

2022年8月期 決算短信 (2022年2月16日～2022年8月15日)

2022年9月21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 ディスクロージャグループ	田原	輝行 (TEL) 03-5210-8779
有価証券報告書提出予定日	2022年11月15日		
分配金支払開始予定日	2022年9月22日		

I ファンドの運用状況

1. 2022年8月期の運用状況 (2022年2月16日～2022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	%
2022年8月期	46,331	(97.9)	985	(2.1)	47,316	(100.0)
2022年2月期	44,570	(97.9)	978	(2.1)	45,549	(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
2022年8月期	2,621	-	-	2,621
2022年2月期	2,618	110	106	2,621

(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
2022年8月期	47,951	634	47,316	18,049
2022年2月期	46,107	558	45,549	17,375

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2022年8月期	223
2022年2月期	171

(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6期 2022年2月15日現在	第7期 2022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	1,356,745,041	1,474,085,147
株式	44,570,880,970	46,331,412,290
派生商品評価勘定	412,170	11,679,406
未収入金	-	5,404,140
未収配当金	72,019,430	67,243,281
前払金	49,550,800	-
差入委託証拠金	57,915,000	61,887,000
流動資産合計	46,107,523,411	47,951,711,264
資産合計	46,107,523,411	47,951,711,264
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,967,070	-
前受金	-	8,477,000
未払金	21,260,440	-
未払収益分配金	448,288,470	584,610,110
未払受託者報酬	7,497,614	6,971,670
未払委託者報酬	23,296,105	21,661,911
未払利息	281	349
その他未払費用	13,831,000	13,189,502
流動負債合計	558,140,980	634,910,542
負債合計	558,140,980	634,910,542
純資産の部		
元本等		
元本	36,825,193,790	36,825,193,790
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	8,724,188,641	10,491,606,932
(分配準備積立金)	1,393,067	1,514,356
元本等合計	45,549,382,431	47,316,800,722
純資産合計	45,549,382,431	47,316,800,722
負債純資産合計	46,107,523,411	47,951,711,264

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第6期	第7期
	自 2021年8月16日 至 2022年2月15日	自 2022年2月16日 至 2022年8月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	492,397,271	626,663,648
受取利息	32,619	5,837
有価証券売買等損益	△1,049,171,250	1,716,038,708
派生商品取引等損益	△28,359,752	51,258,294
その他収益	4,353	2,352
営業収益合計	△585,096,759	2,393,968,839
営業費用		
支払利息	297,559	117,355
受託者報酬	7,497,614	6,971,670
委託者報酬	23,296,105	21,661,911
その他費用	13,831,000	13,189,502
営業費用合計	44,922,278	41,940,438
営業利益又は営業損失 (△)	△630,019,037	2,352,028,401
経常利益又は経常損失 (△)	△630,019,037	2,352,028,401
当期純利益又は当期純損失 (△)	△630,019,037	2,352,028,401
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 (△)	9,733,956,083	8,724,188,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	516,261,425	-
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	516,261,425	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	447,721,360	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	447,721,360	-
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	448,288,470	584,610,110
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	8,724,188,641	10,491,606,932

(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	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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第6期 (2022年2月15日現在)	第7期 (2022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6期 2022年2月15日現在	第7期 2022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	36,777,883,494円	36,825,193,790円
	期中追加設定元本額	1,546,546,606円	－円
	期中一部交換元本額	1,499,236,310円	－円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,621,570口	2,621,570口
3.	1口当たり純資産額	17,375円	18,049円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自2021年8月16日 至2022年2月15日		第7期 自2022年2月16日 至2022年8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	492,136,684円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	2,169,572円	B. 分配準備積立金額	1,393,067円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	494,306,256円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	627,947,549円
	D. 経費	44,624,719円	D. 経費	41,823,083円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	449,681,537円	E. 収益分配可能額 (C-D)	586,124,466円
	F. 収益分配金	448,288,470円	F. 収益分配金	584,610,110円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,393,067円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,514,356円
	H. 口数	2,621,570口	H. 口数	2,621,570口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	171円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	223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6期 自 2021年8月16日 至 2022年2月15日	第7期 自 2022年2月16日 至 2022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6期 2022年2月15日現在	第7期 2022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6期(自 2021年8月16日 至 2022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	△1,107,382,030
合計	△1,107,382,030

