

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 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	44,570	(97.9)	978	(2.1)	45,549	(100.0)
2021年8月期	44,741	(96.2)	1,770	(3.8)	46,511	(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	2,618	110	106	2,621
2021年8月期	2,498	329	210	2,618

(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	46,107	558	45,549	17,375
2021年8月期	47,003	492	46,511	17,765

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2022年2月期	171
2021年8月期	171

(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	2,109,274,520	1,356,745,041
株式	44,741,334,280	44,570,880,970
派生商品評価勘定	1,742,152	412,170
未収配当金	60,538,491	72,019,430
前払金	5,751,200	49,550,800
差入委託証拠金	85,214,000	57,915,000
流動資産合計	47,003,854,643	46,107,523,411
資産合計	47,003,854,643	46,107,523,411
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,165,000	43,967,070
未払金	661,440	21,260,440
未払収益分配金	447,712,542	448,288,470
未払受託者報酬	7,111,027	7,497,614
未払委託者報酬	22,094,916	23,296,105
未払利息	3,943	281
その他未払費用	13,266,198	13,831,000
流動負債合計	492,015,066	558,140,980
負債合計	492,015,066	558,140,980
純資産の部		
元本等		
元本	36,777,883,494	36,825,193,790
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	9,733,956,083	8,724,188,641
(分配準備積立金)	2,169,572	1,393,067
元本等合計	46,511,839,577	45,549,382,431
純資産合計	46,511,839,577	45,549,382,431
負債純資産合計	47,003,854,643	46,107,523,411

(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	490,963,694	492,397,271
受取利息	2,760	32,619
有価証券売買等損益	4,190,926	△1,049,171,250
派生商品取引等損益	10,001,160	△28,359,752
その他収益	130,782	4,353
営業収益合計	505,289,322	△585,096,759
営業費用		
支払利息	346,479	297,559
受託者報酬	7,111,027	7,497,614
委託者報酬	22,094,916	23,296,105
その他費用	13,266,198	13,831,000
営業費用合計	42,818,620	44,922,278
営業利益又は営業損失 (△)	462,470,702	△630,019,037
経常利益又は経常損失 (△)	462,470,702	△630,019,037
当期純利益又は当期純損失 (△)	462,470,702	△630,019,037
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 (△)	9,402,662,646	9,733,956,083
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,116,827,519	516,261,425
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	1,116,827,519	516,261,425
剰余金減少額又は欠損金増加額	800,292,242	447,721,360
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	800,292,242	447,721,360
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	447,712,542	448,288,470
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	9,733,956,083	8,724,188,641

(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)
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	35,098,157,281円	36,777,883,494円
	期中追加設定元本額	4,635,271,201円	1,546,546,606円
	期中一部交換元本額	2,955,544,988円	1,499,236,310円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,618,202口	2,621,570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	19,930,000円	-円
	合計	19,930,000円	-円
4.	1口当たり純資産額	17,765円	17,375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	490,750,757円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,603,498円	B. 分配準備積立金額	2,169,572円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	492,354,255円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	494,306,256円
	D. 経費	42,472,141円	D. 経費	44,624,719円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	449,882,114円	E. 収益分配可能額 (C-D)	449,681,537円
	F. 収益分配金	447,712,542円	F. 収益分配金	448,288,470円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	2,169,572円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	1,393,067円
	H. 口数	2,618,202口	H. 口数	2,621,570口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	171円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	171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	56,445,048
合計	56,445,048

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	△1,107,382,030
合計	△1,107,382,030

(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	1,734,685,200	—	1,735,284,000	598,800
合計		1,734,685,200	—	1,735,284,000	598,800

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	990,092,800	—	946,550,000	△43,542,800
合計		990,092,800	—	946,550,000	△43,542,800

