

2024年8月期 決算短信 (2024年2月16日～2024年8月15日)

2024年9月24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 配当込 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 プロダクトガバナンス部 デイスクロージャグループ 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8692
 有価証券報告書提出予定日 2024年11月15日
 分配金支払開始予定日 2024年9月20日

I ファンドの運用状況

1. 2024年8月期の運用状況 (2024年2月16日～2024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	%
2024年8月期	50,087	(97.5)	1,276	(2.5)	51,364	(100.0)
2024年2月期	51,848	(97.9)	1,106	(2.1)	52,955	(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
2024年8月期	2,231	109	214	2,127
2024年2月期	2,746	110	625	2,231

(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
2024年8月期	52,048	684	51,364	24,148
2024年2月期	53,732	777	52,955	23,731

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2024年8月期	252
2024年2月期	266

(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 10 期 2024 年 2 月 15 日現在	第 11 期 2024 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	1,587,990,154	1,582,885,481
株式	51,848,773,590	50,087,665,950
派生商品評価勘定	91,929,880	-
未収入金	49,404,220	-
未収配当金	74,336,050	63,596,832
未収利息	-	9,933
前払金	-	115,031,200
差入委託証拠金	79,774,242	199,133,978
流動資産合計	53,732,208,136	52,048,323,374
資産合計	53,732,208,136	52,048,323,374
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	72,122,950
前受金	137,170,000	-
未払金	-	29,136,480
未払収益分配金	593,559,848	536,025,168
未払受託者報酬	7,904,174	7,974,148
未払委託者報酬	24,559,346	24,776,783
未払利息	101	-
その他未払費用	13,969,421	14,208,301
流動負債合計	777,162,890	684,243,830
負債合計	777,162,890	684,243,830
純資産の部		
元本等		
元本	31,344,869,116	29,879,148,948
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	21,610,176,130	21,484,930,596
(分配準備積立金)	863,545	1,469,416
元本等合計	52,955,045,246	51,364,079,544
純資産合計	52,955,045,246	51,364,079,544
負債純資産合計	53,732,208,136	52,048,323,374

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第10期 自 2023年8月16日 至 2024年2月15日	第11期 自 2024年2月16日 至 2024年8月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	640,604,123	583,024,605
受取利息	6,160	572,393
有価証券売買等損益	5,869,553,579	872,836,868
派生商品取引等損益	240,774,082	732,646
その他収益	2,557	836
営業収益合計	6,750,940,501	1,457,167,348
営業費用		
支払利息	287,308	7,563
受託者報酬	7,904,174	7,974,148
委託者報酬	24,559,346	24,776,783
その他費用	13,969,421	14,208,301
営業費用合計	46,720,249	46,966,795
営業利益又は営業損失 (△)	6,704,220,252	1,410,200,553
経常利益又は経常損失 (△)	6,704,220,252	1,410,200,553
当期純利益又は当期純損失 (△)	6,704,220,252	1,410,200,553
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 (△)	18,960,752,792	21,610,176,130
剰余金増加額又は欠損金減少額	995,873,977	1,333,898,195
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	995,873,977	1,333,898,195
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,457,111,043	2,333,319,114
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,457,111,043	2,333,319,114
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	593,559,848	536,025,168
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	21,610,176,130	21,484,930,596

(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10期 (2024年2月15日現在)	第11期 (2024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10期 2024年2月15日現在	第11期 2024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	38,582,318,973円	31,344,869,116円
	期中追加設定元本額	1,545,731,880円	1,544,804,778円
	期中一部交換元本額	8,783,181,737円	3,010,524,946円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,231,428口	2,127,084口
3.	1口当たり純資産額	23,731円	24,148円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自2023年8月16日 至2024年2月15日		第11期 自2024年2月16日 至2024年8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	640,325,532円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	530,802円	B. 分配準備積立金額	863,545円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	640,856,334円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	584,453,816円
	D. 経費	46,432,941円	D. 経費	46,959,232円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	594,423,393円	E. 収益分配可能額 (C-D)	537,494,584円
	F. 収益分配金	593,559,848円	F. 収益分配金	536,025,168円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	863,545円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	1,469,416円
	H. 口数	2,231,428口	H. 口数	2,127,084口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	266円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	252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 10 期 自 2023 年 8 月 16 日 至 2024 年 2 月 15 日	第 11 期 自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 年 8 月 15 日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第 10 期 2024 年 2 月 15 日現在	第 11 期 2024 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 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	5,862,344,917
合計	5,862,344,917

