

2024年2月期 決算短信 (2023年8月16日～2024年2月15日)

2024年3月25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 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) 03-5210-8692
 有価証券報告書提出予定日 2024年5月15日
 分配金支払開始予定日 2024年3月25日

I ファンドの運用状況

1. 2024年2月期の運用状況 (2023年8月16日～2024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	%
2024年2月期	51,848	(97.9)	1,106	(2.1)	52,955	(100.0)
2023年8月期	55,441	(96.3)	2,102	(3.7)	57,543	(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2月期	2,746	110	625	2,231
2023年8月期	2,625	330	208	2,746

(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2月期	53,732	777	52,955	23,731
2023年8月期	58,259	715	57,543	20,950

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2024年2月期	266
2023年8月期	225

(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9期 2023年8月15日現在	第10期 2024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	2,580,216,052	1,587,990,154
株式	55,441,067,720	51,848,773,590
派生商品評価勘定	40,474,184	91,929,880
未収入金	15,646,800	49,404,220
未収配当金	74,482,990	74,336,050
差入委託証拠金	107,167,500	79,774,242
流動資産合計	58,259,055,246	53,732,208,136
資産合計	58,259,055,246	53,732,208,136
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,016,562	-
前受金	50,791,600	137,170,000
未払収益分配金	617,998,275	593,559,848
未払受託者報酬	7,862,816	7,904,174
未払委託者報酬	24,430,827	24,559,346
未払利息	2,942	101
その他未払費用	13,880,459	13,969,421
流動負債合計	715,983,481	777,162,890
負債合計	715,983,481	777,162,890
純資産の部		
元本等		
元本	38,582,318,973	31,344,869,116
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,960,752,792	21,610,176,130
(分配準備積立金)	530,802	863,545
元本等合計	57,543,071,765	52,955,045,246
純資産合計	57,543,071,765	52,955,045,246
負債純資産合計	58,259,055,246	53,732,208,136

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第9期	第10期
	自 2023年2月16日 至 2023年8月15日	自 2023年8月16日 至 2024年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	663,404,405	640,604,123
受取利息	13,206	6,160
有価証券売買等損益	7,017,483,812	5,869,553,579
派生商品取引等損益	319,435,366	240,774,082
その他収益	2,353	2,557
営業収益合計	8,000,339,142	6,750,940,501
営業費用		
支払利息	428,057	287,308
受託者報酬	7,862,816	7,904,174
委託者報酬	24,430,827	24,559,346
その他費用	13,912,711	13,969,421
営業費用合計	46,634,411	46,720,249
営業利益又は営業損失 (△)	7,953,704,731	6,704,220,252
経常利益又は経常損失 (△)	7,953,704,731	6,704,220,252
当期純利益又は当期純損失 (△)	7,953,704,731	6,704,220,252
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 (△)	10,722,555,797	18,960,752,792
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,402,995,420	995,873,977
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	2,402,995,420	995,873,977
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,500,504,881	4,457,111,043
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,500,504,881	4,457,111,043
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	617,998,275	593,559,848
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	18,960,752,792	21,610,176,130

(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9期 (2023年8月15日現在)	第10期 (2024年2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9期 2023年8月15日現在	第10期 2024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	36,880,833,957円	38,582,318,973円
	期中追加設定元本額	4,636,984,935円	1,545,731,880円
	期中一部交換元本額	2,935,499,919円	8,783,181,737円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,746,659口	2,231,428口
3.	1口当たり純資産額	20,950円	23,731円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自2023年2月16日 至2023年8月15日		第10期 自2023年8月16日 至2024年2月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	662,991,907円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,743,524円	B. 分配準備積立金額	530,802円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	664,735,431円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	640,856,334円
	D. 経費	46,206,354円	D. 経費	46,432,941円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	618,529,077円	E. 収益分配可能額 (C-D)	594,423,393円
	F. 収益分配金	617,998,275円	F. 収益分配金	593,559,848円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	530,802円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	863,545円
	H. 口数	2,746,659口	H. 口数	2,231,428口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	225円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	266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9期 自 2023年2月16日 至 2023年8月15日	第10期 自 2023年8月16日 至 2024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、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9期 2023年8月15日現在	第10期 2024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9期(自 2023年2月16日 至 2023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	6,431,862,111
合計	6,431,862,111

