

## 2021年2月期 決算短信 (2020年8月16日～2021年2月15日)

2021年3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="https://www.ja-asset.co.jp/">https://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	2021年5月14日		
分配金支払開始予定日	2021年3月26日		

### I ファンドの運用状況

#### 1. 2021年2月期の運用状況 (2020年8月16日～2021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	%
2021年2月期	42,906	(96.4)	1,594	(3.6)	44,500	(100.0)
2020年8月期	24,778	(97.7)	578	(2.3)	25,356	(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
2021年2月期	1,724	880	105	2,498
2020年8月期	1,276	659	211	1,724

##### (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
2021年2月期	44,930	429	44,500	17,810
2020年8月期	25,620	264	25,356	14,706

##### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2021年2月期	106
2020年8月期	139

(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3期 2020年8月15日現在	第4期 2021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	780,016,327	1,722,196,258
株式	24,778,139,460	42,906,673,160
派生商品評価勘定	5,811,974	140,639,640
未収入金	761,640	22,552,560
未収配当金	27,998,524	52,963,075
差入委託証拠金	28,222,000	85,767,500
流動資産合計	25,620,949,925	44,930,792,193
資産合計	25,620,949,925	44,930,792,193
負債の部		
流動負債		
前受金	7,903,300	136,352,500
未払収益分配金	239,667,553	264,854,038
未払受託者報酬	2,921,735	4,884,707
未払委託者報酬	9,078,186	15,177,422
未払利息	1,458	714
その他未払費用	5,185,368	8,702,885
流動負債合計	264,757,600	429,972,266
負債合計	264,757,600	429,972,266
純資産の部		
元本等		
元本	24,220,216,669	35,098,157,281
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,135,975,656	9,402,662,646
(分配準備積立金)	492,062	1,603,498
元本等合計	25,356,192,325	44,500,819,927
純資産合計	25,356,192,325	44,500,819,927
負債純資産合計	25,620,949,925	44,930,792,193

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第3期	第4期
	自 2020年2月16日 至 2020年8月15日	自 2020年8月16日 至 2021年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	256,744,619	294,851,845
受取利息	5,745	19,796
有価証券売買等損益	△208,999,265	6,326,788,808
派生商品取引等損益	38,045,439	233,993,814
その他収益	87,193	52,380
営業収益合計	85,883,731	6,855,706,643
営業費用		
支払利息	126,327	174,848
受託者報酬	2,921,735	4,884,707
委託者報酬	9,078,186	15,177,422
その他費用	5,190,706	8,721,570
営業費用合計	17,316,954	28,958,547
営業利益又は営業損失 (△)	68,566,777	6,826,748,096
経常利益又は経常損失 (△)	68,566,777	6,826,748,096
当期純利益又は当期純損失 (△)	68,566,777	6,826,748,096
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 (△)	1,583,293,292	1,135,975,656
剰余金増加額又は欠損金減少額	212,424,912	1,895,475,066
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	212,424,912	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,895,475,066
剰余金減少額又は欠損金増加額	488,641,772	190,682,134
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	190,682,134
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	488,641,772	-
分配金	239,667,553	264,854,038
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,135,975,656	9,402,662,646

(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。

(貸借対照表に関する注記)

項目		第3期 2020年8月15日現在	第4期 2021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	17,929,028,920円	24,220,216,669円
	期中追加設定元本額	9,268,955,091円	12,363,663,708円
	期中一部交換元本額	2,977,767,342円	1,485,723,096円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	1,724,227口	2,498,623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	14,362,000円	16,912,000円
	合計	14,362,000円	16,912,000円
4.	1口当たり純資産額	14,706円	17,810円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期		第4期	
	自 2020年 2月 16日 至 2020年 8月 15日		自 2020年 8月 16日 至 2021年 2月 15日	
分配金の計算過程	A. 配当等収益額	256,711,230 円	A. 配当等収益額	294,749,173 円
	B. 分配準備積立金額	639,012 円	B. 分配準備積立金額	492,062 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	257,350,242 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	295,241,235 円
	D. 経費	17,190,627 円	D. 経費	28,783,699 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	240,159,615 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	266,457,536 円
	F. 収益分配金	239,667,553 円	F. 収益分配金	264,854,038 円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	492,062 円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,603,498 円
	H. 口数	1,724,227 口	H. 口数	2,498,623 口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	139 円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	106 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3期 自 2020年 2月 16日 至 2020年 8月 15日	第4期 自 2020年 8月 16日 至 2021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3期 2020年8月15日現在	第4期 2021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3期(自 2020年2月16日 至 2020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	212,183,690
合計	212,183,690

