

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 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	55,441	(96.3)	2,102	(3.7)	57,543	(100.0)
2023年2月期	46,414	(97.5)	1,188	(2.5)	47,603	(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	2,625	330	208	2,746
2023年2月期	2,621	110	106	2,625

(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	58,259	715	57,543	20,950
2023年2月期	48,254	651	47,603	18,131

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2023年8月期	225
2023年2月期	214

(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	1,652,662,763	2,580,216,052
株式	46,414,669,280	55,441,067,720
派生商品評価勘定	25,497,588	40,474,184
未収入金	11,058,920	15,646,800
未収配当金	80,741,350	74,482,990
差入委託証拠金	70,035,000	107,167,500
流動資産合計	48,254,664,901	58,259,055,246
資産合計	48,254,664,901	58,259,055,246
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,016,562
前受金	46,893,800	50,791,600
未払収益分配金	561,863,634	617,998,275
未払受託者報酬	7,089,758	7,862,816
未払委託者報酬	22,028,842	24,430,827
未払利息	1,261	2,942
その他未払費用	13,397,852	13,880,459
流動負債合計	651,275,147	715,983,481
負債合計	651,275,147	715,983,481
純資産の部		
元本等		
元本	36,880,833,957	38,582,318,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	10,722,555,797	18,960,752,792
(分配準備積立金)	1,743,524	530,802
元本等合計	47,603,389,754	57,543,071,765
純資産合計	47,603,389,754	57,543,071,765
負債純資産合計	48,254,664,901	58,259,055,246

(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	604,918,317	663,404,405
受取利息	4,217	13,206
有価証券売買等損益	119,486,887	7,017,483,812
派生商品取引等損益	58,974,342	319,435,366
その他収益	2,293	2,353
営業収益合計	783,386,056	8,000,339,142
営業費用		
支払利息	261,737	428,057
受託者報酬	7,089,758	7,862,816
委託者報酬	22,028,842	24,430,827
その他費用	13,451,688	13,912,711
営業費用合計	42,832,025	46,634,411
営業利益又は営業損失 (△)	740,554,031	7,953,704,731
経常利益又は経常損失 (△)	740,554,031	7,953,704,731
当期純利益又は当期純損失 (△)	740,554,031	7,953,704,731
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 (△)	10,491,606,932	10,722,555,797
剰余金増加額又は欠損金減少額	427,889,590	2,402,995,420
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	427,889,590	2,402,995,420
剰余金減少額又は欠損金増加額	375,631,122	1,500,504,881
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	375,631,122	1,500,504,881
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	561,863,634	617,998,275
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	10,722,555,797	18,960,752,792

(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	36,825,193,790円	36,880,833,957円
	期中追加設定元本額	1,545,380,705円	4,636,984,935円
	期中一部交換元本額	1,489,740,538円	2,935,499,919円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,625,531口	2,746,659口
3.	1口当たり純資産額	18,131円	20,950円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期 自2023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	604,663,090円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,514,356円	B. 分配準備積立金額	1,743,524円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	606,177,446円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	664,735,431円
	D. 経費	42,570,288円	D. 経費	46,206,354円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	563,607,158円	E. 収益分配可能額 (C-D)	618,529,077円
	F. 収益分配金	561,863,634円	F. 収益分配金	617,998,275円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,743,524円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	530,802円
	H. 口数	2,625,531口	H. 口数	2,746,659口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	214円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	225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	227,501,427
合計	227,501,427

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	6,431,862,111
合計	6,431,862,111

(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	1,131,797,200	—	1,157,309,000	25,511,800
合計		1,131,797,200	—	1,157,309,000	25,511,800

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	2,025,453,400	—	2,064,933,000	39,479,600
合計		2,025,453,400	—	2,064,933,000	39,479,600