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

(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9期 (2023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	2,025,453,400	—	2,064,933,000	39,479,600
合計		2,025,453,400	—	2,064,933,000	39,479,600

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

(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	927.50	25,691,750	
三井松島ホールディングス	1,700	2,865.00	4,870,500	
I N P E X	102,500	1,933.00	198,132,500	
ウエストホールディングス	2,400	3,135.00	7,524,000	
ショーボンドホールディングス	3,800	6,188.00	23,514,400	
ミライト・ワン	9,200	1,735.00	15,962,000	
タマホーム	1,800	3,940.00	7,092,000	
安藤・間	16,000	1,185.00	18,960,000	
コムシスホールディングス	9,100	3,214.00	29,247,400	
大成建設	18,100	4,695.00	84,979,500	
大林組	69,300	1,371.00	95,010,300	
清水建設	55,000	871.80	47,949,000	
長谷工コーポレーション	17,800	1,841.50	32,778,700	
鹿島建設	43,000	2,671.50	114,874,500	
住友林業	16,800	4,041.00	67,888,800	
大和ハウス工業	53,600	4,299.00	230,426,400	
積水ハウス	58,800	3,261.00	191,746,800	
関電工	12,100	1,564.00	18,924,400	
エクシオグループ	9,700	3,029.00	29,381,300	
九電工	4,200	5,426.00	22,789,200	
インフロニア・ホールディングス	22,300	1,460.00	32,558,000	
森永製菓	8,400	2,694.00	22,629,600	
カルビー	9,000	3,068.00	27,612,000	
森永乳業	7,100	3,024.00	21,470,400	
ヤクルト本社	27,800	3,043.00	84,595,400	
明治ホールディングス	23,800	3,400.00	80,920,000	
日本ハム	8,300	5,239.00	43,483,700	
アサヒグループホールディングス	45,000	5,315.00	239,175,000	
キリンホールディングス	81,000	2,104.50	170,464,500	
宝ホールディングス	13,300	1,159.50	15,421,350	
サントリー食品インターナショナル	13,700	4,716.00	64,609,200	
キッコーマン	12,900	9,402.00	121,285,800	

味の素	46,300	5,667.00	262,382,100
ニチレイ	9,000	3,742.00	33,678,000
東洋水産	9,800	8,162.00	79,987,600
日清食品ホールディングス	20,500	4,357.00	89,318,500
日本たばこ産業	118,200	3,880.00	458,616,000
東レ	132,700	676.00	89,705,200
ゴールドウイン	3,500	8,677.00	30,369,500
王子ホールディングス	82,500	551.40	45,490,500
レンゴー	18,000	983.90	17,710,200
クラレ	28,900	1,505.50	43,508,950
旭化成	133,900	1,010.00	135,239,000
住友化学	146,900	298.80	43,893,720
日産化学	9,300	6,177.00	57,446,100
東ソー	26,400	1,948.50	51,440,400
トクヤマ	6,400	2,283.00	14,611,200
デンカ	7,200	2,458.50	17,701,200
信越化学工業	159,000	6,138.00	975,942,000
エア・ウォーター	18,700	2,105.00	39,363,500
日本酸素ホールディングス	19,200	4,057.00	77,894,400
三菱瓦斯化学	14,800	2,580.00	38,184,000
三井化学	16,300	3,965.00	64,629,500
東京応化工業	9,500	4,164.00	39,558,000
三菱ケミカルグループ	144,700	838.40	121,316,480
KHネオケム	3,100	2,248.00	6,968,800
ダイセル	25,500	1,414.00	36,057,000
住友ベークライト	2,900	7,967.00	23,104,300
積水化学工業	40,100	2,087.50	83,708,750
日本ゼオン	13,600	1,245.50	16,938,800
アイカ工業	5,000	3,474.00	17,370,000
扶桑化学工業	2,100	4,655.00	9,775,500
ADEKA	7,000	2,924.00	20,468,000
日油	6,100	7,043.00	42,962,300
花王	44,800	5,462.00	244,697,600
日本ペイントホールディングス	105,200	1,110.50	116,824,600
関西ペイント	19,400	2,306.50	44,746,100
太陽ホールディングス	3,500	3,135.00	10,972,500
富士フイルムホールディングス	36,800	9,279.00	341,467,200
資生堂	41,400	3,902.00	161,542,800

