

# 2025年2月期 決算短信 (2024年8月16日～2025年2月15日)

2025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 配当込 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 プロダクトガバナンス部 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 2025年5月15日  
 分配金支払開始予定日 2025年3月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2025年2月期の運用状況 (2024年8月16日～2025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	%
2025年2月期	52,097	(97.2)	1,498	(2.8)	53,596	(100.0)
2024年8月期	50,087	(97.5)	1,276	(2.5)	51,364	(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
2025年2月期	2,127	-	-	2,127
2024年8月期	2,231	109	214	2,127

#### (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
2025年2月期	54,233	637	53,596	25,197
2024年8月期	52,048	684	51,364	24,148

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2025年2月期	269
2024年8月期	252

(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11期 2024年8月15日現在	第12期 2025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	1,582,885,481	1,942,304,600
株式	50,087,665,950	52,097,379,740
派生商品評価勘定	-	69,788
未収入金	-	907,880
未収配当金	63,596,832	87,881,798
未収利息	9,933	50,822
前払金	115,031,200	-
差入委託証拠金	199,133,978	104,518,007
流動資産合計	52,048,323,374	54,233,112,635
資産合計	52,048,323,374	54,233,112,635
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	72,122,950	3,608,246
前受金	-	12,560,000
未払金	29,136,480	-
未払収益分配金	536,025,168	572,185,596
未払受託者報酬	7,974,148	8,282,462
未払委託者報酬	24,776,783	25,734,732
その他未払費用	14,208,301	14,648,430
流動負債合計	684,243,830	637,019,466
負債合計	684,243,830	637,019,466
純資産の部		
元本等		
元本	29,879,148,948	29,879,148,948
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	21,484,930,596	23,716,944,221
(分配準備積立金)	1,469,416	1,634,803
元本等合計	51,364,079,544	53,596,093,169
純資産合計	51,364,079,544	53,596,093,169
負債純資産合計	52,048,323,374	54,233,112,635

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第11期	第12期
	自 2024年2月16日 至 2024年8月15日	自 2024年8月16日 至 2025年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	583,024,605	619,030,539
受取利息	572,393	1,984,965
有価証券売買等損益	872,836,868	2,171,728,718
派生商品取引等損益	732,646	60,119,520
その他収益	836	1,103
営業収益合計	1,457,167,348	2,852,864,845
営業費用		
支払利息	7,563	-
受託者報酬	7,974,148	8,282,462
委託者報酬	24,776,783	25,734,732
その他費用	14,208,301	14,648,430
営業費用合計	46,966,795	48,665,624
営業利益又は営業損失 (△)	1,410,200,553	2,804,199,221
経常利益又は経常損失 (△)	1,410,200,553	2,804,199,221
当期純利益又は当期純損失 (△)	1,410,200,553	2,804,199,221
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 (△)	21,610,176,130	21,484,930,596
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,333,898,195	-
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	1,333,898,195	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,333,319,114	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,333,319,114	-
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	536,025,168	572,185,596
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	21,484,930,596	23,716,944,221

(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 11 期 (2024 年 8 月 15 日現在)	第 12 期 (2025 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 11 期 2024 年 8 月 15 日現在	第 12 期 2025 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	31,344,869,116 円	29,879,148,948 円
	期中追加設定元本額	1,544,804,778 円	－円
	期中一部交換元本額	3,010,524,946 円	－円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,127,084 口	2,127,084 口
3.	1 口当たり純資産額	24,148 円	25,197 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第 11 期 自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 年 8 月 15 日		第 12 期 自 2024 年 8 月 16 日 至 2025 年 2 月 15 日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	583,590,271 円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	863,545 円	B. 分配準備積立金額	1,469,416 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	584,453,816 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	622,486,023 円
	D. 経費	46,959,232 円	D. 経費	48,665,624 円
	E. 収益分配可能額 (C- D)	537,494,584 円	E. 収益分配可能額 (C- D)	573,820,399 円
	F. 収益分配金	536,025,168 円	F. 収益分配金	572,185,596 円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,469,416 円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,634,803 円
	H. 口数	2,127,084 口	H. 口数	2,127,084 口
	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1)	252 円	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1)	269 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 11 期 自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 年 8 月 15 日	第 12 期 自 2024 年 8 月 16 日 至 2025 年 2 月 15 日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第 11 期 2024 年 8 月 15 日現在	第 12 期 2025 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 11 期(自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 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	594,195,616
合計	594,195,616

