

2020年8月期 決算短信 (2020年2月16日～2020年8月15日)

2020年9月18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 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11月13日
 分配金支払開始予定日 2020年9月23日

I ファンドの運用状況

1. 2020年8月期の運用状況 (2020年2月16日～2020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	%
2020年8月期	24,778	(97.7)	578	(2.3)	25,356	(100.0)
2020年2月期	19,123	(98.0)	388	(2.0)	19,512	(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8月期	1,276	659	211	1,724
2020年2月期	726	550	—	1,276

(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8月期	25,620	264	25,356	14,706
2020年2月期	19,661	149	19,512	15,287

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2020年8月期	139
2020年2月期	103

(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2期 2020年2月15日現在	第3期 2020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	507,306,232	780,016,327
株式	19,123,521,910	24,778,139,460
派生商品評価勘定	-	5,811,974
未収入金	-	761,640
未収配当金	28,153,100	27,998,524
差入委託証拠金	2,817,500	28,222,000
流動資産合計	19,661,798,742	25,620,949,925
資産合計	19,661,798,742	25,620,949,925
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,436,655	-
前受金	1,565,500	7,903,300
未払金	247,454	-
未払収益分配金	131,465,080	239,667,553
未払受託者報酬	2,351,313	2,921,735
未払委託者報酬	7,305,803	9,078,186
未払利息	622	1,458
その他未払費用	4,104,103	5,185,368
流動負債合計	149,476,530	264,757,600
負債合計	149,476,530	264,757,600
純資産の部		
元本等		
元本	17,929,028,920	24,220,216,669
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,583,293,292	1,135,975,656
(分配準備積立金)	639,012	492,062
元本等合計	19,512,322,212	25,356,192,325
純資産合計	19,512,322,212	25,356,192,325
負債純資産合計	19,661,798,742	25,620,949,925

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第2期	第3期
	自 2019年8月16日 至 2020年2月15日	自 2020年2月16日 至 2020年8月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	145,579,761	256,744,619
受取利息	280	5,745
有価証券売買等損益	1,812,156,423	△208,999,265
派生商品取引等損益	48,252,024	38,045,439
その他収益	102,974	87,193
営業収益合計	2,006,091,462	85,883,731
営業費用		
支払利息	84,885	126,327
受託者報酬	2,351,313	2,921,735
委託者報酬	7,305,803	9,078,186
その他費用	4,108,421	5,190,706
営業費用合計	13,850,422	17,316,954
営業利益又は営業損失 (△)	1,992,241,040	68,566,777
経常利益又は経常損失 (△)	1,992,241,040	68,566,777
当期純利益又は当期純損失 (△)	1,992,241,040	68,566,777
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	1,583,293,292
剰余金増加額又は欠損金減少額	338,543,307	212,424,912
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	212,424,912
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	338,543,307	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	488,641,772
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	488,641,772
分配金	131,465,080	239,667,553
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,583,293,292	1,135,975,656

(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2期 2020年2月15日現在	第3期 2020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	10,202,153,489円	17,929,028,920円
	期中追加設定元本額	7,726,875,431円	9,268,955,091円
	期中一部交換元本額	－円	2,977,767,342円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	1,276,360口	1,724,227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	15,458,000円	14,362,000円
	合計	15,458,000円	14,362,000円
4.	1口当たり純資産額	15,287円	14,706円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期		第3期	
	自 2019年 8月 16日 至 2020年 2月 15日		自 2020年 2月 16日 至 2020年 8月 15日	
分配金の計算過程	A. 配当等収益額	145,598,130 円	A. 配当等収益額	256,711,230 円
	B. 分配準備積立金額	271,499 円	B. 分配準備積立金額	639,012 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	145,869,629 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	257,350,242 円
	D. 経費	13,765,537 円	D. 経費	17,190,627 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	132,104,092 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	240,159,615 円
	F. 収益分配金	131,465,080 円	F. 収益分配金	239,667,553 円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	639,012 円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	492,062 円
	H. 口数	1,276,360 口	H. 口数	1,724,227 口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	103 円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	139 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2期 自 2019年 8月 16日 至 2020年 2月 15日	第3期 自 2020年 2月 16日 至 2020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2期 2020年2月15日現在	第3期 2020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