(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	32,000	558.00	17,856,000	
I N P E X	128,300	1,178.00	151,137,400	
ミライト・ホールディングス	10,300	1,951.00	20,095,300	
安藤・間	17,600	910.00	16,016,000	
東急建設	9,400	711.00	6,683,400	
コムシスホールディングス	10,300	2,758.00	28,407,400	
東建コーポレーション	1,000	9,260.00	9,260,000	
大成建設	21,300	3,795.00	80,833,500	
大林組	73,800	975.00	71,955,000	
清水建設	69,200	788.00	54,529,600	
長谷工コーポレーション	22,000	1,513.00	33,286,000	
鹿島建設	54,100	1,534.00	82,989,400	
西松建設	4,500	3,790.00	17,055,000	
三井住友建設	16,700	438.00	7,314,600	
戸田建設	30,600	770.00	23,562,000	
熊谷組	3,700	2,967.00	10,977,900	
大東建託	7,600	12,910.00	98,116,000	
N I P P O	1,700	3,990.00	6,783,000	
五洋建設	29,300	636.00	18,634,800	
住友林業	18,900	2,281.00	43,110,900	
大和ハウス工業	68,100	3,391.00	230,927,100	
積水ハウス	80,000	2,393.50	191,480,000	
関電工	12,000	871.00	10,452,000	
エクシオグループ	11,200	2,409.00	26,980,800	
九電工	5,700	3,145.00	17,926,500	
インフロニア・ホールディングス	31,000	1,057.00	32,767,000	
森永製菓	5,600	3,700.00	20,720,000	
カルビー	10,700	2,555.00	27,338,500	
森永乳業	4,400	5,700.00	25,080,000	
ヤクルト本社	17,500	6,170.00	107,975,000	
明治ホールディングス	15,600	6,860.00	107,016,000	
プリマハム	3,300	2,405.00	7,936,500	

日本ハム	9,000	4,375.00	39,375,000
アサヒグループホールディングス	55,600	4,873.00	270,938,800
キリンホールディングス	86,900	1,978.00	171,888,200
サントリー食品インターナショナル	15,800	4,440.00	70,152,000
伊藤園	7,200	6,710.00	48,312,000
キッコーマン	17,000	8,800.00	149,600,000
味の素	52,200	3,263.00	170,328,600
キューピー	12,400	2,473.00	30,665,200
カゴメ	8,900	3,020.00	26,878,000
アリアケジャパン	2,100	5,700.00	11,970,000
ニチレイ	11,200	2,653.00	29,713,600
東洋水産	11,300	4,960.00	56,048,000
日清食品ホールディングス	9,300	9,040.00	84,072,000
日本たばこ産業	126,700	2,312.00	292,930,400
帝人	21,700	1,410.00	30,597,000
東レ	167,000	673.80	112,524,600
ゴールドウイン	4,100	6,350.00	26,035,000
王子ホールディングス	96,400	612.00	58,996,800
大王製紙	11,100	1,834.00	20,357,400
レンゴー	21,800	872.00	19,009,600
クラレ	33,700	1,100.00	37,070,000
旭化成	152,900	1,122.00	171,553,800
昭和電工	20,000	2,270.00	45,400,000
住友化学	169,400	562.00	95,202,800
日産化学	12,600	6,470.00	81,522,000
東ソー	33,300	1,845.00	61,438,500
トクヤマ	7,400	1,914.00	14,163,600
デンカ	8,400	3,685.00	30,954,000
信越化学工業	34,100	18,000.00	613,800,000
エア・ウォーター	21,900	1,701.00	37,251,900
日本酸素ホールディングス	22,200	2,249.00	49,927,800
三菱瓦斯化学	21,500	2,074.00	44,591,000
三井化学	20,900	2,952.00	61,696,800
三菱ケミカルホールディングス	154,100	815.30	125,637,730
ダイセル	33,200	884.00	29,348,800
積水化学工業	48,300	1,999.00	96,551,700
日本ゼオン	20,800	1,371.00	28,516,800
アイカ工業	6,400	3,245.00	20,768,000