第 12 期(自 2024 年 8 月 16 日 至 2025 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	2,085,955,482
合計	2,085,955,482

(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11期 (2024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	1,324,236,400	—	1,252,125,000	△72,111,400
合計		1,324,236,400	—	1,252,125,000	△72,111,400

第12期 (2025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	1,468,368,500	—	1,464,843,000	△3,525,500
合計		1,468,368,500	—	1,464,843,000	△3,525,500

(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	
ニッセイ	27,600	856.70	23,644,920	
I N P E X	81,500	1,897.50	154,646,250	
石油資源開発	16,000	1,131.00	18,096,000	
ショーボンドホールディングス	3,500	5,000.00	17,500,000	
タマホーム	1,700	3,360.00	5,712,000	
安藤・間	16,000	1,301.00	20,816,000	
コムシスホールディングス	8,700	3,286.00	28,588,200	
大成建設	17,100	6,640.00	113,544,000	
大林組	62,300	2,055.00	128,026,500	
長谷工コーポレーション	17,700	2,000.00	35,400,000	
鹿島建設	41,800	3,006.00	125,650,800	
住友林業	16,300	4,919.00	80,179,700	
大和ハウス工業	56,900	5,037.00	286,605,300	
積水ハウス	57,200	3,457.00	197,740,400	
関電工	10,300	2,678.00	27,583,400	
エクシオグループ	18,800	1,777.50	33,417,000	
九電工	4,200	4,710.00	19,782,000	
高砂熱学工業	4,500	5,406.00	24,327,000	
インフロニア・ホールディングス	19,800	1,151.50	22,799,700	
森永製菓	8,000	2,580.50	20,644,000	
寿スピリッツ	11,200	2,481.00	27,787,200	
カルビー	8,900	2,838.50	25,262,650	
森永乳業	6,800	2,944.50	20,022,600	
ヤクルト本社	27,100	2,775.00	75,202,500	
明治ホールディングス	24,400	2,939.50	71,723,800	
日本ハム	8,300	4,495.00	37,308,500	
アサヒグループホールディングス	142,300	1,697.50	241,554,250	
キリンホールディングス	78,900	1,941.00	153,144,900	
宝ホールディングス	12,600	1,283.50	16,172,100	
サントリー食品インターナショナル	13,300	4,537.00	60,342,100	
キッコーマン	62,800	1,465.50	92,033,400	
味の素	43,900	6,225.00	273,277,500	

ニチレイ	7,700	3,442.00	26,503,400
東洋水産	8,800	8,521.00	74,984,800
日清食品ホールディングス	24,000	3,011.00	72,264,000
日本たばこ産業	115,100	3,833.00	441,178,300
東レ	140,900	988.10	139,223,290
ゴールドウイン	3,500	7,602.00	26,607,000
王子ホールディングス	73,000	606.60	44,281,800
クラレ	25,700	1,931.50	49,639,550
日産化学	9,900	4,480.00	44,352,000
東ソー	26,300	2,059.50	54,164,850
信越化学工業	124,400	4,741.00	589,780,400
エア・ウォーター	18,600	1,910.50	35,535,300
日本酸素ホールディングス	18,700	4,424.00	82,728,800
三菱瓦斯化学	14,400	2,503.00	36,043,200
三井化学	17,300	3,308.00	57,228,400
東京応化工業	9,400	3,783.00	35,560,200
三菱ケミカルグループ	140,900	774.60	109,141,140
KHネオケム	3,500	2,516.00	8,806,000
ダイセル	21,900	1,346.00	29,477,400
住友ベークライト	5,700	3,658.00	20,850,600
積水化学工業	38,400	2,542.50	97,632,000
扶桑化学工業	2,000	3,440.00	6,880,000
ADEKA	6,800	2,841.50	19,322,200
日油	22,700	2,107.00	47,828,900
花王	46,900	6,640.00	311,416,000
日本ペイントホールディングス	85,300	949.50	80,992,350
関西ペイント	16,100	2,167.00	34,888,700
太陽ホールディングス	3,300	3,900.00	12,870,000
富士フイルムホールディングス	116,400	3,158.00	367,591,200
資生堂	40,300	2,556.00	103,006,800
ライオン	25,100	1,866.00	46,836,600
小林製薬	5,200	5,700.00	29,640,000
タカラバイオ	5,300	915.00	4,849,500
デクセリアルズ	16,900	2,264.00	38,261,600
日東電工	61,000	2,885.00	175,985,000
ニフコ	7,200	3,700.00	26,640,000
ユニ・チャーム	120,600	1,184.00	142,790,400
協和キリン	23,800	2,066.00	49,170,800

