

# 2026年2月期 決算短信 (2025年8月16日～2026年2月15日)

2026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 八木 正展  
 問合せ先責任者 プロダクトガバナンス部 組成開示グループ 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8692  
 有価証券報告書提出予定日 2026年5月15日  
 分配金支払開始予定日 2026年3月26日

## I ファンドの運用状況

### 1. 2026年2月期の運用状況 (2025年8月16日～2026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	%
2026年2月期	69,535	(97.9)	1,511	(2.1)	71,047	(100.0)
2025年8月期	58,271	(96.6)	2,041	(3.4)	60,313	(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
2026年2月期	2,132	110	211	2,030
2025年8月期	2,127	110	104	2,132

#### (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
2026年2月期	71,997	949	71,047	34,986
2025年8月期	61,238	924	60,313	28,287

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2026年2月期	312
2025年8月期	313

(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 13 期 2025 年 8 月 15 日現在	第 14 期 2026 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	2,472,122,900	1,996,976,999
株式	58,271,586,370	69,535,892,050
派生商品評価勘定	189,939,448	161,388,040
未収入金	62,179,004	67,777,500
未収配当金	95,857,892	101,538,115
未収利息	32,391	119,350
差入委託証拠金	146,510,943	133,949,513
流動資産合計	61,238,228,948	71,997,641,567
資産合計	61,238,228,948	71,997,641,567
負債の部		
流動負債		
前受金	206,540,500	257,211,200
未払収益分配金	667,387,677	633,598,680
未払受託者報酬	8,573,420	10,047,222
未払委託者報酬	26,638,805	31,218,065
その他未払費用	15,656,504	17,854,903
流動負債合計	924,796,906	949,930,070
負債合計	924,796,906	949,930,070
純資産の部		
元本等		
元本	29,951,420,763	28,526,155,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	30,362,011,279	42,521,555,542
(分配準備積立金)	1,139,721	1,390,851
元本等合計	60,313,432,042	71,047,711,497
純資産合計	60,313,432,042	71,047,711,497
負債純資産合計	61,238,228,948	71,997,641,567

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第13期 自 2025年2月16日 至 2025年8月15日	第14期 自 2025年8月16日 至 2026年2月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	713,383,468	688,682,759
受取利息	4,376,681	4,252,459
有価証券売買等損益	6,993,537,464	13,548,776,148
派生商品取引等損益	306,028,822	372,176,428
その他収益	1,175	34,782
営業収益合計	8,017,327,610	14,613,922,576
営業費用		
受託者報酬	8,573,420	10,047,222
委託者報酬	26,638,805	31,218,065
その他費用	15,656,504	17,854,903
営業費用合計	50,868,729	59,120,190
営業利益又は営業損失 (△)	7,966,458,881	14,554,802,386
経常利益又は経常損失 (△)	7,966,458,881	14,554,802,386
当期純利益又は当期純損失 (△)	7,966,458,881	14,554,802,386
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 (△)	23,716,944,221	30,362,011,279
剰余金増加額又は欠損金減少額	801,332,872	2,163,514,092
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	801,332,872	2,163,514,092
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,455,337,018	3,925,173,535
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,455,337,018	3,925,173,535
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	667,387,677	633,598,680
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	30,362,011,279	42,521,555,542

(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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>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)

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。

(貸借対照表に関する注記)

項目		第13期 2025年8月15日現在	第14期 2026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	29,879,148,948円	29,951,420,763円
	期中追加設定元本額	1,545,464,987円	1,545,745,927円
	期中一部交換元本額	1,473,193,172円	2,971,010,735円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,132,229口	2,030,765口
3.	1口当たり純資産額	28,287円	34,986円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 自2025年2月16日 至2025年8月15日		第14期 自2025年8月16日 至2026年2月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	717,761,324円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	1,634,803円	B. 分配準備積立金額	1,139,721円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	719,396,127円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	694,109,721円
	D. 経費	50,868,729円	D. 経費	59,120,190円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	668,527,398円	E. 収益分配可能額 (C-D)	634,989,531円
	F. 収益分配金	667,387,677円	F. 収益分配金	633,598,680円
	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,139,721円	G. 次期繰越金(分配準備 積立金) (E-F)	1,390,851円
	H. 口数	2,132,229口	H. 口数	2,030,765口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	313円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	312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13期 自 2025年2月16日 至 2025年8月15日	第14期 自 2025年8月16日 至 2026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、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 2025年8月15日現在	第14期 2026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13期(自 2025年2月16日 至 2025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	6,742,366,529
合計	6,742,366,529

