

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

2026 年 9 月 18 日

ファンド名 NZAM 上場投信 JPX 日経 400
 コード番号 2526
 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
 U R L <https://www.ja-asset.co.jp/>
 代 表 者 代表取締役社長
 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
 上場取引所 東証
 売 買 単 位 1 口
 八木 正展
 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8692
 有価証券報告書提出予定日 2026 年 11 月 13 日
 分配金支払開始予定日 2026 年 9 月 18 日

I ファンドの運用状況

1. 2026 年 8 月期の運用状況 (2026 年 2 月 16 日～2026 年 8 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 8 月期	75,335	(96.2)	2,942	(3.8)	78,278	(100.0)
2026 年 2 月期	69,535	(97.9)	1,511	(2.1)	71,047	(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 8 月期	2,030	-	-	2,030
2026 年 2 月期	2,132	110	211	2,030

(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 8 月期	79,292	1,014	78,278	38,546
2026 年 2 月期	71,997	949	71,047	34,986

(4) 分配金

	1 口当たり分配金
	円
2026 年 8 月期	341
2026 年 2 月期	312

(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 14 期 2026 年 2 月 15 日現在	第 15 期 2026 年 8 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	1,996,976,999	3,382,637,775
株式	69,535,892,050	75,335,820,200
派生商品評価勘定	161,388,040	215,614,748
未収入金	67,777,500	54,668,940
未収配当金	101,538,115	88,598,970
未収利息	119,350	181,742
差入委託証拠金	133,949,513	215,382,524
流動資産合計	71,997,641,567	79,292,904,899
資産合計	71,997,641,567	79,292,904,899
負債の部		
流動負債		
前受金	257,211,200	256,242,900
未払収益分配金	633,598,680	692,490,865
未払受託者報酬	10,047,222	11,090,311
未払委託者報酬	31,218,065	34,459,125
その他未払費用	17,854,903	20,399,844
流動負債合計	949,930,070	1,014,683,045
負債合計	949,930,070	1,014,683,045
純資産の部		
元本等		
元本	28,526,155,955	28,526,155,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	42,521,555,542	49,752,065,899
(分配準備積立金)	1,390,851	477,887
元本等合計	71,047,711,497	78,278,221,854
純資産合計	71,047,711,497	78,278,221,854
負債純資産合計	71,997,641,567	79,292,904,899

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第 14 期 自 2025 年 8 月 16 日 至 2026 年 2 月 15 日	第 15 期 自 2026 年 2 月 16 日 至 2026 年 8 月 15 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	688,682,759	747,769,430
受取利息	4,252,459	9,684,278
有価証券売買等損益	13,548,776,148	6,859,631,961
派生商品取引等損益	372,176,428	371,791,360
その他収益	34,782	73,473
営業収益合計	14,613,922,576	7,988,950,502
営業費用		
受託者報酬	10,047,222	11,090,311
委託者報酬	31,218,065	34,459,125
その他費用	17,854,903	20,399,844
営業費用合計	59,120,190	65,949,280
営業利益又は営業損失 (△)	14,554,802,386	7,923,001,222
経常利益又は経常損失 (△)	14,554,802,386	7,923,001,222
当期純利益又は当期純損失 (△)	14,554,802,386	7,923,001,222
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 (△)	30,362,011,279	42,521,555,542
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	2,163,514,092	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	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	633,598,680	692,490,865
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	42,521,555,542	49,752,065,899