武田薬品工業	171,700	4,151.00	712,726,700
アステラス製薬	169,300	1,488.50	252,003,050
塩野義製薬	64,000	2,172.00	139,008,000
日本新薬	5,200	4,028.00	20,945,600
中外製薬	60,400	7,251.00	437,960,400
エーザイ	25,200	4,365.00	109,998,000
ロート製薬	20,400	2,366.50	48,276,600
小野薬品工業	39,500	1,520.50	60,059,750
第一三共	153,500	3,646.00	559,661,000
大塚ホールディングス	47,700	7,325.00	349,402,500
ペプチドリーム	9,600	2,327.50	22,344,000
出光興産	90,200	1,040.00	93,808,000
E N E O Sホールディングス	327,400	807.00	264,211,800
コスモエネルギーホールディングス	6,400	6,699.00	42,873,600
横浜ゴム	10,000	3,530.00	35,300,000
TOYO TIRE	11,300	2,471.00	27,922,300
ブリヂストン	56,500	5,711.00	322,671,500
住友ゴム工業	19,300	1,734.50	33,475,850
A G C	18,800	4,364.00	82,043,200
東海カーボン	18,200	901.20	16,401,840
T O T O	14,000	3,658.00	51,212,000
日本碍子	21,400	1,903.00	40,724,200
日本特殊陶業	15,800	4,603.00	72,727,400
M A R U W A	800	40,550.00	32,440,000
フジインコーポレーテッド	5,100	2,105.00	10,735,500
ニチアス	4,900	4,558.00	22,334,200
日本製鉄	100,500	3,379.00	339,589,500
神戸製鋼所	40,800	1,711.50	69,829,200
J F Eホールディングス	59,800	1,754.00	104,889,200
東京製鐵	5,800	1,563.00	9,065,400
大和工業	3,800	8,096.00	30,764,800
丸一鋼管	6,200	3,530.00	21,886,000
大同特殊鋼	12,800	1,188.50	15,212,800
日本冶金工業	1,400	4,250.00	5,950,000
三井金属鉱業	5,000	4,532.00	22,660,000
住友金属鉱山	25,100	3,445.00	86,469,500
D O W Aホールディングス	4,900	4,599.00	22,535,100
住友電気工業	68,600	2,907.00	199,420,200

