

# 2023年2月期 決算短信 (2022年8月16日～2023年2月15日)

2023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 <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 2023年5月15日  
 分配金支払開始予定日 2023年3月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2023年2月期の運用状況 (2022年8月16日～2023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	%
2023年2月期	46,414	(97.5)	1,188	(2.5)	47,603	(100.0)
2022年8月期	46,331	(97.9)	985	(2.1)	47,316	(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
2023年2月期	2,621	110	106	2,625
2022年8月期	2,621	-	-	2,621

#### (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
2023年2月期	48,254	651	47,603	18,131
2022年8月期	47,951	634	47,316	18,049

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2023年2月期	214
2022年8月期	223

(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7期 2022年8月15日現在	第8期 2023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	1,474,085,147	1,652,662,763
株式	46,331,412,290	46,414,669,280
派生商品評価勘定	11,679,406	25,497,588
未収入金	5,404,140	11,058,920
未収配当金	67,243,281	80,741,350
差入委託証拠金	61,887,000	70,035,000
流動資産合計	47,951,711,264	48,254,664,901
資産合計	47,951,711,264	48,254,664,901
負債の部		
流動負債		
前受金	8,477,000	46,893,800
未払収益分配金	584,610,110	561,863,634
未払受託者報酬	6,971,670	7,089,758
未払委託者報酬	21,661,911	22,028,842
未払利息	349	1,261
その他未払費用	13,189,502	13,397,852
流動負債合計	634,910,542	651,275,147
負債合計	634,910,542	651,275,147
純資産の部		
元本等		
元本	36,825,193,790	36,880,833,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	10,491,606,932	10,722,555,797
(分配準備積立金)	1,514,356	1,743,524
元本等合計	47,316,800,722	47,603,389,754
純資産合計	47,316,800,722	47,603,389,754
負債純資産合計	47,951,711,264	48,254,664,901

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第7期	第8期
	自 2022年2月16日 至 2022年8月15日	自 2022年8月16日 至 2023年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	626,663,648	604,918,317
受取利息	5,837	4,217
有価証券売買等損益	1,716,038,708	119,486,887
派生商品取引等損益	51,258,294	58,974,342
その他収益	2,352	2,293
営業収益合計	2,393,968,839	783,386,056
営業費用		
支払利息	117,355	261,737
受託者報酬	6,971,670	7,089,758
委託者報酬	21,661,911	22,028,842
その他費用	13,189,502	13,451,688
営業費用合計	41,940,438	42,832,025
営業利益又は営業損失 (△)	2,352,028,401	740,554,031
経常利益又は経常損失 (△)	2,352,028,401	740,554,031
当期純利益又は当期純損失 (△)	2,352,028,401	740,554,031
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 (△)	8,724,188,641	10,491,606,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	427,889,590
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	-	427,889,590
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	375,631,122
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	375,631,122
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	584,610,110	561,863,634
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	10,491,606,932	10,722,555,797

(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7期 (2022年8月15日現在)	第8期 (2023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7期 2022年8月15日現在	第8期 2023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	36,825,193,790円	36,825,193,790円
	期中追加設定元本額	－円	1,545,380,705円
	期中一部交換元本額	－円	1,489,740,538円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,621,570口	2,625,531口
3.	1口当たり純資産額	18,049円	18,131円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期 自2022年2月16日 至2022年8月15日		第8期 自2022年8月16日 至2023年2月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	626,554,482円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,393,067円	B. 分配準備積立金額	1,514,356円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	627,947,549円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	606,177,446円
	D. 経費	41,823,083円	D. 経費	42,570,288円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	586,124,466円	E. 収益分配可能額 (C-D)	563,607,158円
	F. 収益分配金	584,610,110円	F. 収益分配金	561,863,634円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,514,356円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,743,524円
	H. 口数	2,621,570口	H. 口数	2,625,531口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	223円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	214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7期 自 2022年 2月 16日 至 2022年 8月 15日	第8期 自 2022年 8月 16日 至 2023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7期 2022年8月15日現在	第8期 2023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7期(自 2022年2月16日 至 2022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	1,742,742,279
合計	1,742,742,279