(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。

(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 14 期 2026 年 2 月 15 日現在	第 15 期 2026 年 8 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	29,951,420,763 円	28,526,155,955 円
	期中追加設定元本額	1,545,745,927 円	－円
	期中一部交換元本額	2,971,010,735 円	－円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	2,030,765 口	2,030,765 口
3.	1 口当たり純資産額	34,986 円	38,546 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第 14 期 自 2025 年 8 月 16 日 至 2026 年 2 月 15 日	第 15 期 自 2026 年 2 月 16 日 至 2026 年 8 月 15 日
分配金の計算過程	A. 配当等収益額 692,970,000 円	A. 配当等収益額 757,527,181 円
	B. 分配準備積立金額 1,139,721 円	B. 分配準備積立金額 1,390,851 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B) 694,109,721 円	C. 配当等収益合計額 (A+B) 758,918,032 円
	D. 経費 59,120,190 円	D. 経費 65,949,280 円
	E. 収益分配可能額 (C-D) 634,989,531 円	E. 収益分配可能額 (C-D) 692,968,752 円
	F. 収益分配金 633,598,680 円	F. 収益分配金 692,490,865 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 1,390,851 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 477,887 円
	H. 口数 2,030,765 口	H. 口数 2,030,765 口
	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1) 312 円	I. 1 口当たり分配金 (F/H×1) 341 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 14 期 自 2025 年 8 月 16 日 至 2026 年 2 月 15 日	第 15 期 自 2026 年 2 月 16 日 至 2026 年 8 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 14 期 2026 年 2 月 15 日現在	第 15 期 2026 年 8 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 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

第 15 期(自 2026 年 2 月 16 日 至 2026 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	6,929,836,806
合計	6,929,836,806

(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

第15期(2026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	2,694,019,400	—	2,909,651,000	215,631,600
合計		2,694,019,400	—	2,909,651,000	215,631,600

(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	1,310.00	30,785,000	
I N P E X	86,300	3,782.00	326,386,600	
石油資源開発	15,300	1,820.00	27,846,000	
ショーボンドホールディングス	13,400	1,267.50	16,984,500	
タマホーム	1,600	2,985.00	4,776,000	
安藤・間	13,800	1,890.00	26,082,000	
コムシスホールディングス	8,100	5,303.00	42,954,300	
大成建設	13,500	13,050.00	176,175,000	
大林組	56,900	3,051.00	173,601,900	
長谷工コーポレーション	16,800	2,799.00	47,023,200	
鹿島建設	39,700	4,937.00	195,998,900	
住友林業	46,700	1,348.00	62,951,600	
大和ハウス工業	49,800	4,609.00	229,528,200	
積水ハウス	53,600	3,444.00	184,598,400	
関電工	10,000	5,520.00	55,200,000	
エクシオグループ	17,900	2,632.50	47,121,750	
クラフティア	4,000	8,396.00	33,584,000	
高砂熱学工業	9,600	4,338.00	41,644,800	
インフロニア・ホールディングス	19,000	2,838.00	53,922,000	
森永製菓	7,600	2,554.00	19,410,400	
寿スピリッツ	9,600	2,746.00	26,361,600	
カルビー	8,400	3,045.00	25,578,000	
森永乳業	26,000	1,188.50	30,901,000	
ヤクルト本社	23,300	2,881.50	67,138,950	
明治ホールディングス	25,100	4,248.00	106,624,800	
アサヒグループホールディングス	135,500	1,743.50	236,244,250	
キリンホールディングス	78,400	3,108.00	243,667,200	
宝ホールディングス	14,900	2,069.50	30,835,550	
サントリービバレッジ&フード	14,800	4,648.00	68,790,400	
キッコーマン	59,800	1,792.00	107,161,600	