第4期(自 2020年8月16日 至 2021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	5,964,233,386
合計	5,964,233,386

(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3期 (2020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	553,742,600	—	559,563,000	5,820,400
合計		553,742,600	—	559,563,000	5,820,400

第4期 (2021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	1,416,501,000	—	1,557,160,000	140,659,000
合計		1,416,501,000	—	1,557,160,000	140,659,000

(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	27,700	510.00	14,127,000	
マルハニチロ	4,300	2,488.00	10,698,400	
国際石油開発帝石	103,000	769.00	79,207,000	
安藤・間	18,000	776.00	13,968,000	
東急建設	8,600	557.00	4,790,200	
コムスホールディングス	10,000	3,415.00	34,150,000	
東建コーポレーション	600	8,780.00	5,268,000	
大成建設	20,200	3,875.00	78,275,000	
大林組	64,600	943.00	60,917,800	
清水建設	60,900	822.00	50,059,800	
長谷工コーポレーション	21,300	1,383.00	29,457,900	
鹿島建設	47,700	1,498.00	71,454,600	
西松建設	4,600	2,670.00	12,282,000	
三井住友建設	15,900	493.00	7,838,700	
前田建設工業	15,800	940.00	14,852,000	
戸田建設	26,800	780.00	20,904,000	
熊谷組	2,800	2,874.00	8,047,200	
大東建託	7,100	11,800.00	83,780,000	
NIPPO	5,100	2,811.00	14,336,100	
五洋建設	27,600	836.00	23,073,600	
住友林業	15,300	2,297.00	35,144,100	
大和ハウス工業	60,100	3,337.00	200,553,700	
積水ハウス	70,500	2,140.00	150,870,000	
協和エクシオ	9,600	2,844.00	27,302,400	
九電工	4,500	3,515.00	15,817,500	
森永製菓	4,600	4,270.00	19,642,000	
寿スピリッツ	2,000	6,700.00	13,400,000	
カルビー	9,200	3,045.00	28,014,000	
森永乳業	4,000	5,020.00	20,080,000	
ヤクルト本社	14,400	5,260.00	75,744,000	
明治ホールディングス	13,700	7,140.00	97,818,000	
日本ハム	8,200	4,695.00	38,499,000	

アサヒグループホールディングス	45,500	4,584.00	208,572,000
キリンホールディングス	88,200	2,211.00	195,010,200
サントリー食品インターナショナル	13,600	3,845.00	52,292,000
伊藤園	6,400	6,680.00	42,752,000
キッコーマン	15,000	7,360.00	110,400,000
味の素	49,500	2,265.00	112,117,500
キューピー	11,200	2,441.00	27,339,200
カゴメ	8,500	3,430.00	29,155,000
アリアケジャパン	2,000	6,960.00	13,920,000
ニチレイ	9,400	2,881.00	27,081,400
東洋水産	10,700	4,650.00	49,755,000
日清食品ホールディングス	8,200	8,580.00	70,356,000
日本たばこ産業	111,600	1,951.00	217,731,600
帝人	19,100	1,892.00	36,137,200
東レ	147,000	694.70	102,120,900
ゴールドウイン	3,400	7,580.00	25,772,000
王子ホールディングス	91,400	697.00	63,705,800
クラレ	31,500	1,234.00	38,871,000
旭化成	134,200	1,183.50	158,825,700
昭和電工	15,400	2,695.00	41,503,000
住友化学	159,800	516.00	82,456,800
日産化学	11,100	6,070.00	67,377,000
東ソー	31,000	1,929.00	59,799,000
トクヤマ	6,100	2,677.00	16,329,700
デンカ	7,000	4,285.00	29,995,000
信越化学工業	37,500	18,740.00	702,750,000
エア・ウォーター	20,700	1,795.00	37,156,500
日本酸素ホールディングス	16,800	2,034.00	34,171,200
三菱瓦斯化学	20,300	2,567.00	52,110,100
三井化学	17,500	3,340.00	58,450,000
J S R	20,300	3,295.00	66,888,500
三菱ケミカルホールディングス	135,700	741.80	100,662,260
KHネオケム	3,300	2,580.00	8,514,000
ダイセル	27,200	859.00	23,364,800
積水化学工業	43,000	2,041.00	87,763,000
アイカ工業	5,700	3,905.00	22,258,500
宇部興産	10,500	2,086.00	21,903,000
日油	7,400	5,640.00	41,736,000

