

## 2024年2月期 決算短信 (2023年8月16日～2024年2月15日)

2024年3月25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          | <a href="https://www.ja-asset.co.jp/">https://www.ja-asset.co.jp/</a> |       |                       |
| 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 | 2024年5月15日  |       |                       |
| 分配金支払開始予定日   | 2024年3月25日  |       |                       |

### I ファンドの運用状況

#### 1. 2024年2月期の運用状況 (2023年8月16日～2024年2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<br>(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      | %       |
| 2024年2月期 | 232,609 | (98.8) | 2,815                   | (1.2) | 235,424  | (100.0) |
| 2023年8月期 | 196,924 | (98.7) | 2,605                   | (1.3) | 199,530  | (100.0) |

##### (2) 設定・交換実績

|          | 前計算期間末<br>発行済口数<br>(①) | 設定口数<br>(②) | 交換口数<br>(③) | 当計算期間末<br>発行済口数<br>(①+②-③) |
|----------|------------------------|-------------|-------------|----------------------------|
|          | 千口                     | 千口          | 千口          | 千口                         |
| 2024年2月期 | 6,129                  | 737         | 766         | 6,100                      |
| 2023年8月期 | 6,360                  | 405         | 637         | 6,129                      |

##### (3) 基準価額

|          | 総資産<br>(①) | 負債<br>(②) | 純資産<br>(③) (①-②) | 1口当たり基準価額<br>(③/当計算期間末発行済口数) |
|----------|------------|-----------|------------------|------------------------------|
|          | 百万円        | 百万円       | 百万円              | 円                            |
| 2024年2月期 | 237,765    | 2,340     | 235,424          | 38,590                       |
| 2023年8月期 | 201,520    | 1,990     | 199,530          | 32,555                       |

##### (4) 分配金

|          | 1口当たり分配金 |
|----------|----------|
|          | 円        |
| 2024年2月期 | 268      |
| 2023年8月期 | 296      |

(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9期<br>2023年8月15日現在 | 第10期<br>2024年2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         | 4,151,643,901       | 4,024,977,933        |
| 株式              | 196,924,566,870     | 232,609,025,810      |
| 派生商品評価勘定        | 10,484,600          | 339,272,100          |
| 未収入金            | 7,624,480           | 219,917,700          |
| 未収配当金           | 225,419,000         | 331,984,000          |
| 前払金             | 8,060,000           | -                    |
| 差入委託証拠金         | 192,960,000         | 240,111,183          |
| 流動資産合計          | 201,520,758,851     | 237,765,288,726      |
| 資産合計            | 201,520,758,851     | 237,765,288,726      |
| 負債の部            |                     |                      |
| 流動負債            |                     |                      |
| 派生商品評価勘定        | 5,821,320           | -                    |
| 前受金             | -                   | 516,225,000          |
| 未払収益分配金         | 1,814,194,360       | 1,634,998,856        |
| 未払受託者報酬         | 50,937,950          | 56,532,370           |
| 未払委託者報酬         | 86,594,460          | 96,104,977           |
| 未払利息            | 4,735               | 258                  |
| その他未払費用         | 33,117,906          | 36,468,902           |
| 流動負債合計          | 1,990,670,731       | 2,340,330,363        |
| 負債合計            | 1,990,670,731       | 2,340,330,363        |
| 純資産の部           |                     |                      |
| 元本等             |                     |                      |
| 元本              | 127,998,766,940     | 127,407,895,928      |
| 剰余金             |                     |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 71,531,321,180      | 108,017,062,435      |
| (分配準備積立金)       | 3,853,718           | 3,094,734            |
| 元本等合計           | 199,530,088,120     | 235,424,958,363      |
| 純資産合計           | 199,530,088,120     | 235,424,958,363      |
| 負債純資産合計         | 201,520,758,851     | 237,765,288,726      |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