第14期(自 2025年8月16日 至 2026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	12,692,865,912
合計	12,692,865,912

(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13期 (2025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	1,814,486,800	—	2,004,442,000	189,955,200
合計		1,814,486,800	—	2,004,442,000	189,955,200

第14期 (2026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	1,321,027,500	—	1,482,425,000	161,397,500
合計		1,321,027,500	—	1,482,425,000	161,397,500

(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	
ニッスイ	23,500	1,538.00	36,143,000	
I N P E X	86,300	3,473.00	299,719,900	
石油資源開発	15,300	2,236.00	34,210,800	
ショーボンドホールディングス	13,400	1,394.00	18,679,600	
タマホーム	1,600	3,860.00	6,176,000	
安藤・間	13,800	2,085.50	28,779,900	
コムシスホールディングス	9,100	5,303.00	48,257,300	
大成建設	13,500	17,325.00	233,887,500	
大林組	58,100	4,196.00	243,787,600	
長谷工コーポレーション	16,800	3,277.00	55,053,600	
鹿島建設	39,700	7,164.00	284,410,800	
住友林業	46,700	1,785.50	83,382,850	
大和ハウス工業	49,800	5,589.00	278,332,200	
積水ハウス	54,400	3,742.00	203,564,800	
関電工	10,000	6,342.00	63,420,000	
エクシオグループ	17,900	2,775.00	49,672,500	
クラフティア	4,000	9,157.00	36,628,000	
高砂熱学工業	9,600	5,149.00	49,430,400	
インフロニア・ホールディングス	19,000	2,562.50	48,687,500	
森永製菓	7,600	2,751.00	20,907,600	
寿スピリッツ	9,600	1,979.00	18,998,400	
カルビー	8,400	3,075.00	25,830,000	
森永乳業	6,500	4,485.00	29,152,500	
ヤクルト本社	24,900	2,676.00	66,632,400	
明治ホールディングス	25,100	3,861.00	96,911,100	
アサヒグループホールディングス	135,500	1,696.50	229,875,750	
キリンホールディングス	75,100	2,591.50	194,621,650	
宝ホールディングス	14,900	1,587.50	23,653,750	
サントリー食品インターナショナル	12,600	4,847.00	61,072,200	
キッコーマン	59,800	1,491.00	89,161,800	
味の素	89,500	4,436.00	397,022,000	
カゴメ	9,700	2,868.00	27,819,600	

ニチレイ	14,700	2,058.50	30,259,950
東洋水産	8,300	11,945.00	99,143,500
日清食品ホールディングス	20,400	3,317.00	67,666,800
日本たばこ産業	109,600	6,087.00	667,135,200
東レ	123,600	1,232.00	152,275,200
ゴールドウイン	10,100	2,445.00	24,694,500
王子ホールディングス	69,500	978.00	67,971,000
クラレ	24,500	1,753.00	42,948,500
レゾナック・ホールディングス	17,700	10,140.00	179,478,000
日産化学	9,400	6,504.00	61,137,600
東ソー	26,700	2,631.00	70,247,700
信越化学工業	162,600	5,499.00	894,137,400
エア・ウォーター	17,600	2,463.50	43,357,600
日本酸素ホールディングス	20,900	5,430.00	113,487,000
三菱瓦斯化学	13,000	4,475.00	58,175,000
三井化学	32,900	2,366.00	77,841,400
東京応化工業	8,900	8,326.00	74,101,400
三菱ケミカルグループ	128,400	1,110.50	142,588,200
ダイセル	20,900	1,603.50	33,513,150
住友ベークライト	6,500	5,659.00	36,783,500
積水化学工業	39,200	2,922.50	114,562,000
ADEKA	6,500	4,459.00	28,983,500
日油	21,500	3,104.00	66,736,000
花王	43,500	6,760.00	294,060,000
日本ペイントホールディングス	97,500	1,074.50	104,763,750
関西ペイント	14,600	2,769.00	40,427,400
太陽ホールディングス	8,700	5,539.00	48,189,300
富士フイルムホールディングス	110,900	3,033.00	336,359,700
ライオン	21,200	1,832.50	38,849,000
小林製薬	4,900	5,506.00	26,979,400
デクセリアルズ	16,000	2,236.50	35,784,000
日東電工	55,900	3,550.00	198,445,000
ニフコ	6,800	4,992.00	33,945,600
ユニ・チャーム	114,900	1,043.50	119,898,150
協和キリン	21,600	2,691.00	58,125,600
アステラス製薬	161,200	2,510.50	404,692,600
塩野義製薬	67,200	3,536.00	237,619,200
日本新薬	4,900	4,978.00	24,392,200