第 11 期(自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 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	594,195,616
合計	594,195,616

(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 買建	985,380,000	—	1,077,320,000	91,940,000
合計		985,380,000	—	1,077,320,000	91,940,000

第11期 (2024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	1,324,236,400	—	1,252,125,000	△72,111,400
合計		1,324,236,400	—	1,252,125,000	△72,111,400

(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	
ニッセイ	26,300	866.20	22,781,060	
三井松島ホールディングス	1,600	4,750.00	7,600,000	
I N P E X	79,900	2,149.00	171,705,100	
ウエストホールディングス	2,300	2,313.00	5,319,900	
ショーボンドホールディングス	3,600	5,479.00	19,724,400	
ミライト・ワン	8,600	1,952.50	16,791,500	
タマホーム	1,700	4,090.00	6,953,000	
安藤・間	15,200	1,126.00	17,115,200	
コムシスホールディングス	8,700	3,029.00	26,352,300	
大成建設	16,900	6,158.00	104,070,200	
大林組	66,100	1,864.00	123,210,400	
清水建設	52,400	899.40	47,128,560	
長谷工コーポレーション	16,900	1,735.50	29,329,950	
鹿島建設	41,000	2,559.00	104,919,000	
住友林業	16,100	5,213.00	83,929,300	
大和ハウス工業	51,100	4,378.00	223,715,800	
積水ハウス	56,000	3,512.00	196,672,000	
関電工	11,500	1,884.00	21,666,000	
エクシオグループ	18,400	1,487.50	27,370,000	
九電工	4,000	6,212.00	24,848,000	
インフロニア・ホールディングス	21,300	1,191.50	25,378,950	
森永製菓	8,000	2,687.50	21,500,000	
カルビー	8,700	3,046.00	26,500,200	
森永乳業	6,800	3,260.00	22,168,000	
ヤクルト本社	26,400	2,928.00	77,299,200	
明治ホールディングス	22,600	3,443.00	77,811,800	
日本ハム	7,900	5,225.00	41,277,500	
アサヒグループホールディングス	46,500	5,203.00	241,939,500	
麒麟ホールディングス	77,200	2,046.50	157,989,800	
宝ホールディングス	12,600	1,091.50	13,752,900	
サントリー食品インターナショナル	13,000	4,978.00	64,714,000	
キッコーマン	61,800	1,712.00	105,801,600	

味の素	43,600	5,397.00	235,309,200
ニチレイ	8,700	3,957.00	34,425,900
東洋水産	9,300	9,434.00	87,736,200
日清食品ホールディングス	19,600	3,777.00	74,029,200
日本たばこ産業	112,600	4,141.00	466,276,600
東レ	126,500	725.10	91,725,150
ゴールドウイン	3,300	8,332.00	27,495,600
王子ホールディングス	78,500	569.50	44,705,750
レンゴー	17,100	944.40	16,149,240
クラレ	27,600	1,805.50	49,831,800
旭化成	127,600	997.40	127,268,240
住友化学	140,100	428.40	60,018,840
日産化学	8,800	4,686.00	41,236,800
東ソー	25,200	1,856.50	46,783,800
トクヤマ	6,100	2,741.50	16,723,150
デンカ	6,800	2,154.00	14,647,200
信越化学工業	149,800	6,067.00	908,836,600
エア・ウォーター	17,900	1,911.00	34,206,900
日本酸素ホールディングス	18,400	4,555.00	83,812,000
三菱瓦斯化学	14,100	2,637.00	37,181,700
三井化学	15,500	3,565.00	55,257,500
東京応化工業	9,000	3,809.00	34,281,000
三菱ケミカルグループ	137,900	833.00	114,870,700
KHネオケム	2,900	2,053.00	5,953,700
ダイセル	24,200	1,296.00	31,363,200
住友ベークライト	5,700	3,871.00	22,064,700
積水化学工業	38,100	2,160.00	82,296,000
日本ゼオン	12,900	1,186.50	15,305,850
アイカ工業	4,900	3,287.00	16,106,300
扶桑化学工業	2,000	3,890.00	7,780,000
ADEKA	6,800	2,954.00	20,087,200
日油	17,400	2,036.50	35,435,100
花王	46,000	6,327.00	291,042,000
日本ペイントホールディングス	83,500	879.40	73,429,900
関西ペイント	16,300	2,510.50	40,921,150
太陽ホールディングス	3,300	3,460.00	11,418,000
富士フイルムホールディングス	105,200	3,526.00	370,935,200
資生堂	39,500	3,400.00	134,300,000