(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	33,700	766.00	25,814,200	
I N P E X	121,400	2,025.00	245,835,000	
ウエストホールディングス	3,000	2,524.00	7,572,000	
ショーボンドホールディングス	4,500	5,903.00	26,563,500	
ミライト・ワン	11,100	1,877.00	20,834,700	
安藤・間	19,000	1,185.00	22,515,000	
コムシスホールディングス	11,300	3,134.00	35,414,200	
大成建設	21,400	4,833.00	103,426,200	
大林組	82,100	1,270.00	104,267,000	
清水建設	65,100	990.30	64,468,530	
長谷工コーポレーション	23,300	1,763.00	41,077,900	
鹿島建設	50,900	2,302.50	117,197,250	
西松建設	4,000	3,570.00	14,280,000	
戸田建設	28,400	803.90	22,830,760	
熊谷組	3,900	3,040.00	11,856,000	
五洋建設	31,200	839.30	26,186,160	
住友林業	19,800	4,014.00	79,477,200	
大和ハウス工業	63,700	3,867.00	246,327,900	
積水ハウス	69,600	2,893.00	201,352,800	
関電工	12,500	1,253.00	15,662,500	
エクシオグループ	10,500	2,872.00	30,156,000	
九電工	5,200	4,346.00	22,599,200	
インフロニア・ホールディングス	24,000	1,419.50	34,068,000	
森永製菓	4,300	5,095.00	21,908,500	
カルビー	10,400	2,685.00	27,924,000	
森永乳業	4,200	5,635.00	23,667,000	
ヤクルト本社	16,400	7,664.00	125,689,600	
明治ホールディングス	28,700	3,711.00	106,505,700	
プリマハム	3,400	2,414.00	8,207,600	
日本ハム	9,400	4,408.00	41,435,200	
アサヒグループホールディングス	53,300	5,570.00	296,881,000	
キリンホールディングス	96,100	2,003.00	192,488,300	

宝ホールディングス	14,900	1,297.50	19,332,750
サントリー食品インターナショナル	16,300	4,665.00	76,039,500
キッコーマン	15,200	7,900.00	120,080,000
味の素	55,700	5,843.00	325,455,100
キューピー	12,000	2,396.50	28,758,000
カゴメ	9,900	3,327.00	32,937,300
ニチレイ	10,400	3,377.00	35,120,800
東洋水産	11,800	5,897.00	69,584,600
日清食品ホールディングス	8,100	12,270.00	99,387,000
日本たばこ産業	140,300	3,103.00	435,350,900
帝人	22,700	1,471.00	33,391,700
東レ	157,200	800.00	125,760,000
ゴールドウイン	4,300	10,240.00	44,032,000
王子ホールディングス	97,700	585.90	57,242,430
大王製紙	11,200	1,220.50	13,669,600
レンゴー	20,200	930.70	18,800,140
クラレ	34,200	1,471.50	50,325,300
旭化成	146,500	931.60	136,479,400
住友化学	174,000	405.50	70,557,000
日産化学	11,300	6,358.00	71,845,400
東ソー	31,800	1,854.50	58,973,100
トクヤマ	7,700	2,325.00	17,902,500
デンカ	8,800	2,623.00	23,082,400
信越化学工業	195,000	4,559.00	889,005,000
エア・ウォーター	21,400	1,777.50	38,038,500
日本酸素ホールディングス	22,900	3,385.00	77,516,500
三菱瓦斯化学	17,400	1,983.50	34,512,900
三井化学	20,000	4,108.00	82,160,000
三菱ケミカルグループ	158,400	857.80	135,875,520
KHネオケム	3,800	2,233.00	8,485,400
ダイセル	32,800	1,181.50	38,753,200
積水化学工業	48,000	2,235.00	107,280,000
日本ゼオン	14,000	1,542.00	21,588,000
アイカ工業	6,100	3,297.00	20,111,700
UBE	12,100	2,464.00	29,814,400
日油	7,200	6,066.00	43,675,200
花王	53,100	5,751.00	305,378,100
日本ペイントホールディングス	124,700	1,138.50	141,970,950