宇部興産	10,800	2,155.00	23,274,000
日油	7,900	5,170.00	40,843,000
花王	52,100	5,157.00	268,679,700
日本ペイントホールディングス	86,700	961.00	83,318,700
関西ペイント	23,900	2,352.00	56,212,800
D I C	9,700	2,719.00	26,374,300
富士フイルムホールディングス	41,400	7,542.00	312,238,800
資生堂	43,900	6,431.00	282,320,900
ライオン	28,400	1,498.00	42,543,200
ファンケル	9,500	3,185.00	30,257,500
コーセー	4,400	12,560.00	55,264,000
ポーラ・オルビスホールディングス	10,100	1,748.00	17,654,800
小林製薬	6,600	9,620.00	63,492,000
日東電工	14,200	8,520.00	120,984,000
エフピコ	4,300	3,365.00	14,469,500
ニフコ	7,900	3,525.00	27,847,500
ユニ・チャーム	45,400	4,281.00	194,357,400
協和キリン	27,600	2,937.00	81,061,200
武田薬品工業	173,300	3,485.00	603,950,500
アステラス製薬	204,100	1,971.50	402,383,150
大日本住友製薬	14,600	1,244.00	18,162,400
塩野義製薬	29,700	7,603.00	225,809,100
日本新薬	6,100	7,770.00	47,397,000
中外製薬	73,600	3,961.00	291,529,600
科研製薬	3,600	4,240.00	15,264,000
エーザイ	28,200	5,855.00	165,111,000
ロート製薬	12,100	3,555.00	43,015,500
小野薬品工業	54,000	2,860.00	154,440,000
参天製薬	43,900	1,304.00	57,245,600
J C R ファーマ	6,600	2,109.00	13,919,400
東和薬品	3,400	3,060.00	10,404,000
第一三共	185,000	2,380.00	440,300,000
大塚ホールディングス	48,900	3,998.00	195,502,200
ペプチドリーム	12,400	2,128.00	26,387,200
サワイグループホールディングス	5,200	4,545.00	23,634,000
出光興産	26,100	3,135.00	81,823,500
E N E O S ホールディングス	354,200	464.40	164,490,480
コスモエネルギーホールディングス	6,800	2,492.00	16,945,600

横浜ゴム	13,600	1,670.00	22,712,000
TOYO TIRE	12,400	1,551.00	19,232,400
ブリヂストン	67,800	4,901.00	332,287,800
住友ゴム工業	21,100	1,151.00	24,286,100
AGC	21,600	5,530.00	119,448,000
太平洋セメント	13,300	2,333.00	31,028,900
東海カーボン	19,800	1,176.00	23,284,800
TOTO	16,800	4,950.00	83,160,000
日本碍子	25,500	1,847.00	47,098,500
日本特殊陶業	17,900	2,144.00	38,377,600
ニチアス	5,500	2,624.00	14,432,000
三井金属鉱業	6,200	3,330.00	20,646,000
住友金属鉱山	29,800	5,569.00	165,956,200
住友電気工業	87,000	1,580.00	137,460,000
アサヒホールディングス	9,300	2,223.00	20,673,900
SUMCO	35,800	2,085.00	74,643,000
三和ホールディングス	22,000	1,257.00	27,654,000
リンナイ	4,400	9,990.00	43,956,000
日本製鋼所	7,100	3,490.00	24,779,000
三浦工業	10,100	3,390.00	34,239,000
アマダ	36,800	1,037.00	38,161,600
FUJ I	10,700	2,456.00	26,279,200
オーエスジー	10,800	1,939.00	20,941,200
DMG森精機	13,800	1,730.00	23,874,000
ディスコ	3,500	32,850.00	114,975,000
オプトラン	2,900	1,882.00	5,457,800
ナブテスコ	13,200	3,295.00	43,494,000
SMC	6,900	65,420.00	451,398,000
小松製作所	106,700	2,717.00	289,903,900
住友重機械工業	13,400	2,896.00	38,806,400
日立建機	9,400	2,919.00	27,438,600
クボタ	114,900	2,060.50	236,751,450
荏原製作所	9,800	5,650.00	55,370,000
ダイキン工業	30,000	21,505.00	645,150,000
ダイフク	13,000	8,590.00	111,670,000
竹内製作所	3,600	2,640.00	9,504,000
ホシザキ	6,900	8,300.00	57,270,000
日本精工	44,300	739.00	32,737,700