第7期(自 2022年2月16日 至 2022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	1,742,742,279
合計	1,742,742,279

(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6期 (2022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	990,092,800	—	946,550,000	△43,542,800
合計		990,092,800	—	946,550,000	△43,542,800

第7期 (2022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	930,848,500	—	942,539,500	11,691,000
合計		930,848,500	—	942,539,500	11,691,000

(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	
日本水産	32,000	580.00	18,560,000	
I N P E X	108,800	1,491.00	162,220,800	
ミライト・ワン	10,300	1,597.00	16,449,100	
安藤・間	15,800	874.00	13,809,200	
東急建設	9,400	641.00	6,025,400	
コムシスホールディングス	11,100	2,636.00	29,259,600	
東建コーポレーション	1,000	9,220.00	9,220,000	
大成建設	21,900	4,050.00	88,695,000	
大林組	73,800	952.00	70,257,600	
清水建設	69,200	753.00	52,107,600	
長谷工コーポレーション	22,000	1,580.00	34,760,000	
鹿島建設	54,100	1,474.00	79,743,400	
西松建設	4,500	3,900.00	17,550,000	
三井住友建設	16,700	460.00	7,682,000	
戸田建設	30,600	691.00	21,144,600	
熊谷組	3,700	2,708.00	10,019,600	
大東建託	8,100	13,300.00	107,730,000	
五洋建設	29,300	724.00	21,213,200	
住友林業	15,800	2,320.00	36,656,000	
大和ハウス工業	62,400	3,163.00	197,371,200	
積水ハウス	74,800	2,369.50	177,238,600	
関電工	12,000	836.00	10,032,000	
エクシオグループ	11,200	2,151.00	24,091,200	
九電工	5,000	2,886.00	14,430,000	
インフロニア・ホールディングス	27,000	994.00	26,838,000	
森永製菓	5,200	4,050.00	21,060,000	
カルビー	11,500	2,838.00	32,637,000	
森永乳業	4,400	4,390.00	19,316,000	
ヤクルト本社	16,000	8,450.00	135,200,000	
明治ホールディングス	13,900	6,850.00	95,215,000	
プリマハム	3,300	2,245.00	7,408,500	
日本ハム	9,000	4,040.00	36,360,000	

アサヒグループホールディングス	47,600	4,786.00	227,813,600
キリンホールディングス	92,800	2,235.00	207,408,000
サントリー食品インターナショナル	14,600	5,080.00	74,168,000
伊藤園	7,700	6,230.00	47,971,000
キッコーマン	15,100	8,850.00	133,635,000
味の素	50,800	3,750.00	190,500,000
キューピー	11,500	2,317.00	26,645,500
カゴメ	9,600	3,180.00	30,528,000
アリアケジャパン	2,100	4,895.00	10,279,500
ニチレイ	9,400	2,532.00	23,800,800
東洋水産	11,300	5,760.00	65,088,000
日清食品ホールディングス	8,100	9,870.00	79,947,000
日本たばこ産業	135,300	2,328.00	314,978,400
帝人	21,700	1,460.00	31,682,000
東レ	152,800	784.70	119,902,160
ゴールドウイン	4,100	7,910.00	32,431,000
王子ホールディングス	96,400	550.00	53,020,000
大王製紙	11,100	1,329.00	14,751,900
レンゴー	19,000	788.00	14,972,000
クラレ	33,700	1,070.00	36,059,000
旭化成	152,900	1,043.00	159,474,700
昭和電工	20,300	2,271.00	46,101,300
住友化学	169,400	567.00	96,049,800
日産化学	11,100	7,360.00	81,696,000
東ソー	30,500	1,803.00	54,991,500
トクヤマ	7,400	1,865.00	13,801,000
デンカ	8,400	3,320.00	27,888,000
信越化学工業	33,600	17,720.00	595,392,000
エア・ウォーター	20,500	1,741.00	35,690,500
日本酸素ホールディングス	20,900	2,533.00	52,939,700
三菱瓦斯化学	20,100	2,080.00	41,808,000
三井化学	19,200	3,020.00	57,984,000
三菱ケミカルグループ	154,100	758.60	116,900,260
ダイセル	33,200	868.00	28,817,600
積水化学工業	47,000	1,934.00	90,898,000
日本ゼオン	19,300	1,383.00	26,691,900
アイカ工業	5,800	3,115.00	18,067,000
UBE	11,600	2,083.00	24,162,800