第8期(自 2022年8月16日 至 2023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	227,501,427
合計	227,501,427

(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7期 (2022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	930,848,500	—	942,539,500	11,691,000
合計		930,848,500	—	942,539,500	11,691,000

第8期 (2023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	1,131,797,200	—	1,157,309,000	25,511,800
合計		1,131,797,200	—	1,157,309,000	25,511,800

(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	
ニッセイ	32,100	532.00	17,077,200	
I N P E X	115,900	1,463.00	169,561,700	
ウエストホールディングス	2,900	3,600.00	10,440,000	
ショーボンドホールディングス	4,300	5,260.00	22,618,000	
ミライト・ワン	10,400	1,512.00	15,724,800	
安藤・間	18,200	860.00	15,652,000	
コムシスホールディングス	11,100	2,504.00	27,794,400	
大成建設	21,900	4,315.00	94,498,500	
大林組	78,400	970.00	76,048,000	
清水建設	66,000	716.00	47,256,000	
長谷工コーポレーション	22,100	1,521.00	33,614,100	
鹿島建設	48,600	1,592.00	77,371,200	
西松建設	3,800	3,480.00	13,224,000	
戸田建設	27,000	708.00	19,116,000	
熊谷組	3,700	2,686.00	9,938,200	
五洋建設	29,400	641.00	18,845,400	
住友林業	16,800	2,492.00	41,865,600	
大和ハウス工業	61,300	3,108.00	190,520,400	
積水ハウス	68,700	2,522.50	173,295,750	
関電工	12,000	873.00	10,476,000	
エクシオグループ	10,100	2,380.00	24,038,000	
九電工	5,000	3,260.00	16,300,000	
インフロニア・ホールディングス	23,000	1,060.00	24,380,000	
森永製菓	4,100	3,890.00	15,949,000	
カルビー	10,000	2,892.00	28,920,000	
森永乳業	4,000	4,760.00	19,040,000	
ヤクルト本社	15,700	9,150.00	143,655,000	
明治ホールディングス	13,700	6,460.00	88,502,000	
プリマハム	3,300	2,157.00	7,118,100	
日本ハム	9,000	3,695.00	33,255,000	
アサヒグループホールディングス	50,900	4,406.00	224,265,400	
キリンホールディングス	99,300	2,035.00	202,075,500	

宝ホールディングス	14,000	1,065.00	14,910,000
サントリー食品インターナショナル	15,500	4,690.00	72,695,000
キッコーマン	14,600	6,440.00	94,024,000
味の素	53,800	4,006.00	215,522,800
キューピー	11,500	2,247.00	25,840,500
カゴメ	10,200	3,030.00	30,906,000
ニチレイ	10,000	2,700.00	27,000,000
東洋水産	11,300	5,580.00	63,054,000
日清食品ホールディングス	7,800	11,470.00	89,466,000
日本たばこ産業	144,900	2,786.50	403,763,850
帝人	21,700	1,386.00	30,076,200
東レ	150,000	773.90	116,085,000
ゴールドウイン	4,100	10,800.00	44,280,000
王子ホールディングス	93,200	529.00	49,302,800
大王製紙	11,000	1,031.00	11,341,000
レンゴー	19,100	907.00	17,323,700
クラレ	35,600	1,178.00	41,936,800
旭化成	139,900	928.40	129,883,160
住友化学	166,100	467.00	77,568,700
日産化学	10,700	5,840.00	62,488,000
東ソー	30,500	1,724.00	52,582,000
トクヤマ	7,400	2,037.00	15,073,800
デンカ	8,400	2,838.00	23,839,200
信越化学工業	37,800	19,445.00	735,021,000
エア・ウォーター	20,500	1,589.00	32,574,500
日本酸素ホールディングス	21,700	2,299.00	49,888,300
三菱瓦斯化学	16,700	1,890.00	31,563,000
三井化学	19,200	3,140.00	60,288,000
三菱ケミカルグループ	151,200	780.00	117,936,000
KHネオケム	3,600	2,540.00	9,144,000
ダイセル	33,200	923.00	30,643,600
積水化学工業	45,800	1,816.00	83,172,800
日本ゼオン	13,400	1,234.00	16,535,600
アイカ工業	5,800	3,015.00	17,487,000
UBE	11,600	2,027.00	23,513,200
日油	6,900	5,890.00	40,641,000
花王	54,600	5,107.00	278,842,200
日本ペイントホールディングス	99,100	1,233.00	122,190,300