マキタ	28,700	4,131.00	118,559,700
三菱重工業	36,900	3,271.00	120,699,900
I H I	14,700	2,650.00	38,955,000
ブラザー工業	28,800	2,148.00	61,862,400
ミネベアミツミ	40,600	2,559.00	103,895,400
日立製作所	107,300	5,751.00	617,082,300
三菱電機	235,400	1,435.00	337,799,000
富士電機	14,200	6,010.00	85,342,000
安川電機	25,300	4,760.00	120,428,000
日本電産	57,100	10,115.00	577,566,500
オムロン	19,600	8,010.00	156,996,000
MC J	8,200	1,006.00	8,249,200
日本電気	29,900	5,260.00	157,274,000
富士通	21,200	16,035.00	339,942,000
ルネサスエレクトロニクス	127,500	1,391.00	177,352,500
セイコーエプソン	29,200	1,817.00	53,056,400
ワコム	18,200	873.00	15,888,600
アルバック	4,700	5,930.00	27,871,000
エレコム	5,400	1,553.00	8,386,200
パナソニック	251,100	1,211.50	304,207,650
アンリツ	15,200	1,623.00	24,669,600
ソニーグループ	63,100	12,210.00	770,451,000
T D K	34,100	4,510.00	153,791,000
横河電機	23,600	1,877.00	44,297,200
アズビル	13,800	4,225.00	58,305,000
日本光電工業	9,700	3,170.00	30,749,000
堀場製作所	4,300	6,590.00	28,337,000
アドバンテスト	17,500	9,210.00	161,175,000
キーエンス	11,200	57,590.00	645,008,000
シスメックス	19,900	8,868.00	176,473,200
レーザーテック	10,400	21,995.00	228,748,000
スタンレー電気	16,500	2,759.00	45,523,500
カシオ計算機	17,100	1,407.00	24,059,700
ファナック	20,600	22,865.00	471,019,000
浜松ホトニクス	16,900	5,830.00	98,527,000
京セラ	33,100	6,655.00	220,280,500
太陽誘電	11,400	5,050.00	57,570,000
村田製作所	69,200	7,996.00	553,323,200

小糸製作所	13,000	5,780.00	75,140,000
SCREENホールディングス	4,100	11,210.00	45,961,000
東京エレクトロン	15,000	55,220.00	828,300,000
トヨタ紡織	9,600	2,180.00	20,928,000
豊田自動織機	19,100	9,110.00	174,001,000
デンソー	51,800	8,409.00	435,586,200
いすゞ自動車	73,900	1,576.00	116,466,400
トヨタ自動車	351,200	2,153.50	756,309,200
日野自動車	29,400	1,072.00	31,516,800
アイシン	17,300	4,375.00	75,687,500
本田技研工業	185,400	3,601.00	667,625,400
スズキ	53,800	4,842.00	260,499,600
SUBARU	67,500	1,970.50	133,008,750
ヤマハ発動機	30,700	2,728.00	83,749,600
豊田合成	7,600	2,263.00	17,198,800
シマノ	9,500	28,250.00	268,375,000
テイ・エス テック	10,000	1,573.00	15,730,000
テルモ	66,600	3,761.00	250,482,600
島津製作所	30,300	4,175.00	126,502,500
ブイ・テクノロジー	1,200	3,420.00	4,104,000
東京精密	3,900	4,710.00	18,369,000
オリンパス	123,500	2,169.50	267,933,250
HOYA	46,000	15,300.00	703,800,000
朝日インテック	25,800	2,238.00	57,740,400
バンダイナムコホールディングス	21,100	8,000.00	168,800,000
パイロットコーポレーション	4,100	4,605.00	18,880,500
ヤマハ	14,000	5,500.00	77,000,000
ピジョン	14,200	2,286.00	32,461,200
任天堂	10,400	57,420.00	597,168,000
中部電力	72,100	1,131.00	81,545,100
関西電力	89,300	1,150.00	102,695,000
中国電力	36,800	905.00	33,304,000
東北電力	55,200	737.00	40,682,400
九州電力	48,600	844.00	41,018,400
北海道電力	20,400	507.00	10,342,800
電源開発	20,100	1,882.00	37,828,200
イーレックス	3,500	1,624.00	5,684,000
レノバ	4,600	1,423.00	6,545,800

