

2025 年 8 月期 決算短信 (2025 年 2 月 16 日～2025 年 8 月 15 日)

2025 年 9 月 22 日

ファンド名 NZAM 上場投信 JPX 日経 400
 コード番号 2526
 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
 問合せ先責任者 プロダクトガバナンス部 組成開示グループ
 上場取引所 東証
 売買単位 1 口
 八木 正展
 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8692
 有価証券報告書提出予定日 2025 年 11 月 14 日
 分配金支払開始予定日 2025 年 9 月 22 日

I ファンドの運用状況

1. 2025 年 8 月期の運用状況 (2025 年 2 月 16 日～2025 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	%
2025 年 8 月期	58,271	(96.6)	2,041	(3.4)	60,313	(100.0)
2025 年 2 月期	52,097	(97.2)	1,498	(2.8)	53,596	(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
2025 年 8 月期	2,127	110	104	2,132
2025 年 2 月期	2,127	-	-	2,127

(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
2025 年 8 月期	61,238	924	60,313	28,287
2025 年 2 月期	54,233	637	53,596	25,197

(4) 分配金

	1 口当たり分配金
	円
2025 年 8 月期	313
2025 年 2 月期	269

(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 12 期 2025 年 2 月 15 日現在	第 13 期 2025 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	1,942,304,600	2,472,122,900
株式	52,097,379,740	58,271,586,370
派生商品評価勘定	69,788	189,939,448
未収入金	907,880	62,179,004
未収配当金	87,881,798	95,857,892
未収利息	50,822	32,391
差入委託証拠金	104,518,007	146,510,943
流動資産合計	54,233,112,635	61,238,228,948
資産合計	54,233,112,635	61,238,228,948
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,608,246	—
前受金	12,560,000	206,540,500
未払収益分配金	572,185,596	667,387,677
未払受託者報酬	8,282,462	8,573,420
未払委託者報酬	25,734,732	26,638,805
その他未払費用	14,648,430	15,656,504
流動負債合計	637,019,466	924,796,906
負債合計	637,019,466	924,796,906
純資産の部		
元本等		
元本	29,879,148,948	29,951,420,763
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	23,716,944,221	30,362,011,279
(分配準備積立金)	1,634,803	1,139,721
元本等合計	53,596,093,169	60,313,432,042
純資産合計	53,596,093,169	60,313,432,042
負債純資産合計	54,233,112,635	61,238,228,948

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第 12 期 自 2024 年 8 月 16 日 至 2025 年 2 月 15 日	第 13 期 自 2025 年 2 月 16 日 至 2025 年 8 月 15 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	619,030,539	713,383,468
受取利息	1,984,965	4,376,681
有価証券売買等損益	2,171,728,718	6,993,537,464
派生商品取引等損益	60,119,520	306,028,822
その他収益	1,103	1,175
営業収益合計	2,852,864,845	8,017,327,610
営業費用		
受託者報酬	8,282,462	8,573,420
委託者報酬	25,734,732	26,638,805
その他費用	14,648,430	15,656,504
営業費用合計	48,665,624	50,868,729
営業利益又は営業損失 (△)	2,804,199,221	7,966,458,881
経常利益又は経常損失 (△)	2,804,199,221	7,966,458,881
当期純利益又は当期純損失 (△)	2,804,199,221	7,966,458,881
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 (△)	21,484,930,596	23,716,944,221
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	801,332,872
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	-	801,332,872
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,455,337,018
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,455,337,018
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	572,185,596	667,387,677
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	23,716,944,221	30,362,011,279