関西ペイント	20,500	1,832.00	37,556,000
富士フイルムホールディングス	43,100	6,480.00	279,288,000
資生堂	46,800	6,181.00	289,270,800
ライオン	26,900	1,453.00	39,085,700
ファンケル	10,200	2,567.00	26,183,400
コーセー	4,600	14,990.00	68,954,000
小林製薬	6,600	8,550.00	56,430,000
タカラバイオ	6,600	1,814.00	11,972,400
デクセリアルズ	6,600	2,766.00	18,255,600
日東電工	16,300	8,360.00	136,268,000
エフピコ	4,300	3,580.00	15,394,000
ニフコ	8,300	3,450.00	28,635,000
ユニ・チャーム	46,700	5,083.00	237,376,100
協和キリン	27,100	3,005.00	81,435,500
武田薬品工業	172,300	4,196.00	722,970,800
アステラス製薬	215,300	1,931.50	415,851,950
住友ファーマ	16,600	861.00	14,292,600
塩野義製薬	28,600	6,294.00	180,008,400
日本新薬	5,500	6,430.00	35,365,000
中外製薬	70,100	3,586.00	251,378,600
科研製薬	3,600	3,640.00	13,104,000
エーザイ	27,300	7,477.00	204,122,100
ロート製薬	21,700	2,569.00	55,747,300
小野薬品工業	43,300	2,854.50	123,599,850
参天製薬	43,900	999.00	43,856,100
JCRファーマ	7,600	1,597.00	12,137,200
東和薬品	3,400	1,929.00	6,558,600
第一三共	195,400	4,179.00	816,576,600
大塚ホールディングス	51,300	4,198.00	215,357,400
ペプチドリーム	10,300	1,880.00	19,364,000
出光興産	24,900	3,185.00	79,306,500
ENEOSホールディングス	405,100	459.70	186,224,470
コスモエネルギーホールディングス	8,500	3,760.00	31,960,000
横浜ゴム	12,600	2,107.00	26,548,200
TOYO TIRE	12,500	1,534.00	19,175,000
ブリヂストン	71,600	4,855.00	347,618,000
住友ゴム工業	21,200	1,154.00	24,464,800
AGC	22,800	4,925.00	112,290,000

太平洋セメント	14,300	2,347.00	33,562,100
東海カーボン	17,800	1,253.00	22,303,400
TOTO	14,800	4,570.00	67,636,000
日本碍子	26,500	1,797.00	47,620,500
日本特殊陶業	17,000	2,672.00	45,424,000
MARUWA	800	17,680.00	14,144,000
ニチアス	5,500	2,555.00	14,052,500
日本製鉄	103,300	2,956.00	305,354,800
JFEホールディングス	61,700	1,614.00	99,583,800
東京製鐵	7,300	1,485.00	10,840,500
三井金属鉱業	6,700	3,300.00	22,110,000
住友金属鉱山	26,800	5,154.00	138,127,200
DOWAホールディングス	5,200	4,485.00	23,322,000
住友電気工業	79,700	1,680.50	133,935,850
アサヒホールディングス	9,300	1,967.00	18,293,100
SUMCO	43,900	1,922.00	84,375,800
三和ホールディングス	21,200	1,403.00	29,743,600
リンナイ	4,200	9,600.00	40,320,000
三浦工業	9,400	3,380.00	31,772,000
アマダ	36,100	1,196.00	43,175,600
FUJ I	9,900	2,044.00	20,235,600
DMG森精機	13,000	2,103.00	27,339,000
ディスコ	3,700	40,450.00	149,665,000
オプトラン	2,900	1,868.00	5,417,200
ナブテスコ	14,200	3,660.00	51,972,000
SMC	7,300	67,360.00	491,728,000
小松製作所	105,800	3,227.00	341,416,600
住友重機械工業	13,400	2,852.00	38,216,800
日立建機	9,000	3,105.00	27,945,000
ローツェ	1,200	10,400.00	12,480,000
クボタ	119,500	2,025.50	242,047,250
荏原製作所	9,200	5,540.00	50,968,000
ダイキン工業	27,000	23,095.00	623,565,000
ダイフク	11,600	7,370.00	85,492,000
竹内製作所	3,600	2,916.00	10,497,600
ホシザキ	14,500	4,650.00	67,425,000
マキタ	28,100	3,510.00	98,631,000
三菱重工業	39,500	5,042.00	199,159,000