花王	49,700	7,450.00	370,265,000
日本ペイントホールディングス	16,800	9,120.00	153,216,000
関西ペイント	22,800	3,095.00	70,566,000
D I C	8,800	2,756.00	24,252,800
資生堂	41,200	8,180.00	337,016,000
ライオン	26,700	2,244.00	59,914,800
ファンケル	7,500	4,060.00	30,450,000
コーセー	4,000	18,340.00	73,360,000
ポーラ・オルビスホールディングス	8,800	2,529.00	22,255,200
小林製薬	6,000	11,160.00	66,960,000
日東電工	13,300	10,020.00	133,266,000
ニフコ	7,300	4,135.00	30,185,500
ユニ・チャーム	43,900	4,742.00	208,173,800
協和キリン	20,900	3,240.00	67,716,000
武田薬品工業	145,700	3,715.00	541,275,500
アステラス製薬	179,700	1,784.50	320,674,650
大日本住友製薬	15,500	1,751.00	27,140,500
塩野義製薬	26,100	6,070.00	158,427,000
日本新薬	5,900	7,790.00	45,961,000
中外製薬	64,900	5,148.00	334,105,200
科研製薬	3,800	4,110.00	15,618,000
エーザイ	22,900	7,786.00	178,299,400
ロート製薬	9,800	3,135.00	30,723,000
小野薬品工業	47,600	3,146.00	149,749,600
久光製薬	6,100	7,020.00	42,822,000
参天製薬	36,000	1,603.00	57,708,000
沢井製薬	4,500	4,810.00	21,645,000
第一三共	168,900	3,368.00	568,855,200
大塚ホールディングス	43,100	4,530.00	195,243,000
出光興産	22,700	2,741.00	62,220,700
E N E O Sホールディングス	311,900	454.10	141,633,790
コスモエネルギーホールディングス	6,500	2,576.00	16,744,000
横浜ゴム	11,400	1,822.00	20,770,800
TOYO TIRE	10,900	1,792.00	19,532,800
ブリヂストン	55,100	4,396.00	242,219,600
住友ゴム工業	18,000	1,149.00	20,682,000
A G C	19,100	3,705.00	70,765,500
太平洋セメント	12,300	2,563.00	31,524,900