日油	7,400	5,400.00	39,960,000
花王	52,100	6,048.00	315,100,800
日本ペイントホールディングス	92,500	1,056.00	97,680,000
関西ペイント	21,300	2,226.00	47,413,800
D I C	8,200	2,511.00	20,590,200
富士フイルムホールディングス	44,200	7,411.00	327,566,200
資生堂	43,800	5,555.00	243,309,000
ライオン	25,100	1,583.00	39,733,300
ファンケル	10,200	2,682.00	27,356,400
コーセー	4,300	13,690.00	58,867,000
ポーラ・オルビスホールディングス	10,100	1,596.00	16,119,600
小林製薬	6,400	8,440.00	54,016,000
日東電工	15,200	8,990.00	136,648,000
エフピコ	4,300	3,430.00	14,749,000
ニフコ	8,400	3,315.00	27,846,000
ユニ・チャーム	43,700	4,886.00	213,518,200
協和キリン	25,300	3,215.00	81,339,500
武田薬品工業	185,100	3,801.00	703,565,100
アステラス製薬	215,000	2,050.00	440,750,000
住友ファーマ	14,600	1,115.00	16,279,000
塩野義製薬	29,300	6,979.00	204,484,700
日本新薬	5,500	7,820.00	43,010,000
中外製薬	65,600	3,868.00	253,740,800
科研製薬	3,600	3,860.00	13,896,000
エーザイ	27,900	6,205.00	173,119,500
ロート製薬	12,100	4,315.00	52,211,500
小野薬品工業	48,500	3,396.00	164,706,000
参天製薬	43,900	1,050.00	46,095,000
J C R ファーマ	6,600	2,424.00	15,998,400
東和薬品	3,400	2,333.00	7,932,200
第一三共	182,400	4,211.00	768,086,400
大塚ホールディングス	48,200	4,726.00	227,793,200
ペプチドリーム	10,200	1,630.00	16,626,000
サワイグループホールディングス	4,800	4,310.00	20,688,000
出光興産	25,600	3,575.00	91,520,000
E N E O S ホールディングス	378,300	506.90	191,760,270
コスモエネルギーホールディングス	9,900	4,095.00	40,540,500
横浜ゴム	12,500	2,208.00	27,600,000

TOYO TIRE	12,400	1,682.00	20,856,800
ブリヂストン	66,900	5,447.00	364,404,300
住友ゴム工業	21,100	1,166.00	24,602,600
AGC	21,600	4,980.00	107,568,000
太平洋セメント	14,300	2,091.00	29,901,300
東海カーボン	17,700	1,045.00	18,496,500
TOTO	15,200	4,680.00	71,136,000
日本碍子	25,500	2,002.00	51,051,000
日本特殊陶業	17,900	2,786.00	49,869,400
ニチアス	5,500	2,380.00	13,090,000
三井金属鉱業	6,700	3,210.00	21,507,000
住友金属鉱山	27,200	4,308.00	117,177,600
住友電気工業	87,000	1,599.00	139,113,000
アサヒホールディングス	9,300	2,072.00	19,269,600
SUMCO	41,000	1,946.00	79,786,000
三和ホールディングス	23,600	1,415.00	33,394,000
リンナイ	4,400	10,950.00	48,180,000
日本製鋼所	6,600	2,977.00	19,648,200
三浦工業	10,100	3,220.00	32,522,000
アマダ	39,200	1,073.00	42,061,600
FUJ I	9,900	2,117.00	20,958,300
オーエスジー	10,800	1,920.00	20,736,000
DMG森精機	12,900	1,857.00	23,955,300
ディスコ	3,700	34,350.00	127,095,000
オプトラン	2,900	2,346.00	6,803,400
ナブテスコ	13,200	3,470.00	45,804,000
SMC	7,400	69,400.00	513,560,000
小松製作所	114,000	2,919.50	332,823,000
住友重機械工業	13,400	2,939.00	39,382,600
日立建機	10,100	2,996.00	30,259,600
クボタ	112,500	2,225.00	250,312,500
荏原製作所	8,700	5,610.00	48,807,000
ダイキン工業	27,500	25,295.00	695,612,500
ダイフク	11,900	8,620.00	102,578,000
竹内製作所	3,600	2,613.00	9,406,800
ホシザキ	13,600	4,230.00	57,528,000
日本精工	44,300	783.00	34,686,900
マキタ	28,700	3,394.00	97,407,800