I H I	14,200	3,670.00	52,114,000
イビデン	13,000	4,615.00	59,995,000
ブラザー工業	30,200	1,972.00	59,554,400
ミネベアミツミ	39,300	2,384.00	93,691,200
日立製作所	92,500	6,931.00	641,117,500
三菱電機	233,400	1,520.50	354,884,700
富士電機	13,700	5,220.00	71,514,000
安川電機	26,800	5,100.00	136,680,000
日本電産	54,900	6,976.00	382,982,400
オムロン	20,900	7,400.00	154,660,000
MC J	8,300	958.00	7,951,400
日本電気	32,000	4,855.00	155,360,000
富士通	22,500	17,840.00	401,400,000
ルネサスエレクトロニクス	147,300	1,717.50	252,987,750
セイコーエプソン	30,100	1,833.00	55,173,300
ワコム	18,200	668.00	12,157,600
アルバック	5,300	5,420.00	28,726,000
エレコム	5,400	1,314.00	7,095,600
パナソニック ホールディングス	266,800	1,188.00	316,958,400
シャープ	27,200	949.00	25,812,800
アンリツ	15,300	1,254.00	19,186,200
ソニーグループ	59,300	11,705.00	694,106,500
T D K	35,800	4,565.00	163,427,000
横河電機	24,700	2,123.00	52,438,100
アズビル	15,600	3,685.00	57,486,000
日本光電工業	10,300	3,350.00	34,505,000
堀場製作所	5,000	6,700.00	33,500,000
アドバンテスト	17,700	10,130.00	179,301,000
キーエンス	13,900	59,510.00	827,189,000
シスメックス	19,200	8,498.00	163,161,600
フェローテックホールディングス	6,700	3,235.00	21,674,500
レーザーテック	10,300	22,670.00	233,501,000
カシオ計算機	15,600	1,300.00	20,280,000
ファナック	22,000	22,910.00	504,020,000
浜松ホトニクス	18,000	6,600.00	118,800,000
新光電気工業	7,900	3,810.00	30,099,000
京セラ	34,700	6,582.00	228,395,400
太陽誘電	10,900	4,145.00	45,180,500