ライオン	24,600	1,399.50	34,427,700
コーセー	3,800	8,467.00	32,174,600
小林製薬	5,000	5,469.00	27,345,000
タカラバイオ	5,300	1,002.00	5,310,600
デクセリアルズ	4,900	6,365.00	31,188,500
日東電工	12,200	11,070.00	135,054,000
ニフコ	5,600	3,403.00	19,056,800
ユニ・チャーム	39,400	4,982.00	196,290,800
協和キリン	22,700	3,051.00	69,257,700
武田薬品工業	146,100	4,292.00	627,061,200
アステラス製薬	165,600	1,695.50	280,774,800
塩野義製薬	22,900	6,422.00	147,063,800
日本新薬	4,900	3,327.00	16,302,300
中外製薬	59,100	6,588.00	389,350,800
エーザイ	22,900	5,834.00	133,598,600
ロート製薬	18,400	3,226.00	59,358,400
小野薬品工業	38,700	2,154.50	83,379,150
JCRファーマ	6,500	555.00	3,607,500
第一三共	145,500	5,751.00	836,770,500
大塚ホールディングス	47,100	8,075.00	380,332,500
ペプチドリーム	9,100	2,139.00	19,464,900
出光興産	98,100	1,054.00	103,397,400
Eneosホールディングス	299,000	725.40	216,894,600
コスモエネルギーホールディングス	5,600	7,841.00	43,909,600
横浜ゴム	9,500	3,321.00	31,549,500
TOYO TIRE	10,800	2,072.00	22,377,600
ブリヂストン	55,300	5,834.00	322,620,200
住友ゴム工業	18,400	1,473.00	27,103,200
AGC	18,400	4,594.00	84,529,600
TOTO	12,600	4,485.00	56,511,000
日本碍子	22,100	1,855.50	41,006,550
日本特殊陶業	15,900	4,144.00	65,889,600
MARUWA	700	38,700.00	27,090,000
フジインコーポレーテッド	5,100	2,576.00	13,137,600
ニチアス	4,900	5,270.00	25,823,000
日本製鉄	89,400	3,234.00	289,119,600
JFEホールディングス	54,000	1,918.50	103,599,000
東京製鐵	5,800	1,945.00	11,281,000