(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 12 期 2025 年 2 月 15 日現在	第 13 期 2025 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12期 2025年2月15日現在	第13期 2025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	29,879,148,948 円	29,879,148,948 円
	期中追加設定元本額	－円	1,545,464,987 円
	期中一部交換元本額	－円	1,473,193,172 円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,127,084 口	2,132,229 口
3.	1 口当たり純資産額	25,197 円	28,287 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期 自 2024年8月16日 至 2025年2月15日	第13期 自 2025年2月16日 至 2025年8月15日
分配金の計算過程	A. 配当等収益額 621,016,607 円	A. 配当等収益額 717,761,324 円
	B. 分配準備積立金額 1,469,416 円	B. 分配準備積立金額 1,634,803 円
	C. 配当等収益合計額 622,486,023 円	C. 配当等収益合計額 719,396,127 円
	(A+B)	(A+B)
	D. 経費 48,665,624 円	D. 経費 50,868,729 円
	E. 収益分配可能額 (C－D) 573,820,399 円	E. 収益分配可能額 (C－D) 668,527,398 円
	F. 収益分配金 572,185,596 円	F. 収益分配金 667,387,677 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E－F) 1,634,803 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E－F) 1,139,721 円
	H. 口数 2,127,084 口	H. 口数 2,132,229 口
	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1) 269 円	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1) 313 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12期 自 2024年 8月 16日 至 2025年 2月 15日	第13期 自 2025年 2月 16日 至 2025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、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 12 期 2025 年 2 月 15 日現在	第 13 期 2025 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ぬ。	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つた場合、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 12 期(自 2024 年 8 月 16 日 至 2025 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	2,085,955,482
合計	2,085,955,482

第 13 期(自 2025 年 2 月 16 日 至 2025 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	6,742,366,529
合計	6,742,366,529

(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 12 期 (2025 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	1,468,368,500	—	1,464,843,000	△3,525,500
合計		1,468,368,500	—	1,464,843,000	△3,525,500

第 13 期 (2025 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	1,814,486,800	—	2,004,442,000	189,955,200
合計		1,814,486,800	—	2,004,442,000	189,955,200

(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	27,700	980.30	27,154,310	
I N P E X	90,900	2,342.00	212,887,800	
石油資源開発	16,000	1,188.00	19,008,000	
ショーボンドホールディングス	3,500	5,242.00	18,347,000	
タマホーム	1,700	3,700.00	6,290,000	
安藤・間	16,100	1,695.00	27,289,500	
コムシスホールディングス	8,700	3,656.00	31,807,200	
大成建設	17,100	9,850.00	168,435,000	
大林組	62,500	2,368.00	148,000,000	
長谷工コーポレーション	17,700	2,419.50	42,825,150	
鹿島建設	41,900	4,243.00	177,781,700	
住友林業	49,100	1,758.00	86,317,800	
大和ハウス工業	57,000	5,342.00	304,494,000	
積水ハウス	57,300	3,418.00	195,851,400	
関電工	10,400	3,954.00	41,121,600	
エクシオグループ	18,900	2,150.00	40,635,000	
九電工	4,200	7,267.00	30,521,400	
高砂熱学工業	4,500	8,700.00	39,150,000	
インフロニア・ホールディングス	19,900	1,375.50	27,372,450	
森永製菓	8,000	2,632.50	21,060,000	
寿スピリッツ	11,200	1,902.50	21,308,000	
カルビー	8,900	2,702.00	24,047,800	
森永乳業	6,800	3,255.00	22,134,000	
ヤクルト本社	26,300	2,423.00	63,724,900	
明治ホールディングス	24,400	3,019.00	73,663,600	
日本ハム	8,300	5,473.00	45,425,900	
アサヒグループホールディングス	142,600	1,910.00	272,366,000	
キリンホールディングス	79,100	2,151.50	170,183,650	
宝ホールディングス	12,600	1,370.00	17,262,000	
サントリー食品インターナショナル	13,300	4,691.00	62,390,300	
キッコーマン	62,900	1,324.50	83,311,050	
味の素	87,100	3,999.00	348,312,900	