関西ペイント	18,800	2,389.00	44,913,200
富士フイルムホールディングス	45,200	8,341.00	377,013,200
資生堂	49,100	6,374.00	312,963,400
ライオン	30,800	1,526.00	47,000,800
ファンケル	10,600	2,687.00	28,482,200
コーセー	4,800	12,890.00	61,872,000
小林製薬	6,900	7,715.00	53,233,500
タカラバイオ	6,900	1,411.00	9,735,900
デクセリアルズ	6,900	3,329.00	22,970,100
日東電工	17,000	9,709.00	165,053,000
エフピコ	4,500	2,749.00	12,370,500
ニフコ	8,800	4,156.00	36,572,800
ユニ・チャーム	48,800	5,784.00	282,259,200
協和キリン	28,500	2,706.00	77,121,000
武田薬品工業	180,700	4,449.00	803,934,300
アステラス製薬	221,900	2,213.50	491,175,650
住友ファーマ	17,300	505.00	8,736,500
塩野義製薬	29,500	6,309.00	186,115,500
日本新薬	5,700	5,885.00	33,544,500
中外製薬	73,500	4,288.00	315,168,000
科研製薬	3,800	3,581.00	13,607,800
エーザイ	28,700	9,535.00	273,654,500
ロート製薬	22,900	3,662.00	83,859,800
小野薬品工業	45,400	2,806.50	127,415,100
参天製薬	42,900	1,361.00	58,386,900
JCRファーマ	7,900	1,252.50	9,894,750
東和薬品	3,700	2,132.00	7,888,400
第一三共	204,800	4,381.00	897,228,800
大塚ホールディングス	48,900	5,618.00	274,720,200
ペプチドリーム	11,000	1,810.00	19,910,000
出光興産	26,200	3,058.00	80,119,600
ENEOSホールディングス	399,000	532.00	212,268,000
コスモエネルギーホールディングス	8,900	4,947.00	44,028,300
横浜ゴム	11,900	2,952.00	35,128,800
TOYO TIRE	13,300	2,085.00	27,730,500
ブリヂストン	68,800	5,592.00	384,729,600
住友ゴム工業	22,400	1,461.00	32,726,400
AGC	21,900	4,888.00	107,047,200

太平洋セメント	14,900	2,822.00	42,047,800
東海カーボン	21,700	1,133.00	24,586,100
TOTO	15,500	3,951.00	61,240,500
日本碍子	27,700	1,911.00	52,934,700
日本特殊陶業	17,800	3,295.00	58,651,000
MARUWA	800	26,710.00	21,368,000
ニチアス	5,800	2,962.00	17,179,600
日本製鉄	108,300	3,390.00	367,137,000
JFEホールディングス	64,600	2,251.00	145,414,600
東京製鐵	7,600	1,668.00	12,676,800
三井金属鉱業	7,000	3,550.00	24,850,000
住友金属鉱山	28,200	4,436.00	125,095,200
DOWAホールディングス	5,400	4,649.00	25,104,600
住友電気工業	83,500	1,780.50	148,671,750
AREホールディングス	9,700	1,870.00	18,139,000
SUMCO	43,000	1,900.50	81,721,500
三和ホールディングス	22,100	2,043.00	45,150,300
リンナイ	13,400	2,781.00	37,265,400
三浦工業	9,800	3,260.00	31,948,000
アマダ	37,900	1,446.50	54,822,350
FUJ I	10,300	2,395.00	24,668,500
DMG森精機	13,700	2,474.00	33,893,800
ディスコ	11,600	25,865.00	300,034,000
オプトラン	3,100	1,894.00	5,871,400
ナブテスコ	14,800	2,707.50	40,071,000
SMC	7,600	70,440.00	535,344,000
小松製作所	110,900	4,057.00	449,921,300
住友重機械工業	14,000	3,454.00	48,356,000
日立建機	9,400	4,323.00	40,636,200
ローツェ	1,300	11,300.00	14,690,000
クボタ	125,200	2,194.50	274,751,400
荏原製作所	9,600	6,786.00	65,145,600
ダイキン工業	28,400	24,680.00	700,912,000
ダイフク	36,300	2,739.50	99,443,850
竹内製作所	3,800	4,355.00	16,549,000
ホシザキ	13,900	5,418.00	75,310,200
マキタ	29,300	4,134.00	121,126,200
三菱重工業	41,200	7,771.00	320,165,200