味の素	87,200	5,566.00	485,355,200	
カゴメ	9,700	2,667.50	25,874,750	
ニチレイ	14,700	2,188.50	32,170,950	
東洋水産	8,300	10,610.00	88,063,000	
日清食品ホールディングス	20,400	2,970.50	60,598,200	
日本たばこ産業	109,600	7,132.00	781,667,200	
東レ	123,600	1,354.50	167,416,200	
ゴールドウイン	10,100	2,133.50	21,548,350	
王子ホールディングス	62,700	875.60	54,900,120	
クラレ	24,900	1,881.50	46,849,350	
レゾナック・ホールディングス	17,000	16,465.00	279,905,000	
日産化学	9,400	7,976.00	74,974,400	
東ソー	26,700	2,750.00	73,425,000	
信越化学工業	162,600	6,372.00	1,036,087,200	
日本酸素ホールディングス	20,900	6,140.00	128,326,000	
三菱瓦斯化学	13,000	4,019.00	52,247,000	
三井化学	32,900	2,231.50	73,416,350	
東京応化工業	8,900	9,360.00	83,304,000	
三菱ケミカルグループ	128,400	1,208.50	155,171,400	
ダイセル	20,900	1,488.50	31,109,650	
住友ベークライト	6,500	7,799.00	50,693,500	
積水化学工業	36,200	2,693.50	97,504,700	
ADEKA	6,500	4,772.00	31,018,000	
日油	21,500	2,730.00	58,695,000	
花王	87,000	3,533.00	307,371,000	
日本ペイントホールディングス	97,500	1,238.50	120,753,750	
関西ペイント	14,600	2,938.00	42,894,800	
太陽ホールディングス	8,700	4,812.00	41,864,400	
富士フイルムホールディングス	110,100	3,329.00	366,522,900	
ライオン	23,000	1,905.50	43,826,500	
小林製薬	5,400	5,566.00	30,056,400	
デクセリアルズ	16,000	3,191.00	51,056,000	
日東電工	55,900	3,577.00	199,954,300	
ニフコ	6,800	5,112.00	34,761,600	
ユニ・チャーム	114,900	987.50	113,463,750	
協和キリン	21,600	2,579.50	55,717,200	

アステラス製薬	161,200	2,356.50	379,867,800	
塩野義製薬	67,200	2,831.50	190,276,800	
日本新薬	4,900	3,640.00	17,836,000	
中外製薬	57,600	6,933.00	399,340,800	
エーザイ	24,000	4,858.00	116,592,000	
ロート製薬	19,400	2,815.50	54,620,700	
小野薬品工業	41,100	2,430.00	99,873,000	
第一三共	166,200	2,729.00	453,559,800	
大塚ホールディングス	44,700	12,030.00	537,741,000	
ペプチドリーム	9,100	1,031.50	9,386,650	
出光興産	75,500	1,306.50	98,640,750	
E N E O Sホールディングス	259,700	1,291.00	335,272,700	
コスモエネルギーホールディングス	10,100	4,151.00	41,925,100	
横浜ゴム	9,100	7,850.00	71,435,000	
TOYO TIRE	12,700	3,800.00	48,260,000	
ブリヂストン	100,600	4,133.00	415,779,800	
TOTO	11,400	6,631.00	75,593,400	
NGK	19,600	5,925.00	116,130,000	
日本特殊陶業	15,100	9,730.00	146,923,000	
MARUWA	800	61,010.00	48,808,000	
ニチアス	14,400	3,614.00	52,041,600	
日本製鉄	515,600	676.30	348,700,280	
神戸製鋼所	38,800	1,986.00	77,056,800	
J F Eホールディングス	61,400	1,788.00	109,783,200	
東京製鐵	5,500	1,737.00	9,553,500	
大和工業	3,600	13,235.00	47,646,000	
大同特殊鋼	12,200	2,416.00	29,475,200	
日本冶金工業	1,300	5,480.00	7,124,000	
三井金属	4,700	29,375.00	138,062,500	
住友金属鉱山	25,900	9,585.00	248,251,500	
DOWAホールディングス	5,100	9,476.00	48,327,600	
住友電気工業	261,200	2,386.00	623,223,200	
フジクラ	146,400	5,665.00	829,356,000	
SWCC	2,700	14,260.00	38,502,000	
AREホールディングス	8,300	3,630.00	30,129,000	
SUMCO	36,600	3,920.00	143,472,000	