第3期(自 2020年2月16日 至 2020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	212,183,690
合計	212,183,690

(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

第3期 (2020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	553,742,600	—	559,563,000	5,820,400
合計		553,742,600	—	559,563,000	5,820,400

(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	18,800	489.00	9,193,200	
マルハニチロ	2,900	2,321.00	6,730,900	
国際石油開発帝石	70,000	683.20	47,824,000	
安藤・間	11,500	656.00	7,544,000	
東急建設	6,000	495.00	2,970,000	
コムスホールディングス	6,700	3,160.00	21,172,000	
大成建設	14,800	3,545.00	52,466,000	
大林組	44,000	1,011.00	44,484,000	
清水建設	44,500	798.00	35,511,000	
長谷工コーポレーション	16,900	1,384.00	23,389,600	
鹿島建設	34,500	1,316.00	45,402,000	
西松建設	3,200	2,014.00	6,444,800	
三井住友建設	10,900	441.00	4,806,900	
前田建設工業	10,800	768.00	8,294,400	
戸田建設	18,300	692.00	12,663,600	
熊谷組	2,000	2,667.00	5,334,000	
大東建託	4,800	8,594.00	41,251,200	
N I P P O	3,600	2,849.00	10,256,400	
五洋建設	17,800	642.00	11,427,600	
住友林業	10,800	1,521.00	16,426,800	
大和ハウス工業	43,400	2,660.00	115,444,000	
積水ハウス	47,500	2,118.00	100,605,000	
協和エクシオ	6,700	2,722.00	18,237,400	
九電工	3,100	3,050.00	9,455,000	
森永製菓	3,200	4,060.00	12,992,000	
江崎グリコ	3,900	4,835.00	18,856,500	
カルビー	6,400	3,345.00	21,408,000	
ヤクルト本社	9,700	6,090.00	59,073,000	
明治ホールディングス	9,300	8,600.00	79,980,000	
日本ハム	5,400	4,855.00	26,217,000	
アサヒグループホールディングス	29,500	3,711.00	109,474,500	
キリンホールディングス	59,700	2,108.50	125,877,450	

サントリー食品インターナショナル	9,400	3,940.00	37,036,000
キッコーマン	10,100	5,850.00	59,085,000
味の素	31,100	1,915.50	59,572,050
キューピー	7,700	2,007.00	15,453,900
アリアケジャパン	1,300	7,400.00	9,620,000
ニチレイ	6,500	3,025.00	19,662,500
東洋水産	7,200	6,380.00	45,936,000
日清食品ホールディングス	6,000	10,670.00	64,020,000
日本たばこ産業	75,500	2,027.50	153,076,250
帝人	11,200	1,696.00	18,995,200
東レ	99,500	509.40	50,685,300
ゴールドウイン	2,500	6,960.00	17,400,000
王子ホールディングス	57,400	473.00	27,150,200
クラレ	21,500	1,126.00	24,209,000
旭化成	91,400	910.50	83,219,700
昭和電工	10,500	2,294.00	24,087,000
住友化学	100,700	359.00	36,151,300
日産化学	7,600	5,520.00	41,952,000
東ソー	21,200	1,504.00	31,884,800
トクヤマ	4,000	2,705.00	10,820,000
デンカ	4,900	2,897.00	14,195,300
信越化学工業	23,600	12,935.00	305,266,000
エア・ウォーター	12,500	1,491.00	18,637,500
大陽日酸	13,500	1,941.00	26,203,500
三菱瓦斯化学	12,600	1,857.00	23,398,200
三井化学	12,300	2,426.00	29,839,800
J S R	12,800	2,384.00	30,515,200
三菱ケミカルホールディングス	91,100	623.00	56,755,300
ダイセル	18,000	737.00	13,266,000
積水化学工業	29,000	1,650.00	47,850,000
アイカ工業	4,100	3,725.00	15,272,500
宇部興産	7,100	1,916.00	13,603,600
ダイキョーニシカワ	3,000	525.00	1,575,000
日油	5,200	4,280.00	22,256,000
花王	33,600	8,132.00	273,235,200
日本ペイントホールディングス	11,300	8,430.00	95,259,000
関西ペイント	15,300	2,431.00	37,194,300
D I C	6,000	2,592.00	15,552,000