I H I	14,800	3,473.00	51,400,400
イビデン	13,700	8,288.00	113,545,600
ブラザー工業	31,500	2,545.00	80,167,500
ミネベアミツミ	41,100	2,504.00	102,914,400
日立製作所	97,000	9,350.00	906,950,000
三菱電機	244,500	1,844.00	450,858,000
富士電機	14,300	6,652.00	95,123,600
安川電機	28,200	5,768.00	162,657,600
ニデック	57,500	7,786.00	447,695,000
オムロン	21,800	7,013.00	152,883,400
MC J	8,800	1,131.00	9,952,800
日本電気	33,600	7,263.00	244,036,800
富士通	23,700	18,140.00	429,918,000
ルネサスエレクトロニクス	154,400	2,462.50	380,210,000
セイコーエプソン	30,500	2,353.50	71,781,750
ワコム	19,000	588.00	11,172,000
アルバック	5,500	5,697.00	31,333,500
エレコム	5,600	1,712.00	9,587,200
パナソニック ホールディングス	279,600	1,609.00	449,876,400
シャープ	28,600	880.70	25,188,020
アンリツ	16,200	1,019.50	16,515,900
ソニーグループ	62,100	12,220.00	758,862,000
T D K	37,600	5,177.00	194,655,200
横河電機	26,000	2,837.50	73,775,000
アズビル	16,300	4,748.00	77,392,400
日本光電工業	11,000	3,672.00	40,392,000
堀場製作所	4,500	7,445.00	33,502,500
アドバンテスト	18,700	18,120.00	338,844,000
キーエンス	14,500	59,790.00	866,955,000
シスメックス	20,100	7,944.00	159,674,400
フェローテックホールディングス	7,000	3,000.00	21,000,000
レーザーテック	10,800	21,610.00	233,388,000
カシオ計算機	16,300	1,276.00	20,798,800
ファナック	114,400	4,094.00	468,353,600
浜松ホトニクス	18,800	6,455.00	121,354,000
新光電気工業	8,200	5,855.00	48,011,000
京セラ	36,200	7,334.00	265,490,800
太陽誘電	11,400	4,007.00	45,679,800

村田製作所	71,100	8,072.00	573,919,200
小糸製作所	28,300	2,550.50	72,179,150
S C R E E Nホールディングス	4,100	14,485.00	59,388,500
東京エレクトロン	45,900	20,610.00	945,999,000
トヨタ紡織	9,200	2,714.00	24,968,800
豊田自動織機	17,000	10,145.00	172,465,000
デンソー	48,300	9,752.00	471,021,600
いすゞ自動車	68,300	1,778.50	121,471,550
トヨタ自動車	350,400	2,419.00	847,617,600
アイシン	18,200	4,634.00	84,338,800
本田技研工業	190,600	4,503.00	858,271,800
スズキ	43,100	5,232.00	225,499,200
S U B A R U	74,100	2,620.50	194,179,050
ヤマハ発動機	33,700	3,828.00	129,003,600
豊田合成	6,800	3,082.00	20,957,600
シマノ	9,500	21,190.00	201,305,000
テイ・エス テック	10,500	1,706.50	17,918,250
テルモ	72,000	4,315.00	310,680,000
島津製作所	28,600	4,245.00	121,407,000
東京精密	5,100	7,820.00	39,882,000
オリンパス	144,100	1,970.00	283,877,000
H O Y A	49,700	16,265.00	808,370,500
朝日インテック	26,200	2,743.50	71,879,700
バンダイナムコホールディングス	64,100	3,412.00	218,709,200
パイロットコーポレーション	3,700	4,609.00	17,053,300
ヤマハ	14,700	4,580.00	67,326,000
ピジョン	14,800	1,761.00	26,062,800
任天堂	116,400	6,294.00	732,621,600
中部電力	86,200	1,826.00	157,401,200
関西電力	90,500	1,900.00	171,950,000
九州電力	54,000	915.60	49,442,400
北海道電力	21,400	628.70	13,454,180
電源開発	17,500	2,229.50	39,016,250
イーレックス	3,800	984.00	3,739,200
レノバ	6,300	1,418.00	8,933,400
東京瓦斯	49,500	3,289.00	162,805,500
大阪瓦斯	47,500	2,282.50	108,418,750
S B Sホールディングス	2,000	3,115.00	6,230,000

