23,800	1,834.00	43,649,200
日本特殊陶業	16,400	1,689.00	27,699,600
ニチアス	5,900	2,847.00	16,797,300
日本製鉄	102,800	2,244.50	230,734,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	62,200	1,654.00	102,878,800
住友金属鉱山	27,400	4,386.00	120,176,400
古河電気工業	6,800	2,532.00	17,217,600
住友電気工業	75,100	1,530.00	114,903,000
アサヒホールディングス	8,100	2,152.00	17,431,200
SUMCO	27,500	2,274.00	62,535,000
三和ホールディングス	20,300	1,409.00	28,602,700
リンナイ	4,300	11,020.00	47,386,000
日本製鋼所	6,600	2,633.00	17,377,800
三浦工業	9,200	5,080.00	46,736,000
アマダ	31,700	1,148.00	36,391,600
FUJ I	8,600	2,830.00	24,338,000
オーエスジー	10,800	2,041.00	22,042,800
DMG森精機	12,800	1,871.00	23,948,800
ディスコ	2,900	31,300.00	90,770,000
ナブテスコ	12,800	4,375.00	56,000,000
SMC	6,400	71,270.00	456,128,000
小松製作所	98,600	2,814.50	277,509,700
住友重機械工業	11,900	3,125.00	37,187,500
日立建機	10,000	3,140.00	31,400,000
クボタ	106,300	2,318.50	246,456,550
ダイキン工業	27,600	26,000.00	717,600,000
ダイフク	11,900	9,740.00	115,906,000
竹内製作所	4,200	2,824.00	11,860,800
ホシザキ	6,400	9,900.00	63,360,000
日本精工	44,600	849.00	37,865,400
THK	12,700	2,789.00	35,420,300
マキタ	28,200	5,850.00	164,970,000
三菱重工業	34,300	3,018.00	103,517,400
I H I	14,500	2,631.00	38,149,500
ブラザー工業	26,700	2,385.00	63,679,500
ミネベアミツミ	37,300	2,950.00	110,035,000

日立製作所	104,600	6,310.00	660,026,000
三菱電機	217,500	1,514.00	329,295,000
富士電機	13,300	4,820.00	64,106,000
安川電機	23,200	5,680.00	131,776,000
東芝テック	2,300	4,605.00	10,591,500
日本電産	52,400	12,755.00	668,362,000
オムロン	18,100	9,860.00	178,466,000
MC J	6,400	1,167.00	7,468,800
日本電気	27,500	5,620.00	154,550,000
富士通	19,800	19,380.00	383,724,000
ルネサスエレクトロニクス	117,600	1,150.00	135,240,000
セイコーエプソン	26,900	2,090.00	56,221,000
アルバック	4,200	5,770.00	24,234,000
エレコム	4,800	1,743.00	8,366,400
パナソニック	232,100	1,358.50	315,307,850
シャープ	29,000	1,545.00	44,805,000
アンリツ	13,100	1,892.00	24,785,200
ソニーグループ	71,200	11,165.00	794,948,000
TDK	10,700	11,880.00	127,116,000
アルプスアルパイン	17,800	1,128.00	20,078,400
横河電機	21,800	1,769.00	38,564,200
アズビル	14,600	4,520.00	65,992,000
日本光電工業	9,000	3,545.00	31,905,000
堀場製作所	4,000	8,000.00	32,000,000
アドバンテスト	16,100	9,270.00	149,247,000
キーエンス	12,900	64,370.00	830,373,000
シスメックス	16,800	11,970.00	201,096,000
OBARA GROUP	1,400	4,030.00	5,642,000
レーザーテック	9,500	20,410.00	193,895,000
スタンレー電気	15,500	2,945.00	45,647,500
カシオ計算機	17,700	1,861.00	32,939,700
ファナック	19,000	24,450.00	464,550,000
浜松ホトニクス	15,700	6,180.00	97,026,000
京セラ	33,100	6,813.00	225,510,300
太陽誘電	9,600	5,840.00	56,064,000
村田製作所	63,900	9,064.00	579,189,600
小糸製作所	13,100	7,010.00	91,831,000
SCREENホールディングス	4,000	9,740.00	38,960,000