資生堂	27,800	5,670.00	157,626,000
ライオン	18,300	2,354.00	43,078,200
コーセー	2,600	12,000.00	31,200,000
ポーラ・オルビスホールディングス	6,000	1,869.00	11,214,000
小林製薬	3,900	9,420.00	36,738,000
日東電工	9,700	6,240.00	60,528,000
ニフコ	5,100	2,597.00	13,244,700
ユニ・チャーム	29,800	4,658.00	138,808,400
協和キリン	14,100	2,721.00	38,366,100
武田薬品工業	89,600	3,980.00	356,608,000
アステラス製薬	121,600	1,765.00	214,624,000
大日本住友製薬	10,600	1,428.00	15,136,800
塩野義製薬	17,700	6,234.00	110,341,800
日本新薬	3,700	9,280.00	34,336,000
中外製薬	43,800	4,987.00	218,430,600
科研製薬	2,400	5,000.00	12,000,000
エーザイ	16,800	9,671.00	162,472,800
小野薬品工業	32,100	3,270.00	104,967,000
久光製薬	3,700	5,060.00	18,722,000
参天製薬	26,000	2,002.00	52,052,000
沢井製薬	2,900	5,340.00	15,486,000
第一三共	40,100	9,834.00	394,343,400
大塚ホールディングス	29,100	4,786.00	139,272,600
ペプチドリーム	7,100	4,690.00	33,299,000
出光興産	15,600	2,371.00	36,987,600
ENEOSホールディングス	210,800	415.00	87,482,000
コスモエネルギーホールディングス	4,400	1,721.00	7,572,400
横浜ゴム	7,800	1,629.00	12,706,200
ブリヂストン	37,400	3,305.00	123,607,000
住友ゴム工業	12,300	1,023.00	12,582,900
AGC	12,800	3,110.00	39,808,000
太平洋セメント	8,900	2,574.00	22,908,600
東海カーボン	13,700	972.00	13,316,400
TOTO	10,000	4,500.00	45,000,000
日本碍子	16,900	1,575.00	26,617,500
日本特殊陶業	10,800	1,812.00	19,569,600
ニチアス	4,000	2,478.00	9,912,000
日本製鉄	62,000	1,028.50	63,767,000

ジェイ エフ イー ホールディングス	37,300	790.00	29,467,000
日立金属	15,200	1,511.00	22,967,200
日本軽金属ホールディングス	36,300	193.00	7,005,900
住友金属鉱山	17,700	3,282.00	58,091,400
DOWAホールディングス	3,500	3,250.00	11,375,000
古河電気工業	4,400	2,413.00	10,617,200
住友電気工業	51,600	1,308.00	67,492,800
SUMCO	17,800	1,542.00	27,447,600
三和ホールディングス	13,100	996.00	13,047,600
リンナイ	2,700	9,590.00	25,893,000
東プレ	2,900	1,115.00	3,233,500
アマダ	17,300	861.00	14,895,300
オーエスジー	6,800	1,578.00	10,730,400
DMG森精機	9,100	1,308.00	11,902,800
ディスコ	1,900	26,170.00	49,723,000
ナブテスコ	8,200	3,380.00	27,716,000
三井海洋開発	1,500	1,762.00	2,643,000
SMC	4,400	59,800.00	263,120,000
小松製作所	63,300	2,254.00	142,678,200
住友重機械工業	7,800	2,519.00	19,648,200
日立建機	5,600	3,470.00	19,432,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	3,000	5,960.00	17,880,000
クボタ	74,400	1,723.00	128,191,200
ダイキン工業	17,900	19,930.00	356,747,000
ダイフク	7,200	9,900.00	71,280,000
竹内製作所	2,600	1,985.00	5,161,000
T P R	1,700	1,390.00	2,363,000
日本精工	26,300	831.00	21,855,300
ジェイテクト	13,700	847.00	11,603,900
THK	8,800	2,539.00	22,343,200
マキタ	18,400	4,870.00	89,608,000
三菱重工業	23,500	2,671.00	62,768,500
I H I	10,400	1,537.00	15,984,800
コニカミノルタ	30,400	342.00	10,396,800
ブラザー工業	17,000	1,800.00	30,600,000
ミネベアミツミ	26,000	1,912.00	49,712,000
日立製作所	67,300	3,550.00	238,915,000
三菱電機	140,200	1,455.00	203,991,000