|  | 第9期                          | 第10期                         |
|--|------------------------------|------------------------------|
|  | 自 2023年2月16日<br>至 2023年8月15日 | 自 2023年8月16日<br>至 2024年2月15日 |
|  | 金額 (円)                       | 金額 (円)                       |
| 営業収益                                       |                              |                              |
| 受取配当金                                      | 1,984,954,376                | 1,823,459,000                |
| 受取利息                                       | 26,256                       | 12,429                       |
| 有価証券売買等損益                                  | 28,885,554,470               | 35,949,118,723               |
| 派生商品取引等損益                                  | 669,756,020                  | 655,694,660                  |
| その他収益                                      | 94,674                       | 361,071                      |
| 営業収益合計                                     | 31,540,385,796               | 38,428,645,883               |
| 営業費用                                       |                              |                              |
| 支払利息                                       | 753,474                      | 486,379                      |
| 受託者報酬                                      | 50,937,950                   | 56,532,370                   |
| 委託者報酬                                      | 86,594,460                   | 96,104,977                   |
| その他費用                                      | 33,172,559                   | 36,468,902                   |
| 営業費用合計                                     | 171,458,443                  | 189,592,628                  |
| 営業利益又は営業損失 (△)                             | 31,368,927,353               | 38,239,053,255               |
| 経常利益又は経常損失 (△)                             | 31,368,927,353               | 38,239,053,255               |
| 当期純利益又は当期純損失 (△)                           | 31,368,927,353               | 38,239,053,255               |
| 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 (△)                           | 43,572,411,048               | 71,531,321,180               |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                             | 4,763,853,197                | 9,545,296,398                |
| 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                    | 4,763,853,197                | 9,545,296,398                |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                             | 6,359,676,058                | 9,663,609,542                |
| 当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                    | 6,359,676,058                | 9,663,609,542                |
| 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  | 1,814,194,360                | 1,634,998,856                |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△)                           | 71,531,321,180               | 108,017,062,435              |

(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</p> <p>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。<br/>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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>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</p> <p>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。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>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9期<br>(2023年8月15日現在)   | 第10期<br>(2024年2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9期<br>2023年8月15日現在 | 第10期<br>2024年2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             | 132,835,939,904円    | 127,998,766,940円     |
|    | 期中追加設定元本額         | 8,467,668,408円      | 15,409,238,516円      |
|    | 期中一部交換元本額         | 13,304,841,372円     | 16,000,109,528円      |
| 2. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 6,129,035口          | 6,100,742口           |
| 3. | 1口当たり純資産額         | 32,555円             | 38,590円              |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第9期<br>自2023年2月16日<br>至2023年8月15日 |                | 第10期<br>自2023年8月16日<br>至2024年2月15日 |                |
|----|-----------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
|    | 分配金の計算過程                          | A. 配当等収益額      | 1,984,321,832円                     | A. 配当等収益額      |
|    | B. 分配準備積立金額                       | 4,431,215円     | B. 分配準備積立金額                        | 3,853,718円     |
|    | C. 配当等収益合計額<br>(A+B)              | 1,988,753,047円 | C. 配当等収益合計額<br>(A+B)               | 1,827,199,839円 |
|    | D. 経費                             | 170,704,969円   | D. 経費                              | 189,106,249円   |
|    | E. 収益分配可能額 (C-D)                  | 1,818,048,078円 | E. 収益分配可能額 (C-D)                   | 1,638,093,590円 |
|    | F. 収益分配金                          | 1,814,194,360円 | F. 収益分配金                           | 1,634,998,856円 |
|    | G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)           | 3,853,718円     | G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)            | 3,094,734円     |
|    | H. 口数                             | 6,129,035口     | H. 口数                              | 6,100,742口     |
|    | I. 1口当たり分配金<br>(F/H×1)            | 296円           | I. 1口当たり分配金<br>(F/H×1)             | 268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9期<br>自 2023年2月16日<br>至 2023年8月15日   | 第10期<br>自 2023年8月16日<br>至 2024年2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。<br>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。<br>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。<br>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。 | 同左                                   |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                     | 第9期<br>2023年8月15日現在  | 第10期<br>2024年2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<br>「(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。<br>先物取引<br>「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権<br>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    |

