

## 2019年8月期 決算短信 (2019年2月5日～2019年8月15日)

2019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	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	<a href="http://www.ja-asset.co.jp/">http://www.ja-asset.co.jp/</a>		
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	2019年11月15日		
分配金支払開始予定日	2019年9月20日		

### I ファンドの運用状況

#### 1. 2019年8月期の運用状況 (2019年2月5日～2019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	%
2019年8月期	9,435	(98.4)	150	(1.6)	9,586	(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
2019年8月期	—	833	107	726

##### (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
2019年8月期	9,753	167	9,586	13,199

##### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2019年8月期	197

(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1期 2019年8月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	288,496,919
株式	9,435,343,740
未収配当金	19,529,957
前払金	10,287,000
流動資産合計	9,753,657,616
資産合計	9,753,657,616
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,389,389
未払金	6,647,832
未払収益分配金	143,078,539
未払受託者報酬	1,781,067
未払委託者報酬	5,533,959
未払利息	305
その他未払費用	4,099,011
流動負債合計	167,530,102
負債合計	167,530,102
純資産の部	
元本等	
元本	10,202,153,489
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△616,025,975
(分配準備積立金)	271,499
元本等合計	9,586,127,514
純資産合計	9,586,127,514
負債純資産合計	9,753,657,616

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期 自 2019年2月5日 至 2019年8月15日
	金額(円)
営業収益	
受取配当金	154,706,475
受取利息	296
有価証券売買等損益	△616,595,613
派生商品取引等損益	△18,877,265
その他収益	123,401
営業収益合計	△480,642,706
営業費用	
支払利息	52,702
受託者報酬	1,781,067
委託者報酬	5,533,959
その他費用	4,112,406
営業費用合計	11,480,134
営業利益又は営業損失(△)	△492,122,840
経常利益又は経常損失(△)	△492,122,840
当期純利益又は当期純損失(△)	△492,122,840
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(△)	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,166,897
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	35,166,897
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,991,493
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,991,493
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	143,078,539
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△616,025,975

(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）、又は第一種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 受取配当金は、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1期 2019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	10,165,322,255円
	期中追加設定元本額	1,545,212,141円
	期中一部交換元本額	1,508,380,907円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	726,287口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	616,025,975円
4.	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	40,513,000円
	合計	40,513,000円
5.	1口当たり純資産額	13,199円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	
	自 2019 年 2 月 5 日 至 2019 年 8 月 15 日	
分配金の計算過程	A. 配当等収益額	154,777,470 円
	B. 分配準備積立金額	0 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	154,777,470 円
	D. 経費	11,427,432 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	143,350,038 円
	F. 収益分配金	143,078,539 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	271,499 円
	H. 口数	726,287 口
	I. 1 口当たり分配金 (F/H ×1)	197 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1期	
	自 2019 年 2 月 5 日 至 2019 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。	
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。	
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。	

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第 1 期 2019 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。
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。	
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る場合、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 1 期(自 2019 年 2 月 5 日 至 2019 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	△609,906,538
合計	△609,906,538

(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 1 期 (2019 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	147,894,000	—	141,507,500	△6,386,500
合計		147,894,000	—	141,507,500	△6,386,500

(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	7,700	588.00	4,527,600	
マルハニチロ	1,100	2,655.00	2,920,500	
国際石油開発帝石	31,100	903.20	28,089,520	
安藤・間	4,900	666.00	3,263,400	
東急建設	2,300	750.00	1,725,000	
コムシスホールディングス	2,500	2,774.00	6,935,000	
大成建設	6,400	3,560.00	22,784,000	
大林組	19,100	927.00	17,705,700	
清水建設	19,500	854.00	16,653,000	
長谷工コーポレーション	8,000	1,087.00	8,696,000	
鹿島建設	15,000	1,203.00	18,045,000	
西松建設	1,400	1,786.00	2,500,400	
三井住友建設	4,600	513.00	2,359,800	
前田建設工業	4,500	811.00	3,649,500	
戸田建設	7,400	562.00	4,158,800	
熊谷組	900	2,755.00	2,479,500	
大東建託	2,300	13,430.00	30,889,000	
NIPPO	1,700	1,843.00	3,133,100	
前田道路	2,000	2,276.00	4,552,000	
五洋建設	7,600	518.00	3,936,800	
住友林業	4,500	1,220.00	5,490,000	
大和ハウス工業	17,700	3,067.00	54,285,900	
積水ハウス	19,500	1,801.00	35,119,500	
協和エクシオ	2,400	2,337.00	5,608,800	
九電工	1,300	3,115.00	4,049,500	
森永製菓	1,400	5,320.00	7,448,000	
江崎グリコ	1,700	4,530.00	7,701,000	
カルビー	2,600	3,090.00	8,034,000	
ヤクルト本社	4,200	5,820.00	24,444,000	
明治ホールディングス	4,000	7,470.00	29,880,000	
日本ハム	2,300	3,835.00	8,820,500	

## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

アサヒグループホールディングス	12,000	4,781.00	57,372,000
キリンホールディングス	24,300	2,121.50	51,552,450
サントリー食品インターナショナル	3,800	4,475.00	17,005,000
キッコーマン	3,800	4,800.00	18,240,000
味の素	12,600	1,905.00	24,003,000
キューピー	3,200	2,420.00	7,744,000
ニチレイ	3,000	2,346.00	7,038,000
東洋水産	3,000	4,395.00	13,185,000
日清食品ホールディングス	2,400	7,000.00	16,800,000
日本たばこ産業	33,100	2,269.50	75,120,450
帝人	4,500	1,848.00	8,316,000
東レ	43,300	777.20	33,652,760
王子ホールディングス	25,200	477.00	12,020,400
クラレ	8,800	1,219.00	10,727,200
旭化成	39,800	939.20	37,380,160
昭和電工	4,000	2,714.00	10,856,000
住友化学	43,900	459.00	20,150,100
日産化学	3,400	4,770.00	16,218,000
東ソー	8,600	1,350.00	11,610,000
デンカ	2,200	2,826.00	6,217,200
信越化学工業	9,800	10,645.00	104,321,000
エア・ウォーター	4,600	1,743.00	8,017,800
大陽日酸	4,600	2,290.00	10,534,000
日本パーカライジング	3,000	1,121.00	3,363,000
三菱瓦斯化学	5,700	1,215.00	6,925,500
三井化学	5,100	2,279.00	11,622,900
J S R	5,600	1,686.00	9,441,600
三菱ケミカルホールディングス	37,300	717.50	26,762,750
ダイセル	8,200	804.00	6,592,800
積水化学工業	12,200	1,519.00	18,531,800
日本ゼオン	5,000	1,156.00	5,780,000
アイカ工業	1,700	2,989.00	5,081,300
宇部興産	2,800	1,992.00	5,577,600
日立化成	2,600	2,985.00	7,761,000
ダイキョーニシカワ	1,200	741.00	889,200
日油	2,100	3,365.00	7,066,500
花王	13,800	7,643.00	105,473,400
日本ペイントホールディングス	4,600	4,775.00	21,965,000



## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

関西ペイント	6,300	2,102.00	13,242,600
D I C	2,400	2,686.00	6,446,400
資生堂	11,300	7,966.00	90,015,800
ライオン	7,400	2,099.00	15,532,600
コーセー	1,000	16,980.00	16,980,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,400	2,548.00	6,115,200
小林製薬	1,600	7,690.00	12,304,000
日東電工	3,900	4,839.00	18,872,100
ニフコ	2,300	2,403.00	5,526,900
ユニ・チャーム	11,000	3,138.00	34,518,000
協和キリン	5,700	1,800.00	10,260,000
武田薬品工業	49,700	3,615.00	179,665,500
アステラス製薬	50,200	1,418.00	71,183,600
大日本住友製薬	4,200	1,842.00	7,736,400
塩野義製薬	7,300	5,619.00	41,018,700
田辺三菱製薬	6,000	1,147.00	6,882,000
中外製薬	5,900	7,340.00	43,306,000
科研製薬	1,000	4,725.00	4,725,000
エーザイ	6,800	5,325.00	36,210,000
小野薬品工業	13,500	1,973.50	26,642,250
久光製薬	1,700	4,220.00	7,174,000
参天製薬	10,900	1,797.00	19,587,300
ツムラ	1,800	2,964.00	5,335,200
沢井製薬	1,200	5,590.00	6,708,000
第一三共	16,300	7,182.00	117,066,600
大塚ホールディングス	10,900	4,274.00	46,586,600
出光興産	4,400	2,665.00	11,726,000
J X T Gホールディングス	95,900	423.10	40,575,290
コスモエネルギーホールディングス	1,600	1,820.00	2,912,000
横浜ゴム	3,300	1,957.00	6,458,100
ブリヂストン	17,500	3,979.00	69,632,500
住友ゴム工業	5,100	1,153.00	5,880,300
A G C	5,600	2,979.00	16,682,400
太平洋セメント	3,600	2,542.00	9,151,200
T O T O	4,400	4,040.00	17,776,000
日本碍子	6,900	1,455.00	10,039,500
日本特殊陶業	4,800	1,832.00	8,793,600
ニチアス	1,500	1,671.00	2,506,500

## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

日本製鉄	25,300	1,453.00	36,760,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,200	1,206.50	18,338,800
東京製鐵	3,000	808.00	2,424,000
日立金属	6,100	1,091.00	6,655,100
日本軽金属ホールディングス	15,300	180.00	2,754,000
三菱マテリアル	3,700	2,643.00	9,779,100
住友金属鉱山	7,700	3,081.00	23,723,700
DOWAホールディングス	1,300	3,525.00	4,582,500
古河電気工業	1,600	2,346.00	3,753,600
住友電気工業	21,000	1,214.50	25,504,500
SUMCO	6,800	1,256.00	8,540,800
三和ホールディングス	5,800	1,130.00	6,554,000
リンナイ	1,000	6,590.00	6,590,000
東プレ	1,100	1,597.00	1,756,700
日本発條	5,600	718.00	4,020,800
アマダホールディングス	8,700	1,027.00	8,934,900
オーエスジー	2,600	1,981.00	5,150,600
DMG森精機	3,600	1,409.00	5,072,400
ディスコ	800	19,430.00	15,544,000
ナブテスコ	3,300	2,950.00	9,735,000
三井海洋開発	600	2,299.00	1,379,400
SMC	1,700	39,000.00	66,300,000
小松製作所	25,900	2,277.00	58,974,300
住友重機械工業	3,300	3,050.00	10,065,000
日立建機	2,300	2,210.00	5,083,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,000	4,030.00	4,030,000
クボタ	30,600	1,518.00	46,450,800
荏原製作所	2,500	2,370.00	5,925,000
ダイキン工業	7,800	13,270.00	103,506,000
椿本チエイン	700	3,195.00	2,236,500
ダイフク	3,100	4,660.00	14,446,000
タダノ	2,700	895.00	2,416,500
平和	1,600	2,035.00	3,256,000
竹内製作所	900	1,523.00	1,370,700
T P R	800	1,587.00	1,269,600
ホシザキ	1,700	7,220.00	12,274,000
日本精工	11,700	801.00	9,371,700
ジェイテクト	5,500	1,116.00	6,138,000

## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

THK	3,300	2,423.00	7,995,900	
マキタ	6,900	3,125.00	21,562,500	
三菱重工業	9,500	4,026.00	38,247,000	
コニカミノルタ	12,400	735.00	9,114,000	
ブラザー工業	7,400	1,843.00	13,638,200	
ミネベアミツミ	10,600	1,587.00	16,822,200	
日立製作所	25,600	3,641.00	93,209,600	
三菱電機	56,900	1,277.50	72,689,750	
富士電機	3,700	3,075.00	11,377,500	
安川電機	6,600	3,380.00	22,308,000	
日本電産	6,900	13,745.00	94,840,500	
オムロン	6,100	5,040.00	30,744,000	
日本電気	7,400	4,480.00	33,152,000	
富士通	5,500	8,467.00	46,568,500	
ルネサスエレクトロニクス	27,100	616.00	16,693,600	
セイコーエプソン	7,100	1,394.00	9,897,400	
アルバック	1,100	4,180.00	4,598,000	
エレコム	500	4,095.00	2,047,500	
パナソニック	65,100	801.00	52,145,100	
富士通ゼネラル	1,700	1,648.00	2,801,600	
ソニー	29,100	5,838.00	169,885,800	
TDK	3,000	8,260.00	24,780,000	
アルプスアルパイン	5,300	1,747.00	9,259,100	
ヒロセ電機	800	11,710.00	9,368,000	
横河電機	5,700	2,005.00	11,428,500	
日本光電工業	2,500	3,085.00	7,712,500	
堀場製作所	1,100	5,450.00	5,995,000	
アドバンテスト	3,900	4,115.00	16,048,500	
キーエンス	2,600	60,680.00	157,768,000	代用有価証券で 200株 担保差入
シスメックス	4,400	6,340.00	27,896,000	
OBARA GROUP	300	3,110.00	933,000	
スタンレー電気	4,000	2,550.00	10,200,000	
カシオ計算機	5,000	1,408.00	7,040,000	
ファナック	5,400	18,065.00	97,551,000	
浜松ホトニクス	4,100	3,655.00	14,985,500	
京セラ	8,700	6,356.00	55,297,200	
村田製作所	18,000	4,618.00	83,124,000	

## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

小糸製作所	3,400	4,865.00	16,541,000	
S C R E E Nホールディングス	1,000	5,710.00	5,710,000	
キヤノン	30,600	2,744.50	83,981,700	
東京エレクトロン	3,800	18,435.00	70,053,000	
トヨタ紡織	2,000	1,373.00	2,746,000	
豊田自動織機	4,600	5,510.00	25,346,000	
デンソー	12,500	4,287.00	53,587,500	
川崎重工業	4,400	2,002.00	8,808,800	
日産自動車	67,200	655.10	44,022,720	
いすゞ自動車	18,100	1,078.50	19,520,850	
トヨタ自動車	21,000	6,795.00	142,695,000	代用有価証券で 2,000株 担保差入
日野自動車	7,100	817.00	5,800,700	
N O K	3,100	1,403.00	4,349,300	
アイシン精機	4,700	2,994.00	14,071,800	
マツダ	17,900	879.70	15,746,630	
本田技研工業	47,400	2,460.00	116,604,000	
スズキ	10,400	3,932.00	40,892,800	
S U B A R U	17,700	2,720.00	48,144,000	
ヤマハ発動機	7,400	1,707.00	12,631,800	
豊田合成	1,800	1,940.00	3,492,000	
シマノ	2,100	15,130.00	31,773,000	
テイ・エス テック	1,300	2,759.00	3,586,700	
テルモ	16,100	3,311.00	53,307,100	
島津製作所	7,300	2,442.00	17,826,600	
オリンパス	34,000	1,267.00	43,078,000	
H O Y A	11,500	8,367.00	96,220,500	
朝日インテック	6,400	2,555.00	16,352,000	
バンダイナムコホールディングス	5,900	6,020.00	35,518,000	
パイロットコーポレーション	1,000	3,590.00	3,590,000	
アシックス	4,700	1,500.00	7,050,000	
ヤマハ	3,400	4,850.00	16,490,000	
ピジョン	3,400	3,685.00	12,529,000	
任天堂	3,300	39,900.00	131,670,000	
中部電力	17,400	1,515.00	26,361,000	
関西電力	23,300	1,268.00	29,544,400	
東北電力	13,300	1,031.00	13,712,300	
九州電力	11,700	1,024.00	11,980,800	

NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

電源開発	4,500	2,299.00	10,345,500
東京瓦斯	11,200	2,683.50	30,055,200
大阪瓦斯	11,000	1,945.00	21,395,000
東邦瓦斯	2,800	4,105.00	11,494,000
東武鉄道	6,000	3,205.00	19,230,000
相鉄ホールディングス	2,600	2,773.00	7,209,800
東京急行電鉄	15,500	1,868.00	28,954,000
小田急電鉄	9,100	2,467.00	22,449,700
京王電鉄	3,200	6,850.00	21,920,000
京成電鉄	4,300	4,050.00	17,415,000
東日本旅客鉄道	10,200	9,993.00	101,928,600
西日本旅客鉄道	5,100	8,800.00	44,880,000
東海旅客鉄道	5,100	20,965.00	106,921,500
西武ホールディングス	7,300	1,755.00	12,811,500
近鉄グループホールディングス	5,400	5,180.00	27,972,000
阪急阪神ホールディングス	7,200	3,935.00	28,332,000
京阪ホールディングス	3,200	4,405.00	14,096,000
名古屋鉄道	5,900	3,135.00	18,496,500
日本通運	2,100	5,360.00	11,256,000
ヤマトホールディングス	9,500	1,823.50	17,323,250
山九	1,500	5,430.00	8,145,000
日立物流	1,200	3,260.00	3,912,000
日本航空	9,900	3,285.00	32,521,500
ANAホールディングス	9,900	3,590.00	35,541,000
日鉄ソリューションズ	800	3,445.00	2,756,000
T I S	1,900	6,060.00	11,514,000
ネクソン	15,900	1,325.00	21,067,500
コロプラ	1,600	674.00	1,078,400
ティーガイア	500	2,067.00	1,033,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,300	2,349.00	3,053,700
野村総合研究所	10,700	1,954.00	20,907,800
オービック	1,900	11,440.00	21,736,000
ヤフー	36,500	272.00	9,928,000
トレンドマイクロ	2,500	5,080.00	12,700,000
日本オラクル	1,100	9,030.00	9,933,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,500	2,785.00	6,962,500
大塚商会	3,000	3,855.00	11,565,000

NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

日本ユニシス	1,700	3,255.00	5,533,500	
日本テレビホールディングス	5,100	1,377.00	7,022,700	
日本電信電話	31,200	4,929.00	153,784,800	代用有価証券で 3,000株 担保差入
KDDI	45,800	2,649.50	121,347,100	
光通信	700	25,230.00	17,661,000	
NTTドコモ	35,400	2,592.00	91,756,800	
GMOインターネット	2,200	1,761.00	3,874,200	
東宝	3,700	4,485.00	16,594,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	14,900	1,350.00	20,115,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,600	4,140.00	10,764,000	
カプコン	2,400	2,831.00	6,794,400	
SCSK	1,500	4,925.00	7,387,500	
コナミホールディングス	2,300	4,390.00	10,097,000	
ソフトバンクグループ	36,100	4,952.00	178,767,200	
双日	31,100	322.00	10,014,200	
アルフレッサ ホールディングス	6,200	2,420.00	15,004,000	
神戸物産	1,000	6,370.00	6,370,000	
シップヘルスケアホールディングス	1,200	4,860.00	5,832,000	
第一興商	1,100	4,615.00	5,076,500	
メディパルホールディングス	6,100	2,253.00	13,743,300	
伊藤忠商事	39,200	2,040.50	79,987,600	
丸紅	55,400	656.50	36,370,100	
豊田通商	6,300	3,140.00	19,782,000	
兼松	2,200	1,094.00	2,406,800	
三井物産	46,300	1,642.50	76,047,750	
日立ハイテクノロジーズ	1,700	5,540.00	9,418,000	
住友商事	33,200	1,533.50	50,912,200	
三菱商事	39,300	2,595.00	101,983,500	
阪和興業	1,000	2,680.00	2,680,000	
岩谷産業	1,200	3,535.00	4,242,000	
東邦ホールディングス	1,700	2,457.00	4,176,900	
PALTAC	1,000	5,330.00	5,330,000	
日鉄物産	400	4,120.00	1,648,000	
ミスミグループ本社	7,000	2,278.00	15,946,000	
ローソン	1,400	5,290.00	7,406,000	
エービーシー・マート	900	6,510.00	5,859,000	
アダストリア	800	2,037.00	1,629,600	

NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

セリア	1,500	2,410.00	3,615,000
ビックカメラ	3,000	1,046.00	3,138,000
MonotaRO	4,000	2,303.00	9,212,000
J. フロント リテイリング	7,200	1,185.00	8,532,000
マツモトキヨシホールディングス	2,300	3,525.00	8,107,500
ZOZO	6,100	1,984.00	12,102,400
ウエルシアホールディングス	1,500	5,280.00	7,920,000
クリエイトSDホールディングス	800	2,283.00	1,826,400
すかいらーくホールディングス	6,300	1,874.00	11,806,200
コスモス薬品	200	21,200.00	4,240,000
セブン&アイ・ホールディングス	23,500	3,665.00	86,127,500
ツルハホールディングス	1,200	10,910.00	13,092,000
クスリのアオキホールディングス	600	7,460.00	4,476,000
ノジマ	1,000	1,692.00	1,692,000
良品計画	800	18,270.00	14,616,000
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	3,400	6,400.00	21,760,000
ゼンショーホールディングス	2,600	2,384.00	6,198,400
ユナイテッドアローズ	600	2,956.00	1,773,600
スギホールディングス	1,200	5,320.00	6,384,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,400	2,172.00	13,900,800
日本瓦斯	900	2,982.00	2,683,800
しまむら	700	7,970.00	5,579,000
丸井グループ	4,700	1,950.00	9,165,000
イオン	21,600	1,884.00	40,694,400
イズミ	1,100	3,845.00	4,229,500
ヤオコー	600	4,720.00	2,832,000
ケーズホールディングス	5,800	1,030.00	5,974,000
アインホールディングス	800	5,480.00	4,384,000
ニトリホールディングス	2,400	14,895.00	35,748,000
ファーストリテイリング	700	62,440.00	43,708,000
サンドラッグ	2,100	3,010.00	6,321,000
めぶきフィナンシャルグループ	29,300	238.00	6,973,400
九州フィナンシャルグループ	12,300	388.00	4,772,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	35,900	351.00	12,600,900
新生銀行	4,100	1,420.00	5,822,000
あおぞら銀行	3,100	2,480.00	7,688,000

NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

三菱UF J フィナンシャル・グループ	256,000	499.00	127,744,000
りそなホールディングス	61,700	409.90	25,290,830
三井住友トラスト・ホールディングス	11,000	3,438.00	37,818,000
三井住友フィナンシャルグループ	35,600	3,467.00	123,425,200
千葉銀行	20,000	522.00	10,440,000
静岡銀行	14,100	690.00	9,729,000
広島銀行	8,300	477.00	3,959,100
セブン銀行	19,000	275.00	5,225,000
みずほフィナンシャルグループ	764,100	153.30	117,136,530
F P G	1,800	978.00	1,760,400
S B I ホールディングス	6,700	2,245.00	15,041,500
大和証券グループ本社	45,100	429.70	19,379,470
野村ホールディングス	98,300	365.00	35,879,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,700	275.00	1,842,500
松井証券	2,700	852.00	2,300,400
S O M P O ホールディングス	9,900	4,199.00	41,570,100
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	14,800	3,425.00	50,690,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	4,600	2,400.00	11,040,000
第一生命ホールディングス	31,900	1,369.00	43,671,100
東京海上ホールディングス	20,100	5,621.00	112,982,100
T & D ホールディングス	17,400	990.70	17,238,180
全国保証	1,600	3,960.00	6,336,000
芙蓉総合リース	600	6,280.00	3,768,000
東京センチュリー	1,100	4,105.00	4,515,500
イオンフィナンシャルサービス	3,600	1,594.00	5,738,400
オリエン트コーポレーション	15,200	118.00	1,793,600
日立キャピタル	1,300	2,091.00	2,718,300
オリックス	37,600	1,481.50	55,704,400
三菱UF J リース	12,700	566.00	7,188,200
日本取引所グループ	15,200	1,581.00	24,031,200
いちご	7,100	383.00	2,719,300
ヒューリック	11,700	947.00	11,079,900
野村不動産ホールディングス	3,700	2,061.00	7,625,700
プレサンスコーポレーション	900	1,508.00	1,357,200
オープンハウス	900	4,490.00	4,041,000
東急不動産ホールディングス	15,100	597.00	9,014,700
飯田グループホールディングス	4,700	1,548.00	7,275,600



## NZAM 上場投信 JPX 日経 400 (2526) 2019 年8月期 決算短信

パーク 2 4	3,000	2,416.00	7,248,000
三井不動産	29,900	2,272.00	67,932,800
三菱地所	39,300	1,961.50	77,086,950
東京建物	6,100	1,267.00	7,728,700
住友不動産	12,600	3,850.00	48,510,000
レオパレス 2 1	6,900	235.00	1,621,500
スターツコーポレーション	800	2,228.00	1,782,400
イオンモール	2,800	1,612.00	4,513,600
ミクシィ	1,500	2,250.00	3,375,000
日本M&Aセンター	4,100	2,918.00	11,963,800
パーソルホールディングス	5,400	2,199.00	11,874,600
総合警備保障	2,200	5,050.00	11,110,000
カカコム	4,100	2,431.00	9,967,100
ディップ	900	2,241.00	2,016,900
エムスリー	11,500	2,198.00	25,277,000
ディー・エヌ・エー	2,900	2,074.00	6,014,600
博報堂DYホールディングス	7,600	1,563.00	11,878,800
電通	5,600	3,695.00	20,692,000
オリエンタルランド	6,400	14,975.00	95,840,000
リゾートトラスト	2,300	1,575.00	3,622,500
ユー・エス・エス	6,600	1,901.00	12,546,600
サイバーエージェント	3,100	4,330.00	13,423,000
楽天	25,400	1,015.00	25,781,000
エン・ジャパン	800	3,840.00	3,072,000
テクノプロ・ホールディングス	1,100	5,990.00	6,589,000
リクルートホールディングス	39,100	3,522.00	137,710,200
リログループ	3,000	2,575.00	7,725,000
カナモト	900	2,635.00	2,371,500
セコム	5,800	8,751.00	50,755,800
メイテック	700	5,400.00	3,780,000
イオンディライト	700	3,230.00	2,261,000
合 計	4,826,500		9,435,343,740

## 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。