フジクラ	21,300	6,932.00	147,651,600
AREホールディングス	7,600	1,890.00	14,364,000
SUMCO	38,600	1,131.00	43,656,600
三和ホールディングス	20,200	4,835.00	97,667,000
リンナイ	9,700	3,312.00	32,126,400
日本発條	17,900	1,787.00	31,987,300
三浦工業	8,300	3,339.00	27,713,700
ツガミ	4,200	1,641.00	6,892,200
アマダ	27,000	1,562.00	42,174,000
DMG森精機	12,500	2,437.00	30,462,500
ディスコ	9,400	45,380.00	426,572,000
野村マイクロ・サイエンス	2,700	2,905.00	7,843,500
ナブテスコ	12,500	2,385.50	29,818,750
SMC	5,800	54,280.00	314,824,000
小松製作所	95,800	4,708.00	451,026,400
住友重機械工業	11,700	2,948.00	34,491,600
日立建機	7,900	3,787.00	29,917,300
TOWA	6,600	1,847.00	12,190,200
ローツェ	10,000	1,657.00	16,570,000
クボタ	99,400	1,881.50	187,021,100
荏原製作所	39,900	2,505.00	99,949,500
ダイキン工業	25,300	16,465.00	416,564,500
オルガノ	2,500	7,140.00	17,850,000
ダイフク	32,800	3,155.00	103,484,000
SANKYO	22,500	2,125.00	47,812,500
竹内製作所	3,600	5,460.00	19,656,000
セガサミーホールディングス	17,700	3,035.00	53,719,500
ホシザキ	12,800	5,801.00	74,252,800
マキタ	24,200	4,749.00	114,925,800
三菱重工業	339,900	2,114.50	718,718,550
イビデン	10,400	3,736.00	38,854,400
ブラザー工業	26,500	2,669.50	70,741,750
ミネベアミツミ	33,800	2,388.50	80,731,300
日立製作所	232,800	4,312.00	1,003,833,600
三菱電機	197,700	2,385.50	471,613,350
富士電機	11,800	6,870.00	81,066,000
安川電機	21,100	4,187.00	88,345,700
JVCケンウッド	15,700	1,463.00	22,969,100

オムロン	17,800	4,515.00	80,367,000
MC J	7,900	1,327.00	10,483,300
日本電気	27,500	15,390.00	423,225,000
富士通	178,800	3,079.00	550,525,200
ルネサスエレクトロニクス	148,100	2,435.00	360,623,500
セイコーエプソン	24,900	2,500.50	62,262,450
アルバック	4,400	5,769.00	25,383,600
パナソニック ホールディングス	229,600	1,832.00	420,627,200
ソニーグループ	282,600	3,705.00	1,047,033,000
TDK	167,900	1,721.00	288,955,900
メイコー	2,000	8,690.00	17,380,000
ヒロセ電機	2,800	18,310.00	51,268,000
横河電機	21,700	2,992.00	64,926,400
アズビル	54,000	1,180.50	63,747,000
日本光電工業	16,100	2,299.50	37,021,950
堀場製作所	3,700	9,741.00	36,041,700
アドバンテスト	60,600	9,087.00	550,672,200
キーエンス	11,100	63,520.00	705,072,000
シスメックス	49,800	2,736.00	136,252,800
フェローテックホールディングス	6,200	2,590.00	16,058,000
レーザーテック	7,500	15,605.00	117,037,500
日本電子	4,400	5,449.00	23,975,600
ファナック	93,100	4,419.00	411,408,900
ローム	35,600	1,577.00	56,141,200
浜松ホトニクス	31,600	1,750.50	55,315,800
三井ハイテック	8,500	847.00	7,199,500
新光電気工業	7,000	5,872.00	41,104,000
京セラ	119,600	1,735.50	207,565,800
太陽誘電	8,400	2,639.00	22,167,600
村田製作所	169,500	2,692.00	456,294,000
小糸製作所	20,400	1,997.50	40,749,000
S C R E E Nホールディングス	8,000	10,185.00	81,480,000
キヤノン	96,000	5,184.00	497,664,000
東京エレクトロン	22,400	24,825.00	556,080,000
トヨタ紡織	8,300	1,994.00	16,550,200
豊田自動織機	16,400	12,610.00	206,804,000
デンソー	188,500	1,951.50	367,857,750
三菱ロジスネクスト	3,100	1,944.00	6,026,400

