

2020年2月期 決算短信 (2019年8月16日～2020年2月15日)

2020年3月26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	http://www.ja-asset.co.jp/		
代表者	代表取締役社長	吉田 一生	
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	2020年5月15日		
分配金支払開始予定日	2020年3月25日		

I ファンドの運用状況

1. 2020年2月期の運用状況 (2019年8月16日～2020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 (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	%
2020年2月期	19,123	(98.0)	388	(2.0)	19,512	(100.0)
2019年8月期	9,435	(98.4)	150	(1.6)	9,586	(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
2020年2月期	726	550	—	1,276
2019年8月期	—	833	107	726

(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
2020年2月期	19,661	149	19,512	15,287
2019年8月期	9,753	167	9,586	13,199

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年2月期	103
2019年8月期	197

(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1期 2019年8月15日現在	第2期 2020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	288,496,919	507,306,232
株式	9,435,343,740	19,123,521,910
未収配当金	19,529,957	28,153,100
前払金	10,287,000	-
差入委託証拠金	-	2,817,500
流動資産合計	9,753,657,616	19,661,798,742
資産合計	9,753,657,616	19,661,798,742
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,389,389	2,436,655
前受金	-	1,565,500
未払金	6,647,832	247,454
未払収益分配金	143,078,539	131,465,080
未払受託者報酬	1,781,067	2,351,313
未払委託者報酬	5,533,959	7,305,803
未払利息	305	622
その他未払費用	4,099,011	4,104,103
流動負債合計	167,530,102	149,476,530
負債合計	167,530,102	149,476,530
純資産の部		
元本等		
元本	10,202,153,489	17,929,028,920
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△616,025,975	1,583,293,292
(分配準備積立金)	271,499	639,012
元本等合計	9,586,127,514	19,512,322,212
純資産合計	9,586,127,514	19,512,322,212
負債純資産合計	9,753,657,616	19,661,798,742

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期	第2期
	自 2019年2月5日 至 2019年8月15日	自 2019年8月16日 至 2020年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	154,706,475	145,579,761
受取利息	296	280
有価証券売買等損益	△616,595,613	1,812,156,423
派生商品取引等損益	△18,877,265	48,252,024
その他収益	123,401	102,974
営業収益合計	△480,642,706	2,006,091,462
営業費用		
支払利息	52,702	84,885
受託者報酬	1,781,067	2,351,313
委託者報酬	5,533,959	7,305,803
その他費用	4,112,406	4,108,421
営業費用合計	11,480,134	13,850,422
営業利益又は営業損失 (△)	△492,122,840	1,992,241,040
経常利益又は経常損失 (△)	△492,122,840	1,992,241,040
当期純利益又は当期純損失 (△)	△492,122,840	1,992,241,040
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 (△)	-	△616,025,975
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,166,897	338,543,307
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	35,166,897	338,543,307
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,991,493	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,991,493	-
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	143,078,539	131,465,080
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△616,025,975	1,583,293,292

(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。

(貸借対照表に関する注記)

項目		第1期 2019年8月15日現在	第2期 2020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	10,165,322,255円	10,202,153,489円
	期中追加設定元本額	1,545,212,141円	7,726,875,431円
	期中一部交換元本額	1,508,380,907円	－円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	726,287口	1,276,360口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	616,025,975円	－円
4.	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	40,513,000円	15,458,000円
	合計	40,513,000円	15,458,000円
5.	1口当たり純資産額	13,199円	15,287円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期		第2期	
	自 2019年 2月 5日 至 2019年 8月 15日		自 2019年 8月 16日 至 2020年 2月 15日	
分配金の計算過程	A. 配当等収益額	154,777,470 円	A. 配当等収益額	145,598,130 円
	B. 分配準備積立金額	0 円	B. 分配準備積立金額	271,499 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	154,777,470 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	145,869,629 円
	D. 経費	11,427,432 円	D. 経費	13,765,537 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	143,350,038 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	132,104,092 円
	F. 収益分配金	143,078,539 円	F. 収益分配金	131,465,080 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	271,499 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	639,012 円
	H. 口数	726,287 口	H. 口数	1,276,360 口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	197 円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	103 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1期 自 2019年 2月 5日 至 2019年 8月 15日	第2期 自 2019年 8月 16日 至 2020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。 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1期 2019年8月15日現在	第2期 2020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 「(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1期(自 2019年2月5日 至 2019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	△609,906,538
合計	△609,906,538