中外製薬	57,600	9,280.00	534,528,000
エーザイ	24,000	5,066.00	121,584,000
ロート製薬	19,400	2,514.00	48,771,600
小野薬品工業	41,100	2,536.50	104,250,150
第一三共	168,700	2,937.50	495,556,250
大塚ホールディングス	41,000	10,585.00	433,985,000
ペプチドリーム	9,100	1,518.50	13,818,350
出光興産	79,600	1,384.00	110,166,400
E N E O Sホールディングス	259,700	1,425.50	370,202,350
コスモエネルギーホールディングス	10,100	4,572.00	46,177,200
横浜ゴム	10,200	6,767.00	69,023,400
TOYO TIRE	11,800	4,418.00	52,132,400
ブリヂストン	107,600	3,817.00	410,709,200
TOTO	11,400	5,629.00	64,170,600
日本碍子	20,400	4,131.00	84,272,400
日本特殊陶業	15,100	7,099.00	107,194,900
MARUWA	800	52,580.00	42,064,000
ニチアス	5,100	7,981.00	40,703,100
日本製鉄	515,600	648.00	334,108,800
神戸製鋼所	38,800	2,236.50	86,776,200
J F Eホールディングス	61,400	2,287.00	140,421,800
東京製鐵	5,500	1,546.00	8,503,000
大和工業	3,600	11,430.00	41,148,000
大同特殊鋼	12,200	2,061.00	25,144,200
日本冶金工業	1,300	4,805.00	6,246,500
三井金属	4,700	26,540.00	124,738,000
住友金属鉱山	25,900	9,886.00	256,047,400
DOWAホールディングス	5,100	9,461.00	48,251,100
住友電気工業	65,300	8,593.00	561,122,900
フジクラ	24,400	21,795.00	531,798,000
SWCC	2,700	13,930.00	37,611,000
AREホールディングス	7,200	3,845.00	27,684,000
SUMCO	36,600	1,526.00	55,851,600
三和ホールディングス	18,100	3,912.00	70,807,200
リンナイ	9,400	4,021.00	37,797,400
日本発條	14,200	3,113.00	44,204,600
三浦工業	8,100	3,073.00	24,891,300
ツガミ	4,000	3,690.00	14,760,000