ライオン	25,900	1,290.00	33,411,000
コーセー	4,000	8,056.00	32,224,000
小林製薬	5,800	6,020.00	34,916,000
タカラバイオ	5,600	1,024.00	5,734,400
デクセリアルズ	5,000	5,776.00	28,880,000
日東電工	12,700	13,940.00	177,038,000
ニフコ	5,900	3,715.00	21,918,500
ユニ・チャーム	41,300	5,111.00	211,084,300
協和キリン	23,900	2,800.00	66,920,000
武田薬品工業	153,500	4,315.00	662,352,500
アステラス製薬	173,900	1,652.50	287,369,750
塩野義製薬	25,000	6,995.00	174,875,000
日本新薬	5,200	4,888.00	25,417,600
中外製薬	62,100	5,705.00	354,280,500
エーザイ	24,100	6,300.00	151,830,000
ロート製薬	19,200	2,878.50	55,267,200
小野薬品工業	42,000	2,382.50	100,065,000
JCRファーマ	6,700	901.00	6,036,700
第一三共	152,700	4,789.00	731,280,300
大塚ホールディングス	41,200	5,428.00	223,633,600
ペプチドリーム	9,600	1,479.00	14,198,400
出光興産	110,100	880.40	96,932,040
ENEOSホールディングス	313,800	629.20	197,442,960
コスモエネルギーホールディングス	5,900	6,178.00	36,450,200
横浜ゴム	10,000	3,646.00	36,460,000
TOYO TIRE	11,400	2,760.00	31,464,000
ブリヂストン	58,100	6,482.00	376,604,200
住友ゴム工業	19,400	1,722.50	33,416,500
AGC	17,700	5,290.00	93,633,000
TOTO	13,100	3,658.00	47,919,800
日本碍子	23,100	1,869.00	43,173,900
日本特殊陶業	16,600	4,211.00	69,902,600
MARUWA	700	31,800.00	22,260,000
フジインコーポレーテッド	5,400	3,390.00	18,306,000
ニチアス	5,100	3,635.00	18,538,500
日本製鉄	91,400	3,428.00	313,319,200
JFEホールディングス	56,700	2,248.50	127,489,950
東京製鐵	6,100	1,672.00	10,199,200

丸一鋼管	6,200	3,827.00	23,727,400
日本冶金工業	1,500	4,340.00	6,510,000
大紀アルミニウム工業所	2,700	1,212.00	3,272,400
三井金属鉱業	5,900	4,305.00	25,399,500
住友金属鉱山	23,600	3,974.00	93,786,400
DOWAホールディングス	5,100	5,334.00	27,203,400
住友電気工業	76,300	2,099.50	160,191,850
AREホールディングス	7,700	1,930.00	14,861,000
SUMCO	36,200	2,363.50	85,558,700
三和ホールディングス	20,400	2,560.50	52,234,200
リンナイ	10,000	3,468.00	34,680,000
三浦工業	8,300	2,905.50	24,115,650
アマダ	31,800	1,574.50	50,069,100
FUJ I	9,400	2,583.00	24,280,200
DMG森精機	12,100	3,264.00	39,494,400
ディスコ	9,600	45,530.00	437,088,000
ナブテスコ	12,500	2,345.00	29,312,500
SMC	6,000	82,680.00	496,080,000
小松製作所	93,600	4,288.00	401,356,800
住友重機械工業	11,800	4,429.00	52,262,200
日立建機	7,900	4,167.00	32,919,300
ローツェ	1,100	20,190.00	22,209,000
クボタ	104,700	2,267.00	237,354,900
荏原製作所	8,200	10,910.00	89,462,000
ダイキン工業	23,700	21,500.00	509,550,000
オルガノ	2,600	6,870.00	17,862,000
ダイフク	33,700	3,333.00	112,322,100
SANKYO	4,600	9,037.00	41,570,200
竹内製作所	3,600	4,945.00	17,802,000
セガサミーホールディングス	17,800	1,717.00	30,562,600
ホシザキ	11,800	5,215.00	61,537,000
マキタ	22,800	3,787.00	86,343,600
三菱重工業	34,900	10,905.00	380,584,500
I H I	14,900	3,039.00	45,281,100
イビデン	10,400	7,337.00	76,304,800
ブラザー工業	26,700	2,524.00	67,390,800
ミネベアミツミ	34,800	3,047.00	106,035,600
日立製作所	77,200	12,130.00	936,436,000