三菱重工業	36,900	4,764.00	175,791,600
I H I	15,300	3,405.00	52,096,500
ブラザー工業	28,800	2,640.00	76,032,000
ミネベアミツミ	40,600	2,566.00	104,179,600
日立製作所	114,600	6,922.00	793,261,200
三菱電機	235,400	1,444.00	339,917,600
富士電機	14,200	5,970.00	84,774,000
安川電機	25,300	4,930.00	124,729,000
日本電産	52,200	9,924.00	518,032,800
オムロン	20,900	7,888.00	164,859,200
MC J	8,200	980.00	8,036,000
日本電気	29,900	4,995.00	149,350,500
富士通	22,600	17,000.00	384,200,000
ルネサスエレクトロニクス	136,900	1,356.00	185,636,400
セイコーエプソン	28,100	2,189.00	61,510,900
ワコム	18,200	856.00	15,579,200
アルバック	4,700	5,400.00	25,380,000
エレコム	5,400	1,765.00	9,531,000
パナソニック ホールディングス	268,200	1,129.00	302,797,800
アンリツ	15,200	1,646.00	25,019,200
ソニーグループ	67,400	11,585.00	780,829,000
T D K	36,400	5,080.00	184,912,000
横河電機	23,600	2,336.00	55,129,600
アズビル	14,400	4,110.00	59,184,000
日本光電工業	9,700	3,110.00	30,167,000
堀場製作所	4,700	6,330.00	29,751,000
アドバンテスト	18,700	8,450.00	158,015,000
キーエンス	12,000	57,480.00	689,760,000
シスメックス	18,000	8,761.00	157,698,000
レーザーテック	10,300	21,415.00	220,574,500
スタンレー電気	16,500	2,523.00	41,629,500
カシオ計算機	15,600	1,349.00	21,044,400
ファナック	22,100	24,780.00	547,638,000
浜松ホトニクス	16,900	6,290.00	106,301,000
京セラ	35,400	7,725.00	273,465,000
太陽誘電	11,400	4,595.00	52,383,000
村田製作所	68,600	7,929.00	543,929,400
小糸製作所	12,600	4,760.00	59,976,000