東京瓦斯	45,100	2,314.00	104,361,400
大阪瓦斯	42,600	2,093.00	89,161,800
東海旅客鉄道	19,600	15,825.00	310,170,000
阪急阪神ホールディングス	27,900	3,545.00	98,905,500
ヤマトホールディングス	31,300	2,185.00	68,390,500
山九	6,200	4,105.00	25,451,000
センコーグループホールディングス	12,000	924.00	11,088,000
日立物流	4,300	5,830.00	25,069,000
丸和運輸機関	4,700	1,137.00	5,343,900
九州旅客鉄道	17,300	2,583.00	44,685,900
S Gホールディングス	42,100	2,476.00	104,239,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	7,700	7,280.00	56,056,000
日本郵船	18,600	9,660.00	179,676,000
商船三井	12,400	8,910.00	110,484,000
近鉄エクスプレス	4,200	3,145.00	13,209,000
NEC ネットエスアイ	7,700	1,790.00	13,783,000
システナ	32,900	382.00	12,567,800
日鉄ソリューションズ	3,400	3,645.00	12,393,000
T I S	22,100	2,698.00	59,625,800
コーエーテクモホールディングス	7,400	4,110.00	30,414,000
ネクソン	52,100	2,398.00	124,935,800
ティーガイア	2,200	1,736.00	3,819,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,200	2,642.00	16,380,400
GMOペイメントゲートウェイ	4,500	10,550.00	47,475,000
ラクス	10,600	1,870.00	19,822,000
アカツキ	1,100	2,880.00	3,168,000
野村総合研究所	44,600	3,935.00	175,501,000
インフォコム	2,500	2,031.00	5,077,500
オービック	7,300	18,720.00	136,656,000
ジャストシステム	3,300	5,500.00	18,150,000
Zホールディングス	335,800	563.80	189,324,040
トレンドマイクロ	12,400	6,000.00	74,400,000
日本オラクル	3,800	8,220.00	31,236,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,600	2,963.00	31,407,800
大塚商会	12,500	4,400.00	55,000,000
電通国際情報サービス	3,400	3,540.00	12,036,000
東映アニメーション	1,000	9,980.00	9,980,000