第2期(自 2019年8月16日 至 2020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	1,778,098,145
合計	1,778,098,145

(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1期 (2019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	147,894,000	—	141,507,500	△6,386,500
合計		147,894,000	—	141,507,500	△6,386,500

第2期 (2020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	370,754,000	—	368,324,000	△2,430,000
合計		370,754,000	—	368,324,000	△2,430,000

(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	13,700	616.00	8,439,200	
マルハニチロ	2,100	2,542.00	5,338,200	
国際石油開発帝石	55,700	1,050.50	58,512,850	
安藤・間	8,700	881.00	7,664,700	
東急建設	4,300	751.00	3,229,300	
コムスホールディングス	4,700	2,961.00	13,916,700	
大成建設	10,900	4,245.00	46,270,500	
大林組	32,400	1,249.00	40,467,600	
清水建設	32,800	1,113.00	36,506,400	
長谷工コーポレーション	12,500	1,459.00	18,237,500	
鹿島建設	25,300	1,316.00	33,294,800	
西松建設	2,400	2,487.00	5,968,800	
三井住友建設	8,100	612.00	4,957,200	
前田建設工業	8,000	1,108.00	8,864,000	
戸田建設	13,400	737.00	9,875,800	
熊谷組	1,400	3,225.00	4,515,000	
大東建託	3,800	12,715.00	48,317,000	
NIPPO	2,600	2,727.00	7,090,200	
五洋建設	13,400	679.00	9,098,600	
住友林業	8,000	1,745.00	13,960,000	
大和ハウス工業	31,700	3,334.00	105,687,800	
積水ハウス	35,300	2,407.00	84,967,100	
協和エクシオ	4,800	2,670.00	12,816,000	
九電工	2,300	3,235.00	7,440,500	
森永製菓	2,400	4,950.00	11,880,000	
江崎グリコ	3,200	4,705.00	15,056,000	
カルビー	4,600	3,170.00	14,582,000	
ヤクルト本社	7,100	5,370.00	38,127,000	
明治ホールディングス	6,800	7,090.00	48,212,000	
日本ハム	3,900	4,775.00	18,622,500	
アサヒグループホールディングス	21,500	5,011.00	107,736,500	
キリンホールディングス	43,900	2,532.00	111,154,800	

サントリー食品インターナショナル	6,800	4,695.00	31,926,000
キッコーマン	7,500	5,820.00	43,650,000
味の素	22,600	1,994.50	45,075,700
キューピー	5,700	2,194.00	12,505,800
アリアケジャパン	1,000	7,500.00	7,500,000
ニチレイ	4,900	2,763.00	13,538,700
東洋水産	5,500	4,605.00	25,327,500
日清食品ホールディングス	4,400	8,980.00	39,512,000
日本たばこ産業	59,700	2,276.50	135,907,050
帝人	8,000	2,010.00	16,080,000
東レ	73,100	707.50	51,718,250
ゴールドウイン	2,000	7,310.00	14,620,000
王子ホールディングス	42,100	578.00	24,333,800
クラレ	15,800	1,344.00	21,235,200
旭化成	67,200	1,053.00	70,761,600
昭和電工	7,000	2,737.00	19,159,000
住友化学	74,000	454.00	33,596,000
日産化学	5,600	5,140.00	28,784,000
東ソー	15,500	1,657.00	25,683,500
トクヤマ	3,100	2,791.00	8,652,100
デンカ	3,700	3,035.00	11,229,500
信越化学工業	17,200	13,565.00	233,318,000
エア・ウォーター	9,300	1,613.00	15,000,900
大陽日酸	9,800	2,314.00	22,677,200
三菱瓦斯化学	9,400	1,848.00	17,371,200
三井化学	9,100	2,581.00	23,487,100
J S R	9,300	2,160.00	20,088,000
三菱ケミカルホールディングス	66,900	796.20	53,265,780
ダイセル	14,500	1,033.00	14,978,500
積水化学工業	21,700	1,855.00	40,253,500
アイカ工業	3,200	3,550.00	11,360,000
宇部興産	5,000	2,218.00	11,090,000
日立化成	3,800	4,610.00	17,518,000
ダイキョーニシカワ	2,200	738.00	1,623,600
日油	3,600	3,970.00	14,292,000
花王	24,700	8,735.00	215,754,500
日本ペイントホールディングス	8,300	5,180.00	42,994,000
関西ペイント	11,300	2,565.00	28,984,500