ニチレイ	15,400	1,705.50	26,264,700	
東洋水産	8,800	9,810.00	86,328,000	
日清食品ホールディングス	24,100	2,792.50	67,299,250	
日本たばこ産業	115,300	4,744.00	546,983,200	
東レ	141,200	976.30	137,853,560	
ゴールドウイン	3,500	7,115.00	24,902,500	
王子ホールディングス	73,200	775.30	56,751,960	
クラレ	25,800	1,748.00	45,098,400	
日産化学	9,900	5,457.00	54,024,300	
東ソー	26,300	2,242.00	58,964,600	
信越化学工業	124,700	4,628.00	577,111,600	
エア・ウォーター	18,600	2,450.00	45,570,000	
日本酸素ホールディングス	18,700	5,660.00	105,842,000	
三菱瓦斯化学	14,500	2,498.00	36,221,000	
三井化学	17,300	3,593.00	62,158,900	
東京応化工業	9,400	4,596.00	43,202,400	
三菱ケミカルグループ	141,200	793.40	112,028,080	
KHネオケム	3,500	2,747.00	9,614,500	
ダイセル	22,000	1,343.00	29,546,000	
住友ベークライト	5,700	4,837.00	27,570,900	
積水化学工業	38,500	2,753.50	106,009,750	
扶桑化学工業	2,000	4,525.00	9,050,000	
ADEKA	6,800	3,197.00	21,739,600	
日油	22,700	2,855.50	64,819,850	
花王	47,000	6,628.00	311,516,000	
日本ペイントホールディングス	102,600	1,133.00	116,245,800	
関西ペイント	16,200	2,470.00	40,014,000	
太陽ホールディングス	3,300	7,300.00	24,090,000	
富士フイルムホールディングス	116,700	3,591.00	419,069,700	
資生堂	37,600	2,516.00	94,601,600	
ライオン	22,200	1,628.50	36,152,700	
小林製薬	5,200	5,430.00	28,236,000	
タカラバイオ	5,300	893.00	4,732,900	
デクセリアルズ	16,900	2,107.00	35,608,300	
日東電工	61,100	3,317.00	202,668,700	
ニフコ	7,200	3,990.00	28,728,000	
ユニ・チャーム	120,900	986.90	119,316,210	
協和キリン	23,800	2,633.00	62,665,400	

武田薬品工業	172,100	4,409.00	758,788,900	
アステラス製薬	169,600	1,671.00	283,401,600	
塩野義製薬	64,200	2,626.50	168,621,300	
日本新薬	5,200	3,243.00	16,863,600	
中外製薬	60,600	6,243.00	378,325,800	
エーザイ	25,300	4,638.00	117,341,400	
ロート製薬	20,400	2,496.50	50,928,600	
小野薬品工業	39,600	1,708.50	67,656,600	
第一三共	149,700	3,676.00	550,297,200	
大塚ホールディングス	43,100	7,890.00	340,059,000	
ペプチドリーム	9,600	1,629.50	15,643,200	
出光興産	83,700	973.60	81,490,320	
E N E O S ホールディングス	292,900	865.70	253,563,530	
コスモエネルギーホールディングス	6,400	7,090.00	45,376,000	
横浜ゴム	10,800	5,426.00	58,600,800	
TOYO TIRE	12,300	3,589.00	44,144,700	
ブリヂストン	56,600	6,562.00	371,409,200	
住友ゴム工業	20,900	1,703.00	35,592,700	
A G C	18,800	4,581.00	86,122,800	
東海カーボン	18,300	1,050.50	19,224,150	
T O T O	14,100	3,864.00	54,482,400	
日本碍子	21,500	2,258.50	48,557,750	
日本特殊陶業	15,900	5,232.00	83,188,800	
MARUWA	800	43,190.00	34,552,000	
フジミインコーポレーテッド	5,100	2,134.00	10,883,400	
ニチアス	4,900	5,581.00	27,346,900	
日本製鉄	100,700	3,014.00	303,509,800	
神戸製鋼所	40,900	1,780.00	72,802,000	
J F E ホールディングス	59,900	1,798.50	107,730,150	
東京製鐵	5,800	1,585.00	9,193,000	
大和工業	3,800	9,023.00	34,287,400	
丸一鋼管	6,200	3,719.00	23,057,800	
大同特殊鋼	12,800	1,230.50	15,750,400	
日本冶金工業	1,400	4,265.00	5,971,000	
三井金属鉱業	5,000	8,461.00	42,305,000	
住友金属鉱山	25,200	3,690.00	92,988,000	
D O W A ホールディングス	4,900	5,014.00	24,568,600	
住友電気工業	68,700	4,050.00	278,235,000	