キヤノン	108,100	2,638.00	285,167,800	
東京エレクトロン	13,000	44,500.00	578,500,000	
トヨタ紡織	6,500	2,142.00	13,923,000	
豊田自動織機	17,800	9,640.00	171,592,000	
デンソー	48,000	7,820.00	375,360,000	
いすゞ自動車	57,800	1,503.00	86,873,400	
トヨタ自動車	75,000	9,965.00	747,375,000	代用有価証券で 2,000株 担保差入
日野自動車	27,100	953.00	25,826,300	
アイシン	15,900	4,385.00	69,721,500	
マツダ	68,200	1,018.00	69,427,600	
本田技研工業	171,200	3,574.00	611,868,800	
スズキ	43,200	4,889.00	211,204,800	
SUBARU	62,300	2,203.50	137,278,050	
ヤマハ発動機	28,400	2,865.00	81,366,000	
豊田合成	6,900	2,436.00	16,808,400	
シマノ	8,800	31,850.00	280,280,000	
テイ・エス テック	9,400	1,589.00	14,936,600	
テルモ	66,600	4,357.00	290,176,200	
島津製作所	27,900	4,675.00	130,432,500	
ブイ・テクノロジー	800	4,790.00	3,832,000	
東京精密	3,700	4,715.00	17,445,500	
ニコン	32,700	1,146.00	37,474,200	
オリンパス	114,300	2,239.50	255,974,850	
HOYA	42,400	17,350.00	735,640,000	
朝日インテック	22,800	3,010.00	68,628,000	
バンダイナムコホールディングス	18,000	7,409.00	133,362,000	
パイロットコーポレーション	4,100	4,150.00	17,015,000	
ヤマハ	13,100	6,350.00	83,185,000	
ピジョン	13,200	3,295.00	43,494,000	
任天堂	8,900	52,440.00	466,716,000	
中部電力	66,000	1,351.50	89,199,000	
関西電力	82,000	1,104.00	90,528,000	
中国電力	31,300	1,023.00	32,019,900	
東北電力	50,900	853.00	43,417,700	
九州電力	48,100	853.00	41,029,300	
北海道電力	20,200	505.00	10,201,000	
電源開発	16,700	1,658.00	27,688,600	
東京瓦斯	41,600	2,169.50	90,251,200	

大阪瓦斯	39,200	2,113.00	82,829,600
東武鉄道	22,800	2,839.00	64,729,200
相鉄ホールディングス	9,800	2,149.00	21,060,200
東急	54,700	1,490.00	81,503,000
小田急電鉄	34,700	2,584.00	89,664,800
京王電鉄	12,100	6,080.00	73,568,000
京成電鉄	16,200	3,275.00	53,055,000
東日本旅客鉄道	38,400	7,262.00	278,860,800
西日本旅客鉄道	19,200	5,853.00	112,377,600
東海旅客鉄道	18,100	16,000.00	289,600,000
西武ホールディングス	26,000	1,249.00	32,474,000
近鉄グループホールディングス	20,500	3,660.00	75,030,000
阪急阪神ホールディングス	27,400	3,295.00	90,283,000
南海電気鉄道	13,200	2,306.00	30,439,200
京阪ホールディングス	12,100	2,970.00	35,937,000
名古屋鉄道	22,600	1,865.00	42,149,000
日本通運	7,000	8,500.00	59,500,000
ヤマトホールディングス	29,000	2,965.00	85,985,000
山九	5,400	5,000.00	27,000,000
日立物流	4,500	4,415.00	19,867,500
九州旅客鉄道	15,900	2,437.00	38,748,300
日本航空	50,200	2,253.00	113,100,600
ANAホールディングス	55,600	2,575.50	143,197,800
システナ	7,300	2,088.00	15,242,400
日鉄ソリューションズ	3,000	3,670.00	11,010,000
T I S	21,000	2,809.00	58,989,000
コーエーテクモホールディングス	5,700	4,805.00	27,388,500
ネクソン	48,100	2,267.00	109,042,700
ティーガイア	2,200	1,962.00	4,316,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,800	2,070.00	12,006,000
GMOペイメントゲートウェイ	4,100	12,990.00	53,259,000
アカツキ	500	3,085.00	1,542,500
野村総合研究所	37,000	3,725.00	137,825,000
インフォコム	2,000	2,328.00	4,656,000
オービック	6,700	20,270.00	135,809,000
ジャストシステム	3,100	5,850.00	18,135,000
Zホールディングス	293,200	626.30	183,631,160
トレンドマイクロ	11,400	5,750.00	65,550,000