いすゞ自動車	59,400	2,010.50	119,423,700
トヨタ自動車	237,800	2,804.50	666,910,100
三菱自動車工業	76,700	397.60	30,495,920
カヤバ	3,600	2,993.00	10,774,800
アイシン	41,700	1,771.50	73,871,550
マツダ	59,100	1,055.00	62,350,500
本田技研工業	454,900	1,469.50	668,475,550
スズキ	155,500	1,933.50	300,659,250
S U B A R U	58,000	2,949.50	171,071,000
ヤマハ発動機	81,200	1,199.50	97,399,400
豊田合成	5,500	2,735.50	15,045,250
シマノ	8,400	20,525.00	172,410,000
テルモ	128,700	2,795.50	359,780,850
島津製作所	27,700	4,007.00	110,993,900
ナカニシ	8,200	2,388.00	19,581,600
東京精密	4,000	8,932.00	35,728,000
オリンパス	110,200	2,275.00	250,705,000
H O Y A	37,600	19,265.00	724,364,000
ノーリツ鋼機	1,900	4,765.00	9,053,500
朝日インテック	24,000	2,546.50	61,116,000
シチズン時計	18,100	898.00	16,253,800
三井松島ホールディングス	1,600	4,330.00	6,928,000
フルヤ金属	1,900	3,050.00	5,795,000
バンダイナムコホールディングス	52,200	4,849.00	253,117,800
パイロットコーポレーション	3,100	4,493.00	13,928,300
大日本印刷	39,900	2,193.00	87,500,700
アシックス	71,000	3,518.00	249,778,000
ローランド	1,400	3,895.00	5,453,000
ヤマハ	36,000	1,110.00	39,960,000
任天堂	91,500	11,245.00	1,028,917,500
中部電力	70,900	1,563.00	110,816,700
関西電力	93,800	1,702.00	159,647,600
九州電力	45,300	1,294.50	58,640,850
電源開発	14,500	2,498.00	36,221,000
東京瓦斯	36,400	4,491.00	163,472,400
大阪瓦斯	38,300	3,157.00	120,913,100
S B S ホールディングス	1,700	2,545.00	4,326,500
京浜急行電鉄	24,300	1,411.00	34,287,300

小田急電鉄	32,500	1,484.50	48,246,250
東海旅客鉄道	74,100	2,815.50	208,628,550
西武ホールディングス	20,900	3,192.00	66,712,800
近鉄グループホールディングス	19,600	3,282.00	64,327,200
ヤマトホールディングス	23,800	1,925.00	45,815,000
山九	4,800	5,841.00	28,036,800
センコーグループホールディングス	10,000	1,428.00	14,280,000
AZ-COM丸和ホールディングス	4,700	1,268.00	5,959,600
SGホールディングス	32,900	1,442.00	47,441,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	20,700	2,504.50	51,843,150
日本郵船	39,800	5,315.00	211,537,000
商船三井	36,500	5,524.00	201,626,000
川崎汽船	43,700	2,159.50	94,370,150
NSユナイテッド海運	1,000	4,115.00	4,115,000
飯野海運	7,200	1,070.00	7,704,000
三井倉庫ホールディングス	1,800	7,570.00	13,626,000
NECネットエスアイ	7,700	3,305.00	25,448,500
システナ	30,100	358.00	10,775,800
日鉄ソリューションズ	6,700	4,296.00	28,783,200
TIS	20,800	3,769.00	78,395,200
コーエーテクモホールディングス	12,400	2,062.00	25,568,800
ネクソン	42,400	2,100.50	89,061,200
SHIFT	19,500	1,479.50	28,850,250
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,900	3,429.00	16,802,100
GMOペイメントゲートウェイ	4,500	8,454.00	38,043,000
インターネットイニシアティブ	9,400	2,718.00	25,549,200
ラクス	9,300	2,111.50	19,636,950
ビジョナル	2,300	7,530.00	17,319,000
野村総合研究所	41,800	5,355.00	223,839,000
オービック	35,800	4,521.00	161,851,800
ジャストシステム	2,800	3,455.00	9,674,000
LINEヤフー	308,700	493.70	152,405,190
トレンドマイクロ	10,100	11,595.00	117,109,500
日本オラクル	3,800	14,440.00	54,872,000
フューチャー	4,900	1,883.00	9,226,700
大塚商会	22,300	3,607.00	80,436,100
電通総研	1,900	6,650.00	12,635,000