フジクラ	21,300	12,275.00	261,457,500	
A R E ホールディングス	7,600	1,929.00	14,660,400	
S U M C O	38,600	1,201.00	46,358,600	
三和ホールディングス	20,300	4,681.00	95,024,300	
リンナイ	9,800	3,937.00	38,582,600	
日本発條	18,000	1,807.50	32,535,000	
三浦工業	8,400	2,903.50	24,389,400	
ツガミ	4,200	2,181.00	9,160,200	
アマダ	27,100	1,786.00	48,400,600	
DMG森精機	13,300	3,497.00	46,510,100	
ディスコ	9,400	42,350.00	398,090,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,800	3,035.00	8,498,000	
ナブテスコ	11,300	3,108.00	35,120,400	
SMC	5,500	48,130.00	264,715,000	
小松製作所	96,000	5,040.00	483,840,000	
住友重機械工業	11,700	3,323.00	38,879,100	
日立建機	7,900	4,689.00	37,043,100	
T O W A	6,600	1,745.00	11,517,000	
ローツェ	10,100	1,918.50	19,376,850	
クボタ	99,600	1,796.50	178,931,400	
荏原製作所	40,000	3,238.00	129,520,000	
ダイキン工業	25,400	19,850.00	504,190,000	
オルガノ	2,600	11,990.00	31,174,000	
ダイフク	32,900	4,555.00	149,859,500	
S A N K Y O	22,500	2,904.50	65,351,250	
竹内製作所	3,600	5,470.00	19,692,000	
セガサミーホールディングス	16,000	3,342.00	53,472,000	
ホシザキ	12,800	5,960.00	76,288,000	
マキタ	24,200	5,269.00	127,509,800	
三菱重工業	340,600	3,910.00	1,331,746,000	
イビデン	10,500	6,889.00	72,334,500	
ブラザー工業	26,500	2,522.50	66,846,250	
ミネベアミツミ	33,800	2,493.00	84,263,400	
日立製作所	230,600	4,274.00	985,584,400	
三菱電機	198,200	3,625.00	718,475,000	
富士電機	11,800	9,345.00	110,271,000	
安川電機	21,100	3,074.00	64,861,400	
J V C ケンウッド	15,700	1,261.00	19,797,700	

オムロン	17,900	3,848.00	68,879,200	
MC J	7,900	1,371.00	10,830,900	
日本電気	137,800	4,580.00	631,124,000	
富士通	179,100	3,500.00	626,850,000	
ルネサスエレクトロニクス	188,900	1,820.00	343,798,000	
セイコーエプソン	24,900	1,891.50	47,098,350	
アルバック	4,400	6,171.00	27,152,400	
パナソニック ホールディングス	230,100	1,523.00	350,442,300	
ソニーグループ	283,200	4,292.00	1,215,494,400	
TDK	168,300	1,917.50	322,715,250	
メイコー	2,000	7,980.00	15,960,000	
ヒロセ電機	2,900	18,875.00	54,737,500	
横河電機	21,700	4,313.00	93,592,100	
アズビル	50,800	1,459.50	74,142,600	
日本光電工業	16,200	1,653.00	26,778,600	
堀場製作所	3,700	11,060.00	40,922,000	
アドバンテスト	60,800	11,295.00	686,736,000	
キーエンス	11,100	55,440.00	615,384,000	
シスメックス	49,900	1,999.50	99,775,050	
フェローテック	6,200	3,750.00	23,250,000	
レーザーテック	7,500	17,405.00	130,537,500	
日本電子	4,400	4,690.00	20,636,000	
ファナック	92,100	4,598.00	423,475,800	
ローム	35,700	2,052.50	73,274,250	
浜松ホトニクス	33,400	1,667.00	55,677,800	
三井ハイテック	8,600	797.00	6,854,200	
京セラ	119,900	1,897.00	227,450,300	
太陽誘電	8,500	2,812.00	23,902,000	
村田製作所	169,800	2,400.00	407,520,000	
小糸製作所	20,400	2,035.50	41,524,200	
S C R E E Nホールディングス	8,000	11,555.00	92,440,000	
キヤノン	86,600	4,363.00	377,835,800	
東京エレクトロン	22,400	21,505.00	481,712,000	
トヨタ紡織	8,300	2,342.00	19,438,600	
豊田自動織機	16,400	16,345.00	268,058,000	
デンソー	188,900	2,103.00	397,256,700	
三菱ロジスネクスト	3,100	2,000.00	6,200,000	
いすゞ自動車	56,700	1,938.50	109,912,950	