デジタルガレージ	4,000	3,935.00	15,740,000
日本ユニシス	7,200	3,120.00	22,464,000
USEN-NEXT HOLDINGS	2,200	2,423.00	5,330,600
日本電信電話	210,900	3,285.00	692,806,500
KDDI	168,400	3,720.00	626,448,000
光通信	2,700	14,720.00	39,744,000
東宝	13,600	4,785.00	65,076,000
エヌ・ティ・ティ・データ	61,500	2,107.00	129,580,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,700	5,670.00	60,669,000
カプコン	21,800	2,878.00	62,740,400
SCSK	16,000	1,939.00	31,024,000
コナミホールディングス	8,300	6,760.00	56,108,000
ソフトバンクグループ	66,300	5,158.00	341,975,400
双日	25,600	1,919.00	49,126,400
アルフレッサ ホールディングス	25,800	1,737.00	44,814,600
神戸物産	18,000	3,745.00	67,410,000
ダイワボウホールディングス	11,200	1,746.00	19,555,200
TOKAIホールディングス	11,200	906.00	10,147,200
シップヘルスケアホールディングス	7,400	2,364.00	17,493,600
コメダホールディングス	5,100	2,152.00	10,975,200
メディパルホールディングス	25,000	2,120.00	53,000,000
日本ライフライン	6,900	1,037.00	7,155,300
伊藤忠商事	162,200	3,794.00	615,386,800
丸紅	228,800	1,182.50	270,556,000
豊田通商	23,300	4,895.00	114,053,500
兼松	9,100	1,370.00	12,467,000
三井物産	180,000	2,964.00	533,520,000
住友商事	146,400	1,862.00	272,596,800
三菱商事	173,800	3,964.00	688,943,200
岩谷産業	5,600	5,250.00	29,400,000
PALTAC	3,300	4,455.00	14,701,500
日鉄物産	1,600	5,330.00	8,528,000
ミスミグループ本社	29,100	3,535.00	102,868,500
ローソン	5,100	4,970.00	25,347,000
エービーシー・マート	3,600	5,280.00	19,008,000
日本マクドナルドホールディングス	10,700	4,955.00	53,018,500
セリア	5,600	3,030.00	16,968,000
ビックカメラ	13,700	1,040.00	14,248,000

Monotaro	29,300	2,034.00	59,596,200
マツキョココカラ&カンパニー	10,500	4,235.00	44,467,500
ZOZO	15,900	3,185.00	50,641,500
ウエルシアホールディングス	12,300	3,170.00	38,991,000
クリエイトSDホールディングス	3,500	3,170.00	11,095,000
コスモス薬品	2,300	15,250.00	35,075,000
セブン&アイ・ホールディングス	90,700	5,832.00	528,962,400
ツルハホールディングス	5,100	9,400.00	47,940,000
クスリのアオキホールディングス	2,300	7,000.00	16,100,000
FOOD & LIFE COMPANIES	13,500	3,795.00	51,232,500
ノジマ	4,100	2,513.00	10,303,300
良品計画	26,700	1,739.00	46,431,300
コーナン商事	3,300	3,645.00	12,028,500
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	46,400	1,905.00	88,392,000
ゼンショーホールディングス	11,300	2,695.00	30,453,500
ワークマン	3,000	4,990.00	14,970,000
スギホールディングス	4,600	6,590.00	30,314,000
ライフコーポレーション	2,200	3,060.00	6,732,000
丸井グループ	18,400	2,289.00	42,117,600
イズミ	4,200	3,325.00	13,965,000
ヤオコー	2,600	6,640.00	17,264,000
ケーズホールディングス	21,400	1,260.00	26,964,000
アインホールディングス	3,400	6,370.00	21,658,000
ニトリホールディングス	9,200	16,670.00	153,364,000
ファーストリテイリング	3,100	62,970.00	195,207,000
サンドラッグ	8,700	3,130.00	27,231,000
めぶきフィナンシャルグループ	120,600	281.00	33,888,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	132,600	490.00	64,974,000
新生銀行	15,200	2,200.00	33,440,000
あおぞら銀行	13,000	2,679.00	34,827,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,042,600	734.10	765,372,660
りそなホールディングス	265,800	535.20	142,256,160
三井住友トラスト・ホールディングス	43,900	4,193.00	184,072,700
三井住友フィナンシャルグループ	160,700	4,310.00	692,617,000
千葉銀行	77,500	775.00	60,062,500
ふくおかフィナンシャルグループ	19,600	2,377.00	46,589,200