日本オラクル	4,400	8,700.00	38,280,000
伊藤忠テクノソリューションズ	9,500	3,310.00	31,445,000
大塚商会	11,500	5,690.00	65,435,000
東映アニメーション	600	14,740.00	8,844,000
デジタルガレージ	4,000	4,835.00	19,340,000
日本ユニシス	7,300	2,903.00	21,191,900
日本電信電話	232,800	2,913.50	678,262,800
KDDI	171,200	3,373.00	577,457,600
光通信	2,500	19,320.00	48,300,000
東宝	12,200	4,710.00	57,462,000
エヌ・ティ・ティ・データ	56,900	1,777.00	101,111,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,100	6,210.00	56,511,000
カプコン	18,200	2,929.00	53,307,800
S C S K	4,700	6,550.00	30,785,000
コナミホールディングス	7,400	6,480.00	47,952,000
ソフトバンクグループ	88,500	6,647.00	588,259,500
双日	117,600	327.00	38,455,200
アルフレッサ ホールディングス	22,400	1,725.00	38,640,000
神戸物産	16,700	4,085.00	68,219,500
ダイワボウホールディングス	10,000	2,107.00	21,070,000
TOKAIホールディングス	11,100	900.00	9,990,000
シップヘルスケアホールディングス	7,600	2,731.00	20,755,600
コメダホールディングス	4,700	2,053.00	9,649,100
第一興商	4,500	3,800.00	17,100,000
メディカルホールディングス	21,300	2,141.00	45,603,300
日本ライフライン	6,800	1,364.00	9,275,200
伊藤忠商事	150,000	3,410.00	511,500,000
丸紅	211,300	926.10	195,684,930
豊田通商	21,400	5,470.00	117,058,000
兼松	8,100	1,462.00	11,842,200
三井物産	170,900	2,633.50	450,065,150
住友商事	135,200	1,584.00	214,156,800
三菱商事	130,400	3,308.00	431,363,200
岩谷産業	5,200	6,440.00	33,488,000
PALTAC	3,100	4,925.00	15,267,500
日鉄物産	1,800	5,050.00	9,090,000
ミスミグループ本社	27,100	4,200.00	113,820,000
ローソン	5,100	5,690.00	29,019,000

エービーシー・マート	3,100	6,250.00	19,375,000
日本マクドナルドホールディングス	9,900	4,955.00	49,054,500
セリア	4,900	3,980.00	19,502,000
ビックカメラ	12,100	1,101.00	13,322,100
MonotaRO	27,100	2,343.00	63,495,300
J. フロント リテイリング	26,000	984.00	25,584,000
マツモトキヨシホールディングス	8,900	5,010.00	44,589,000
ZOZO	12,700	4,100.00	52,070,000
ウエルシアホールディングス	11,300	3,845.00	43,448,500
クリエイトSDホールディングス	3,100	3,735.00	11,578,500
すかいらーくホールディングス	27,300	1,465.00	39,994,500
コスモス薬品	2,200	18,940.00	41,668,000
セブン&アイ・ホールディングス	83,900	4,928.00	413,459,200
ツルハホールディングス	4,400	13,970.00	61,468,000
クスリのアオキホールディングス	2,100	7,740.00	16,254,000
FOOD & LIFE COMPANIES	12,500	4,265.00	53,312,500
ノジマ	4,100	2,727.00	11,180,700
良品計画	24,700	2,311.00	57,081,700
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	42,900	2,320.00	99,528,000
ゼンショーホールディングス	11,500	2,810.00	32,315,000
ワークマン	2,200	7,550.00	16,610,000
スギホールディングス	4,400	8,460.00	37,224,000
丸井グループ	18,100	1,945.00	35,204,500
イオン	82,400	3,062.00	252,308,800
イズミ	4,500	3,675.00	16,537,500
ヤオコー	2,300	6,890.00	15,847,000
ケーズホールディングス	19,000	1,154.00	21,926,000
アインホールディングス	3,000	7,150.00	21,450,000
ニトリホールディングス	8,500	21,760.00	184,960,000
ファーストリテイリング	2,800	75,430.00	211,204,000
サンドラッグ	7,900	3,580.00	28,282,000
めぶきフィナンシャルグループ	110,700	247.00	27,342,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	130,600	440.00	57,464,000
新生銀行	17,600	1,456.00	25,625,600
あおぞら銀行	12,700	2,644.00	33,578,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,375,200	610.50	839,559,600