東海カーボン	20,100	1,539.00	30,933,900
TOTO	14,800	7,230.00	107,004,000
日本碍子	22,800	1,927.00	43,935,600
日本特殊陶業	15,700	1,924.00	30,206,800
ニチアス	5,900	2,538.00	14,974,200
日本製鉄	97,900	1,500.00	146,850,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	59,300	1,089.00	64,577,700
住友金属鉱山	26,200	5,031.00	131,812,200
古河電気工業	6,500	2,925.00	19,012,500
住友電気工業	71,600	1,601.50	114,667,400
アサヒホールディングス	3,800	4,280.00	16,264,000
SUMCO	26,300	2,485.00	65,355,500
三和ホールディングス	19,400	1,355.00	26,287,000
リンナイ	4,100	11,950.00	48,995,000
日本製鋼所	6,300	3,280.00	20,664,000
三浦工業	8,800	6,190.00	54,472,000
アマダ	30,100	1,310.00	39,431,000
FUJ I	8,200	2,756.00	22,599,200
オーエスジー	10,300	1,998.00	20,579,400
DMG森精機	13,300	1,617.00	21,506,100
ディスコ	2,800	35,550.00	99,540,000
ナブテスコ	12,100	5,020.00	60,742,000
SMC	6,100	67,480.00	411,628,000
小松製作所	93,900	3,262.00	306,301,800
住友重機械工業	11,400	2,934.00	33,447,600
日立建機	9,600	3,230.00	31,008,000
クボタ	108,900	2,584.00	281,397,600
ダイキン工業	26,400	23,405.00	617,892,000
ダイフク	11,400	11,230.00	128,022,000
竹内製作所	4,000	2,743.00	10,972,000
ホシザキ	6,500	10,670.00	69,355,000
日本精工	42,500	1,044.00	44,370,000
THK	13,000	3,850.00	50,050,000
マキタ	27,000	4,820.00	130,140,000
三菱重工業	32,600	3,043.00	99,201,800
I H I	13,900	1,946.00	27,049,400
ブラザー工業	25,400	2,358.00	59,893,200
ミネベアミツミ	35,700	2,726.00	97,318,200

日立製作所	99,700	4,846.00	483,146,200
三菱電機	207,300	1,710.00	354,483,000
富士電機	12,700	4,545.00	57,721,500
安川電機	22,200	5,930.00	131,646,000
東芝テック	2,200	3,990.00	8,778,000
日本電産	49,900	14,990.00	748,001,000
オムロン	17,300	9,750.00	168,675,000
MC J	6,100	992.00	6,051,200
日本電気	26,300	6,290.00	165,427,000
富士通	18,700	16,075.00	300,602,500
ルネサスエレクトロニクス	89,200	1,290.00	115,068,000
セイコーエプソン	25,500	1,830.00	46,665,000
アルバック	4,000	5,260.00	21,040,000
エレコム	2,300	4,915.00	11,304,500
パナソニック	221,100	1,498.00	331,207,800
シャープ	23,900	2,346.00	56,069,400
アンリツ	12,500	2,491.00	31,137,500
ソニー	67,900	11,970.00	812,763,000
TDK	10,100	16,770.00	169,377,000
アルプスアルパイン	17,000	1,511.00	25,687,000
横河電機	20,700	2,206.00	45,664,200
アズビル	14,000	5,000.00	70,000,000
日本光電工業	8,600	3,120.00	26,832,000
堀場製作所	4,200	7,240.00	30,408,000
アドバンテスト	15,400	9,300.00	143,220,000
キーエンス	12,100	59,080.00	714,868,000
シスメックス	16,100	12,000.00	193,200,000
OBARA GROUP	1,500	4,020.00	6,030,000
レーザーテック	9,100	14,570.00	132,587,000
スタンレー電気	14,700	3,635.00	53,434,500
カシオ計算機	16,700	1,996.00	33,333,200
ファナック	18,200	29,000.00	527,800,000
浜松ホトニクス	15,000	7,000.00	105,000,000
京セラ	31,500	7,077.00	222,925,500
太陽誘電	9,200	5,630.00	51,796,000
村田製作所	60,900	9,938.00	605,224,200
小糸製作所	12,400	8,020.00	99,448,000
SCREENホールディングス	3,800	8,760.00	33,288,000