東海旅客鉄道	18,200	18,395.00	334,789,000
ヤマトホールディングス	30,000	2,671.00	80,130,000
山九	6,100	5,062.00	30,878,200
センコーグループホールディングス	12,500	1,029.00	12,862,500
AZ-COM丸和ホールディングス	4,900	2,180.00	10,682,000
SGホールディングス	45,000	2,115.00	95,175,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	7,900	7,791.00	61,548,900
日本郵船	62,600	3,839.00	240,321,400
商船三井	41,100	4,058.00	166,783,800
川崎汽船	17,500	4,951.00	86,642,500
三井倉庫ホールディングス	2,400	4,080.00	9,792,000
NECネットエスアイ	8,000	1,918.00	15,344,000
システナ	39,600	264.00	10,454,400
日鉄ソリューションズ	4,200	3,895.00	16,359,000
TIS	25,800	3,300.00	85,140,000
コーエーテクモホールディングス	14,600	2,269.50	33,134,700
ネクソン	52,400	2,740.50	143,602,200
ティーガイア	2,300	1,684.00	3,873,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,200	2,472.50	15,329,500
GMOペイメントゲートウェイ	4,700	9,493.00	44,617,100
インターネットイニシアティブ	13,000	2,582.00	33,566,000
ラクス	11,300	2,311.50	26,119,950
チェンジホールディングス	5,300	2,033.00	10,774,900
野村総合研究所	46,900	4,006.00	187,881,400
インフォコム	2,600	2,720.00	7,072,000
オービック	7,800	24,185.00	188,643,000
ジャストシステム	3,400	3,165.00	10,761,000
Zホールディングス	334,400	417.70	139,678,880
トレンドマイクロ	11,200	6,276.00	70,291,200
日本オラクル	4,500	9,826.00	44,217,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,500	4,317.00	53,962,500
大塚商会	11,600	6,080.00	70,528,000
電通国際情報サービス	2,700	5,560.00	15,012,000
東映アニメーション	1,000	12,280.00	12,280,000
デジタルガレージ	4,200	3,785.00	15,897,000
ネットワンシステムズ	8,800	2,713.50	23,878,800
BIPROGY	8,800	3,565.00	31,372,000