三菱電機	222,100	2,201.00	488,842,100
富士電機	12,100	8,789.00	106,346,900
安川電機	21,700	5,369.00	116,507,300
ニデック	44,000	5,622.00	247,368,000
オムロン	15,300	5,351.00	81,870,300
MC J	8,300	1,363.00	11,312,900
日本電気	26,200	9,635.00	252,437,000
富士通	18,300	23,070.00	422,181,000
ルネサスエレクトロニクス	130,200	2,536.00	330,187,200
セイコーエプソン	25,600	2,412.00	61,747,200
ワコム	15,300	645.00	9,868,500
アルバック	4,400	8,886.00	39,098,400
エレコム	4,700	1,562.00	7,341,400
パナソニック ホールディングス	235,800	1,391.50	328,115,700
アンリツ	14,000	1,155.00	16,170,000
ソニーグループ	53,600	13,710.00	734,856,000
TDK	31,600	7,825.00	247,270,000
ヒロセ電機	3,000	16,120.00	48,360,000
横河電機	21,800	3,128.00	68,190,400
アズビル	13,800	4,684.00	64,639,200
日本光電工業	8,400	4,150.00	34,860,000
堀場製作所	3,800	15,170.00	57,646,000
アドバンテスト	56,600	7,045.00	398,747,000
キーエンス	10,200	67,170.00	685,134,000
シスメックス	17,100	8,196.00	140,151,600
フェローテックホールディングス	6,200	2,894.00	17,942,800
レーザーテック	9,100	42,210.00	384,111,000
日本電子	5,000	6,679.00	33,395,000
ファナック	96,400	3,974.00	383,093,600
ローム	36,600	2,551.00	93,366,600
浜松ホトニクス	15,900	5,415.00	86,098,500
三井ハイテック	1,800	7,930.00	14,274,000
新光電気工業	7,000	5,500.00	38,500,000
京セラ	122,700	2,199.00	269,817,300
太陽誘電	9,600	3,421.00	32,841,600
村田製作所	179,800	3,019.00	542,816,200
小糸製作所	20,400	1,939.50	39,565,800
S C R E E Nホールディングス	6,700	19,400.00	129,980,000