丸一鋼管	5,900	3,315.00	19,558,500
日本冶金工業	1,400	4,280.00	5,992,000
大紀アルミニウム工業所	2,600	1,086.00	2,823,600
三井金属鉱業	5,600	4,573.00	25,608,800
住友金属鉱山	22,400	3,915.00	87,696,000
DOWAホールディングス	4,900	4,747.00	23,260,300
住友電気工業	72,600	2,383.00	173,005,800
AREホールディングス	7,300	1,789.00	13,059,700
SUMCO	37,000	1,706.00	63,122,000
三和ホールディングス	19,400	3,001.00	58,219,400
リンナイ	9,500	3,117.00	29,611,500
三浦工業	7,900	3,252.00	25,690,800
アマダ	28,900	1,524.00	44,043,600
FUJ I	8,900	2,331.00	20,745,900
DMG森精機	12,000	3,495.00	41,940,000
ディスコ	9,100	45,180.00	411,138,000
ナブテスコ	11,900	2,412.50	28,708,750
SMC	5,700	64,400.00	367,080,000
小松製作所	89,200	4,100.00	365,720,000
住友重機械工業	11,200	3,315.00	37,128,000
日立建機	7,500	3,456.00	25,920,000
ローツェ	1,000	21,910.00	21,910,000
クボタ	99,600	2,015.00	200,694,000
荏原製作所	39,100	2,014.50	78,766,950
ダイキン工業	22,500	17,735.00	399,037,500
オルガノ	2,500	6,770.00	16,925,000
ダイフク	32,000	2,643.00	84,576,000
SANKYO	18,300	1,853.00	33,909,900
竹内製作所	3,400	4,295.00	14,603,000
セガサミーホールディングス	16,900	2,307.00	38,988,300
ホシザキ	12,300	4,564.00	56,137,200
マキタ	21,800	4,437.00	96,726,600
三菱重工業	332,800	1,920.50	639,142,400
I H I	14,300	5,496.00	78,592,800
イビデン	9,900	5,060.00	50,094,000
ブラザー工業	25,500	2,680.00	68,340,000
ミネベアミツミ	33,200	2,963.00	98,371,600
日立製作所	367,700	3,396.00	1,248,709,200

三菱電機	208,400	2,301.50	479,632,600
富士電機	11,500	8,138.00	93,587,000
安川電機	20,600	4,567.00	94,080,200
ニデック	41,900	6,054.00	253,662,600
オムロン	14,500	5,337.00	77,386,500
MC J	7,900	1,320.00	10,428,000
日本電気	24,900	12,500.00	311,250,000
富士通	174,400	2,453.50	427,890,400
ルネサスエレクトロニクス	145,000	2,335.00	338,575,000
セイコーエプソン	24,300	2,591.00	62,961,300
ワコム	14,400	636.00	9,158,400
アルバック	4,200	8,044.00	33,784,800
エレコム	4,600	1,401.00	6,444,600
パナソニック ホールディングス	224,700	1,114.50	250,428,150
アンリツ	13,300	1,058.00	14,071,400
ソニーグループ	50,500	12,880.00	650,440,000
TDK	30,000	9,594.00	287,820,000
ヒロセ電機	2,800	17,360.00	48,608,000
横河電機	20,700	3,504.00	72,532,800
アズビル	13,100	4,400.00	57,640,000
日本光電工業	16,100	1,835.50	29,551,550
堀場製作所	3,600	9,752.00	35,107,200
アドバンテスト	53,900	6,235.00	336,066,500
キーエンス	9,700	64,420.00	624,874,000
シスメックス	49,100	2,696.00	132,373,600
フェローテックホールディングス	5,900	2,397.00	14,142,300
レーザーテック	8,700	28,540.00	248,298,000
日本電子	4,900	5,895.00	28,885,500
ファナック	91,200	4,076.00	371,731,200
ローム	34,800	1,678.50	58,411,800
浜松ホトニクス	15,100	3,822.00	57,712,200
三井ハイテック	8,500	1,012.50	8,606,250
新光電気工業	6,400	5,704.00	36,505,600
京セラ	117,000	1,655.50	193,693,500
太陽誘電	9,100	3,661.00	33,315,100
村田製作所	168,200	2,894.50	486,854,900
小糸製作所	19,500	1,992.50	38,853,750
S C R E E Nホールディングス	6,400	11,045.00	70,688,000

