

2022年2月期 決算短信 (2021年8月16日～2022年2月15日)

2022年3月23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	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	企画部 ディスクロージャーグループ	田原	輝行 (TEL) 03-5210-8779
有価証券報告書提出予定日	2022年5月13日		
分配金支払開始予定日	2022年3月25日		

I ファンドの運用状況

1. 2022年2月期の運用状況 (2021年8月16日～2022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	%
2022年2月期	179,890	(97.2)	5,107	(2.8)	184,997	(100.0)
2021年8月期	184,901	(97.5)	4,700	(2.5)	189,602	(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
2022年2月期	6,731	1,583	1,475	6,840
2021年8月期	2,375	6,335	1,979	6,731

(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
2022年2月期	187,095	2,097	184,997	27,046
2021年8月期	191,139	1,536	189,602	28,167

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2022年2月期	215
2021年8月期	191

(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5期 2021年8月15日現在	第6期 2022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	5,798,243,926	6,327,011,129
株式	184,901,612,140	179,890,065,440
未収配当金	201,202,800	271,622,400
前払金	83,036,500	388,140,000
差入委託証拠金	154,980,000	218,276,000
流動資産合計	191,139,075,366	187,095,114,969
資産合計	191,139,075,366	187,095,114,969
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,852,140	348,800,700
未払金	38,899,800	101,793,760
未払収益分配金	1,285,699,883	1,470,615,695
未払受託者報酬	49,284,589	53,869,769
未払委託者報酬	83,783,752	91,578,548
未払利息	10,840	1,312
その他未払費用	28,073,711	30,748,602
流動負債合計	1,536,604,715	2,097,408,386
負債合計	1,536,604,715	2,097,408,386
純資産の部		
元本等		
元本	140,578,829,092	142,848,084,532
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	49,023,641,559	42,149,622,051
(分配準備積立金)	3,638,612	4,181,032
元本等合計	189,602,470,651	184,997,706,583
純資産合計	189,602,470,651	184,997,706,583
負債純資産合計	191,139,075,366	187,095,114,969

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第5期	第6期
	自 2021年2月16日 至 2021年8月15日	自 2021年8月16日 至 2022年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,450,489,552	1,648,195,200
受取利息	3,675	104,682
有価証券売買等損益	△12,301,362,455	△6,657,589,737
派生商品取引等損益	△165,234,080	△423,481,180
その他収益	32,060	58,847
営業収益合計	△11,016,071,248	△5,432,712,188
営業費用		
支払利息	444,381	1,003,695
受託者報酬	49,284,589	53,869,769
委託者報酬	83,783,752	91,578,548
その他費用	28,073,711	30,748,602
営業費用合計	161,586,433	177,200,614
営業利益又は営業損失 (△)	△11,177,657,681	△5,609,912,802
経常利益又は経常損失 (△)	△11,177,657,681	△5,609,912,802
当期純利益又は当期純損失 (△)	△11,177,657,681	△5,609,912,802
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 (△)	22,291,675,140	49,023,641,559
剰余金増加額又は欠損金減少額	56,034,214,907	13,237,817,519
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	56,034,214,907	13,237,817,519
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,838,890,924	13,031,308,530
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,838,890,924	13,031,308,530
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	1,285,699,883	1,470,615,695
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	49,023,641,559	42,149,622,051

(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 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。</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 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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第5期 (2021年8月15日現在)	第6期 (2022年2月15日現在)
<p>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。</p>	<p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目		第5期 2021年8月15日現在	第6期 2022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	49,606,579,676円	140,578,829,092円
	期中追加設定元本額	132,305,214,812円	33,073,155,440円
	期中一部交換元本額	41,332,965,396円	30,803,900,000円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	6,731,413口	6,840,073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	150,860,000円	125,940,000円
	合計	150,860,000円	125,940,000円
4.	1口当たり純資産額	28,167円	27,046円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期 自2021年2月16日 至2021年8月15日		第6期 自2021年8月16日 至2022年2月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	1,450,080,906円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	399,641円	B. 分配準備積立金額	3,638,612円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,450,480,547円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,650,993,646円
	D. 経費	161,142,052円	D. 経費	176,196,919円
	E. 収益分配可能額 (C -D)	1,289,338,495円	E. 収益分配可能額 (C -D)	1,474,796,727円
	F. 収益分配金	1,285,699,883円	F. 収益分配金	1,470,615,695円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	3,638,612円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	4,181,032円
	H. 口数	6,731,413口	H. 口数	6,840,073口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	191円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	215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5期 自 2021年 2月 16日 至 2021年 8月 15日	第6期 自 2021年 8月 16日 至 2022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5期 2021年8月15日現在	第6期 2022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つた場合、当該価額が異なることもあります。	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。