SCREENホールディングス	4,100	9,860.00	40,426,000
東京エレクトロン	16,000	46,750.00	748,000,000
トヨタ紡織	8,800	2,080.00	18,304,000
豊田自動織機	17,800	8,010.00	142,578,000
デンソー	49,200	7,817.00	384,596,400
いすゞ自動車	72,800	1,573.00	114,514,400
トヨタ自動車	337,600	2,132.50	719,932,000
日野自動車	29,400	656.00	19,286,400
アイシン	18,500	4,280.00	79,180,000
本田技研工業	183,800	3,629.00	667,010,200
スズキ	49,800	4,857.00	241,878,600
SUBARU	66,500	2,456.50	163,357,250
ヤマハ発動機	33,000	2,838.00	93,654,000
豊田合成	7,600	2,335.00	17,746,000
シマノ	8,600	24,995.00	214,957,000
テイ・エス テック	10,000	1,605.00	16,050,000
テルモ	71,200	4,630.00	329,656,000
島津製作所	30,300	4,375.00	132,562,500
ブイ・テクノロジー	1,200	3,030.00	3,636,000
東京精密	3,900	4,730.00	18,447,000
オリンパス	120,600	2,960.00	356,976,000
HOYA	48,500	14,840.00	719,740,000
朝日インテック	27,700	2,704.00	74,900,800
バンダイナムコホールディングス	20,900	10,160.00	212,344,000
パイロットコーポレーション	3,300	5,180.00	17,094,000
ヤマハ	14,600	5,740.00	83,804,000
ピジョン	13,400	2,084.00	27,925,600
任天堂	11,100	57,790.00	641,469,000
中部電力	72,100	1,394.00	100,507,400
関西電力	87,900	1,257.00	110,490,300
中国電力	36,800	855.00	31,464,000
東北電力	55,200	649.00	35,824,800
九州電力	48,600	837.00	40,678,200
北海道電力	20,400	514.00	10,485,600
電源開発	19,100	1,998.00	38,161,800
イーレックス	3,500	2,748.00	9,618,000
レノバ	4,600	2,698.00	12,410,800
東京瓦斯	45,100	2,589.00	116,763,900

大阪瓦斯	42,600	2,376.00	101,217,600
東海旅客鉄道	17,700	15,950.00	282,315,000
阪急阪神ホールディングス	27,900	4,095.00	114,250,500
ヤマトホールディングス	32,600	2,229.00	72,665,400
山九	5,800	4,400.00	25,520,000
センコーグループホールディングス	12,000	937.00	11,244,000
日立物流	4,600	8,760.00	40,296,000
丸和運輸機関	4,700	1,639.00	7,703,300
九州旅客鉄道	16,400	2,827.00	46,362,800
S Gホールディングス	40,000	2,303.00	92,120,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	7,800	8,030.00	62,634,000
日本郵船	19,900	10,760.00	214,124,000
商船三井	36,700	3,765.00	138,175,500
NEC ネットエスアイ	7,700	1,789.00	13,775,300
システナ	32,900	443.00	14,574,700
日鉄ソリューションズ	4,000	3,750.00	15,000,000
T I S	21,600	3,910.00	84,456,000
コーエーテクモホールディングス	7,900	4,790.00	37,841,000
ネクソン	56,300	2,850.00	160,455,000
ティーガイア	2,200	1,615.00	3,553,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,200	2,336.00	14,483,200
GMO ペイメントゲートウェイ	4,700	11,150.00	52,405,000
ラクス	10,600	1,910.00	20,246,000
アカツキ	1,100	2,386.00	2,624,600
野村総合研究所	42,900	4,115.00	176,533,500
インフォコム	2,500	2,072.00	5,180,000
オービック	7,800	21,670.00	169,026,000
ジャストシステム	3,300	3,635.00	11,995,500
Zホールディングス	355,800	437.50	155,662,500
トレンドマイクロ	12,100	8,840.00	106,964,000
日本オラクル	4,000	8,650.00	34,600,000
伊藤忠テクノソリューションズ	11,200	3,495.00	39,144,000
大塚商会	11,900	4,640.00	55,216,000
電通国際情報サービス	2,600	4,430.00	11,518,000
東映アニメーション	1,000	13,150.00	13,150,000
デジタルガレージ	4,000	3,965.00	15,860,000
B I P R O G Y	7,200	3,050.00	21,960,000