D I C	4,400	3,125.00	13,750,000
資生堂	20,400	7,137.00	145,594,800
ライオン	13,400	2,043.00	27,376,200
コーセー	2,000	15,220.00	30,440,000
ポーラ・オルビスホールディングス	4,400	2,369.00	10,423,600
小林製薬	3,000	8,840.00	26,520,000
日東電工	7,100	6,100.00	43,310,000
ニフコ	3,700	2,935.00	10,859,500
ユニ・チャーム	19,900	3,823.00	76,077,700
協和キリン	10,200	2,830.00	28,866,000
武田薬品工業	65,800	4,298.00	282,808,400
アステラス製薬	90,600	1,906.50	172,728,900
大日本住友製薬	7,700	1,808.00	13,921,600
塩野義製薬	13,200	6,464.00	85,324,800
日本新薬	2,600	9,550.00	24,830,000
中外製薬	10,600	11,900.00	126,140,000
科研製薬	2,000	6,020.00	12,040,000
エーザイ	12,300	8,951.00	110,097,300
小野薬品工業	23,600	2,604.50	61,466,200
久光製薬	2,600	5,730.00	14,898,000
参天製薬	19,100	2,034.00	38,849,400
沢井製薬	2,200	7,160.00	15,752,000
第一三共	29,500	7,738.00	228,271,000
大塚ホールディングス	19,400	4,741.00	91,975,400
ペプチドリーム	5,300	5,250.00	27,825,000
出光興産	11,600	2,827.00	32,793,200
J X T Gホールディングス	154,800	475.80	73,653,840
コスモエネルギーホールディングス	3,100	2,041.00	6,327,100
横浜ゴム	5,800	1,907.00	11,060,600
ブリヂストン	31,700	3,891.00	123,344,700
住友ゴム工業	9,100	1,229.00	11,183,900
A G C	10,100	3,500.00	35,350,000
太平洋セメント	6,600	2,990.00	19,734,000
東海カーボン	10,700	1,012.00	10,828,400
T O T O	7,500	4,785.00	35,887,500
日本碍子	12,400	1,899.00	23,547,600
日本特殊陶業	8,000	1,920.00	15,360,000
ニチアス	2,700	2,547.00	6,876,900