キヤノン	103,000	2,364.50	243,543,500	
東京エレクトロン	12,200	43,560.00	531,432,000	
トヨタ紡織	6,200	1,835.00	11,377,000	
豊田自動織機	16,900	9,840.00	166,296,000	
デンソー	45,700	6,934.00	316,883,800	
いすゞ自動車	59,600	1,166.00	69,493,600	
トヨタ自動車	71,400	8,456.00	603,758,400	代用有価証券で 2,000株 担保差入
日野自動車	25,700	1,030.00	26,471,000	
アイシン精機	15,200	3,675.00	55,860,000	
マツダ	65,100	874.00	56,897,400	
本田技研工業	163,200	3,052.00	498,086,400	
スズキ	41,100	4,960.00	203,856,000	
SUBARU	59,400	2,126.00	126,284,400	
ヤマハ発動機	28,900	2,450.00	70,805,000	
豊田合成	6,600	3,015.00	19,899,000	
シマノ	7,800	26,365.00	205,647,000	
テイ・エス テック	4,500	3,240.00	14,580,000	
テルモ	63,500	4,564.00	289,814,000	
島津製作所	26,700	4,375.00	116,812,500	
ブイ・テクノロジー	800	6,280.00	5,024,000	
東京精密	3,500	4,920.00	17,220,000	
ニコン	31,200	905.00	28,236,000	
オリンパス	114,800	2,314.00	265,647,200	
HOYA	41,100	13,190.00	542,109,000	
朝日インテック	21,800	3,255.00	70,959,000	
バンダイナムコホールディングス	17,200	9,057.00	155,780,400	
パイロットコーポレーション	3,900	3,175.00	12,382,500	
ヤマハ	12,500	6,060.00	75,750,000	
ピジョン	13,200	4,390.00	57,948,000	
任天堂	8,500	66,600.00	566,100,000	
中部電力	62,900	1,328.50	83,562,650	
関西電力	78,000	1,075.50	83,889,000	
中国電力	29,800	1,300.00	38,740,000	
東北電力	48,500	935.00	45,347,500	
九州電力	45,800	942.00	43,143,600	
北海道電力	19,200	472.00	9,062,400	
電源開発	15,800	1,717.00	27,128,600	
東京瓦斯	39,800	2,289.00	91,102,200	

大阪瓦斯	37,500	2,005.00	75,187,500
東武鉄道	21,800	3,210.00	69,978,000
相鉄ホールディングス	9,400	2,586.00	24,308,400
東急	52,100	1,466.00	76,378,600
小田急電鉄	33,200	3,455.00	114,706,000
京王電鉄	11,600	8,720.00	101,152,000
京成電鉄	15,500	3,950.00	61,225,000
東日本旅客鉄道	36,500	7,789.00	284,298,500
西日本旅客鉄道	18,400	6,428.00	118,275,200
東海旅客鉄道	17,300	17,380.00	300,674,000
西武ホールディングス	24,900	1,249.00	31,100,100
近鉄グループホールディングス	19,600	4,650.00	91,140,000
阪急阪神ホールディングス	26,200	3,695.00	96,809,000
南海電気鉄道	12,600	2,726.00	34,347,600
京阪ホールディングス	11,600	5,130.00	59,508,000
名古屋鉄道	21,400	2,877.00	61,567,800
日本通運	6,700	7,700.00	51,590,000
ヤマトホールディングス	27,600	2,885.00	79,626,000
山九	5,200	4,390.00	22,828,000
日立物流	4,300	3,325.00	14,297,500
九州旅客鉄道	15,200	2,632.00	40,006,400
日本航空	47,800	2,221.00	106,163,800
ANAホールディングス	53,000	2,356.50	124,894,500
システナ	7,000	1,944.00	13,608,000
日鉄ソリューションズ	2,900	3,445.00	9,990,500
T I S	20,100	2,418.00	48,601,800
コーエーテクモホールディングス	4,200	6,540.00	27,468,000
ネクソン	51,400	3,455.00	177,587,000
ティーガイア	2,100	1,905.00	4,000,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,681.00	12,064,500
GMOペイメントゲートウェイ	4,300	16,250.00	69,875,000
アカツキ	500	4,305.00	2,152,500
野村総合研究所	37,100	3,625.00	134,487,500
インフォコム	1,900	3,085.00	5,861,500
オービック	6,400	19,750.00	126,400,000
ジャストシステム	3,000	7,650.00	22,950,000
Zホールディングス	279,400	666.70	186,275,980
トレンドマイクロ	10,900	6,090.00	66,381,000