セブン銀行	69,000	248.00	17,112,000
みずほフィナンシャルグループ	297,000	1,605.00	476,685,000
F P G	7,800	868.00	6,770,400
GMOフィナンシャルホールディングス	4,300	800.00	3,440,000
S B Iホールディングス	28,600	3,085.00	88,231,000
ジャフコ グループ	9,000	1,680.00	15,120,000
大和証券グループ本社	173,900	691.00	120,164,900
野村ホールディングス	354,500	540.30	191,536,350
S O M P Oホールディングス	38,100	5,339.00	203,415,900
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	52,100	3,928.00	204,648,800
第一生命ホールディングス	114,300	2,594.00	296,494,200
東京海上ホールディングス	76,500	6,891.00	527,161,500
T & Dホールディングス	60,300	1,734.00	104,560,200
全国保証	5,600	4,855.00	27,188,000
芙蓉総合リース	2,400	7,890.00	18,936,000
みずほリース	3,600	3,265.00	11,754,000
東京センチュリー	4,500	5,870.00	26,415,000
イオンフィナンシャルサービス	12,700	1,274.00	16,179,800
アコム	45,800	332.00	15,205,600
オリエントコーポレーション	62,900	127.00	7,988,300
オリックス	141,000	2,363.50	333,253,500
三菱HCキャピタル	85,800	599.00	51,394,200
日本取引所グループ	58,800	2,288.00	134,534,400
いちご	26,800	270.00	7,236,000
ヒューリック	55,500	1,082.00	60,051,000
野村不動産ホールディングス	12,000	2,762.00	33,144,000
サムティ	3,700	2,131.00	7,884,700
プレサンスコーポレーション	3,000	1,840.00	5,520,000
オープンハウスグループ	7,400	5,750.00	42,550,000
東急不動産ホールディングス	68,400	653.00	44,665,200
飯田グループホールディングス	19,400	2,245.00	43,553,000
三井不動産	105,900	2,573.00	272,480,700
三菱地所	152,600	1,773.50	270,636,100
東京建物	22,900	1,781.00	40,784,900
住友不動産	48,800	3,547.00	173,093,600
スターツコーポレーション	3,200	2,546.00	8,147,200
日本エスコン	4,300	764.00	3,285,200
イオンモール	11,600	1,680.00	19,488,000

カチタス	5,800	3,460.00	20,068,000
ミクシィ	5,200	2,250.00	11,700,000
日本M&Aセンターホールディングス	36,900	1,760.00	64,944,000
UTグループ	3,300	3,505.00	11,566,500
エス・エム・エス	7,700	3,230.00	24,871,000
パーソルホールディングス	22,500	2,677.00	60,232,500
総合警備保障	8,900	4,275.00	38,047,500
カカクコム	16,500	2,596.00	42,834,000
ディップ	3,900	3,390.00	13,221,000
ベネフィット・ワン	8,200	2,623.00	21,508,600
エムスリー	39,700	4,123.00	163,683,100
アウトソーシング	12,900	1,372.00	17,698,800
博報堂DYホールディングス	31,300	1,604.00	50,205,200
オリエンタルランド	26,600	21,830.00	580,678,000
ユー・エス・エス	25,100	1,932.00	48,493,200
フルキャストホールディングス	1,900	2,163.00	4,109,700
エン・ジャパン	3,600	2,875.00	10,350,000
テクノプロ・ホールディングス	13,400	3,295.00	44,153,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	3,940.00	4,334,000
ジャパンマテリアル	6,900	1,704.00	11,757,600
リクルートホールディングス	134,300	5,046.00	677,677,800
ベルシステム24ホールディングス	3,700	1,403.00	5,191,100
ベイカレント・コンサルティング	1,600	40,600.00	64,960,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,100	1,581.00	11,225,100
リログループ	12,300	1,846.00	22,705,800
カナモト	3,900	2,308.00	9,001,200
セコム	22,200	8,591.00	190,720,200
メイテック	2,700	6,880.00	18,576,000
イオンディライト	2,800	3,035.00	8,498,000
合 計	15,783,200		44,570,880,970

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。