日本製鉄	45,500	1,488.00	67,704,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	27,200	1,228.00	33,401,600
日立金属	11,100	1,714.00	19,025,400
日本軽金属ホールディングス	27,100	212.00	5,745,200
住友金属鉱山	13,100	3,172.00	41,553,200
DOWAホールディングス	2,300	3,910.00	8,993,000
古河電気工業	3,100	2,582.00	8,004,200
住友電気工業	37,700	1,469.00	55,381,300
SUMCO	12,300	1,916.00	23,566,800
三和ホールディングス	10,300	1,135.00	11,690,500
リンナイ	2,000	8,100.00	16,200,000
東プレ	2,100	1,709.00	3,588,900
アマダホールディングス	12,900	1,119.00	14,435,100
オーエスジー	4,600	1,839.00	8,459,400
DMG森精機	6,600	1,579.00	10,421,400
ディスコ	1,300	26,860.00	34,918,000
ナブテスコ	5,800	3,405.00	19,749,000
三井海洋開発	1,100	2,070.00	2,277,000
SMC	3,300	50,080.00	165,264,000
小松製作所	46,300	2,336.50	108,179,950
住友重機械工業	5,800	2,726.00	15,810,800
日立建機	4,300	3,045.00	13,093,500
ハーモニック・ドライブ・システムズ	2,200	5,630.00	12,386,000
クボタ	54,600	1,716.50	93,720,900
ダイキン工業	13,200	15,120.00	199,584,000
ダイフク	5,300	7,000.00	37,100,000
竹内製作所	1,700	1,998.00	3,396,600
T P R	1,300	1,711.00	2,224,300
日本精工	19,400	919.00	17,828,600
ジェイテクト	10,000	1,175.00	11,750,000
THK	5,800	2,871.00	16,651,800
マキタ	13,500	4,280.00	57,780,000
三菱重工業	17,200	3,868.00	66,529,600
I H I	7,500	2,802.00	21,015,000
コニカミノルタ	22,300	659.00	14,695,700
ブラザー工業	12,600	2,246.00	28,299,600
ミネベアミツミ	19,100	2,200.00	42,020,000
日立製作所	49,500	4,164.00	206,118,000

三菱電機	103,000	1,567.00	161,401,000
富士電機	6,100	3,455.00	21,075,500
安川電機	11,100	3,890.00	43,179,000
東芝テック	1,200	4,400.00	5,280,000
日本電産	12,400	14,475.00	179,490,000
日新電機	2,300	1,180.00	2,714,000
オムロン	9,200	6,730.00	61,916,000
日本電気	12,500	4,890.00	61,125,000
富士通	10,000	12,430.00	124,300,000
ルネサスエレクトロニクス	48,500	783.00	37,975,500
セイコーエプソン	12,600	1,676.00	21,117,600
アルバック	2,100	3,880.00	8,148,000
エレコム	1,000	4,065.00	4,065,000
パナソニック	117,700	1,207.50	142,122,750
富士通ゼネラル	3,000	2,493.00	7,479,000
ソニー	44,000	7,622.00	335,368,000
TDK	4,900	11,870.00	58,163,000
アルプスアルパイン	9,100	1,924.00	17,508,400
ヒロセ電機	1,500	13,570.00	20,355,000
横河電機	9,400	1,939.00	18,226,600
アズビル	6,600	2,906.00	19,179,600
日本光電工業	4,500	3,455.00	15,547,500
堀場製作所	2,100	7,310.00	15,351,000
アドバンテスト	7,700	5,890.00	45,353,000
キーエンス	7,400	38,370.00	283,938,000
シスメックス	7,300	7,848.00	57,290,400
OBARA GROUP	300	3,350.00	1,005,000
レーザーテック	4,500	6,090.00	27,405,000
スタンレー電気	7,000	2,924.00	20,468,000
カシオ計算機	9,000	2,055.00	18,495,000
ファナック	9,800	20,655.00	202,419,000
浜松ホトニクス	7,300	4,700.00	34,310,000
京セラ	14,500	7,433.00	107,778,500
太陽誘電	4,500	3,550.00	15,975,000
村田製作所	30,300	6,480.00	196,344,000
小糸製作所	6,100	4,770.00	29,097,000
SCREENホールディングス	1,900	6,750.00	12,825,000
キヤノン	55,400	2,830.00	156,782,000