日本オラクル	4,200	12,690.00	53,298,000
伊藤忠テクノソリューションズ	9,100	3,575.00	32,532,500
大塚商会	11,000	5,420.00	59,620,000
東映アニメーション	600	11,130.00	6,678,000
デジタルガレージ	3,900	4,140.00	16,146,000
日本ユニシス	7,000	3,500.00	24,500,000
日本電信電話	221,900	2,850.00	632,415,000
KDDI	163,200	3,365.00	549,168,000
光通信	2,400	22,340.00	53,616,000
東宝	11,500	4,375.00	50,312,500
エヌ・ティ・ティ・データ	54,200	1,677.00	90,893,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,700	7,150.00	62,205,000
カプコン	8,700	6,850.00	59,595,000
S C S K	4,500	6,720.00	30,240,000
コナミホールディングス	7,100	7,310.00	51,901,000
ソフトバンクグループ	84,300	10,005.00	843,421,500
双日	112,000	264.00	29,568,000
アルフレッサ ホールディングス	21,200	2,232.00	47,318,400
神戸物産	13,600	2,943.00	40,024,800
ダイワボウホールディングス	1,900	8,390.00	15,941,000
TOKAIホールディングス	10,900	981.00	10,692,900
シップヘルスケアホールディングス	3,600	6,290.00	22,644,000
コメダホールディングス	4,500	1,971.00	8,869,500
第一興商	4,300	3,980.00	17,114,000
メディカルホールディングス	20,400	2,229.00	45,471,600
日本ライフライン	6,500	1,400.00	9,100,000
伊藤忠商事	142,900	3,140.00	448,706,000
丸紅	201,300	741.10	149,183,430
豊田通商	20,500	4,715.00	96,657,500
兼松	7,500	1,443.00	10,822,500
三井物産	165,800	2,057.50	341,133,500
住友商事	128,900	1,501.00	193,478,900
三菱商事	124,300	2,888.00	358,978,400
岩谷産業	5,000	6,290.00	31,450,000
PALTAC	3,000	5,600.00	16,800,000
日鉄物産	1,700	3,880.00	6,596,000
ミスミグループ本社	25,700	3,555.00	91,363,500
ローソン	4,900	5,300.00	25,970,000



エービーシー・マート	3,000	6,210.00	18,630,000
日本マクドナルドホールディングス	8,600	5,170.00	44,462,000
セリア	4,700	3,655.00	17,178,500
ビックカメラ	11,500	1,202.00	13,823,000
MonotaRO	14,700	6,410.00	94,227,000
J. フロント リテイリング	24,900	1,006.00	25,049,400
マツモトキヨシホールディングス	8,500	4,615.00	39,227,500
ZOZO	12,000	3,480.00	41,760,000
ウエルシアホールディングス	10,800	3,635.00	39,258,000
クリエイトSDホールディングス	3,000	3,435.00	10,305,000
すかいらーくホールディングス	22,400	1,618.00	36,243,200
コスモス薬品	2,100	16,170.00	33,957,000
セブン&アイ・ホールディングス	79,900	4,225.00	337,577,500
ツルハホールディングス	4,400	14,700.00	64,680,000
クスリのアオキホールディングス	2,000	8,800.00	17,600,000
スシローグローバルホールディングス	11,100	4,420.00	49,062,000
ノジマ	3,900	2,799.00	10,916,100
良品計画	26,800	2,553.00	68,420,400
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	40,800	2,685.00	109,548,000
ゼンショーホールディングス	11,000	2,914.00	32,054,000
ワークマン	2,100	8,500.00	17,850,000
スギホールディングス	4,200	7,350.00	30,870,000
丸井グループ	17,300	1,931.00	33,406,300
イオン	78,600	3,580.00	281,388,000
イズミ	4,300	4,045.00	17,393,500
ヤオコー	2,200	6,860.00	15,092,000
ケーズホールディングス	18,200	1,517.00	27,609,400
アインホールディングス	2,900	7,400.00	21,460,000
ニトリホールディングス	8,100	20,900.00	169,290,000
ファーストリテイリング	2,700	99,460.00	268,542,000
サンドラッグ	7,400	4,145.00	30,673,000
めぶきフィナンシャルグループ	105,400	225.00	23,715,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	124,600	404.00	50,338,400
新生銀行	16,700	1,408.00	23,513,600
あおぞら銀行	12,000	2,265.00	27,180,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,310,500	541.50	709,635,750
りそなホールディングス	221,300	431.40	95,468,820