第10期(自 2023年8月16日 至 2024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 | 35,337,968,350    |
| 合計 | 35,337,968,350    |

(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<br>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 |

第10期 (2024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<br>買建 | 2,330,512,500 | —     | 2,669,800,000 | 339,287,500 |
| 合計   |                | 2,330,512,500 | —     | 2,669,800,000 | 339,287,500 |

(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            |    |
| ニッスイ            | 203,000 | 927.50   | 188,282,500   |    |
| I N P E X       | 81,200  | 1,933.00 | 156,959,600   |    |
| コムシスホールディングス    | 203,000 | 3,214.00 | 652,442,000   |    |
| 大成建設            | 40,600  | 4,695.00 | 190,617,000   |    |
| 大林組             | 203,000 | 1,371.00 | 278,313,000   |    |
| 清水建設            | 203,000 | 871.80   | 176,975,400   |    |
| 長谷工コーポレーション     | 40,600  | 1,841.50 | 74,764,900    |    |
| 鹿島建設            | 101,500 | 2,671.50 | 271,157,250   |    |
| 大和ハウス工業         | 203,000 | 4,299.00 | 872,697,000   |    |
| 積水ハウス           | 203,000 | 3,261.00 | 661,983,000   |    |
| 日揮ホールディングス      | 203,000 | 1,400.00 | 284,200,000   |    |
| 日清製粉グループ本社      | 203,000 | 2,090.00 | 424,270,000   |    |
| 明治ホールディングス      | 81,200  | 3,400.00 | 276,080,000   |    |
| 日本ハム            | 101,500 | 5,239.00 | 531,758,500   |    |
| サッポロホールディングス    | 40,600  | 6,964.00 | 282,738,400   |    |
| アサヒグループホールディングス | 203,000 | 5,315.00 | 1,078,945,000 |    |
| キリンホールディングス     | 203,000 | 2,104.50 | 427,213,500   |    |
| 宝ホールディングス       | 203,000 | 1,159.50 | 235,378,500   |    |
| キッコーマン          | 203,000 | 9,402.00 | 1,908,606,000 |    |
| 味の素             | 203,000 | 5,667.00 | 1,150,401,000 |    |
| ニチレイ            | 101,500 | 3,742.00 | 379,813,000   |    |
| 日本たばこ産業         | 203,000 | 3,880.00 | 787,640,000   |    |
| 帝人              | 40,600  | 1,229.00 | 49,897,400    |    |
| 東レ              | 203,000 | 676.00   | 137,228,000   |    |
| 王子ホールディングス      | 203,000 | 551.40   | 111,934,200   |    |
| 日本製紙            | 20,300  | 1,090.00 | 22,127,000    |    |
| クラレ             | 203,000 | 1,505.50 | 305,616,500   |    |
| 旭化成             | 203,000 | 1,010.00 | 205,030,000   |    |
| レゾナック・ホールディングス  | 20,300  | 3,125.00 | 63,437,500    |    |
| 住友化学            | 203,000 | 298.80   | 60,656,400    |    |
| 日産化学            | 203,000 | 6,177.00 | 1,253,931,000 |    |
| 東ソー             | 101,500 | 1,948.50 | 197,772,750   |    |