(有価証券に関する注記)

第5期(自 2021年2月16日 至 2021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	△10,632,861,106
合計	△10,632,861,106

第6期(自 2021年8月16日 至 2022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	△8,794,691,987
合計	△8,794,691,987

(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5期 (2021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	4,585,196,500	—	4,534,380,000	△50,816,500
合計		4,585,196,500	—	4,534,380,000	△50,816,500

第6期 (2022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	5,314,160,000	—	4,965,400,000	△348,760,000
合計		5,314,160,000	—	4,965,400,000	△348,760,000

(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	236,000	558.00	131,688,000	
マルハニチロ	23,600	2,630.00	62,068,000	
I N P E X	94,400	1,178.00	111,203,200	
コムシスホールディングス	236,000	2,758.00	650,888,000	
大成建設	47,200	3,795.00	179,124,000	
大林組	236,000	975.00	230,100,000	
清水建設	236,000	788.00	185,968,000	
長谷工コーポレーション	47,200	1,513.00	71,413,600	
鹿島建設	118,000	1,534.00	181,012,000	
大和ハウス工業	236,000	3,391.00	800,276,000	
積水ハウス	236,000	2,393.50	564,866,000	
日揮ホールディングス	236,000	1,123.00	265,028,000	
日清製粉グループ本社	236,000	1,702.00	401,672,000	
明治ホールディングス	47,200	6,860.00	323,792,000	
日本ハム	118,000	4,375.00	516,250,000	
サッポロホールディングス	47,200	2,337.00	110,306,400	
アサヒグループホールディングス	236,000	4,873.00	1,150,028,000	
キリンホールディングス	236,000	1,978.00	466,808,000	
宝ホールディングス	236,000	1,155.00	272,580,000	
キッコーマン	236,000	8,800.00	2,076,800,000	
味の素	236,000	3,263.00	770,068,000	
ニチレイ	118,000	2,653.00	313,054,000	
日本たばこ産業	236,000	2,312.00	545,632,000	
東洋紡	23,600	1,269.00	29,948,400	
ユニチカ	23,600	308.00	7,268,800	
帝人	47,200	1,410.00	66,552,000	
東レ	236,000	673.80	159,016,800	
王子ホールディングス	236,000	612.00	144,432,000	
日本製紙	23,600	1,167.00	27,541,200	
クラレ	236,000	1,100.00	259,600,000	
旭化成	236,000	1,122.00	264,792,000	
昭和電工	23,600	2,270.00	53,572,000	

住友化学	236,000	562.00	132,632,000
日産化学	236,000	6,470.00	1,526,920,000
東ソー	118,000	1,845.00	217,710,000
トクヤマ	47,200	1,914.00	90,340,800
デンカ	47,200	3,685.00	173,932,000
信越化学工業	236,000	18,000.00	4,248,000,000
三井化学	47,200	2,952.00	139,334,400
三菱ケミカルホールディングス	118,000	815.30	96,205,400
宇部興産	23,600	2,155.00	50,858,000
花王	236,000	5,157.00	1,217,052,000
D I C	23,600	2,719.00	64,168,400
富士フイルムホールディングス	236,000	7,542.00	1,779,912,000
資生堂	236,000	6,431.00	1,517,716,000
日東電工	236,000	8,520.00	2,010,720,000
協和キリン	236,000	2,937.00	693,132,000
武田薬品工業	236,000	3,485.00	822,460,000
アステラス製薬	1,180,000	1,971.50	2,326,370,000
大日本住友製薬	236,000	1,244.00	293,584,000
塩野義製薬	236,000	7,603.00	1,794,308,000
中外製薬	708,000	3,961.00	2,804,388,000
エーザイ	236,000	5,855.00	1,381,780,000
第一三共	708,000	2,380.00	1,685,040,000
大塚ホールディングス	236,000	3,998.00	943,528,000
出光興産	94,400	3,135.00	295,944,000
E N E O Sホールディングス	236,000	464.40	109,598,400
横浜ゴム	118,000	1,670.00	197,060,000
ブリヂストン	236,000	4,901.00	1,156,636,000
A G C	47,200	5,530.00	261,016,000
日本板硝子	23,600	494.00	11,658,400
日本電気硝子	70,800	2,865.00	202,842,000
住友大阪セメント	23,600	3,540.00	83,544,000
太平洋セメント	23,600	2,333.00	55,058,800
東海カーボン	236,000	1,176.00	277,536,000
T O T O	118,000	4,950.00	584,100,000
日本碍子	236,000	1,847.00	435,892,000
日本製鉄	23,600	1,981.00	46,751,600
神戸製鋼所	23,600	593.00	13,994,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	23,600	1,652.00	38,987,200