富士電機	8,500	3,160.00	26,860,000
安川電機	15,200	3,860.00	58,672,000
東芝テック	1,800	4,380.00	7,884,000
日本電産	33,700	9,076.00	305,861,200
日新電機	3,100	1,071.00	3,320,100
オムロン	12,600	7,980.00	100,548,000
日本電気	16,900	5,520.00	93,288,000
富士通	13,500	14,265.00	192,577,500
ルネサスエレクトロニクス	59,800	688.00	41,142,400
セイコーエプソン	17,100	1,261.00	21,563,100
アルバック	2,600	3,850.00	10,010,000
エレコム	1,600	5,230.00	8,368,000
パナソニック	160,300	936.00	150,040,800
富士通ゼネラル	3,800	2,684.00	10,199,200
ソニー	59,400	8,876.00	527,234,400
TDK	6,800	11,690.00	79,492,000
アルプスアルパイン	12,300	1,579.00	19,421,700
ヒロセ電機	2,200	12,880.00	28,336,000
横河電機	12,700	1,722.00	21,869,400
アズビル	8,800	3,515.00	30,932,000
日本光電工業	5,800	3,750.00	21,750,000
堀場製作所	2,800	6,300.00	17,640,000
アドバンテスト	10,400	5,610.00	58,344,000
キーエンス	10,000	46,080.00	460,800,000
シスメックス	10,000	8,495.00	84,950,000
OBARA GROUP	800	3,585.00	2,868,000
レーザーテック	6,100	9,010.00	54,961,000
スタンレー電気	9,800	2,969.00	29,096,200
カシオ計算機	12,200	1,615.00	19,703,000
ファナック	13,200	19,440.00	256,608,000
浜松ホトニクス	10,100	4,945.00	49,944,500
京セラ	19,800	6,358.00	125,888,400
太陽誘電	6,100	3,185.00	19,428,500
村田製作所	41,200	6,807.00	280,448,400
小糸製作所	8,500	4,990.00	42,415,000
SCREENホールディングス	2,400	5,600.00	13,440,000
キヤノン	69,700	1,901.00	132,499,700
東京エレクトロン	8,900	28,690.00	255,341,000