USEN-NEXT HOLDINGS	2,200	2,128.00	4,681,600
日本電信電話	241,200	3,717.00	896,540,400
KDDI	179,900	4,189.00	753,601,100
光通信	2,800	15,400.00	43,120,000
東宝	14,600	5,310.00	77,526,000
エヌ・ティ・ティ・データ	65,700	2,034.00	133,633,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,500	6,060.00	69,690,000
カプコン	23,400	3,660.00	85,644,000
SCSK	17,100	2,276.00	38,919,600
コナミグループ	9,000	7,220.00	64,980,000
ソフトバンクグループ	70,800	5,900.00	417,720,000
双日	25,600	2,239.00	57,318,400
アルフレッサ ホールディングス	25,800	1,663.00	42,905,400
神戸物産	17,400	3,950.00	68,730,000
ダイワボウホールディングス	11,200	1,896.00	21,235,200
TOKAIホールディングス	11,200	889.00	9,956,800
シップヘルスケアホールディングス	7,400	2,584.00	19,121,600
コメダホールディングス	5,100	2,346.00	11,964,600
メディパルホールディングス	23,600	1,970.00	46,492,000
日本ライフライン	6,900	1,049.00	7,238,100
伊藤忠商事	148,500	3,842.00	570,537,000
丸紅	214,500	1,357.00	291,076,500
豊田通商	22,100	4,760.00	105,196,000
兼松	9,100	1,453.00	13,222,300
三井物産	180,000	3,081.00	554,580,000
住友商事	146,400	1,908.00	279,331,200
三菱商事	162,400	4,274.00	694,097,600
岩谷産業	5,600	5,490.00	30,744,000
PALTAC	3,300	4,175.00	13,777,500
日鉄物産	1,600	5,270.00	8,432,000
ミスミグループ本社	31,300	3,715.00	116,279,500
ローソン	5,500	4,770.00	26,235,000
エービーシー・マート	3,900	5,760.00	22,464,000
日本マクドナルドホールディングス	12,500	4,985.00	62,312,500
セリア	5,600	2,769.00	15,506,400
ビックカメラ	13,700	1,173.00	16,070,100
MonotaRO	31,500	2,605.00	82,057,500
マツキヨココカラ&カンパニー	10,500	5,430.00	57,015,000

Z O Z O	16,600	3,145.00	52,207,000
ウエルシアホールディングス	13,200	3,050.00	40,260,000
クリエイトSDホールディングス	3,500	3,165.00	11,077,500
コスモス薬品	2,500	14,850.00	37,125,000
セブン&アイ・ホールディングス	83,000	5,560.00	461,480,000
ツルハホールディングス	5,400	7,850.00	42,390,000
クスリのアオキホールディングス	2,300	6,300.00	14,490,000
FOOD & LIFE COMPAN IES	12,700	2,373.00	30,137,100
ノジマ	4,100	2,778.00	11,389,800
良品計画	28,500	1,299.00	37,021,500
コーナン商事	3,300	3,685.00	12,160,500
パン・パシフィック・インターナシヨナ ルホールディングス	49,500	2,408.00	119,196,000
ゼンショーホールディングス	12,100	3,515.00	42,531,500
ワークマン	2,600	6,500.00	16,900,000
スギホールディングス	4,900	6,090.00	29,841,000
ライフコーポレーション	2,200	2,679.00	5,893,800
丸井グループ	18,400	2,395.00	44,068,000
イズミ	4,200	3,025.00	12,705,000
ヤオコー	2,600	6,620.00	17,212,000
ケーズホールディングス	21,400	1,290.00	27,606,000
アインホールディングス	3,100	7,780.00	24,118,000
ニトリホールディングス	9,800	14,465.00	141,757,000
ファーストリテイリング	3,300	85,170.00	281,061,000
サンドラッグ	9,400	3,445.00	32,383,000
めぶきフィナンシャルグループ	102,000	264.00	26,928,000
コンコルディア・フィナンシャルグルー プ	122,800	443.00	54,400,400
新生銀行	16,200	1,988.00	32,205,600
あおぞら銀行	13,900	2,704.00	37,585,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,040,400	726.30	755,642,520
りそなホールディングス	262,800	515.90	135,578,520
三井住友トラスト・ホールディングス	41,000	4,318.00	177,038,000
三井住友フィナンシャルグループ	161,100	4,146.00	667,920,600
千葉銀行	70,000	749.00	52,430,000
ふくおかフィナンシャルグループ	18,500	2,445.00	45,232,500
セブン銀行	69,000	260.00	17,940,000
みずほフィナンシャルグループ	297,000	1,582.50	470,002,500