東京エレクトロン	6,800	25,685.00	174,658,000	
トヨタ紡織	3,500	1,621.00	5,673,500	
豊田自動織機	8,300	6,200.00	51,460,000	
デンソー	22,500	4,481.00	100,822,500	
川崎重工業	7,900	2,236.00	17,664,400	
いすゞ自動車	29,800	1,138.00	33,912,400	
トヨタ自動車	39,500	7,729.00	305,295,500	代用有価証券で 2,000株 担保差入
日野自動車	12,600	1,030.00	12,978,000	
アイシン精機	8,200	3,705.00	30,381,000	
マツダ	30,300	889.00	26,936,700	
本田技研工業	81,200	2,960.00	240,352,000	
スズキ	20,400	5,037.00	102,754,800	
SUBARU	31,700	2,857.00	90,566,900	
ヤマハ発動機	13,400	1,953.00	26,170,200	
豊田合成	3,300	2,488.00	8,210,400	
シマノ	3,800	15,960.00	60,648,000	
テイ・エス テック	2,300	3,140.00	7,222,000	
テルモ	29,200	3,896.00	113,763,200	
島津製作所	12,300	3,045.00	37,453,500	
ブイ・テクノロジー	300	4,560.00	1,368,000	
東京精密	2,000	4,040.00	8,080,000	
ニコン	16,700	1,204.00	20,106,800	
オリンパス	56,900	2,036.50	115,876,850	
HOYA	20,500	10,190.00	208,895,000	
朝日インテック	11,400	3,115.00	35,511,000	
バンダイナムコホールディングス	10,600	6,078.00	64,426,800	
パイロットコーポレーション	1,800	4,485.00	8,073,000	
タカラトミー	4,400	1,088.00	4,787,200	
ヤマハ	5,900	5,760.00	33,984,000	
ピジョン	6,300	3,945.00	24,853,500	
任天堂	6,400	39,840.00	254,976,000	
中部電力	31,100	1,517.50	47,194,250	
関西電力	38,900	1,264.50	49,189,050	
東北電力	25,800	1,042.00	26,883,600	
九州電力	20,900	865.00	18,078,500	
電源開発	8,000	2,561.00	20,488,000	
東京瓦斯	19,500	2,387.00	46,546,500	
大阪瓦斯	19,700	1,897.00	37,370,900	

東武鉄道	10,900	3,650.00	39,785,000
相鉄ホールディングス	4,600	2,790.00	12,834,000
東急	26,000	1,874.00	48,724,000
小田急電鉄	15,400	2,348.00	36,159,200
京王電鉄	5,400	5,950.00	32,130,000
京成電鉄	7,100	4,030.00	28,613,000
東日本旅客鉄道	18,100	9,438.00	170,827,800
西日本旅客鉄道	9,100	9,057.00	82,418,700
東海旅客鉄道	8,600	21,760.00	187,136,000
西武ホールディングス	13,800	1,730.00	23,874,000
近鉄グループホールディングス	9,800	5,400.00	52,920,000
阪急阪神ホールディングス	12,900	4,125.00	53,212,500
京阪ホールディングス	5,700	4,845.00	27,616,500
名古屋鉄道	10,400	3,165.00	32,916,000
日本通運	3,400	5,910.00	20,094,000
ヤマトホールディングス	17,000	1,921.00	32,657,000
山九	2,500	5,300.00	13,250,000
日立物流	1,900	3,235.00	6,146,500
日本航空	17,800	3,099.00	55,162,200
ANAホールディングス	17,900	3,395.00	60,770,500
日鉄ソリューションズ	1,300	3,235.00	4,205,500
T I S	3,400	7,050.00	23,970,000
ネクソン	28,400	1,837.00	52,170,800
コロプラ	3,300	955.00	3,151,500
ティーガイア	1,000	2,406.00	2,406,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,300	1,966.00	4,521,800
GMOペイメントゲートウェイ	1,600	7,840.00	12,544,000
アカツキ	200	4,885.00	977,000
野村総合研究所	14,300	2,688.00	38,438,400
オービック	3,500	15,160.00	53,060,000
Zホールディングス	138,800	452.00	62,737,600
トレンドマイクロ	4,500	6,000.00	27,000,000
日本オラクル	2,100	9,650.00	20,265,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,500	3,365.00	15,142,500
大塚商会	5,500	5,060.00	27,830,000
デジタルガレージ	2,100	4,365.00	9,166,500
日本ユニシス	3,200	3,710.00	11,872,000
日本テレビホールディングス	8,900	1,478.00	13,154,200