東京エレクトロン	33,800	35,210.00	1,190,098,000
トヨタ紡織	8,300	2,436.00	20,218,800
豊田自動織機	16,900	14,170.00	239,473,000
デンソー	163,000	2,618.00	426,734,000
いすゞ自動車	57,400	2,080.50	119,420,700
トヨタ自動車	300,900	3,382.00	1,017,643,800
カヤバ	1,900	4,835.00	9,186,500
アイシン	15,300	5,192.00	79,437,600
マツダ	65,300	1,716.50	112,087,450
本田技研工業	480,200	1,721.50	826,664,300
スズキ	36,200	6,605.00	239,101,000
SUBARU	61,300	3,339.00	204,680,700
ヤマハ発動機	85,400	1,380.00	117,852,000
豊田合成	5,800	2,944.00	17,075,200
シマノ	8,000	20,375.00	163,000,000
テルモ	55,200	5,432.00	299,846,400
島津製作所	26,200	3,831.00	100,372,200
ナカニシ	8,300	2,098.00	17,413,400
東京精密	4,100	10,155.00	41,635,500
オリンパス	121,700	2,055.00	250,093,500
HOYA	37,800	18,325.00	692,685,000
朝日インテック	24,000	2,993.00	71,832,000
バンダイナムコホールディングス	54,200	2,647.00	143,467,400
パイロットコーポレーション	2,900	3,699.00	10,727,100
ヤマハ	12,400	3,220.00	39,928,000
ピジョン	12,500	1,576.50	19,706,250
任天堂	106,200	8,950.00	950,490,000
中部電力	72,800	1,822.50	132,678,000
関西電力	76,300	1,921.00	146,572,300
電源開発	16,200	2,433.00	39,414,600
イーレックス	3,500	731.00	2,558,500
レノバ	5,300	1,190.00	6,307,000
東京瓦斯	41,800	3,122.00	130,499,600
大阪瓦斯	40,000	3,006.00	120,240,000
SBSホールディングス	1,800	2,173.00	3,911,400
ヤマトホールディングス	25,300	2,400.00	60,720,000
山九	5,100	5,178.00	26,407,800
センコーグループホールディングス	10,400	1,105.00	11,492,000

AZ-COM丸和ホールディングス	4,800	1,401.00	6,724,800
SGホールディングス	33,100	1,866.50	61,781,150
NIPPON EXPRESSホールディングス	6,700	8,196.00	54,913,200
日本郵船	56,600	4,775.00	270,265,000
商船三井	42,800	5,215.00	223,202,000
川崎汽船	15,800	6,910.00	109,178,000
NSユナイテッド海運	1,100	5,100.00	5,610,000
三井倉庫ホールディングス	1,900	4,595.00	8,730,500
NECネットエスアイ	7,700	2,360.00	18,172,000
システナ	31,700	275.00	8,717,500
日鉄ソリューションズ	3,400	4,865.00	16,541,000
TIS	21,700	3,410.00	73,997,000
コーエーテクモホールディングス	12,400	1,819.00	22,555,600
ネクソン	44,300	2,490.00	110,307,000
SHIFT	1,400	26,865.00	37,611,000
ティーガイア	2,100	2,106.00	4,422,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,200	2,217.00	11,528,400
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	8,960.00	35,840,000
インターネットイニシアティブ	9,500	2,800.50	26,604,750
ラクス	9,400	2,082.50	19,575,500
チェンジホールディングス	4,700	1,443.00	6,782,100
野村総合研究所	43,900	4,128.00	181,219,200
オービック	6,600	22,060.00	145,596,000
ジャストシステム	2,800	2,486.00	6,960,800
LINEヤフー	282,200	417.60	117,846,720
トレンドマイクロ	9,400	8,721.00	81,977,400
日本オラクル	3,800	11,690.00	44,422,000
大塚商会	9,800	6,015.00	58,947,000
電通総研	2,400	5,550.00	13,320,000
東映アニメーション	900	17,000.00	15,300,000
デジタルガレージ	3,400	3,095.00	10,523,000
ネットワンシステムズ	8,000	2,550.00	20,400,000
BIPROGY	6,500	4,542.00	29,523,000
USEN-NEXT HOLDINGS	2,200	4,380.00	9,636,000
日本電信電話	3,783,800	181.00	684,867,800
KDDI	153,200	4,510.00	690,932,000
ソフトバンク	318,900	1,946.00	620,579,400