|                   |           |           |               |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|
| トクヤマ              | 40,600    | 2,283.00  | 92,689,800    |
| デンカ               | 40,600    | 2,458.50  | 99,815,100    |
| 信越化学工業            | 1,015,000 | 6,138.00  | 6,230,070,000 |
| 三井化学              | 40,600    | 3,965.00  | 160,979,000   |
| 三菱ケミカルグループ        | 101,500   | 838.40    | 85,097,600    |
| UBE               | 20,300    | 2,531.00  | 51,379,300    |
| 花王                | 203,000   | 5,462.00  | 1,108,786,000 |
| D I C             | 20,300    | 2,929.00  | 59,458,700    |
| 富士フイルムホールディングス    | 203,000   | 9,279.00  | 1,883,637,000 |
| 資生堂               | 203,000   | 3,902.00  | 792,106,000   |
| 日東電工              | 203,000   | 13,940.00 | 2,829,820,000 |
| 協和キリン             | 203,000   | 2,800.00  | 568,400,000   |
| 武田薬品工業            | 203,000   | 4,315.00  | 875,945,000   |
| アステラス製薬           | 1,015,000 | 1,652.50  | 1,677,287,500 |
| 住友ファーマ            | 203,000   | 354.00    | 71,862,000    |
| 塩野義製薬             | 203,000   | 6,995.00  | 1,419,985,000 |
| 中外製薬              | 609,000   | 5,705.00  | 3,474,345,000 |
| エーザイ              | 203,000   | 6,300.00  | 1,278,900,000 |
| 第一三共              | 609,000   | 4,789.00  | 2,916,501,000 |
| 大塚ホールディングス        | 203,000   | 5,428.00  | 1,101,884,000 |
| 出光興産              | 406,000   | 880.40    | 357,442,400   |
| E N E O Sホールディングス | 203,000   | 629.20    | 127,727,600   |
| 横浜ゴム              | 101,500   | 3,646.00  | 370,069,000   |
| ブリヂストン            | 203,000   | 6,482.00  | 1,315,846,000 |
| A G C             | 40,600    | 5,290.00  | 214,774,000   |
| 日本電気硝子            | 60,900    | 3,593.00  | 218,813,700   |
| 住友大阪セメント          | 20,300    | 3,527.00  | 71,598,100    |
| 太平洋セメント           | 20,300    | 3,087.00  | 62,666,100    |
| 東海カーボン            | 203,000   | 1,020.00  | 207,060,000   |
| T O T O           | 101,500   | 3,658.00  | 371,287,000   |
| 日本碍子              | 203,000   | 1,869.00  | 379,407,000   |
| 日本製鉄              | 20,300    | 3,428.00  | 69,588,400    |
| 神戸製鋼所             | 20,300    | 1,966.50  | 39,919,950    |
| J F Eホールディングス     | 20,300    | 2,248.50  | 45,644,550    |
| 大太平洋金属            | 20,300    | 1,313.00  | 26,653,900    |
| 三井金属鉱業            | 20,300    | 4,305.00  | 87,391,500    |
| 三菱マテリアル           | 20,300    | 2,553.00  | 51,825,900    |
| 住友金属鉱山            | 101,500   | 3,974.00  | 403,361,000   |