トヨタ自動車	238,300	2,854.00	680,108,200	
三菱自動車工業	76,700	406.00	31,140,200	
カヤバ	3,600	3,590.00	12,924,000	
アイシン	38,300	2,267.00	86,826,100	
マツダ	59,200	972.00	57,542,400	
本田技研工業	455,800	1,637.50	746,372,500	
スズキ	155,800	1,784.00	277,947,200	
S U B A R U	58,100	2,965.00	172,266,500	
ヤマハ発動機	95,500	1,086.50	103,760,750	
豊田合成	5,500	3,416.00	18,788,000	
シマノ	8,300	16,810.00	139,523,000	
テルモ	128,200	2,750.00	352,550,000	
島津製作所	27,800	3,506.00	97,466,800	
ナカニシ	8,200	2,030.00	16,646,000	
東京精密	4,000	8,375.00	33,500,000	
オリンパス	106,900	1,737.50	185,738,750	
H O Y A	37,200	19,375.00	720,750,000	
ノーリツ鋼機	5,700	1,585.00	9,034,500	
朝日インテック	24,100	2,642.00	63,672,200	
シチズン時計	18,200	988.00	17,981,600	
三井松島ホールディングス	1,600	6,490.00	10,384,000	
フルヤ金属	1,900	2,277.00	4,326,300	
バンダイナムコホールディングス	51,500	5,558.00	286,237,000	
パイロットコーポレーション	3,100	4,528.00	14,036,800	
大日本印刷	37,800	2,390.00	90,342,000	
アシックス	74,200	4,245.00	314,979,000	
ローランド	1,400	3,285.00	4,599,000	
ヤマハ	32,600	955.50	31,149,300	
任天堂	91,700	14,400.00	1,320,480,000	
中部電力	71,000	2,036.00	144,556,000	
関西電力	94,000	2,080.50	195,567,000	
九州電力	45,400	1,521.00	69,053,400	
電源開発	14,500	2,905.50	42,129,750	
東京瓦斯	34,800	5,696.00	198,220,800	
大阪瓦斯	38,300	4,304.00	164,843,200	
S B Sホールディングス	1,700	3,380.00	5,746,000	
京浜急行電鉄	24,300	1,586.50	38,551,950	
小田急電鉄	32,500	1,709.00	55,542,500	

東海旅客鉄道	74,300	3,892.00	289,175,600	
西武ホールディングス	20,900	5,248.00	109,683,200	
近鉄グループホールディングス	19,700	2,939.00	57,898,300	
ヤマトホールディングス	23,900	2,469.00	59,009,100	
山九	4,800	8,357.00	40,113,600	
センコーグループホールディングス	10,200	2,021.00	20,614,200	
AZ－COM丸和ホールディングス	4,800	1,228.00	5,894,400	
SGホールディングス	32,900	1,682.00	55,337,800	
NIPPON EXPRESSホールディングス	20,700	3,125.00	64,687,500	
日本郵船	37,600	5,278.00	198,452,800	
商船三井	36,600	4,935.00	180,621,000	
川崎汽船	41,500	2,260.00	93,790,000	
NSユニテッド海運	1,000	4,280.00	4,280,000	
飯野海運	7,200	1,085.00	7,812,000	
三井倉庫ホールディングス	5,400	4,285.00	23,139,000	
システナ	30,000	495.00	14,850,000	
日鉄ソリューションズ	6,800	3,547.00	24,119,600	
TIS	20,800	4,940.00	102,752,000	
コーエーテクモホールディングス	12,600	2,114.00	26,636,400	
ネクソン	47,500	3,309.00	157,177,500	
SHIFT	17,400	1,633.00	28,414,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,893.50	11,574,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,900	8,147.00	31,773,300	
インターネットイニシアティブ	9,500	2,922.00	27,759,000	
ラクス	9,300	2,546.00	23,677,800	
ビジョナル	2,300	11,805.00	27,151,500	
野村総合研究所	41,900	6,044.00	253,243,600	
オービック	35,800	5,405.00	193,499,000	
ジャストシステム	2,900	4,425.00	12,832,500	
LINEヤフー	309,400	479.10	148,233,540	
トレンドマイクロ	11,200	8,076.00	90,451,200	
日本オラクル	3,800	15,880.00	60,344,000	
フューチャー	4,900	2,354.00	11,534,600	
大塚商会	22,300	3,076.00	68,594,800	
電通総研	2,400	6,530.00	15,672,000	
東映アニメーション	7,600	3,295.00	25,042,000	
BIPROGY	6,000	6,379.00	38,274,000	