村田製作所	67,800	7,464.00	506,059,200
小糸製作所	26,900	2,231.00	60,013,900
S C R E E Nホールディングス	3,900	10,290.00	40,131,000
東京エレクトロン	14,600	46,570.00	679,922,000
トヨタ紡織	8,800	2,063.00	18,154,400
豊田自動織機	16,300	7,730.00	125,999,000
デンソー	46,100	7,334.00	338,097,400
いすゞ自動車	65,000	1,615.00	104,975,000
トヨタ自動車	334,400	1,874.00	626,665,600
アイシン	17,200	3,650.00	62,780,000
本田技研工業	181,800	3,355.00	609,939,000
スズキ	41,100	4,722.00	194,074,200
S U B A R U	70,800	2,150.00	152,220,000
ヤマハ発動機	35,100	3,360.00	117,936,000
豊田合成	6,500	2,145.00	13,942,500
シマノ	9,100	21,565.00	196,241,500
テイ・エス テック	10,000	1,629.00	16,290,000
テルモ	69,800	3,798.00	265,100,400
島津製作所	27,200	3,950.00	107,440,000
東京精密	4,900	4,730.00	23,177,000
オリンパス	139,800	2,349.50	328,460,100
H O Y A	47,800	13,650.00	652,470,000
朝日インテック	25,000	2,335.00	58,375,000
バンダイナムコホールディングス	20,400	8,744.00	178,377,600
パイロットコーポレーション	3,400	4,450.00	15,130,000
ヤマハ	14,100	4,980.00	70,218,000
ピジョン	14,200	2,115.00	30,033,000
任天堂	111,100	5,336.00	592,829,600
中部電力	82,400	1,392.00	114,700,800
関西電力	86,300	1,223.00	105,544,900
九州電力	51,500	735.00	37,852,500
北海道電力	20,400	471.00	9,608,400
電源開発	16,800	2,146.00	36,052,800
イーレックス	3,600	1,978.00	7,120,800
レノバ	6,000	2,165.00	12,990,000
東京瓦斯	47,200	2,714.00	128,100,800
大阪瓦斯	45,300	2,193.00	99,342,900
S B Sホールディングス	1,900	3,130.00	5,947,000

東海旅客鉄道	17,200	15,305.00	263,246,000
ヤマトホールディングス	28,500	2,335.00	66,547,500
山九	5,800	4,970.00	28,826,000
センコーグループホールディングス	12,000	971.00	11,652,000
AZ-COM丸和ホールディングス	4,700	1,700.00	7,990,000
SGホールディングス	42,900	2,074.00	88,974,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	8,400	7,340.00	61,656,000
日本郵船	59,800	3,298.00	197,220,400
商船三井	39,300	3,390.00	133,227,000
川崎汽船	19,000	3,290.00	62,510,000
三井倉庫ホールディングス	2,300	4,010.00	9,223,000
NEC ネットエスアイ	7,700	1,637.00	12,604,900
システナ	37,700	357.00	13,458,900
日鉄ソリューションズ	4,000	3,390.00	13,560,000
TIS	25,200	3,455.00	87,066,000
コーエーテクモホールディングス	14,000	2,452.00	34,328,000
ネクソン	57,900	3,045.00	176,305,500
ティーガイア	2,200	1,648.00	3,625,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,200	2,371.00	14,700,200
GMOペイメントゲートウェイ	5,100	11,640.00	59,364,000
インターネットイニシアティブ	12,500	2,593.00	32,412,500
ラクス	10,700	1,760.00	18,832,000
チェンジ	5,100	2,546.00	12,984,600
野村総合研究所	46,000	3,020.00	138,920,000
インフォコム	2,500	2,388.00	5,970,000
オービック	7,500	20,490.00	153,675,000
ジャストシステム	3,300	3,330.00	10,989,000
Zホールディングス	319,100	385.60	123,044,960
トレンドマイクロ	13,000	6,320.00	82,160,000
日本オラクル	4,300	9,210.00	39,603,000
伊藤忠テクノソリューションズ	12,000	3,100.00	37,200,000
大塚商会	12,800	4,590.00	58,752,000
電通国際情報サービス	2,600	4,720.00	12,272,000
東映アニメーション	1,000	13,120.00	13,120,000
デジタルガレージ	4,000	4,550.00	18,200,000
ネットワンシステムズ	8,400	3,260.00	27,384,000
BIPROGY	8,300	2,971.00	24,659,300