|                   |         |           |               |
|-------------------|---------|-----------|---------------|
| DOWAホールディングス      | 40,600  | 5,334.00  | 216,560,400   |
| 古河電気工業            | 20,300  | 2,809.00  | 57,022,700    |
| 住友電気工業            | 203,000 | 2,099.50  | 426,198,500   |
| フジクラ              | 203,000 | 1,696.00  | 344,288,000   |
| SUMCO             | 20,300  | 2,363.50  | 47,979,050    |
| 日本製鋼所             | 40,600  | 2,461.50  | 99,936,900    |
| オークマ              | 40,600  | 6,871.00  | 278,962,600   |
| アマダ               | 203,000 | 1,574.50  | 319,623,500   |
| SMC               | 20,300  | 82,680.00 | 1,678,404,000 |
| 小松製作所             | 203,000 | 4,288.00  | 870,464,000   |
| 住友重機械工業           | 40,600  | 4,429.00  | 179,817,400   |
| 日立建機              | 203,000 | 4,167.00  | 845,901,000   |
| クボタ               | 203,000 | 2,267.00  | 460,201,000   |
| 荏原製作所             | 40,600  | 10,910.00 | 442,946,000   |
| ダイキン工業            | 203,000 | 21,500.00 | 4,364,500,000 |
| 日本精工              | 203,000 | 760.20    | 154,320,600   |
| NTN               | 203,000 | 282.50    | 57,347,500    |
| ジェイテクト            | 203,000 | 1,340.50  | 272,121,500   |
| 日立造船              | 40,600  | 1,031.00  | 41,858,600    |
| 三菱重工業             | 20,300  | 10,905.00 | 221,371,500   |
| IHI               | 20,300  | 3,039.00  | 61,691,700    |
| コニカミノルタ           | 203,000 | 478.60    | 97,155,800    |
| ミネベアミツミ           | 203,000 | 3,047.00  | 618,541,000   |
| 日立製作所             | 40,600  | 12,130.00 | 492,478,000   |
| 三菱電機              | 203,000 | 2,201.00  | 446,803,000   |
| 富士電機              | 40,600  | 8,789.00  | 356,833,400   |
| 安川電機              | 203,000 | 5,369.00  | 1,089,907,000 |
| ニデック              | 162,400 | 5,622.00  | 913,012,800   |
| オムロン              | 203,000 | 5,351.00  | 1,086,253,000 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 40,600  | 2,561.00  | 103,976,600   |
| 日本電気              | 20,300  | 9,635.00  | 195,590,500   |
| 富士通               | 20,300  | 23,070.00 | 468,321,000   |
| ルネサスエレクトロニクス      | 203,000 | 2,536.00  | 514,808,000   |
| セイコーエプソン          | 406,000 | 2,412.00  | 979,272,000   |
| パナソニック ホールディングス   | 203,000 | 1,391.50  | 282,474,500   |
| シャープ              | 203,000 | 806.10    | 163,638,300   |
| ソニーグループ           | 203,000 | 13,710.00 | 2,783,130,000 |
| TDK               | 609,000 | 7,825.00  | 4,765,425,000 |

|                     |           |           |                |
|---------------------|-----------|-----------|----------------|
| アルプスアルパイン           | 203,000   | 1,021.00  | 207,263,000    |
| 横河電機                | 203,000   | 3,128.00  | 634,984,000    |
| アドバンテスト             | 1,624,000 | 7,045.00  | 11,441,080,000 |
| キーエンス               | 20,300    | 67,170.00 | 1,363,551,000  |
| レーザーテック             | 81,200    | 42,210.00 | 3,427,452,000  |
| カシオ計算機              | 203,000   | 1,158.00  | 235,074,000    |
| ファナック               | 1,015,000 | 3,974.00  | 4,033,610,000  |
| 京セラ                 | 1,624,000 | 2,199.00  | 3,571,176,000  |
| 太陽誘電                | 203,000   | 3,421.00  | 694,463,000    |
| 村田製作所               | 487,200   | 3,019.00  | 1,470,856,800  |
| S C R E E Nホールディングス | 81,200    | 19,400.00 | 1,575,280,000  |
| キヤノン                | 304,500   | 4,130.00  | 1,257,585,000  |
| リコー                 | 203,000   | 1,260.50  | 255,881,500    |
| 東京エレクトロン            | 609,000   | 35,210.00 | 21,442,890,000 |
| デンソー                | 812,000   | 2,618.00  | 2,125,816,000  |
| 川崎重工業               | 20,300    | 3,705.00  | 75,211,500     |
| 日産自動車               | 203,000   | 550.10    | 111,670,300    |
| いすゞ自動車              | 101,500   | 2,080.50  | 211,170,750    |
| トヨタ自動車              | 1,015,000 | 3,382.00  | 3,432,730,000  |
| 日野自動車               | 203,000   | 453.00    | 91,959,000     |
| 三菱自動車工業             | 20,300    | 440.00    | 8,932,000      |
| マツダ                 | 40,600    | 1,716.50  | 69,689,900     |
| 本田技研工業              | 1,218,000 | 1,721.50  | 2,096,787,000  |
| スズキ                 | 203,000   | 6,605.00  | 1,340,815,000  |
| S U B A R U         | 203,000   | 3,339.00  | 677,817,000    |
| ヤマハ発動機              | 609,000   | 1,380.00  | 840,420,000    |
| テルモ                 | 812,000   | 5,432.00  | 4,410,784,000  |
| ニコン                 | 203,000   | 1,510.50  | 306,631,500    |
| オリンパス               | 812,000   | 2,055.00  | 1,668,660,000  |
| HOYA                | 101,500   | 18,325.00 | 1,859,987,500  |
| シチズン時計              | 203,000   | 1,070.00  | 217,210,000    |
| バンダイナムコホールディングス     | 609,000   | 2,647.00  | 1,612,023,000  |
| T O P P A Nホールディングス | 101,500   | 3,599.00  | 365,298,500    |
| 大日本印刷               | 101,500   | 4,547.00  | 461,520,500    |
| ヤマハ                 | 203,000   | 3,220.00  | 653,660,000    |
| 任天堂                 | 203,000   | 8,950.00  | 1,816,850,000  |
| 東京電力ホールディングス        | 20,300    | 757.70    | 15,381,310     |
| 中部電力                | 20,300    | 1,822.50  | 36,996,750     |