三井住友トラスト・ホールディングス	38,700	3,536.00	136,843,200
三井住友フィナンシャルグループ	141,500	3,688.00	521,852,000
千葉銀行	68,500	649.00	44,456,500
ふくおかフィナンシャルグループ	18,400	2,043.00	37,591,200
セブン銀行	67,700	246.00	16,654,200
みずほフィナンシャルグループ	277,800	1,552.50	431,284,500
F P G	6,700	600.00	4,020,000
S B I ホールディングス	25,000	3,215.00	80,375,000
大和証券グループ本社	153,100	539.00	82,520,900
野村ホールディングス	312,200	647.90	202,274,380
S O M P O ホールディングス	36,100	4,285.00	154,688,500
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	49,700	3,199.00	158,990,300
第一生命ホールディングス	108,100	1,875.50	202,741,550
東京海上ホールディングス	67,800	5,560.00	376,968,000
T & D ホールディングス	61,000	1,443.00	88,023,000
全国保証	5,300	5,060.00	26,818,000
芙蓉総合リース	2,200	7,440.00	16,368,000
東京センチュリー	4,700	7,930.00	37,271,000
イオンフィナンシャルサービス	13,200	1,398.00	18,453,600
アコム	40,900	471.00	19,263,900
オリエントコーポレーション	55,300	140.00	7,742,000
オリックス	126,800	1,746.50	221,456,200
三菱UFJリース	46,100	588.00	27,106,800
日本取引所グループ	55,200	2,418.00	133,473,600
いちご	25,900	332.00	8,598,800
ヒューリック	42,700	1,210.00	51,667,000
野村不動産ホールディングス	12,700	2,499.00	31,737,300
オープンハウス	6,500	4,250.00	27,625,000
東急不動産ホールディングス	54,800	692.00	37,921,600
飯田グループホールディングス	17,300	2,419.00	41,848,700
パーク24	11,000	2,337.00	25,707,000
三井不動産	93,200	2,434.50	226,895,400
三菱地所	134,400	1,885.50	253,411,200
東京建物	20,000	1,630.00	32,600,000
住友不動産	45,800	3,636.00	166,528,800
スターツコーポレーション	2,400	2,902.00	6,964,800
イオンモール	10,500	1,919.00	20,149,500
日本空港ビルデング	6,600	5,270.00	34,782,000

ミクシィ	4,700	2,620.00	12,314,000	
日本M&Aセンター	16,200	6,210.00	100,602,000	
UTグループ	2,900	3,385.00	9,816,500	
エス・エム・エス	6,700	3,855.00	25,828,500	
パーソルホールディングス	19,900	2,278.00	45,332,200	
総合警備保障	8,100	5,170.00	41,877,000	
カカクコム	14,800	3,600.00	53,280,000	
ディップ	3,100	3,100.00	9,610,000	
ベネフィット・ワン	6,800	3,035.00	20,638,000	
エムスリー	34,900	9,003.00	314,204,700	
アウトソーシング	11,200	1,570.00	17,584,000	
博報堂DYホールディングス	27,000	1,788.00	48,276,000	
電通グループ	22,100	3,800.00	83,980,000	
オリエンタルランド	21,100	17,765.00	374,841,500	
ユー・エス・エス	22,200	2,069.00	45,931,800	
楽天	92,300	1,110.00	102,453,000	
エン・ジャパン	3,800	3,440.00	13,072,000	
テクノプロ・ホールディングス	4,100	8,320.00	34,112,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	15,020.00	9,012,000	
リクルートホールディングス	131,100	5,142.00	674,116,200	
ベイカレント・コンサルティング	1,500	20,210.00	30,315,000	
リログループ	11,000	2,529.00	27,819,000	
エイチ・アイ・エス	2,700	2,084.00	5,626,800	
カナモト	3,600	2,412.00	8,683,200	
セコム	19,500	10,080.00	196,560,000	
メイテック	2,300	5,570.00	12,811,000	
合 計	14,845,500		42,906,673,160	

## 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。