大太平洋金属	23,600	3,160.00	74,576,000
日本軽金属ホールディングス	23,600	1,816.00	42,857,600
三井金属鉱業	23,600	3,330.00	78,588,000
東邦亜鉛	23,600	2,645.00	62,422,000
三菱マテリアル	23,600	2,089.00	49,300,400
住友金属鉱山	118,000	5,569.00	657,142,000
DOWAホールディングス	47,200	4,870.00	229,864,000
古河電気工業	23,600	2,330.00	54,988,000
住友電気工業	236,000	1,580.00	372,880,000
フジクラ	236,000	650.00	153,400,000
SUMCO	23,600	2,085.00	49,206,000
日本製鋼所	47,200	3,490.00	164,728,000
オークマ	47,200	4,765.00	224,908,000
アマダ	236,000	1,037.00	244,732,000
小松製作所	236,000	2,717.00	641,212,000
住友重機械工業	47,200	2,896.00	136,691,200
日立建機	236,000	2,919.00	688,884,000
クボタ	236,000	2,060.50	486,278,000
荏原製作所	47,200	5,650.00	266,680,000
ダイキン工業	236,000	21,505.00	5,075,180,000
日本精工	236,000	739.00	174,404,000
NTN	236,000	231.00	54,516,000
ジェイテクト	236,000	1,047.00	247,092,000
三井E&Sホールディングス	23,600	359.00	8,472,400
日立造船	47,200	774.00	36,532,800
三菱重工業	23,600	3,271.00	77,195,600
IHI	23,600	2,650.00	62,540,000
コニカミノルタ	236,000	500.00	118,000,000
ミネベアミツミ	236,000	2,559.00	603,924,000
日立製作所	47,200	5,751.00	271,447,200
三菱電機	236,000	1,435.00	338,660,000
富士電機	47,200	6,010.00	283,672,000
安川電機	236,000	4,760.00	1,123,360,000
オムロン	236,000	8,010.00	1,890,360,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,200	2,363.00	111,533,600
日本電気	23,600	5,260.00	124,136,000
富士通	23,600	16,035.00	378,426,000
沖電気工業	23,600	898.00	21,192,800

セイコーエプソン	472,000	1,817.00	857,624,000
パナソニック	236,000	1,211.50	285,914,000
シャープ	236,000	1,318.00	311,048,000
ソニーグループ	236,000	12,210.00	2,881,560,000
TDK	708,000	4,510.00	3,193,080,000
アルプスアルパイン	236,000	1,243.00	293,348,000
横河電機	236,000	1,877.00	442,972,000
アドバンテスト	472,000	9,210.00	4,347,120,000
キーエンス	23,600	57,590.00	1,359,124,000
カシオ計算機	236,000	1,407.00	332,052,000
ファナック	236,000	22,865.00	5,396,140,000
京セラ	472,000	6,655.00	3,141,160,000
太陽誘電	236,000	5,050.00	1,191,800,000
村田製作所	188,800	7,996.00	1,509,644,800
SCREENホールディングス	47,200	11,210.00	529,112,000
キヤノン	354,000	2,819.50	998,103,000
リコー	236,000	1,034.00	244,024,000
東京エレクトロン	236,000	55,220.00	13,031,920,000
デンソー	236,000	8,409.00	1,984,524,000
川崎重工業	23,600	2,133.00	50,338,800
日産自動車	236,000	606.40	143,110,400
いすゞ自動車	118,000	1,576.00	185,968,000
トヨタ自動車	1,180,000	2,153.50	2,541,130,000
日野自動車	236,000	1,072.00	252,992,000
三菱自動車工業	23,600	324.00	7,646,400
マツダ	47,200	910.00	42,952,000
本田技研工業	472,000	3,601.00	1,699,672,000
スズキ	236,000	4,842.00	1,142,712,000
SUBARU	236,000	1,970.50	465,038,000
ヤマハ発動機	236,000	2,728.00	643,808,000
テルモ	944,000	3,761.00	3,550,384,000
ニコン	236,000	1,329.00	313,644,000
オリンパス	944,000	2,169.50	2,048,008,000
シチズン時計	236,000	504.00	118,944,000
バンダイナムコホールディングス	236,000	8,000.00	1,888,000,000
凸版印刷	118,000	2,297.00	271,046,000
大日本印刷	118,000	2,925.00	345,150,000
ヤマハ	236,000	5,500.00	1,298,000,000