U-NEXT HOLDINGS	6,700	2,195.00	14,706,500	
NTT	5,165,400	163.00	841,960,200	
KDDI	271,900	2,630.00	715,097,000	
ソフトバンク	3,103,600	240.00	744,864,000	
光通信	2,200	42,230.00	92,906,000	
GMOインターネットグループ	6,400	3,809.00	24,377,600	
東宝	11,400	9,854.00	112,335,600	
NTTデータグループ	50,600	3,960.00	200,376,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,700	11,380.00	110,386,000	
カプコン	38,500	4,209.00	162,046,500	
SCSK	15,900	4,561.00	72,519,900	
NSD	7,000	3,398.00	23,786,000	
コナミグループ	7,200	25,315.00	182,268,000	
東京エレクトロン デバイス	2,100	2,921.00	6,134,100	
双日	22,700	3,776.00	85,715,200	
神戸物産	17,800	4,215.00	75,027,000	
ダイワボウホールディングス	9,200	3,068.00	28,225,600	
マクニカホールディングス	14,700	2,063.50	30,333,450	
シップヘルスケアホールディングス	7,500	2,167.50	16,256,250	
メディパルホールディングス	21,200	2,566.50	54,409,800	
IDOM	5,900	1,050.00	6,195,000	
伊藤忠商事	99,800	7,992.00	797,601,600	
丸紅	167,600	3,236.00	542,353,600	
豊田通商	61,200	3,798.00	232,437,600	
兼松	8,700	2,989.50	26,008,650	
三井物産	206,200	3,272.00	674,686,400	
住友商事	122,300	4,024.00	492,135,200	
三菱商事	239,700	3,167.00	759,129,900	
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	5,641.00	27,076,800	
阪和興業	3,600	6,240.00	22,464,000	
岩谷産業	18,900	1,619.50	30,608,550	
稲畑産業	5,500	3,390.00	18,645,000	
伊藤忠エネクス	4,900	1,979.00	9,697,100	
サンリオ	16,500	8,149.00	134,458,500	
加賀電子	3,600	3,200.00	11,520,000	
ミスミグループ本社	30,900	2,209.50	68,273,550	
エービーシー・マート	9,100	2,995.00	27,254,500	
アスクル	5,000	1,552.00	7,760,000	

アダストリア	2,600	3,040.00	7,904,000	
日本マクドナルドホールディングス	12,500	6,490.00	81,125,000	
パルグループホールディングス	4,200	5,390.00	22,638,000	
セリア	6,100	3,055.00	18,635,500	
M o n o t a R O	29,600	2,735.50	80,970,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	35,900	3,218.00	115,526,200	
Z O Z O	45,400	1,479.00	67,146,600	
ウエルシアホールディングス	10,800	2,582.00	27,885,600	
クリエイトSDホールディングス	3,300	3,475.00	11,467,500	
ネクステージ	4,700	2,041.00	9,592,700	
コスモス薬品	4,000	9,576.00	38,304,000	
セブン&アイ・ホールディングス	225,300	2,005.50	451,839,150	
ツルハホールディングス	3,600	11,390.00	41,004,000	
クスリのアオキホールディングス	5,300	4,084.00	21,645,200	
FOOD & LIFE COMPAN I E S	11,700	8,435.00	98,689,500	
ノジマ	6,500	3,345.00	21,742,500	
良品計画	22,200	7,200.00	159,840,000	
パン・パシフィック・インターナシヨナ ルホールディングス	41,200	5,241.00	215,929,200	
ゼンショーホールディングス	11,600	10,485.00	121,626,000	
ワークマン	2,400	5,630.00	13,512,000	
スギホールディングス	10,900	3,705.00	40,384,500	
日本瓦斯	9,700	2,896.50	28,096,050	
ライフコーポレーション	4,200	2,458.00	10,323,600	
しまむら	4,900	11,100.00	54,390,000	
丸井グループ	11,900	3,219.00	38,306,100	
ヤオコー	2,500	9,494.00	23,735,000	
ニトリホールディングス	7,400	13,610.00	100,714,000	
ファーストリテイリング	13,800	49,240.00	679,512,000	
サンドラッグ	7,000	4,820.00	33,740,000	
めぶきフィナンシャルグループ	90,000	912.20	82,098,000	
コンコルディア・フィナンシャルグルー プ	101,000	1,177.00	118,877,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	477,700	2,374.00	1,134,059,800	
りそなホールディングス	234,500	1,560.00	365,820,000	
三井住友トラストグループ	66,800	4,299.00	287,173,200	
三井住友フィナンシャルグループ	215,600	4,265.00	919,534,000	
千葉銀行	58,800	1,553.00	91,316,400	