トヨタ紡織	4,100	1,403.00	5,752,300	
豊田自動織機	11,300	6,160.00	69,608,000	
デンソー	30,900	4,387.00	135,558,300	
川崎重工業	10,700	1,523.00	16,296,100	
いすゞ自動車	40,700	1,043.50	42,470,450	
トヨタ自動車	53,700	7,181.00	385,619,700	代用有価証券で 2,000株 担保差入
日野自動車	17,300	716.00	12,386,800	
アイシン精機	11,400	3,640.00	41,496,000	
マツダ	41,300	657.00	27,134,100	
本田技研工業	110,500	2,722.00	300,781,000	
スズキ	27,700	4,195.00	116,201,500	
SUBARU	43,400	2,218.50	96,282,900	
ヤマハ発動機	19,800	1,783.00	35,303,400	
豊田合成	4,500	2,317.00	10,426,500	
シマノ	5,200	22,910.00	119,132,000	
テイ・エス テック	3,100	3,285.00	10,183,500	
テルモ	39,700	4,308.00	171,027,600	
島津製作所	16,800	3,195.00	53,676,000	
ブイ・テクノロジー	700	3,885.00	2,719,500	
東京精密	2,500	3,540.00	8,850,000	
ニコン	21,300	844.00	17,977,200	
オリンパス	77,500	2,181.00	169,027,500	
HOYA	27,800	10,750.00	298,850,000	
朝日インテック	15,700	3,160.00	49,612,000	
バンダイナムコホールディングス	14,500	6,491.00	94,119,500	
パイロットコーポレーション	2,500	3,365.00	8,412,500	
タカラトミー	6,000	877.00	5,262,000	
ヤマハ	8,300	5,120.00	42,496,000	
ピジョン	9,000	4,680.00	42,120,000	
任天堂	8,600	51,320.00	441,352,000	
中部電力	42,500	1,321.00	56,142,500	
関西電力	53,000	1,047.00	55,491,000	
東北電力	35,100	1,079.00	37,872,900	
九州電力	28,700	964.00	27,666,800	
電源開発	10,800	1,621.00	17,506,800	
東京瓦斯	26,700	2,401.00	64,106,700	
大阪瓦斯	27,100	2,113.00	57,262,300	
東武鉄道	14,700	3,370.00	49,539,000	

相鉄ホールディングス	6,000	2,873.00	17,238,000
東急	35,300	1,389.00	49,031,700
小田急電鉄	20,800	2,558.00	53,206,400
京王電鉄	7,300	6,150.00	44,895,000
京成電鉄	9,800	2,985.00	29,253,000
東日本旅客鉄道	24,600	6,673.00	164,155,800
西日本旅客鉄道	12,500	5,221.00	65,262,500
東海旅客鉄道	11,700	14,865.00	173,920,500
西武ホールディングス	18,300	1,117.00	20,441,100
近鉄グループホールディングス	13,300	4,625.00	61,512,500
阪急阪神ホールディングス	17,700	3,470.00	61,419,000
京阪ホールディングス	7,900	4,680.00	36,972,000
名古屋鉄道	14,400	2,940.00	42,336,000
日本通運	4,600	5,910.00	27,186,000
ヤマトホールディングス	23,100	2,768.00	63,940,800
山九	3,700	4,215.00	15,595,500
日立物流	2,400	3,425.00	8,220,000
日本航空	23,300	1,980.50	46,145,650
ANAホールディングス	24,400	2,408.50	58,767,400
日鉄ソリューションズ	2,100	3,050.00	6,405,000
T I S	13,800	2,218.00	30,608,400
ネクソン	34,700	2,607.00	90,462,900
コロプラ	4,500	983.00	4,423,500
ティーガイア	1,400	2,159.00	3,022,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,100	2,052.00	6,361,200
GMOペイメントゲートウェイ	2,900	12,130.00	35,177,000
アカツキ	500	4,130.00	2,065,000
野村総合研究所	19,600	2,851.00	55,879,600
オービック	4,800	18,860.00	90,528,000
Zホールディングス	188,800	650.00	122,720,000
トレンドマイクロ	7,400	6,520.00	48,248,000
日本オラクル	2,800	12,630.00	35,364,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,300	3,955.00	24,916,500
大塚商会	7,500	5,470.00	41,025,000
デジタルガレージ	2,500	3,560.00	8,900,000
日本ユニシス	4,400	3,150.00	13,860,000
日本テレビホールディングス	11,500	1,235.00	14,202,500
日本電信電話	139,800	2,644.50	369,701,100