USEN-NEXT HOLDINGS	2,200	2,322.00	5,108,400
日本電信電話	174,900	3,884.00	679,311,600
KDDI	147,300	4,023.00	592,587,900
ソフトバンク	360,200	1,538.50	554,167,700
光通信	2,600	20,000.00	52,000,000
GMOインターネットグループ	7,900	2,637.00	20,832,300
東宝	14,000	4,740.00	66,360,000
エヌ・ティ・ティ・データ	70,400	1,902.00	133,900,800
DTS	4,600	3,155.00	14,513,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,500	6,260.00	71,990,000
カプコン	22,300	4,385.00	97,785,500
SCSK	18,300	1,933.00	35,373,900
NSD	7,700	2,328.00	17,925,600
コナミグループ	9,600	6,410.00	61,536,000
ソフトバンクグループ	109,800	5,791.00	635,851,800
双日	25,600	2,579.00	66,022,400
アルフレッサ ホールディングス	23,700	1,608.00	38,109,600
神戸物産	18,300	3,655.00	66,886,500
ダイワボウホールディングス	9,600	2,083.00	19,996,800
TOKAIホールディングス	11,200	856.00	9,587,200
シップヘルスケアホールディングス	8,500	2,498.00	21,233,000
メディパルホールディングス	24,600	1,721.00	42,336,600
伊藤忠商事	145,700	4,122.00	600,575,400
丸紅	186,800	1,755.00	327,834,000
豊田通商	20,700	5,590.00	115,713,000
兼松	9,100	1,558.00	14,177,800
三井物産	173,100	3,933.00	680,802,300
住友商事	146,700	2,368.50	347,458,950
三菱商事	147,900	4,617.00	682,854,300
阪和興業	4,300	3,895.00	16,748,500
岩谷産業	5,600	5,550.00	31,080,000
PALTAC	3,800	4,830.00	18,354,000
日鉄物産	1,500	9,240.00	13,860,000
ミスミグループ本社	35,600	3,210.00	114,276,000
ローソン	5,900	5,370.00	31,683,000
エービーシー・マート	3,400	6,710.00	22,814,000
日本マクドナルドホールディングス	13,400	5,350.00	71,690,000
セリア	6,400	2,721.00	17,414,400

Monotaro	33,600	1,890.00	63,504,000
マツキョココカラ&カンパニー	14,500	6,520.00	94,540,000
ZOZO	15,700	3,115.00	48,905,500
ウエルシアホールディングス	12,200	2,972.00	36,258,400
クリエイトSDホールディングス	3,600	3,445.00	12,402,000
ネクステージ	5,000	3,195.00	15,975,000
コスモス薬品	2,300	12,550.00	28,865,000
セブン&アイ・ホールディングス	81,500	6,066.00	494,379,000
ツルハホールディングス	5,000	9,330.00	46,650,000
クスリのアオキホールディングス	2,100	7,030.00	14,763,000
FOOD & LIFE COMPANIES	13,600	3,500.00	47,600,000
ノジマ	8,200	1,302.00	10,676,400
良品計画	30,500	1,400.00	42,700,000
コーナン商事	3,300	3,305.00	10,906,500
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	47,700	2,422.00	115,529,400
ゼンショーホールディングス	13,000	3,575.00	46,475,000
ワークマン	2,600	5,400.00	14,040,000
スギホールディングス	4,900	5,640.00	27,636,000
日本瓦斯	12,600	1,877.00	23,650,200
ライフコーポレーション	2,200	2,769.00	6,091,800
丸井グループ	17,500	2,057.00	35,997,500
イズミ	3,600	2,940.00	10,584,000
ヤオコー	2,600	6,770.00	17,602,000
ケーズホールディングス	18,800	1,174.00	22,071,200
ニトリホールディングス	9,600	16,105.00	154,608,000
ファーストリテイリング	3,600	81,900.00	294,840,000
サンドラッグ	9,400	3,615.00	33,981,000
めぶきフィナンシャルグループ	109,200	358.00	39,093,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	122,900	585.00	71,896,500
SBI新生銀行	6,500	2,457.00	15,970,500
あおぞら銀行	13,900	2,676.00	37,196,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	865,800	981.10	849,436,380
りそなホールディングス	281,100	753.10	211,696,410
三井住友トラスト・ホールディングス	40,000	4,917.00	196,680,000
三井住友フィナンシャルグループ	160,900	5,911.00	951,079,900
千葉銀行	61,400	997.00	61,215,800