F P G	7,800	1,185.00	9,243,000
GMOフィナンシャルホールディングス	4,300	768.00	3,302,400
S B Iホールディングス	30,600	2,735.00	83,691,000
ジャフコ グループ	9,000	2,118.00	19,062,000
大和証券グループ本社	159,300	607.00	96,695,100
野村ホールディングス	378,600	507.60	192,177,360
S O M P Oホールディングス	35,300	5,831.00	205,834,300
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	51,300	4,083.00	209,457,900
第一生命ホールディングス	120,800	2,343.00	283,034,400
東京海上ホールディングス	69,000	7,583.00	523,227,000
T & Dホールディングス	55,200	1,466.00	80,923,200
全国保証	5,600	4,390.00	24,584,000
芙蓉総合リース	2,100	8,030.00	16,863,000
みずほリース	3,100	3,405.00	10,555,500
東京センチュリー	4,100	5,090.00	20,869,000
イオンフィナンシャルサービス	12,700	1,408.00	17,881,600
アコム	45,800	341.00	15,617,800
オリエン트コーポレーション	62,900	126.00	7,925,400
オリックス	147,300	2,246.50	330,909,450
三菱HCキャピタル	82,100	656.00	53,857,600
日本取引所グループ	58,000	2,191.50	127,107,000
いちご	26,800	304.00	8,147,200
ヒューリック	48,200	1,070.00	51,574,000
野村不動産ホールディングス	12,800	3,395.00	43,456,000
サムティ	3,700	2,120.00	7,844,000
プレサンスコーポレーション	3,000	1,510.00	4,530,000
オープンハウスグループ	7,900	5,590.00	44,161,000
東急不動産ホールディングス	68,400	750.00	51,300,000
飯田グループホールディングス	20,700	2,231.00	46,181,700
三井不動産	96,800	2,885.00	279,268,000
三菱地所	141,200	1,920.50	271,174,600
東京建物	19,700	2,100.00	41,370,000
住友不動産	44,600	3,597.00	160,426,200
スターツコーポレーション	3,200	2,749.00	8,796,800
日本エスコン	4,300	809.00	3,478,700
イオンモール	11,600	1,712.00	19,859,200
カチタス	5,800	3,445.00	19,981,000
ミクシィ	5,200	2,389.00	12,422,800

日本M&Aセンターホールディングス	39,600	1,858.00	73,576,800
UTグループ	3,300	2,802.00	9,246,600
エス・エム・エス	7,700	3,415.00	26,295,500
パーソルホールディングス	23,500	2,946.00	69,231,000
総合警備保障	8,900	3,625.00	32,262,500
カカクコム	17,600	2,560.00	45,056,000
ディップ	3,900	3,760.00	14,664,000
ベネフィット・ワン	8,200	2,220.00	18,204,000
エムスリー	42,400	4,733.00	200,679,200
アウトソーシング	12,900	1,214.00	15,660,600
博報堂DYホールディングス	31,300	1,356.00	42,442,800
オリエンタルランド	25,600	20,805.00	532,608,000
ユー・エス・エス	27,000	2,422.00	65,394,000
フルキャストホールディングス	1,900	2,405.00	4,569,500
エン・ジャパン	3,600	2,508.00	9,028,800
テクノプロ・ホールディングス	14,100	3,350.00	47,235,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	2,417.00	2,658,700
ジャパンマテリアル	6,900	1,948.00	13,441,200
リクルートホールディングス	133,500	5,010.00	668,835,000
ベルシステム24ホールディングス	3,700	1,482.00	5,483,400
ベイカレント・コンサルティング	1,700	43,250.00	73,525,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,100	1,800.00	12,780,000
リログループ	13,200	2,230.00	29,436,000
カナモト	3,900	2,134.00	8,322,600
セコム	23,700	9,031.00	214,034,700
メイテック	8,100	2,564.00	20,768,400
イオンディライト	2,800	2,904.00	8,131,200
合 計	15,770,900		46,331,412,290

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。