任天堂	23,600	57,420.00	1,355,112,000
東京電力ホールディングス	23,600	355.00	8,378,000
中部電力	23,600	1,131.00	26,691,600
関西電力	23,600	1,150.00	27,140,000
東京瓦斯	47,200	2,314.00	109,220,800
大阪瓦斯	47,200	2,093.00	98,789,600
東武鉄道	47,200	2,935.00	138,532,000
東急	118,000	1,599.00	188,682,000
小田急電鉄	118,000	2,163.00	255,234,000
京王電鉄	47,200	5,420.00	255,824,000
京成電鉄	118,000	3,415.00	402,970,000
東日本旅客鉄道	23,600	7,150.00	168,740,000
西日本旅客鉄道	23,600	5,086.00	120,029,600
東海旅客鉄道	23,600	15,825.00	373,470,000
ヤマトホールディングス	236,000	2,185.00	515,660,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	23,600	7,280.00	171,808,000
日本郵船	23,600	9,660.00	227,976,000
商船三井	23,600	8,910.00	210,276,000
川崎汽船	23,600	7,180.00	169,448,000
ANAホールディングス	23,600	2,577.00	60,817,200
三菱倉庫	118,000	2,786.00	328,748,000
ネクソン	472,000	2,398.00	1,131,856,000
Zホールディングス	94,400	563.80	53,222,720
トレンドマイクロ	236,000	6,000.00	1,416,000,000
日本電信電話	94,400	3,285.00	310,104,000
KDDI	1,416,000	3,720.00	5,267,520,000
ソフトバンク	236,000	1,434.00	338,424,000
東宝	23,600	4,785.00	112,926,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,180,000	2,107.00	2,486,260,000
コナミホールディングス	236,000	6,760.00	1,595,360,000
ソフトバンクグループ	1,416,000	5,158.00	7,303,728,000
双日	23,600	1,919.00	45,288,400
伊藤忠商事	236,000	3,794.00	895,384,000
丸紅	236,000	1,182.50	279,070,000
豊田通商	236,000	4,895.00	1,155,220,000
三井物産	236,000	2,964.00	699,504,000
住友商事	236,000	1,862.00	439,432,000
三菱商事	236,000	3,964.00	935,504,000

J. フロント リテイリング	118,000	1,077.00	127,086,000	
三越伊勢丹ホールディングス	236,000	954.00	225,144,000	
セブン&アイ・ホールディングス	236,000	5,832.00	1,376,352,000	
高島屋	118,000	1,160.00	136,880,000	
丸井グループ	236,000	2,289.00	540,204,000	
イオン	236,000	2,678.50	632,126,000	
ファーストリテイリング	236,000	62,970.00	14,860,920,000	代用有価証券で 2,000株 担保差入
コンコルディア・フィナンシャルグループ	236,000	490.00	115,640,000	
新生銀行	23,600	2,200.00	51,920,000	
あおぞら銀行	23,600	2,679.00	63,224,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	236,000	734.10	173,247,600	
りそなホールディングス	23,600	535.20	12,630,720	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,600	4,193.00	98,954,800	
三井住友フィナンシャルグループ	23,600	4,310.00	101,716,000	
千葉銀行	236,000	775.00	182,900,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	47,200	2,377.00	112,194,400	
静岡銀行	236,000	907.00	214,052,000	
みずほフィナンシャルグループ	23,600	1,605.00	37,878,000	
大和証券グループ本社	236,000	691.00	163,076,000	
野村ホールディングス	236,000	540.30	127,510,800	
松井証券	236,000	816.00	192,576,000	
SOMPOホールディングス	47,200	5,339.00	252,000,800	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	70,800	3,928.00	278,102,400	
第一生命ホールディングス	23,600	2,594.00	61,218,400	
東京海上ホールディングス	118,000	6,891.00	813,138,000	
T&Dホールディングス	47,200	1,734.00	81,844,800	
クレディセゾン	236,000	1,365.00	322,140,000	
日本取引所グループ	236,000	2,288.00	539,968,000	
東急不動産ホールディングス	236,000	653.00	154,108,000	
三井不動産	236,000	2,573.00	607,228,000	
三菱地所	236,000	1,773.50	418,546,000	
東京建物	118,000	1,781.00	210,158,000	
住友不動産	236,000	3,547.00	837,092,000	
エムスリー	566,400	4,123.00	2,335,267,200	
ディー・エヌ・エー	70,800	1,710.00	121,068,000	
電通グループ	236,000	4,620.00	1,090,320,000	

サイバーエージェント	188,800	1,522.00	287,353,600	
楽天グループ	236,000	981.00	231,516,000	
リクルートホールディングス	708,000	5,046.00	3,572,568,000	
日本郵政	236,000	981.00	231,516,000	
セコム	236,000	8,591.00	2,027,476,000	
合 計	44,108,400		179,890,065,440	

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。