東映アニメーション	7,600	3,420.00	25,992,000
ネットワンシステムズ	2,300	4,482.00	10,308,600
B I P R O G Y	5,900	4,360.00	25,724,000
U-NEXT HOLDINGS	6,600	1,812.00	11,959,200
日本電信電話	5,154,500	146.90	757,196,050
K D D I	141,900	5,000.00	709,500,000
ソフトバンク	3,087,800	208.50	643,806,300
光通信	2,200	37,830.00	83,226,000
GMOインターネットグループ	6,400	3,033.00	19,411,200
東宝	12,100	7,152.00	86,539,200
N T T データグループ	50,500	3,027.00	152,863,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,700	7,009.00	67,987,300
カプコン	38,400	3,825.00	146,880,000
S C S K	15,800	3,574.00	56,469,200
N S D	7,000	3,552.00	24,864,000
コナミグループ	7,200	18,725.00	134,820,000
東京エレクトロン デバイス	2,100	3,160.00	6,636,000
双日	22,700	3,298.00	74,864,600
神戸物産	16,100	3,303.00	53,178,300
ダイワボウホールディングス	9,200	2,775.50	25,534,600
マクニカホールディングス	14,700	1,817.00	26,709,900
シップヘルスケアホールディングス	7,500	2,048.00	15,360,000
メディパルホールディングス	21,100	2,256.50	47,612,150
I D O M	5,800	1,148.00	6,658,400
伊藤忠商事	99,600	6,501.00	647,499,600
丸紅	167,300	2,315.00	387,299,500
豊田通商	61,100	2,496.50	152,536,150
兼松	8,700	2,498.00	21,732,600
三井物産	210,200	2,794.00	587,298,800
住友商事	122,000	3,335.00	406,870,000
三菱商事	239,200	2,462.00	588,910,400
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	5,163.00	20,652,000
阪和興業	3,600	4,955.00	17,838,000
岩谷産業	18,800	1,601.50	30,108,200
稲畑産業	5,500	3,135.00	17,242,500
伊藤忠エネクス	4,900	1,620.00	7,938,000
サンリオ	16,500	6,088.00	100,452,000
加賀電子	3,600	2,812.00	10,123,200

ミスミグループ本社	30,800	2,351.00	72,410,800
エービーシー・マート	9,100	3,088.00	28,100,800
アスクル	5,000	1,653.00	8,265,000
アダストリア	2,500	3,130.00	7,825,000
日本マクドナルドホールディングス	12,400	6,060.00	75,144,000
パルグループホールディングス	4,100	3,295.00	13,509,500
セリア	6,100	2,536.00	15,469,600
MonotaRO	29,500	2,817.00	83,101,500
マツキヨココカラ&カンパニー	35,900	2,170.00	77,903,000
ZOZO	15,100	4,940.00	74,594,000
ウエルシアホールディングス	10,800	2,230.50	24,089,400
クリエイイトSDホールディングス	3,300	2,832.00	9,345,600
ネクステージ	4,600	1,539.00	7,079,400
コスモス薬品	4,000	6,890.00	27,560,000
セブン&アイ・ホールディングス	224,900	2,415.00	543,133,500
ツルハホールディングス	3,600	9,218.00	33,184,800
クスリのアオキホールディングス	5,300	3,276.00	17,362,800
FOOD & LIFE COMPANIES	11,100	4,284.00	47,552,400
ノジマ	6,400	2,270.00	14,528,000
良品計画	24,800	4,013.00	99,522,400
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	41,100	4,162.00	171,058,200
ゼンショーホールディングス	11,600	7,777.00	90,213,200
ワークマン	2,300	3,980.00	9,154,000
スギホールディングス	10,900	2,682.00	29,233,800
日本瓦斯	9,700	2,229.50	21,626,150
ライフコーポレーション	2,100	3,660.00	7,686,000
しまむら	4,900	9,060.00	44,394,000
丸井グループ	13,800	2,590.50	35,748,900
ヤオコー	2,500	8,992.00	22,480,000
ニトリホールディングス	7,400	16,285.00	120,509,000
ファーストリテイリング	11,400	49,620.00	565,668,000
サンドラッグ	7,000	4,111.00	28,777,000
めぶきフィナンシャルグループ	89,700	631.20	56,618,640
コンコルディア・フィナンシャルグループ	100,800	865.70	87,262,560
三菱UFJフィナンシャル・グループ	476,700	1,943.50	926,466,450
りそなホールディングス	234,100	1,166.00	272,960,600