日本電信電話	102,800	2,798.50	287,685,800
KDDI	75,200	3,425.00	257,560,000
光通信	1,100	26,170.00	28,787,000
NTTドコモ	74,700	3,112.00	232,466,400
東宝	6,000	4,065.00	24,390,000
エヌ・ティ・ティ・データ	26,600	1,445.00	38,437,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,300	5,030.00	21,629,000
カプコン	4,700	3,315.00	15,580,500
SCSK	2,300	6,180.00	14,214,000
コナミホールディングス	3,600	4,375.00	15,750,000
ソフトバンクグループ	48,500	5,517.00	267,574,500
双日	55,700	351.00	19,550,700
アルフレッサ ホールディングス	11,200	2,179.00	24,404,800
神戸物産	3,500	4,575.00	16,012,500
ダイワボウホールディングス	1,000	6,220.00	6,220,000
TOKAIホールディングス	5,500	998.00	5,489,000
シップヘルスケアホールディングス	1,500	4,785.00	7,177,500
コメダホールディングス	2,300	2,187.00	5,030,100
第一興商	2,100	5,060.00	10,626,000
メディパルホールディングス	11,000	2,280.00	25,080,000
日本ライフライン	3,200	1,442.00	4,614,400
伊藤忠商事	71,000	2,617.00	185,807,000
丸紅	105,500	790.80	83,429,400
豊田通商	11,300	3,730.00	42,149,000
兼松	4,000	1,339.00	5,356,000
三井物産	89,200	1,943.00	173,315,600
日立ハイテク	3,500	8,030.00	28,105,000
住友商事	64,100	1,685.00	108,008,500
三菱商事	71,200	2,869.50	204,308,400
岩谷産業	2,200	3,710.00	8,162,000
PALTAC	1,500	5,080.00	7,620,000
日鉄物産	900	4,665.00	4,198,500
ミスミグループ本社	12,500	2,831.00	35,387,500
ローソン	2,400	6,200.00	14,880,000
エービーシー・マート	1,400	7,010.00	9,814,000
日本マクドナルドホールディングス	4,300	5,250.00	22,575,000
セリア	2,500	3,120.00	7,800,000
ビックカメラ	5,800	1,174.00	6,809,200

Monotaro	7,000	2,807.00	19,649,000
J. フロント リテイリング	12,700	1,357.00	17,233,900
マツモトキヨシホールディングス	4,300	4,140.00	17,802,000
ZOZO	6,900	1,818.00	12,544,200
ウエルシアホールディングス	3,100	6,350.00	19,685,000
クリエイティブSDホールディングス	1,300	2,858.00	3,715,400
すかいらーくホールディングス	11,300	1,962.00	22,170,600
コスモス薬品	400	24,300.00	9,720,000
セブン&アイ・ホールディングス	39,700	4,297.00	170,590,900
ツルハホールディングス	2,200	13,060.00	28,732,000
クスリのアオキホールディングス	1,100	6,810.00	7,491,000
ノジマ	2,000	2,252.00	4,504,000
良品計画	13,500	1,828.00	24,678,000
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	22,300	1,948.00	43,440,400
ゼンショーホールディングス	4,600	2,479.00	11,403,400
ワークマン	1,100	8,510.00	9,361,000
ユナイテッドアローズ	1,100	2,693.00	2,962,300
スギホールディングス	2,100	5,550.00	11,655,000
ファミリーマート	8,100	2,499.00	20,241,900
しまむら	1,200	7,940.00	9,528,000
丸井グループ	9,300	2,485.00	23,110,500
イオン	38,600	2,313.50	89,301,100
イズミ	2,100	3,480.00	7,308,000
ヤオコー	1,100	6,000.00	6,600,000
ケーズホールディングス	10,300	1,366.00	14,069,800
アインホールディングス	1,200	6,890.00	8,268,000
ニトリホールディングス	4,400	17,415.00	76,626,000
ファーストリテイリング	1,300	59,470.00	77,311,000
サンドラッグ	3,600	3,395.00	12,222,000
めぶきフィナンシャルグループ	52,500	248.00	13,020,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	59,800	434.00	25,953,200
新生銀行	7,300	1,713.00	12,504,900
あおぞら銀行	6,000	3,075.00	18,450,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	515,500	572.30	295,020,650
りそなホールディングス	110,300	456.80	50,385,040
三井住友トラスト・ホールディングス	19,200	4,023.00	77,241,600
三井住友フィナンシャルグループ	68,000	3,867.00	262,956,000