りそなホールディングス	232,200	436.60	101,378,520
三井住友トラスト・ホールディングス	40,700	3,720.00	151,404,000
三井住友フィナンシャルグループ	148,500	3,873.00	575,140,500
千葉銀行	71,800	691.00	49,613,800
ふくおかフィナンシャルグループ	19,200	2,077.00	39,878,400
セブン銀行	70,900	249.00	17,654,100
みずほフィナンシャルグループ	291,600	1,630.50	475,453,800
F P G	7,000	714.00	4,998,000
S B I ホールディングス	26,300	2,748.00	72,272,400
大和証券グループ本社	160,500	602.50	96,701,250
野村ホールディングス	327,600	556.40	182,276,640
S O M P O ホールディングス	37,900	4,718.00	178,812,200
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	52,200	3,536.00	184,579,200
第一生命ホールディングス	105,700	2,218.00	234,442,600
東京海上ホールディングス	70,600	5,422.00	382,793,200
T & D ホールディングス	64,000	1,437.00	91,968,000
全国保証	5,500	5,150.00	28,325,000
芙蓉総合リース	2,300	7,340.00	16,882,000
東京センチュリー	4,900	6,220.00	30,478,000
イオンフィナンシャルサービス	13,800	1,366.00	18,850,800
アコム	42,900	439.00	18,833,100
オリエントコーポレーション	57,900	146.00	8,453,400
オリックス	130,200	2,088.50	271,922,700
三菱HCキャピタル	48,400	614.00	29,717,600
日本取引所グループ	57,900	2,619.50	151,669,050
いちご	26,700	343.00	9,158,100
ヒューリック	44,900	1,283.00	57,606,700
野村不動産ホールディングス	12,300	2,916.00	35,866,800
オープンハウス	6,800	5,610.00	38,148,000
東急不動産ホールディングス	57,600	627.00	36,115,200
飯田グループホールディングス	18,100	2,651.00	47,983,100
パーク24	11,500	2,054.00	23,621,000
三井不動産	97,800	2,516.50	246,113,700
三菱地所	141,100	1,732.00	244,385,200
東京建物	20,900	1,694.00	35,404,600
住友不動産	48,100	3,618.00	174,025,800
スターツコーポレーション	2,500	2,833.00	7,082,500
イオンモール	11,000	1,680.00	18,480,000

日本空港ビルデング	7,400	4,985.00	36,889,000	
ミクシィ	4,900	2,517.00	12,333,300	
日本M&Aセンター	34,000	3,150.00	107,100,000	
UTグループ	3,000	3,085.00	9,255,000	
エス・エム・エス	7,000	3,480.00	24,360,000	
パーソルホールディングス	20,800	2,635.00	54,808,000	
総合警備保障	8,500	5,280.00	44,880,000	
カカクコム	15,500	3,335.00	51,692,500	
ディップ	3,200	3,375.00	10,800,000	
ベネフィット・ワン	7,100	3,750.00	26,625,000	
エムスリー	36,700	7,159.00	262,735,300	
アウトソーシング	11,700	1,834.00	21,457,800	
博報堂DYホールディングス	28,400	1,757.00	49,898,800	
電通グループ	21,500	4,185.00	89,977,500	
オリエンタルランド	22,300	15,745.00	351,113,500	
ユー・エス・エス	23,200	1,885.00	43,732,000	
楽天グループ	106,800	1,244.00	132,859,200	
エン・ジャパン	4,000	3,810.00	15,240,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,000	2,608.00	33,904,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	12,010.00	7,206,000	
リクルートホールディングス	137,500	6,350.00	873,125,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,600	47,700.00	76,320,000	
リログループ	11,500	2,595.00	29,842,500	
エイチ・アイ・エス	4,600	2,448.00	11,260,800	
カナモト	3,800	2,579.00	9,800,200	
セコム	20,400	8,454.00	172,461,600	
メイテック	2,400	6,440.00	15,456,000	
合 計	15,681,000		44,741,334,280	

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。