USEN-NEXT HOLDINGS	2,300	3,510.00	8,073,000
日本電信電話	4,582,200	164.00	751,480,800
KDDI	154,400	4,233.00	653,575,200
ソフトバンク	377,500	1,623.00	612,682,500
光通信	2,700	22,780.00	61,506,000
GMOインターネットグループ	8,500	2,264.00	19,244,000
東宝	14,600	5,484.00	80,066,400
NTTデータグループ	73,800	1,881.00	138,817,800
DTS	4,800	3,155.00	15,144,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	12,000	5,440.00	65,280,000
カプコン	23,500	6,113.00	143,655,500
SCSK	19,100	2,420.50	46,231,550
NSD	8,300	2,722.00	22,592,600
コナミグループ	10,000	8,382.00	83,820,000
ソフトバンクグループ	98,200	6,675.00	655,485,000
双日	24,600	3,106.00	76,407,600
アルフレッサ ホールディングス	24,700	2,467.50	60,947,250
神戸物産	19,100	3,772.00	72,045,200
ダイワボウホールディングス	10,000	2,679.50	26,795,000
TOKAIホールディングス	11,700	914.00	10,693,800
シップヘルスケアホールディングス	8,900	2,462.00	21,911,800
メディパルホールディングス	23,700	2,483.00	58,847,100
伊藤忠商事	152,700	5,710.00	871,917,000
丸紅	193,500	2,428.00	469,818,000
豊田通商	21,600	8,384.00	181,094,400
兼松	9,500	2,025.00	19,237,500
三井物産	176,000	5,582.00	982,432,000
住友商事	151,000	2,970.50	448,545,500
三菱商事	151,200	7,170.00	1,084,104,000
阪和興業	4,500	4,780.00	21,510,000
岩谷産業	5,800	7,399.00	42,914,200
PALTAC	4,000	4,501.00	18,004,000
ミスミグループ本社	37,400	2,443.50	91,386,900
ローソン	6,300	7,164.00	45,133,200
エービーシー・マート	3,700	8,102.00	29,977,400
日本マクドナルドホールディングス	15,100	5,770.00	87,127,000
セリア	6,700	2,339.00	15,671,300
Monotaro	35,300	1,759.00	62,092,700

マツキョココカラ&カンパニー	15,100	9,122.00	137,742,200
ZOZO	16,400	2,709.50	44,435,800
ウエルシアホールディングス	12,700	2,741.50	34,817,050
クリエイトSDホールディングス	3,800	3,635.00	13,813,000
ネクステージ	5,200	3,335.00	17,342,000
コスモス薬品	2,400	17,050.00	40,920,000
セブン&アイ・ホールディングス	85,500	6,116.00	522,918,000
ツルハホールディングス	5,200	10,920.00	56,784,000
クスリのアオキホールディングス	2,200	8,822.00	19,408,400
FOOD & LIFE COMPANIES	13,400	2,691.00	36,059,400
ノジマ	8,500	1,266.00	10,761,000
良品計画	26,900	1,974.50	53,114,050
コーナン商事	3,400	3,560.00	12,104,000
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	50,000	3,042.00	152,100,000
ゼンショーホールディングス	13,700	7,291.00	99,886,700
ワークマン	2,700	5,050.00	13,635,000
スギホールディングス	5,100	6,754.00	34,445,400
日本瓦斯	13,400	2,145.00	28,743,000
ライフコーポレーション	2,300	3,680.00	8,464,000
丸井グループ	18,500	2,467.00	45,639,500
イズミ	3,800	3,683.00	13,995,400
ヤオコー	2,700	7,776.00	20,995,200
ケーズホールディングス	17,400	1,309.00	22,776,600
ニトリホールディングス	10,000	15,870.00	158,700,000
ファーストリテイリング	11,300	34,160.00	386,008,000
サンドラッグ	9,800	4,340.00	42,532,000
めぶきフィナンシャルグループ	114,400	389.40	44,547,360
コンコルディア・フィナンシャルグループ	128,300	624.30	80,097,690
SBI新生銀行	4,800	2,814.50	13,509,600
あおぞら銀行	14,500	2,816.50	40,839,250
三菱UFJフィナンシャル・グループ	895,600	1,121.50	1,004,415,400
りそなホールディングス	291,800	721.30	210,475,340
三井住友トラスト・ホールディングス	41,900	5,257.00	220,268,300
三井住友フィナンシャルグループ	164,100	6,401.00	1,050,404,100
千葉銀行	64,300	983.90	63,264,770
ふくおかフィナンシャルグループ	18,600	3,349.00	62,291,400