|                        |           |          |                |
|------------------------|-----------|----------|----------------|
| 関西電力                   | 20,300    | 1,921.00 | 38,996,300     |
| 東京瓦斯                   | 40,600    | 3,122.00 | 126,753,200    |
| 大阪瓦斯                   | 40,600    | 3,006.00 | 122,043,600    |
| 東武鉄道                   | 40,600    | 3,786.00 | 153,711,600    |
| 東急                     | 101,500   | 1,705.50 | 173,108,250    |
| 小田急電鉄                  | 101,500   | 2,066.50 | 209,749,750    |
| 京王電鉄                   | 40,600    | 4,144.00 | 168,246,400    |
| 京成電鉄                   | 101,500   | 7,141.00 | 724,811,500    |
| 東日本旅客鉄道                | 20,300    | 8,818.00 | 179,005,400    |
| 西日本旅客鉄道                | 20,300    | 6,146.00 | 124,763,800    |
| 東海旅客鉄道                 | 101,500   | 3,670.00 | 372,505,000    |
| ヤマトホールディングス            | 203,000   | 2,400.00 | 487,200,000    |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 20,300    | 8,196.00 | 166,378,800    |
| 日本郵船                   | 60,900    | 4,775.00 | 290,797,500    |
| 商船三井                   | 60,900    | 5,215.00 | 317,593,500    |
| 川崎汽船                   | 60,900    | 6,910.00 | 420,819,000    |
| 日本航空                   | 203,000   | 2,753.00 | 558,859,000    |
| ANAホールディングス            | 20,300    | 3,217.00 | 65,305,100     |
| 三菱倉庫                   | 101,500   | 4,509.00 | 457,663,500    |
| ネクソン                   | 406,000   | 2,490.00 | 1,010,940,000  |
| メルカリ                   | 203,000   | 2,043.50 | 414,830,500    |
| LINEヤフー                | 81,200    | 417.60   | 33,909,120     |
| トレンドマイクロ               | 203,000   | 8,721.00 | 1,770,363,000  |
| 日本電信電話                 | 2,030,000 | 181.00   | 367,430,000    |
| KDDI                   | 1,218,000 | 4,510.00 | 5,493,180,000  |
| ソフトバンク                 | 203,000   | 1,946.00 | 395,038,000    |
| 東宝                     | 20,300    | 4,679.00 | 94,983,700     |
| NTTデータグループ             | 1,015,000 | 2,300.00 | 2,334,500,000  |
| コナミグループ                | 203,000   | 9,842.00 | 1,997,926,000  |
| ソフトバンクグループ             | 1,218,000 | 8,502.00 | 10,355,436,000 |
| 双日                     | 20,300    | 3,667.00 | 74,440,100     |
| 伊藤忠商事                  | 203,000   | 6,635.00 | 1,346,905,000  |
| 丸紅                     | 203,000   | 2,382.00 | 483,546,000    |
| 豊田通商                   | 203,000   | 9,217.00 | 1,871,051,000  |
| 三井物産                   | 203,000   | 6,052.00 | 1,228,556,000  |
| 住友商事                   | 203,000   | 3,455.00 | 701,365,000    |
| 三菱商事                   | 609,000   | 2,960.00 | 1,802,640,000  |
| J. フロント リテイリング         | 101,500   | 1,527.50 | 155,041,250    |