千葉銀行	34,500	604.00	20,838,000
セブン銀行	33,800	321.00	10,849,800
みずほフィナンシャルグループ	1,379,900	161.00	222,163,900
F P G	3,300	986.00	3,253,800
S B I ホールディングス	11,300	2,496.00	28,204,800
大和証券グループ本社	80,700	558.00	45,030,600
野村ホールディングス	178,700	562.00	100,429,400
松井証券	4,900	905.00	4,434,500
S O M P O ホールディングス	19,100	4,228.00	80,754,800
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	26,300	3,759.00	98,861,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,100	2,527.00	20,468,700
第一生命ホールディングス	57,100	1,732.00	98,897,200
東京海上ホールディングス	36,300	6,140.00	222,882,000
T & D ホールディングス	30,400	1,247.00	37,908,800
全国保証	2,800	4,740.00	13,272,000
芙蓉総合リース	1,100	7,030.00	7,733,000
東京センチュリー	2,100	5,400.00	11,340,000
イオンフィナンシャルサービス	6,600	1,802.00	11,893,200
オリエントコーポレーション	27,400	170.00	4,658,000
オリックス	63,500	1,918.00	121,793,000
三菱UFJリース	25,800	698.00	18,008,400
日本取引所グループ	29,200	2,010.00	58,692,000
いちご	12,800	408.00	5,222,400
ヒューリック	20,900	1,357.00	28,361,300
野村不動産ホールディングス	6,100	2,806.00	17,116,600
プレサンスコーポレーション	1,600	1,334.00	2,134,400
オープンハウス	3,200	2,911.00	9,315,200
東急不動産ホールディングス	27,100	781.00	21,165,100
飯田グループホールディングス	8,400	1,702.00	14,296,800
パーク24	5,500	2,806.00	15,433,000
三井不動産	50,000	2,934.50	146,725,000
三菱地所	71,200	2,125.50	151,335,600
東京建物	11,100	1,797.00	19,946,700
住友不動産	22,600	4,213.00	95,213,800
スターツコーポレーション	1,300	2,706.00	3,517,800
イオンモール	5,000	1,895.00	9,475,000
日本空港ビルデング	3,300	5,400.00	17,820,000
ミクシィ	2,500	1,920.00	4,800,000

ジェイエイシーリクルートメント	900	1,634.00	1,470,600	
日本M&Aセンター	7,300	3,930.00	28,689,000	
UTグループ	1,400	2,814.00	3,939,600	
エス・エム・エス	3,100	2,456.00	7,613,600	
パーソルホールディングス	9,900	2,125.00	21,037,500	
総合警備保障	3,700	5,790.00	21,423,000	
カカクコム	7,300	3,010.00	21,973,000	
ディップ	1,400	3,515.00	4,921,000	
ベネフィット・ワン	3,500	2,009.00	7,031,500	
エムスリー	21,700	3,260.00	70,742,000	
アウトソーシング	5,600	967.00	5,415,200	
ディー・エヌ・エー	4,800	1,604.00	7,699,200	
博報堂DYホールディングス	13,600	1,516.00	20,617,600	
電通グループ	10,100	3,525.00	35,602,500	
オリエンタルランド	10,400	14,510.00	150,904,000	
リゾートトラスト	4,300	1,678.00	7,215,400	
ユー・エス・エス	11,100	1,929.00	21,411,900	
サイバーエージェント	5,600	4,255.00	23,828,000	
楽天	45,600	905.00	41,268,000	
エン・ジャパン	1,800	3,985.00	7,173,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,100	7,950.00	16,695,000	
リクルートホールディングス	70,400	4,501.00	316,870,400	
リログループ	5,500	2,760.00	15,180,000	
カナモト	1,400	2,726.00	3,816,400	
セコム	10,400	9,783.00	101,743,200	
メイテック	1,200	5,980.00	7,176,000	
合 計	8,571,600		19,123,521,910	

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。