KDDI	100,200	3,324.00	333,064,800
光通信	1,400	24,610.00	34,454,000
NTTドコモ	98,300	3,124.00	307,089,200
東宝	8,000	3,660.00	29,280,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,400	1,273.00	46,337,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,900	6,740.00	39,766,000
カプコン	6,500	5,050.00	32,825,000
SCSK	3,100	5,780.00	17,918,000
コナミホールディングス	5,000	3,930.00	19,650,000
ソフトバンクグループ	66,100	6,326.00	418,148,600
双日	76,100	242.00	18,416,200
アルフレッサ ホールディングス	15,300	2,147.00	32,849,100
神戸物産	4,700	6,680.00	31,396,000
ダイワボウホールディングス	1,200	6,540.00	7,848,000
TOKAIホールディングス	7,500	1,010.00	7,575,000
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,715.00	10,373,000
コメダホールディングス	3,100	1,769.00	5,483,900
第一興商	2,900	3,175.00	9,207,500
メディパルホールディングス	15,100	2,065.00	31,181,500
日本ライフライン	4,400	1,451.00	6,384,400
伊藤忠商事	96,600	2,573.50	248,600,100
丸紅	143,800	583.40	83,892,920
豊田通商	15,300	3,100.00	47,430,000
兼松	5,200	1,315.00	6,838,000
三井物産	119,500	1,772.00	211,754,000
住友商事	87,000	1,280.00	111,360,000
三菱商事	90,600	2,314.50	209,693,700
岩谷産業	3,000	3,790.00	11,370,000
PALTAC	2,200	5,940.00	13,068,000
日鉄物産	1,000	3,225.00	3,225,000
ミスミグループ本社	17,300	2,761.00	47,765,300
ローソン	3,500	5,360.00	18,760,000
エービーシー・マート	2,200	5,740.00	12,628,000
日本マクドナルドホールディングス	5,800	5,370.00	31,146,000
セリア	3,300	4,710.00	15,543,000
ビックカメラ	7,900	1,134.00	8,958,600
MonotaRO	9,800	4,360.00	42,728,000
J. フロント リテイリング	17,100	729.00	12,465,900

マツモトキヨシホールディングス	5,700	3,675.00	20,947,500
ZOZO	9,300	2,866.00	26,653,800
ウエルシアホールディングス	4,100	9,580.00	39,278,000
クリエイティブSDホールディングス	2,300	3,940.00	9,062,000
すかいらーくホールディングス	15,300	1,548.00	23,684,400
コスモス薬品	1,200	18,900.00	22,680,000
セブン&アイ・ホールディングス	54,100	3,444.00	186,320,400
ツルハホールディングス	3,000	14,690.00	44,070,000
クスリのアオキホールディングス	1,200	9,630.00	11,556,000
ノジマ	2,500	2,976.00	7,440,000
良品計画	18,400	1,537.00	28,280,800
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	30,400	2,446.00	74,358,400
ゼンショーホールディングス	6,600	2,191.00	14,460,600
ワークマン	1,400	9,660.00	13,524,000
ユナイテッドアローズ	1,500	1,528.00	2,292,000
スギホールディングス	2,800	7,750.00	21,700,000
ファミリーマート	9,500	2,301.00	21,859,500
しまむら	1,600	7,980.00	12,768,000
丸井グループ	12,500	1,804.00	22,550,000
イオン	53,100	2,715.00	144,166,500
イズミ	2,900	4,370.00	12,673,000
ヤオコー	1,500	8,430.00	12,645,000
ケーズホールディングス	13,300	1,438.00	19,125,400
アインホールディングス	1,600	6,600.00	10,560,000
ニトリホールディングス	6,000	22,390.00	134,340,000
ファーストリテイリング	1,800	61,590.00	110,862,000
サンドラッグ	5,200	4,030.00	20,956,000
めぶきフィナンシャルグループ	71,700	263.00	18,857,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	78,900	352.00	27,772,800
新生銀行	10,200	1,189.00	12,127,800
あおぞら銀行	8,000	1,912.00	15,296,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	696,900	435.50	303,499,950
りそなホールディングス	150,600	382.00	57,529,200
三井住友トラスト・ホールディングス	26,100	2,998.00	78,247,800
三井住友フィナンシャルグループ	92,600	3,085.00	285,671,000
千葉銀行	46,800	543.00	25,412,400
セブン銀行	46,000	268.00	12,328,000