三井住友トラストグループ	67,500	3,876.00	261,630,000
三井住友フィナンシャルグループ	217,300	3,803.00	826,391,900
千葉銀行	58,700	1,309.50	76,867,650
ふくおかフィナンシャルグループ	16,900	3,958.00	66,890,200
セブン銀行	60,700	305.90	18,568,130
みずほフィナンシャルグループ	233,000	4,324.00	1,007,492,000
F P G	6,900	2,508.00	17,305,200
S B I ホールディングス	30,500	4,321.00	131,790,500
大和証券グループ本社	135,500	1,061.00	143,765,500
野村ホールディングス	318,700	1,031.50	328,739,050
マネックスグループ	19,600	843.00	16,522,800
S O M P O ホールディングス	92,700	4,345.00	402,781,500
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	138,900	3,264.00	453,369,600
第一生命ホールディングス	89,100	4,353.00	387,852,300
東京海上ホールディングス	130,300	5,047.00	657,624,100
全国保証	5,100	5,475.00	27,922,500
クレディセゾン	12,300	3,537.00	43,505,100
芙蓉総合リース	1,800	11,235.00	20,223,000
みずほリース	14,200	1,046.00	14,853,200
東京センチュリー	14,500	1,498.50	21,728,250
イオンフィナンシャルサービス	11,100	1,263.50	14,024,850
アコム	45,100	396.90	17,900,190
ジャックス	2,000	3,895.00	7,790,000
オリックス	113,700	3,138.00	356,790,600
三菱HCキャピタル	95,000	1,021.50	97,042,500
日本取引所グループ	112,700	1,610.00	181,447,000
大東建託	6,400	15,595.00	99,808,000
ヒューリック	45,100	1,380.00	62,238,000
野村不動産ホールディングス	11,900	4,179.00	49,730,100
オープンハウスグループ	7,100	5,406.00	38,382,600
東急不動産ホールディングス	58,200	1,000.00	58,200,000
飯田グループホールディングス	18,500	2,305.00	42,642,500
ケイアイスター不動産	1,000	4,775.00	4,775,000
三井不動産	260,300	1,319.00	343,335,700
三菱地所	108,000	2,214.00	239,112,000
東京建物	16,900	2,436.00	41,168,400
住友不動産	30,800	5,204.00	160,283,200
スターツコーポレーション	2,700	4,055.00	10,948,500

カチタス	5,000	2,182.00	10,910,000
ジェイエシーリクルートメント	7,300	790.00	5,767,000
日本M&Aセンターホールディングス	29,100	601.00	17,489,100
UTグループ	2,600	2,396.00	6,229,600
パソナグループ	2,300	2,003.00	4,606,900
エス・エム・エス	7,000	1,321.00	9,247,000
パーソルホールディングス	184,600	225.20	41,571,920
総合警備保障	33,700	1,076.00	36,261,200
カカコム	13,100	2,503.00	32,789,300
ディップ	3,100	2,243.00	6,953,300
エムスリー	39,900	1,790.00	71,421,000
博報堂DYホールディングス	22,400	1,100.00	24,640,000
オリエンタルランド	116,600	3,219.00	375,335,400
ラウンドワン	19,100	1,325.00	25,307,500
ビー・エム・エル	2,400	2,872.00	6,892,800
ユー・エス・エス	40,700	1,384.00	56,328,800
サイバーエージェント	44,700	1,182.50	52,857,750
テクノプロ・ホールディングス	11,700	3,163.00	37,007,100
ジャパンマテリアル	5,900	1,600.00	9,440,000
リクルートホールディングス	98,500	10,030.00	987,955,000
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,253.00	3,383,100
ベイカレント	14,800	6,963.00	103,052,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,600	3,075.00	20,295,000
アンビスホールディングス	4,300	718.00	3,087,400
トランス・コスモス	2,400	3,205.00	7,692,000
セコム	40,300	5,222.00	210,446,600
メイテックグループホールディングス	6,900	3,015.00	20,803,500
イオンディライト	2,200	4,035.00	8,877,000
合 計	25,448,700		52,097,379,740

## 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。