東京エレクトロン	32,100	27,620.00	886,602,000
トヨタ紡織	7,900	1,862.50	14,713,750
豊田自動織機	16,200	11,370.00	184,194,000
デンソー	155,300	2,255.50	350,279,150
いすゞ自動車	52,800	2,082.50	109,956,000
トヨタ自動車	277,700	2,657.50	737,987,750
カヤバ	1,800	4,525.00	8,145,000
アイシン	14,500	4,987.00	72,311,500
マツダ	62,300	1,225.50	76,348,650
本田技研工業	444,400	1,546.50	687,264,600
スズキ	137,800	1,705.00	234,949,000
SUBARU	58,400	2,701.50	157,767,600
ヤマハ発動機	81,400	1,238.00	100,773,200
豊田合成	5,500	2,433.50	13,384,250
シマノ	8,200	27,790.00	227,878,000
テルモ	105,200	2,665.00	280,358,000
島津製作所	24,900	4,491.00	111,825,900
ナカニシ	7,900	2,503.00	19,773,700
東京精密	3,900	8,175.00	31,882,500
オリンパス	107,800	2,489.50	268,368,100
HOYA	35,900	19,575.00	702,742,500
朝日インテック	22,800	2,254.50	51,402,600
バンダイナムコホールディングス	51,500	2,920.50	150,405,750
パイロットコーポレーション	2,900	4,155.00	12,049,500
ヤマハ	11,800	3,007.00	35,482,600
ピジョン	12,000	1,552.50	18,630,000
任天堂	101,200	7,898.00	799,277,600
中部電力	69,300	1,725.50	119,577,150
関西電力	72,600	2,460.50	178,632,300
電源開発	15,400	2,436.00	37,514,400
イーレックス	3,300	796.00	2,626,800
レノバ	5,000	953.00	4,765,000
東京瓦斯	36,700	3,495.00	128,266,500
大阪瓦斯	37,500	3,359.00	125,962,500
SBSホールディングス	1,700	2,559.00	4,350,300
ヤマトホールディングス	22,800	1,587.00	36,183,600
山九	4,800	4,349.00	20,875,200
センコーグループホールディングス	10,000	1,158.00	11,580,000

AZ-COM丸和ホールディングス	4,700	1,065.00	5,005,500
SGホールディングス	31,600	1,518.00	47,968,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	7,000	6,997.00	48,979,000
日本郵船	48,700	4,929.00	240,042,300
商船三井	40,800	4,936.00	201,388,800
川崎汽船	45,000	2,100.50	94,522,500
NSユナイテッド海運	1,000	4,700.00	4,700,000
三井倉庫ホールディングス	1,800	5,110.00	9,198,000
NECネットエスアイ	7,300	2,549.00	18,607,700
システナ	30,100	350.00	10,535,000
日鉄ソリューションズ	6,400	3,575.00	22,880,000
TIS	20,000	3,250.00	65,000,000
コーエーテクモホールディングス	11,800	1,382.00	16,307,600
ネクソン	41,400	2,906.50	120,329,100
SHIFT	1,300	10,315.00	13,409,500
ティーガイア	2,000	3,730.00	7,460,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,900	2,872.00	14,072,800
GMOペイメントゲートウェイ	4,300	7,823.00	33,638,900
インターネットイニシアティブ	9,000	2,579.50	23,215,500
ラクス	8,900	2,104.00	18,725,600
チェンジホールディングス	4,500	1,056.00	4,752,000
野村総合研究所	40,900	4,658.00	190,512,200
オービック	6,300	24,645.00	155,263,500
ジャストシステム	2,800	3,305.00	9,254,000
LINEヤフー	268,900	376.20	101,160,180
トレンドマイクロ	9,900	8,200.00	81,180,000
日本オラクル	3,600	12,500.00	45,000,000
大塚商会	21,500	3,360.00	72,240,000
電通総研	1,800	5,560.00	10,008,000
東映アニメーション	4,700	2,819.00	13,249,300
デジタルガレージ	3,200	2,820.00	9,024,000
ネットワンシステムズ	7,600	3,105.00	23,598,000
BIPROGY	6,200	4,409.00	27,335,800
U-NEXT HOLDINGS	2,100	4,960.00	10,416,000
日本電信電話	3,604,400	149.30	538,136,920
KDDI	139,000	4,578.00	636,342,000
ソフトバンク	301,500	1,895.00	571,342,500