アマダ	25,800	2,475.00	63,855,000
DMG森精機	12,600	2,939.00	37,031,400
ディスコ	8,900	73,060.00	650,234,000
野村マイクロ・サイエンス	3,300	3,585.00	11,830,500
三井海洋開発	4,600	14,355.00	66,033,000
SMC	5,200	70,840.00	368,368,000
小松製作所	89,300	7,713.00	688,770,900
日立建機	7,500	6,564.00	49,230,000
ローツェ	10,900	3,399.00	37,049,100
クボタ	93,600	3,137.00	293,623,200
荏原製作所	37,900	5,303.00	200,983,700
ダイキン工業	24,100	19,370.00	466,817,000
オルガノ	2,500	15,635.00	39,087,500
ダイフク	31,200	6,311.00	196,903,200
SANKYO	19,500	2,210.50	43,104,750
竹内製作所	3,400	7,370.00	25,058,000
アマノ	5,200	4,004.00	20,820,800
セガサミーホールディングス	15,300	2,374.50	36,329,850
ホシザキ	12,100	5,601.00	67,772,100
マキタ	23,000	5,930.00	136,390,000
三井E&S	9,200	7,292.00	67,086,400
カナデビア	15,300	1,088.00	16,646,400
三菱重工業	230,200	5,031.00	1,158,136,200
I H I	96,600	4,165.00	402,339,000
イビデン	23,100	8,640.00	199,584,000
ブラザー工業	23,000	3,107.00	71,461,000
ミネベアミツミ	32,200	3,471.00	111,766,200
日立製作所	184,400	5,209.00	960,539,600
三菱電機	202,800	5,590.00	1,133,652,000
富士電機	13,300	11,265.00	149,824,500
安川電機	20,000	5,224.00	104,480,000
芝浦メカトロニクス	1,100	25,510.00	28,061,000
JVCケンウッド	14,900	1,245.00	18,550,500
オムロン	15,700	4,743.00	74,465,100
MCJ	7,500	2,266.00	16,995,000
日本電気	121,600	4,099.00	498,438,400
富士通	170,200	3,828.00	651,525,600
サンケン電気	1,900	8,192.00	15,564,800

ルネサスエレクトロニクス	179,500	2,940.00	527,730,000
セイコーエプソン	23,600	2,094.50	49,430,200
アルバック	4,700	10,485.00	49,279,500
パナソニック ホールディングス	218,500	2,430.00	530,955,000
ソニーグループ	207,900	3,552.00	738,460,800
TDK	159,800	2,212.00	353,477,600
メイコー	1,600	19,490.00	31,184,000
ヒロセ電機	2,800	20,665.00	57,862,000
横河電機	20,600	4,984.00	102,670,400
アズビル	44,600	1,283.00	57,221,800
日本光電工業	15,500	1,696.00	26,288,000
堀場製作所	3,500	19,500.00	68,250,000
アドバンテスト	57,800	27,130.00	1,568,114,000
キーエンス	13,400	55,590.00	744,906,000
シスメックス	47,400	1,301.00	61,667,400
レーザーテック	7,800	30,860.00	240,708,000
日本電子	4,200	6,300.00	26,460,000
ファナック	87,500	6,445.00	563,937,500
浜松ホトニクス	30,500	1,695.50	51,712,750
三井ハイテック	8,300	814.00	6,756,200
村田製作所	174,900	3,259.00	569,999,100
小糸製作所	19,400	2,662.00	51,642,800
SCREENホールディングス	6,500	20,830.00	135,395,000
キャノン	82,200	4,824.00	396,532,800
東京エレクトロン	28,100	41,990.00	1,179,919,000
トヨタ紡織	9,000	3,236.00	29,124,000
豊田自動織機	15,700	20,450.00	321,065,000
デンソー	179,500	2,234.00	401,003,000
川崎重工業	13,800	17,710.00	244,398,000
名村造船所	5,700	5,430.00	30,951,000
三菱ロジスネクスト	2,800	1,549.00	4,337,200
いすゞ自動車	48,800	2,817.50	137,494,000
トヨタ自動車	311,100	3,774.00	1,174,091,400
三菱自動車工業	72,700	444.00	32,278,800
アイシン	46,900	2,919.50	136,924,550
マツダ	60,600	1,363.00	82,597,800
本田技研工業	398,100	1,601.00	637,358,100
スズキ	134,600	2,382.00	320,617,200