|                           |         |           |                |
|---------------------------|---------|-----------|----------------|
| 三越伊勢丹ホールディングス             | 203,000 | 2,040.00  | 414,120,000    |
| セブン&アイ・ホールディングス           | 203,000 | 6,182.00  | 1,254,946,000  |
| 高島屋                       | 101,500 | 2,185.00  | 221,777,500    |
| 丸井グループ                    | 203,000 | 2,443.00  | 495,929,000    |
| イオン                       | 203,000 | 3,566.00  | 723,898,000    |
| ニトリホールディングス               | 60,900  | 21,270.00 | 1,295,343,000  |
| ファーストリテイリング               | 609,000 | 41,630.00 | 25,352,670,000 |
| しずおかフィナンシャルグループ           | 203,000 | 1,394.00  | 282,982,000    |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ       | 203,000 | 691.00    | 140,273,000    |
| あおぞら銀行                    | 20,300  | 2,033.00  | 41,269,900     |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ         | 203,000 | 1,404.00  | 285,012,000    |
| りそなホールディングス               | 20,300  | 797.60    | 16,191,280     |
| 三井住友トラスト・ホールディングス         | 40,600  | 2,873.00  | 116,643,800    |
| 三井住友フィナンシャルグループ           | 20,300  | 7,770.00  | 157,731,000    |
| 千葉銀行                      | 203,000 | 1,093.00  | 221,879,000    |
| ふくおかフィナンシャルグループ           | 40,600  | 3,584.00  | 145,510,400    |
| みずほフィナンシャルグループ            | 20,300  | 2,665.00  | 54,099,500     |
| 大和証券グループ本社                | 203,000 | 1,035.50  | 210,206,500    |
| 野村ホールディングス                | 203,000 | 808.70    | 164,166,100    |
| SOMPOホールディングス             | 40,600  | 8,627.00  | 350,256,200    |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 60,900  | 7,477.00  | 455,349,300    |
| 第一生命ホールディングス              | 20,300  | 3,200.00  | 64,960,000     |
| 東京海上ホールディングス              | 304,500 | 4,367.00  | 1,329,751,500  |
| T&Dホールディングス               | 40,600  | 2,364.50  | 95,998,700     |
| クレディセゾン                   | 203,000 | 2,687.50  | 545,562,500    |
| オリックス                     | 203,000 | 2,986.50  | 606,259,500    |
| 日本取引所グループ                 | 203,000 | 3,750.00  | 761,250,000    |
| 東急不動産ホールディングス             | 203,000 | 961.30    | 195,143,900    |
| 三井不動産                     | 203,000 | 3,923.00  | 796,369,000    |
| 三菱地所                      | 203,000 | 2,018.50  | 409,755,500    |
| 東京建物                      | 101,500 | 2,181.00  | 221,371,500    |
| 住友不動産                     | 203,000 | 4,521.00  | 917,763,000    |
| エムスリー                     | 487,200 | 2,012.00  | 980,246,400    |
| ディー・エヌ・エー                 | 60,900  | 1,230.00  | 74,907,000     |
| 電通グループ                    | 203,000 | 4,170.00  | 846,510,000    |
| オリエンタルランド                 | 203,000 | 5,298.00  | 1,075,494,000  |
| サイバーエージェント                | 162,400 | 1,044.50  | 169,626,800    |

|               |            |           |                 |  |
|---------------|------------|-----------|-----------------|--|
| 楽天グループ        | 203,000    | 731.20    | 148,433,600     |  |
| リクルートホールディングス | 609,000    | 5,971.00  | 3,636,339,000   |  |
| 日本郵政          | 203,000    | 1,398.00  | 283,794,000     |  |
| セコム           | 203,000    | 10,550.00 | 2,141,650,000   |  |
| 合 計           | 49,795,900 |           | 232,609,025,810 |  |

## 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。