光通信	1,900	28,135.00	53,456,500
GMOインターネットグループ	6,100	2,251.00	13,731,100
KADOKAWA	9,900	2,856.50	28,279,350
東宝	10,700	5,303.00	56,742,100
NTTデータグループ	49,400	1,973.50	97,490,900
DTS	4,000	4,020.00	16,080,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,700	4,825.00	41,977,500
カプコン	33,600	2,982.50	100,212,000
SCSK	13,200	2,732.50	36,069,000
NSD	6,800	2,989.00	20,325,200
コナミグループ	7,000	11,660.00	81,620,000
ソフトバンクグループ	93,200	8,187.00	763,028,400
双日	22,300	3,349.00	74,682,700
アルフレッサ ホールディングス	20,100	2,233.00	44,883,300
神戸物産	15,400	3,952.00	60,860,800
ダイワボウホールディングス	8,800	2,467.00	21,709,600
マクニカホールディングス	4,900	5,461.00	26,758,900
シップヘルスケアホールディングス	7,100	2,142.00	15,208,200
メディパルホールディングス	20,600	2,492.50	51,345,500
IDOM	5,800	1,102.00	6,391,600
伊藤忠商事	126,900	7,069.00	897,056,100
丸紅	166,100	2,439.00	405,117,900
豊田通商	52,300	2,648.00	138,490,400
兼松	8,400	2,382.00	20,008,800
三井物産	258,300	3,031.00	782,907,300
住友商事	120,600	3,378.00	407,386,800
三菱商事	300,900	2,945.50	886,300,950
キヤノンマーケティングジャパン	4,700	4,458.00	20,952,600
阪和興業	3,600	5,170.00	18,612,000
岩谷産業	4,500	8,269.00	37,210,500
稲畑産業	3,900	3,300.00	12,870,000
伊藤忠エネクス	4,900	1,493.00	7,315,700
加賀電子	1,800	5,050.00	9,090,000
PALTAC	2,700	4,254.00	11,485,800
ミスミグループ本社	30,000	2,655.00	79,650,000
エービーシー・マート	8,700	2,804.00	24,394,800
アスクル	4,200	2,128.00	8,937,600
日本マクドナルドホールディングス	12,300	6,200.00	76,260,000

セリア	5,900	3,255.00	19,204,500
MonotaRO	28,100	2,401.00	67,468,100
マツキョココカラ&カンパニー	36,200	2,223.50	80,490,700
ZOZO	13,100	4,279.00	56,054,900
ウエルシアホールディングス	10,500	2,002.50	21,026,250
クリエイトSDホールディングス	3,300	3,265.00	10,774,500
ネクステージ	4,600	1,847.00	8,496,200
コスモス薬品	1,700	13,660.00	23,222,000
セブン&アイ・ホールディングス	201,900	1,757.50	354,839,250
ツルハホールディングス	4,200	8,550.00	35,910,000
クスリのアオキホールディングス	6,000	2,987.50	17,925,000
FOOD & LIFE COMPANIES	10,700	2,435.50	26,059,850
ノジマ	6,400	1,588.00	10,163,200
良品計画	23,800	2,571.00	61,189,800
コーナン商事	2,600	3,670.00	9,542,000
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	40,300	3,672.00	147,981,600
ゼンショーホールディングス	10,100	6,674.00	67,407,400
ワークマン	2,300	4,230.00	9,729,000
VTホールディングス	7,600	490.00	3,724,000
スギホールディングス	12,100	2,617.50	31,671,750
日本瓦斯	10,700	2,317.00	24,791,900
ライフコーポレーション	2,100	3,435.00	7,213,500
コメリ	3,100	3,330.00	10,323,000
しまむら	4,400	7,266.00	31,970,400
イズミ	3,500	3,368.00	11,788,000
ヤオコー	2,200	8,866.00	19,505,200
ケーズホールディングス	14,100	1,506.50	21,241,650
ニトリホールディングス	7,200	19,360.00	139,392,000
ファーストリテイリング	11,200	41,210.00	461,552,000
サンドラッグ	6,800	4,076.00	27,716,800
めぶきフィナンシャルグループ	85,900	559.70	48,078,230
コンコルディア・フィナンシャルグループ	99,500	832.30	82,813,850
三菱UFJフィナンシャル・グループ	604,600	1,503.00	908,713,800
りそなホールディングス	216,100	986.80	213,247,480
三井住友トラスト・ホールディングス	66,600	3,546.00	236,163,600
三井住友フィナンシャルグループ	102,900	9,699.00	998,027,100