SUBARU	55,200	3,165.00	174,708,000
ヤマハ発動機	90,800	1,185.00	107,598,000
豊田合成	6,100	5,093.00	31,067,300
シマノ	7,900	16,755.00	132,364,500
テルモ	121,800	2,010.50	244,878,900
島津製作所	24,400	4,153.00	101,333,200
ナカニシ	7,800	2,419.00	18,868,200
東京精密	3,500	16,630.00	58,205,000
オリンパス	99,200	1,852.50	183,768,000
タムロン	9,400	1,012.00	9,512,800
HOYA	35,300	28,140.00	993,342,000
ノーリツ鋼機	5,400	2,284.00	12,333,600
朝日インテック	22,900	2,600.00	59,540,000
シチズン時計	15,300	1,702.00	26,040,600
三井松島ホールディングス	3,100	1,540.00	4,774,000
バンダイナムコホールディングス	48,800	4,010.00	195,688,000
パイロットコーポレーション	2,900	4,960.00	14,384,000
タカラトミー	9,000	2,795.00	25,155,000
ヨネックス	6,500	3,625.00	23,562,500
大日本印刷	39,600	3,182.00	126,007,200
アシックス	70,500	4,396.00	309,918,000
ローランド	1,300	3,860.00	5,018,000
ヤマハ	30,900	1,190.50	36,786,450
任天堂	55,900	8,350.00	466,765,000
オカムラ	5,500	2,565.00	14,107,500
中部電力	67,400	2,618.00	176,453,200
関西電力	99,400	2,745.50	272,902,700
東北電力	48,300	1,198.50	57,887,550
四国電力	17,200	1,707.00	29,360,400
九州電力	43,200	1,863.00	80,481,600
北海道電力	19,400	1,090.00	21,146,000
電源開発	13,800	3,575.00	49,335,000
東京瓦斯	33,000	7,769.00	256,377,000
大阪瓦斯	32,600	6,640.00	216,464,000
SBSホールディングス	1,600	4,055.00	6,488,000
東急	47,000	1,964.50	92,331,500
京浜急行電鉄	20,900	1,529.00	31,956,100
小田急電鉄	27,800	1,721.00	47,843,800

京王電鉄	8,300	4,076.00	33,830,800
京成電鉄	32,000	1,298.00	41,536,000
西日本旅客鉄道	43,600	3,368.00	146,844,800
東海旅客鉄道	77,600	4,647.00	360,607,200
西武ホールディングス	19,800	4,457.00	88,248,600
近鉄グループホールディングス	19,500	3,376.00	65,832,000
ヤマトホールディングス	22,700	1,854.00	42,085,800
山九	4,200	9,549.00	40,105,800
センコーグループホールディングス	13,200	1,943.50	25,654,200
AZ-COM丸和ホールディングス	4,600	941.00	4,328,600
九州旅客鉄道	14,000	4,032.00	56,448,000
SGホールディングス	31,200	1,477.00	46,082,400
NIPPON EXPRESSホールディングス	18,300	3,651.00	66,813,300
日本郵船	38,700	5,049.00	195,396,300
商船三井	34,700	5,140.00	178,358,000
川崎汽船	39,500	2,318.50	91,580,750
NSユニテッド海運	900	7,480.00	6,732,000
飯野海運	6,800	1,601.00	10,886,800
日本航空	41,900	3,107.00	130,183,300
ANAホールディングス	49,800	3,345.00	166,581,000
三井倉庫ホールディングス	5,100	3,855.00	19,660,500
システナ	28,500	425.00	12,112,500
日鉄ソリューションズ	5,000	3,623.00	18,115,000
TIS	19,700	3,174.00	62,527,800
コーエーテクモホールディングス	11,900	1,542.00	18,349,800
ネクソン	45,100	3,148.00	141,974,800
SHIFT	16,500	623.60	10,289,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,588.00	9,834,400
GMOペイメントゲートウェイ	3,700	7,636.00	28,253,200
インターネットイニシアティブ	10,100	2,159.00	21,805,900
ラクス	17,600	765.00	13,464,000
ビジョナル	2,200	7,911.00	17,404,200
野村総合研究所	35,900	4,053.00	145,502,700
メルカリ	7,900	3,474.00	27,444,600
オービック	34,100	3,845.00	131,114,500
ジャストシステム	2,800	3,955.00	11,074,000
LINEヤフー	282,900	387.50	109,623,750