ふくおかフィナンシャルグループ	16,900	4,459.00	75,357,100	
セブン銀行	61,200	270.20	16,536,240	
みずほフィナンシャルグループ	231,200	4,960.00	1,146,752,000	
F P G	6,900	2,391.00	16,497,900	
S B I ホールディングス	30,500	6,703.00	204,441,500	
大和証券グループ本社	135,800	1,137.50	154,472,500	
野村ホールディングス	318,600	1,088.00	346,636,800	
マネックスグループ	19,600	755.00	14,798,000	
S O M P O ホールディングス	87,600	4,785.00	419,166,000	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	139,200	3,599.00	500,980,800	
第一生命ホールディングス	347,100	1,259.00	436,998,900	
東京海上ホールディングス	127,700	6,642.00	848,183,400	
全国保証	10,200	3,332.00	33,986,400	
クレディセゾン	12,400	3,731.00	46,264,400	
芙蓉総合リース	5,400	4,287.00	23,149,800	
みずほリース	14,300	1,253.00	17,917,900	
東京センチュリー	14,500	1,840.00	26,680,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,100	1,475.00	16,372,500	
アコム	45,300	464.00	21,019,200	
ジャックス	2,000	4,215.00	8,430,000	
オリックス	109,100	3,817.00	416,434,700	
三菱H C キャピタル	95,200	1,211.00	115,287,200	
日本取引所グループ	113,000	1,676.00	189,388,000	
大東建託	6,400	16,010.00	102,464,000	
ヒューリック	55,400	1,556.00	86,202,400	
野村不動産ホールディングス	59,600	904.60	53,914,160	
オープンハウスグループ	6,100	7,051.00	43,011,100	
東急不動産ホールディングス	58,300	1,177.00	68,619,100	
飯田グループホールディングス	18,500	2,272.00	42,032,000	
ケイアイスター不動産	1,000	5,080.00	5,080,000	
三井不動産	260,800	1,577.50	411,412,000	
三菱地所	108,200	3,163.00	342,236,600	
東京建物	18,100	2,778.00	50,281,800	
住友不動産	30,900	6,141.00	189,756,900	
スターツコーポレーション	2,800	4,845.00	13,566,000	
カチタス	5,000	2,643.00	13,215,000	
ジェイエイシーリクルートメント	7,300	1,080.00	7,884,000	
日本M & A センターホールディングス	29,200	736.20	21,497,040	

UTグループ	2,600	2,646.00	6,879,600	
パソナグループ	2,300	2,120.00	4,876,000	
エス・エム・エス	7,000	1,583.50	11,084,500	
パーソルホールディングス	184,800	272.90	50,431,920	
ALSO K	33,800	1,108.50	37,467,300	
カカコム	13,200	2,880.50	38,022,600	
ディップ	3,100	2,433.00	7,542,300	
エムスリー	39,900	2,243.50	89,515,650	
博報堂DYホールディングス	22,400	1,169.50	26,196,800	
オリエンタルランド	116,900	3,506.00	409,851,400	
ラウンドワン	19,100	1,544.00	29,490,400	
ビー・エム・エル	2,400	3,495.00	8,388,000	
ユー・エス・エス	37,700	1,790.00	67,483,000	
サイバーエージェント	40,200	1,696.00	68,179,200	
テクノプロ・ホールディングス	11,800	4,827.00	56,958,600	
ジャパンマテリアル	5,900	1,486.00	8,767,400	
リクルートホールディングス	93,600	8,956.00	838,281,600	
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,335.00	3,604,500	
ベイカレント	14,800	8,521.00	126,110,800	
ジャパニーズエレベーターサービスホールディングス	6,700	3,910.00	26,197,000	
アンビスホールディングス	4,300	772.00	3,319,600	
トランス・コスモス	2,400	3,665.00	8,796,000	
セコム	40,400	5,753.00	232,421,200	
メイテックグループホールディングス	6,900	3,279.00	22,625,100	
合 計	26,136,500		58,271,586,370	

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。