千葉銀行	51,700	1,197.00	61,884,900
ふくおかフィナンシャルグループ	16,300	3,929.00	64,042,700
セブン銀行	58,200	262.50	15,277,500
みずほフィナンシャルグループ	250,200	3,041.00	760,858,200
SBIホールディングス	29,800	3,505.00	104,449,000
ジャフコ グループ	5,800	1,859.50	10,785,100
大和証券グループ本社	143,500	1,076.00	154,406,000
野村ホールディングス	311,500	817.30	254,588,950
マネックスグループ	19,600	651.00	12,759,600
SOMPOホールディングス	84,000	3,276.00	275,184,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	124,900	3,254.00	406,424,600
第一生命ホールディングス	87,200	4,034.00	351,764,800
東京海上ホールディングス	181,100	5,393.00	976,672,300
全国保証	4,900	5,714.00	27,998,600
芙蓉総合リース	1,700	11,285.00	19,184,500
みずほリース	15,400	1,040.00	16,016,000
東京センチュリー	14,100	1,518.00	21,403,800
イオンフィナンシャルサービス	10,700	1,340.00	14,338,000
アコム	33,200	370.70	12,307,240
ジャックス	2,000	4,030.00	8,060,000
オリエントコーポレーション	6,000	958.00	5,748,000
オリックス	111,300	3,406.00	379,087,800
三菱HCキャピタル	82,600	1,047.50	86,523,500
日本取引所グループ	47,800	3,411.00	163,045,800
大東建託	6,800	17,040.00	115,872,000
ヒューリック	43,300	1,413.50	61,204,550
野村不動産ホールディングス	10,500	4,002.00	42,021,000
プレサンスコーポレーション	2,800	1,821.00	5,098,800
オープンハウスグループ	6,800	5,458.00	37,114,400
東急不動産ホールディングス	55,700	1,003.50	55,894,950
飯田グループホールディングス	17,900	2,149.00	38,467,100
ケイアイスター不動産	1,000	3,450.00	3,450,000
三井不動産	257,400	1,470.50	378,506,700
三菱地所	116,400	2,338.00	272,143,200
東京建物	16,300	2,430.50	39,617,150
住友不動産	26,700	4,613.00	123,167,100
スターツコーポレーション	2,700	3,270.00	8,829,000
カチタス	5,000	1,786.00	8,930,000

日本M&Aセンターホールディングス	30,900	638.30	19,723,470	
UTグループ	2,600	2,737.00	7,116,200	
パソナグループ	2,300	2,234.00	5,138,200	
エス・エム・エス	7,000	2,080.50	14,563,500	
パーソルホールディングス	197,000	272.00	53,584,000	
総合警備保障	32,300	932.70	30,126,210	
カカクコム	12,700	2,242.00	28,473,400	
ディップ	3,100	2,827.00	8,763,700	
エムスリー	38,200	1,246.00	47,597,200	
博報堂DYホールディングス	24,600	1,164.50	28,646,700	
H. U. グループホールディングス	5,600	2,539.00	14,218,400	
ビー・エム・エル	2,400	2,661.00	6,386,400	
ユー・エス・エス	43,500	1,266.50	55,092,750	
サイバーエージェント	42,800	955.60	40,899,680	
フルキャストホールディングス	1,800	1,409.00	2,536,200	
テクノプロ・ホールディングス	11,400	2,860.00	32,604,000	
ジャパンマテリアル	5,900	1,676.00	9,888,400	
リクルートホールディングス	139,500	8,286.00	1,155,897,000	
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,435.00	3,874,500	
ベイカレント・コンサルティング	14,400	4,304.00	61,977,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,600	2,772.00	18,295,200	
リログループ	9,700	1,764.50	17,115,650	
トランス・コスモス	2,400	3,270.00	7,848,000	
セコム	19,800	9,576.00	189,604,800	
メイテックグループホールディングス	6,900	3,289.00	22,694,100	
イオンディライト	2,200	3,830.00	8,426,000	
合 計	19,941,000		50,087,665,950	

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。