みずほフィナンシャルグループ	1,878,500	143.80	270,128,300
F P G	4,500	522.00	2,349,000
S B I ホールディングス	15,300	2,361.00	36,123,300
大和証券グループ本社	110,300	489.10	53,947,730
野村ホールディングス	243,200	537.80	130,792,960
松井証券	7,900	924.00	7,299,600
S O M P O ホールディングス	26,000	3,859.00	100,334,000
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	36,000	2,904.00	104,544,000
第一生命ホールディングス	78,000	1,500.00	117,000,000
東京海上ホールディングス	48,800	4,869.00	237,607,200
T & D ホールディングス	41,300	1,065.00	43,984,500
全国保証	3,900	3,895.00	15,190,500
芙蓉総合リース	1,500	6,400.00	9,600,000
東京センチュリー	2,800	6,160.00	17,248,000
イオンフィナンシャルサービス	9,100	917.00	8,344,700
オリエントコーポレーション	37,600	116.00	4,361,600
オリックス	85,800	1,313.50	112,698,300
三菱U F J リース	35,100	509.00	17,865,900
日本取引所グループ	39,700	2,640.00	104,808,000
いちご	17,800	269.00	4,788,200
ヒューリック	28,700	967.00	27,752,900
野村不動産ホールディングス	8,500	1,960.00	16,660,000
プレサンスコーポレーション	2,200	1,328.00	2,921,600
オープンハウス	4,400	3,450.00	15,180,000
東急不動産ホールディングス	37,200	450.00	16,740,000
飯田グループホールディングス	11,700	2,068.00	24,195,600
パーク 2 4	7,500	1,591.00	11,932,500
三井不動産	68,200	1,809.00	123,373,800
三菱地所	97,100	1,668.50	162,011,350
東京建物	13,700	1,265.00	17,330,500
住友不動産	31,100	3,105.00	96,565,500
スターツコーポレーション	1,700	2,221.00	3,775,700
イオンモール	7,100	1,395.00	9,904,500
日本空港ビルデング	4,500	4,435.00	19,957,500
ミクシィ	3,300	2,335.00	7,705,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	1,248.00	1,622,400
日本M&Aセンター	10,200	5,460.00	55,692,000
U T グループ	2,100	3,065.00	6,436,500

エス・エム・エス	4,200	2,965.00	12,453,000	
パーソルホールディングス	13,600	1,703.00	23,160,800	
総合警備保障	5,300	5,300.00	28,090,000	
カカクコム	9,900	2,619.00	25,928,100	
ディップ	1,800	2,161.00	3,889,800	
ベネフィット・ワン	4,700	2,633.00	12,375,100	
エムスリー	29,500	5,950.00	175,525,000	
アウトソーシング	7,600	825.00	6,270,000	
ディー・エヌ・エー	5,800	1,771.00	10,271,800	
博報堂DYホールディングス	18,400	1,355.00	24,932,000	
電通グループ	15,100	2,871.00	43,352,100	
オリエンタルランド	14,200	14,080.00	199,936,000	
リゾートトラスト	6,000	1,327.00	7,962,000	
ユー・エス・エス	15,200	1,764.00	26,812,800	
サイバーエージェント	8,300	5,910.00	49,053,000	
楽天	62,100	982.00	60,982,200	
エン・ジャパン	2,400	3,085.00	7,404,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,700	6,080.00	16,416,000	
リクルートホールディングス	95,800	3,879.00	371,608,200	
リログループ	7,500	2,111.00	15,832,500	
カナモト	2,100	2,289.00	4,806,900	
セコム	14,200	10,185.00	144,627,000	
メイテック	1,600	5,280.00	8,448,000	
合 計	11,655,700		24,778,139,460	

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。