トレンドマイクロ	10,600	5,421.00	57,462,600
日本オラクル	3,600	9,288.00	33,436,800
フューチャー	4,600	1,750.00	8,050,000
大塚商会	21,200	3,023.00	64,087,600
電通総研	6,800	1,825.00	12,410,000
東映アニメーション	7,200	2,358.00	16,977,600
ANYCOLOR	2,500	4,180.00	10,450,000
B I P R O G Y	6,200	4,656.00	28,867,200
U-NEXT HOLDINGS	6,500	1,850.00	12,025,000
NTT	4,648,400	154.60	718,642,640
KDDI	258,300	2,694.00	695,860,200
ソフトバンク	2,948,700	214.10	631,316,670
光通信	1,800	42,470.00	76,446,000
GMOインターネットグループ	6,100	3,158.00	19,263,800
東宝	9,700	8,083.00	78,405,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,300	2,573.50	77,977,050
カプコン	36,500	3,057.00	111,580,500
NSD	6,600	2,906.50	19,182,900
コナミグループ	7,900	18,280.00	144,412,000
ソフトバンクグループ	286,500	4,390.00	1,257,735,000
東京エレクトロン デバイス	2,000	3,695.00	7,390,000
円谷フィールズホールディングス	3,100	1,627.00	5,043,700
双日	18,700	6,374.00	119,193,800
神戸物産	16,900	3,806.00	64,321,400
ダイワボウホールディングス	7,900	3,108.00	24,553,200
マクニカホールディングス	13,900	2,645.00	36,765,500
シップヘルスケアホールディングス	7,100	2,740.50	19,457,550
メディパルホールディングス	20,200	2,934.00	59,266,800
IDOM	5,600	1,505.00	8,428,000
伊藤忠商事	513,000	2,225.50	1,141,681,500
丸紅	148,100	6,033.00	893,487,300
豊田通商	58,100	6,858.00	398,449,800
兼松	16,500	2,229.50	36,786,750
三井物産	263,100	5,691.00	1,497,302,100
住友商事	116,200	6,627.00	770,057,400
三菱商事	289,700	5,058.00	1,465,302,600
キャノンマーケティングジャパン	4,600	6,818.00	31,362,800
阪和興業	3,400	8,750.00	29,750,000

岩谷産業	18,000	1,839.50	33,111,000
稲畑産業	4,600	4,110.00	18,906,000
サンゲツ	4,800	3,225.00	15,480,000
伊藤忠エネクス	4,600	1,947.00	8,956,200
サンリオ	19,400	5,464.00	106,001,600
加賀電子	3,400	4,095.00	13,923,000
ミスミグループ本社	27,300	3,033.00	82,800,900
エービーシー・マート	10,100	2,630.00	26,563,000
アスクル	4,600	1,354.00	6,228,400
アンドエスティHD	2,600	2,985.00	7,761,000
日本マクドナルドホールディングス	12,000	7,070.00	84,840,000
パルグループホールディングス	8,000	1,651.00	13,208,000
MonotaRO	28,100	2,074.50	58,293,450
J. フロント リテイリング	22,200	2,670.00	59,274,000
マツキヨココカラ&カンパニー	34,100	2,749.00	93,740,900
ZOZO	30,500	1,097.50	33,473,750
クリエイトSDホールディングス	3,100	3,380.00	10,478,000
ネクステージ	4,600	3,485.00	16,031,000
コスモス薬品	3,300	7,538.00	24,875,400
セブン&アイ・ホールディングス	214,100	2,375.00	508,487,500
ツルハホールディングス	30,400	2,731.00	83,022,400
クスリのアオキホールディングス	5,000	4,347.00	21,735,000
FOOD & LIFE COMPANIES	11,100	9,340.00	103,674,000
ブルーゾーンホールディングス	2,400	9,413.00	22,591,200
ノジマ	18,600	1,085.00	20,181,000
良品計画	42,200	3,500.00	147,700,000
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	195,800	977.30	191,355,340
ゼンショーホールディングス	10,000	9,705.00	97,050,000
ワークマン	2,800	6,770.00	18,956,000
スギホールディングス	10,300	3,732.00	38,439,600
日本瓦斯	9,200	2,997.50	27,577,000
ライフコーポレーション	4,000	2,748.00	10,992,000
しまむら	4,600	11,050.00	50,830,000
丸井グループ	11,300	3,164.00	35,753,200
ニトリホールディングス	31,400	3,058.00	96,021,200
ファーストリテイリング	13,100	69,150.00	905,865,000
サンドラッグ	5,700	4,188.00	23,871,600