光通信	2,000	24,605.00	49,210,000
GMOインターネットグループ	7,400	2,622.00	19,402,800
KADOKAWA	10,400	3,028.00	31,491,200
東宝	11,100	4,679.00	51,936,900
NTTデータグループ	51,800	2,300.00	119,140,000
DTS	4,200	3,835.00	16,107,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,100	6,666.00	60,660,600
カプコン	17,700	5,961.00	105,509,700
SCSK	13,900	2,672.50	37,147,750
NSD	7,100	2,679.00	19,020,900
コナミグループ	7,400	9,842.00	72,830,800
ソフトバンクグループ	97,800	8,502.00	831,495,600
双日	23,300	3,667.00	85,441,100
アルフレッサ ホールディングス	21,000	2,253.00	47,313,000
神戸物産	16,200	3,657.00	59,243,400
ダイワボウホールディングス	9,300	2,660.50	24,742,650
マクニカホールディングス	5,000	8,355.00	41,775,000
シップヘルスケアホールディングス	7,500	2,132.00	15,990,000
メディパルホールディングス	21,700	2,290.50	49,703,850
IDOM	6,100	908.00	5,538,800
伊藤忠商事	133,300	6,635.00	884,445,500
丸紅	174,400	2,382.00	415,420,800
豊田通商	18,300	9,217.00	168,671,100
兼松	8,700	2,335.00	20,314,500
三井物産	136,300	6,052.00	824,887,600
住友商事	126,500	3,455.00	437,057,500
三菱商事	325,900	2,960.00	964,664,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	4,333.00	20,798,400
阪和興業	3,800	5,610.00	21,318,000
岩谷産業	4,700	7,140.00	33,558,000
稲畑産業	4,100	3,095.00	12,689,500
伊藤忠エネクス	5,200	1,498.00	7,789,600
加賀電子	1,900	6,450.00	12,255,000
PALTAC	2,800	4,275.00	11,970,000
ミスミグループ本社	31,600	2,121.50	67,039,400
ローソン	4,400	10,220.00	44,968,000
エービーシー・マート	9,200	2,556.00	23,515,200
アスクル	4,300	1,994.00	8,574,200

日本マクドナルドホールディングス	12,800	6,920.00	88,576,000
セリア	6,200	2,753.00	17,068,600
MonotaRO	29,600	1,483.00	43,896,800
マツキヨココカラ&カンパニー	38,000	2,572.00	97,736,000
ZOZO	13,800	3,426.00	47,278,800
ウエルシアホールディングス	10,900	2,559.00	27,893,100
クリエイトSDホールディングス	3,500	3,125.00	10,937,500
ネクステージ	4,700	2,424.00	11,392,800
コスモス薬品	1,800	15,030.00	27,054,000
セブン&アイ・ホールディングス	72,100	6,182.00	445,722,200
ツルハホールディングス	4,400	10,725.00	47,190,000
クスリのアオキホールディングス	6,300	2,947.00	18,566,100
FOOD & LIFE COMPANIES	11,200	2,838.00	31,785,600
ノジマ	6,700	1,667.00	11,168,900
良品計画	22,900	2,208.00	50,563,200
コーナン商事	2,700	3,830.00	10,341,000
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	42,300	3,510.00	148,473,000
ゼンショーホールディングス	10,600	6,454.00	68,412,400
ワークマン	2,400	3,820.00	9,168,000
VTホールディングス	7,900	518.00	4,092,200
スギホールディングス	4,200	6,672.00	28,022,400
日本瓦斯	11,100	2,385.00	26,473,500
ライフコーポレーション	2,200	3,670.00	8,074,000
コメリ	3,300	3,245.00	10,708,500
しまむら	2,400	16,440.00	39,456,000
イズミ	3,700	3,524.00	13,038,800
ヤオコー	2,300	8,038.00	18,487,400
ケーズホールディングス	14,800	1,233.00	18,248,400
ニトリホールディングス	7,600	21,270.00	161,652,000
ファーストリテイリング	9,400	41,630.00	391,322,000
サンドラッグ	7,100	4,354.00	30,913,400
めぶきフィナンシャルグループ	96,600	415.50	40,137,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	104,400	691.00	72,140,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	634,700	1,404.00	891,118,800
りそなホールディングス	227,000	797.60	181,055,200
三井住友トラスト・ホールディングス	70,000	2,873.00	201,110,000