ふくおかフィナンシャルグループ	17,600	3,060.00	53,856,000
セブン銀行	78,900	269.00	21,224,100
みずほフィナンシャルグループ	318,400	2,147.00	683,604,800
GMOフィナンシャルホールディングス	4,300	538.00	2,313,400
ジャフコ グループ	7,300	2,128.00	15,534,400
大和証券グループ本社	159,400	621.00	98,987,400
野村ホールディングス	405,500	542.30	219,902,650
マネックスグループ	24,600	497.00	12,226,200
SOMPOホールディングス	37,800	5,553.00	209,903,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	44,800	4,350.00	194,880,000
第一生命ホールディングス	112,100	3,050.00	341,905,000
東京海上ホールディングス	221,700	2,797.50	620,205,750
T&Dホールディングス	59,100	2,171.00	128,306,100
全国保証	5,600	5,090.00	28,504,000
芙蓉総合リース	2,100	8,950.00	18,795,000
みずほリース	3,100	3,545.00	10,989,500
東京センチュリー	4,100	4,585.00	18,798,500
イオンフィナンシャルサービス	12,700	1,328.00	16,865,600
アコム	39,300	324.00	12,733,200
オリエントコーポレーション	6,100	1,168.00	7,124,800
オリックス	147,500	2,359.50	348,026,250
三菱HCキャピタル	85,800	676.00	58,000,800
日本取引所グループ	61,900	1,957.00	121,138,300
大東建託	8,100	12,380.00	100,278,000
ヒューリック	51,300	1,074.00	55,096,200
野村不動産ホールディングス	13,800	2,894.00	39,937,200
プレサンスコーポレーション	3,000	1,591.00	4,773,000
オープンハウスグループ	7,900	4,835.00	38,196,500
東急不動産ホールディングス	66,200	634.00	41,970,800
飯田グループホールディングス	19,300	2,103.00	40,587,900
ケイアイスター不動産	1,100	4,050.00	4,455,000
三井不動産	95,700	2,431.50	232,694,550
三菱地所	132,800	1,608.00	213,542,400
東京建物	21,000	1,570.00	32,970,000
住友不動産	39,800	3,081.00	122,623,800
スターツコーポレーション	3,200	2,562.00	8,198,400
日本エスコン	4,300	819.00	3,521,700
イオンモール	11,600	1,792.00	20,787,200

カチタス	5,900	2,691.00	15,876,900
UTグループ	3,300	2,416.00	7,972,800
エス・エム・エス	8,800	3,365.00	29,612,000
パーソルホールディングス	25,700	2,831.00	72,756,700
総合警備保障	8,900	3,500.00	31,150,000
カカクコム	17,600	2,023.00	35,604,800
ディップ	3,900	3,840.00	14,976,000
ベネフィット・ワン	10,700	2,191.00	23,443,700
エムスリー	45,400	3,485.00	158,219,000
博報堂DYホールディングス	29,300	1,468.00	43,012,400
バリューコマース	1,600	1,769.00	2,830,400
H. U. グループホールディングス	6,300	2,646.00	16,669,800
ビー・エム・エル	3,100	3,115.00	9,656,500
ユー・エス・エス	23,600	2,199.00	51,896,400
サイバーエージェント	55,000	1,225.00	67,375,000
フルキャストホールディングス	1,900	2,659.00	5,052,100
エン・ジャパン	3,600	2,404.00	8,654,400
テクノプロ・ホールディングス	13,600	3,570.00	48,552,000
ジャパンマテリアル	6,900	2,361.00	16,290,900
リクルートホールディングス	162,200	3,990.00	647,178,000
ベルシステム24ホールディングス	3,600	1,478.00	5,320,800
ベイカレント・コンサルティング	16,800	5,490.00	92,232,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	8,200	2,001.00	16,408,200
リログループ	13,200	2,106.00	27,799,200
トランス・コスモス	3,100	3,395.00	10,524,500
セコム	23,400	7,887.00	184,555,800
メイテック	9,200	2,447.00	22,512,400
イオンディライト	2,800	3,025.00	8,470,000
合 計	16,154,400		46,414,669,280

## 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。