セブン銀行	82,800	300.20	24,856,560
みずほフィナンシャルグループ	333,100	2,311.00	769,794,100
GMOフィナンシャルホールディングス	4,600	703.00	3,233,800
ジャフコ グループ	7,600	1,742.50	13,243,000
大和証券グループ本社	166,700	773.90	129,009,130
野村ホールディングス	416,100	539.00	224,277,900
マネックスグループ	25,700	522.00	13,415,400
SOMPOホールディングス	39,700	6,195.00	245,941,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	47,000	5,136.00	241,392,000
第一生命ホールディングス	112,700	2,706.50	305,022,550
東京海上ホールディングス	228,100	3,106.00	708,478,600
T&Dホールディングス	61,900	2,239.00	138,594,100
全国保証	6,100	5,000.00	30,500,000
芙蓉総合リース	2,200	12,210.00	26,862,000
みずほリース	3,200	4,580.00	14,656,000
東京センチュリー	4,300	5,339.00	22,957,700
イオンフィナンシャルサービス	13,500	1,257.00	16,969,500
アコム	41,200	341.10	14,053,320
オリエントコーポレーション	6,400	1,097.00	7,020,800
オリックス	151,400	2,615.00	395,911,000
三菱HCキャピタル	90,000	903.00	81,270,000
日本取引所グループ	64,800	2,636.50	170,845,200
大東建託	8,700	15,345.00	133,501,500
ヒューリック	53,900	1,235.00	66,566,500
野村不動産ホールディングス	14,400	3,513.00	50,587,200
プレサンスコーポレーション	3,400	1,887.00	6,415,800
オープンハウスグループ	8,500	4,905.00	41,692,500
東急不動産ホールディングス	69,300	873.80	60,554,340
飯田グループホールディングス	20,200	2,336.50	47,197,300
ケイアイスター不動産	1,100	4,455.00	4,900,500
三井不動産	98,500	3,027.00	298,159,500
三菱地所	139,100	1,719.00	239,112,900
東京建物	20,200	1,861.50	37,602,300
住友不動産	41,600	3,664.00	152,422,400
スターツコーポレーション	3,300	2,957.00	9,758,100
日本エスコン	4,500	803.00	3,613,500
イオンモール	12,100	1,757.00	21,259,700
カチタス	6,300	2,329.00	14,672,700

UTグループ	3,500	2,512.00	8,792,000
エス・エム・エス	9,200	2,825.00	25,990,000
パーソルホールディングス	26,800	2,545.50	68,219,400
総合警備保障	46,300	884.80	40,966,240
カカコム	18,300	1,703.00	31,164,900
ディップ	4,100	3,335.00	13,673,500
ベネフィット・ワン	11,300	1,192.50	13,475,250
エムスリー	47,600	2,886.50	137,397,400
博報堂DYホールディングス	30,800	1,413.50	43,535,800
バリューコマース	1,700	1,215.00	2,065,500
H. U. グループホールディングス	6,600	2,580.00	17,028,000
ビー・エム・エル	3,200	2,666.00	8,531,200
ユー・エス・エス	24,600	2,531.50	62,274,900
サイバーエージェント	53,200	903.50	48,066,200
フルキャストホールディングス	2,000	2,107.00	4,214,000
エン・ジャパン	3,800	2,466.00	9,370,800
テクノプロ・ホールディングス	14,200	3,691.00	52,412,200
ジャパンマテリアル	7,200	2,294.00	16,516,800
リクルートホールディングス	169,900	4,960.00	842,704,000
ベルシステム24ホールディングス	3,600	1,464.00	5,270,400
ベイカレント・コンサルティング	17,800	4,500.00	80,100,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	8,700	2,164.00	18,826,800
リログループ	13,800	1,715.50	23,673,900
トランス・コスモス	3,200	3,245.00	10,384,000
セコム	24,400	10,030.00	244,732,000
メイテック	9,600	2,560.00	24,576,000
イオンディライト	2,900	3,095.00	8,975,500
合 計	21,560,700		55,441,067,720

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。