三井住友フィナンシャルグループ	109,800	7,770.00	853,146,000
千葉銀行	54,300	1,093.00	59,349,900
ふくおかフィナンシャルグループ	17,000	3,584.00	60,928,000
セブン銀行	61,000	292.30	17,830,300
みずほフィナンシャルグループ	262,700	2,665.00	700,095,500
SBIホールディングス	28,500	3,878.00	110,523,000
ジャフコ グループ	6,100	1,713.50	10,452,350
大和証券グループ本社	150,800	1,035.50	156,153,400
野村ホールディングス	327,400	808.70	264,768,380
マネックスグループ	20,600	822.00	16,933,200
SOMPOホールディングス	29,300	8,627.00	252,771,100
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	43,600	7,477.00	325,997,200
第一生命ホールディングス	95,100	3,200.00	304,320,000
東京海上ホールディングス	192,400	4,367.00	840,210,800
全国保証	5,100	5,460.00	27,846,000
芙蓉総合リース	1,800	13,520.00	24,336,000
みずほリース	3,300	5,260.00	17,358,000
東京センチュリー	14,700	1,608.50	23,644,950
イオンフィナンシャルサービス	11,200	1,313.00	14,705,600
アコム	34,800	386.00	13,432,800
ジャックス	2,100	5,420.00	11,382,000
オリエン트コーポレーション	6,300	1,061.00	6,684,300
オリックス	118,600	2,986.50	354,198,900
三菱HCキャピタル	86,700	1,019.00	88,347,300
日本取引所グループ	50,800	3,750.00	190,500,000
大東建託	7,200	16,995.00	122,364,000
ヒューリック	45,400	1,535.00	69,689,000
野村不動産ホールディングス	10,900	3,675.00	40,057,500
プレサンスコーポレーション	3,100	1,742.00	5,400,200
オープンハウスグループ	7,200	4,802.00	34,574,400
東急不動産ホールディングス	58,500	961.30	56,236,050
飯田グループホールディングス	18,700	1,876.00	35,081,200
ケイアイスター不動産	900	3,470.00	3,123,000
三井不動産	90,000	3,923.00	353,070,000
三菱地所	127,300	2,018.50	256,955,050
東京建物	17,000	2,181.00	37,077,000
住友不動産	28,100	4,521.00	127,040,100
スターツコーポレーション	2,800	2,921.00	8,178,800

カチタス	5,300	1,930.00	10,229,000
日本M&Aセンターホールディングス	32,400	929.90	30,128,760
UTグループ	2,700	3,025.00	8,167,500
パソナグループ	2,400	2,784.00	6,681,600
エス・エム・エス	7,400	2,616.50	19,362,100
パーソルホールディングス	206,800	215.30	44,524,040
総合警備保障	33,900	783.60	26,564,040
カカクコム	13,400	1,630.50	21,848,700
ディップ	3,300	2,664.00	8,791,200
ベネフィット・ワン	7,100	2,167.50	15,389,250
エムスリー	40,100	2,012.00	80,681,200
博報堂DYホールディングス	25,900	1,357.00	35,146,300
H. U. グループホールディングス	5,900	2,669.00	15,747,100
ビー・エム・エル	2,500	2,661.00	6,652,500
ユー・エス・エス	22,800	2,620.50	59,747,400
サイバーエージェント	44,900	1,044.50	46,898,050
フルキャストホールディングス	1,900	1,439.00	2,734,100
テクノプロ・ホールディングス	12,000	3,158.00	37,896,000
ジャパンマテリアル	6,200	2,647.00	16,411,400
リクルートホールディングス	150,400	5,971.00	898,038,400
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,798.00	5,034,400
ベイカレント・コンサルティング	15,000	3,081.00	46,215,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,900	2,128.00	14,683,200
リログループ	10,200	1,243.50	12,683,700
トランス・コスモス	2,500	2,935.00	7,337,500
セコム	20,700	10,550.00	218,385,000
メイテックグループホールディングス	7,300	3,077.00	22,462,100
イオンディライト	2,300	3,485.00	8,015,500
合 計	19,090,200		51,848,773,590

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。