めぶきフィナンシャルグループ	84,400	1,315.00	110,986,000
横浜フィナンシャルグループ	94,200	1,681.00	158,350,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	384,400	3,003.00	1,154,353,200
りそなホールディングス	221,400	2,142.00	474,238,800
三井住友トラストグループ	62,900	5,740.00	361,046,000
三井住友フィナンシャルグループ	226,700	6,062.00	1,374,255,400
千葉銀行	55,900	2,395.00	133,880,500
ふくおかフィナンシャルグループ	14,400	7,130.00	102,672,000
セブン銀行	58,100	301.00	17,488,100
みずほフィナンシャルグループ	206,100	7,681.00	1,583,054,100
FPG	5,700	2,038.00	11,616,600
SBIホールディングス	63,500	3,489.00	221,551,500
大和証券グループ本社	129,000	1,653.50	213,301,500
野村ホールディングス	302,800	1,442.00	436,637,600
SOMPOホールディングス	89,600	5,966.00	534,553,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	112,500	4,190.00	471,375,000
ソニーフィナンシャルグループ	208,000	156.20	32,489,600
第一生命ホールディングス	355,000	1,488.00	528,240,000
東京海上ホールディングス	136,700	6,297.00	860,799,900
全国保証	9,800	3,159.00	30,958,200
クレディセゾン	10,100	4,449.00	44,934,900
芙蓉総合リース	5,100	4,529.00	23,097,900
みずほリース	13,700	1,490.00	20,413,000
東京センチュリー	13,800	2,233.50	30,822,300
アイフル	30,000	526.00	15,780,000
アコム	32,300	510.10	16,476,230
ジャックス	1,900	4,305.00	8,179,500
オリックス	111,500	5,443.00	606,894,500
三菱HCキャピタル	90,500	1,467.00	132,763,500
日本取引所グループ	100,200	1,822.50	182,614,500
大東建託	30,400	3,511.00	106,734,400
ヒューリック	52,500	2,029.00	106,522,500
野村不動産ホールディングス	50,400	1,107.50	55,818,000
オープンハウスグループ	5,800	11,190.00	64,902,000
東急不動産ホールディングス	49,300	1,543.00	76,069,900
飯田グループホールディングス	15,500	2,655.00	41,152,500
ケイアイスター不動産	900	7,500.00	6,750,000
パーク24	12,900	2,163.50	27,909,150

三井不動産	266,900	2,081.50	555,552,350	
三菱地所	108,400	4,853.00	526,065,200	
東京建物	17,300	4,128.00	71,414,400	
住友不動産	51,300	4,980.00	255,474,000	
レオパレス21	15,700	724.00	11,366,800	
スターツコーポレーション	3,300	5,100.00	16,830,000	
カチタス	4,700	3,240.00	15,228,000	
トーセイ	5,300	1,673.00	8,866,900	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	974.00	6,720,600	
日本M&Aセンターホールディングス	27,900	694.80	19,384,920	
オープンアップグループ	6,400	1,891.00	12,102,400	
パソナグループ	2,200	1,990.00	4,378,000	
パーソルホールディングス	175,400	259.50	45,516,300	
カカクコム	12,500	1,644.50	20,556,250	
ディップ	2,900	2,015.00	5,843,500	
エムスリー	37,800	1,624.50	61,406,100	
オリエンタルランド	111,100	2,819.00	313,190,900	
ラウンドワン	18,100	988.00	17,882,800	
リゾートトラスト	17,800	1,789.50	31,853,100	
ユー・エス・エス	35,900	1,835.50	65,894,450	
リクルートホールディングス	90,900	6,156.00	559,580,400	
ベイカレント	14,000	4,292.00	60,088,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	15,800	1,578.50	24,940,300	
リログroup	8,300	1,837.00	15,247,100	
セコム	35,200	6,075.00	213,840,000	
メイテックグループホールディングス	6,500	3,422.00	22,243,000	
合 計	26,307,000		69,535,892,050	

## 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。