三和ホールディングス	18,100	3,651.00	66,083,100	
リンナイ	9,400	3,650.00	34,310,000	
日本発條	14,200	3,713.00	52,724,600	
三浦工業	8,100	3,203.00	25,944,300	
ツガミ	4,000	6,200.00	24,800,000	
アマダ	25,800	2,767.00	71,388,600	
DMG森精機	12,600	3,303.00	41,617,800	
ディスコ	8,900	65,470.00	582,683,000	
野村マイクロ・サイエンス	3,300	3,900.00	12,870,000	
三井海洋開発	4,600	10,510.00	48,346,000	
SMC	5,200	76,430.00	397,436,000	
小松製作所	89,300	7,302.00	652,068,600	
日立建機	7,500	5,556.00	41,670,000	
ローツェ	10,900	4,337.00	47,273,300	
クボタ	93,600	2,751.50	257,540,400	
荏原製作所	43,900	5,860.00	257,254,000	
ダイキン工業	24,100	21,255.00	512,245,500	
オルガノ	2,500	14,785.00	36,962,500	
ダイフク	31,200	6,303.00	196,653,600	
SANKYO	17,300	1,931.00	33,406,300	
竹内製作所	3,400	7,650.00	26,010,000	
アマノ	5,200	3,876.00	20,155,200	
セガサミーホールディングス	15,300	2,736.50	41,868,450	
ホンザキ	10,900	5,788.00	63,089,200	
マキタ	23,000	5,425.00	124,775,000	
三井E&S	9,200	4,345.00	39,974,000	
カナデビア	15,300	1,246.00	19,063,800	
三菱重工業	230,200	4,254.00	979,270,800	
I H I	96,600	3,028.00	292,504,800	
イビデン	23,100	20,785.00	480,133,500	
ブラザー工業	22,300	4,744.00	105,791,200	
ミネベアミツミ	32,200	3,770.00	121,394,000	
日立製作所	182,700	5,767.00	1,053,630,900	
三菱電機	202,800	6,153.00	1,247,828,400	
富士電機	13,300	14,900.00	198,170,000	
安川電機	20,000	5,431.00	108,620,000	

芝浦メカトロニクス	5,500	4,485.00	24,667,500	
JVCケンウッド	14,900	1,044.00	15,555,600	
オムロン	15,700	7,004.00	109,962,800	
日本電気	121,600	5,168.00	628,428,800	
富士通	170,200	3,841.00	653,738,200	
サンケン電気	1,900	8,280.00	15,732,000	
ルネサスエレクトロニクス	179,500	3,746.00	672,407,000	
セイコーエプソン	23,600	3,171.00	74,835,600	
アルバック	4,700	9,370.00	44,039,000	
パナソニック ホールディングス	218,500	4,721.00	1,031,538,500	
ソニーグループ	201,900	3,912.00	789,832,800	
TDK	159,800	3,210.00	512,958,000	
メイコー	1,600	18,250.00	29,200,000	
ヒロセ電機	2,600	27,310.00	71,006,000	
横河電機	19,400	5,689.00	110,366,600	
アズビル	44,600	1,565.00	69,799,000	
日本光電工業	15,500	1,483.50	22,994,250	
堀場製作所	3,800	25,045.00	95,171,000	
アドバンテスト	55,200	36,870.00	2,035,224,000	
キーエンス	13,400	87,660.00	1,174,644,000	
シスメックス	47,400	1,918.50	90,936,900	
レーザーテック	7,800	38,820.00	302,796,000	
日本電子	4,200	8,847.00	37,157,400	
ファナック	87,500	6,435.00	563,062,500	
浜松ホトニクス	28,500	2,562.00	73,017,000	
三井ハイテック	8,300	970.00	8,051,000	
村田製作所	174,900	8,235.00	1,440,301,500	
小糸製作所	19,400	2,718.50	52,738,900	
SCREENホールディングス	13,000	14,275.00	185,575,000	
キヤノン	82,200	4,656.00	382,723,200	
東京エレクトロン	27,800	59,130.00	1,643,814,000	
トヨタ紡織	9,000	2,241.50	20,173,500	
デンソー	179,500	1,955.00	350,922,500	
川崎重工業	72,200	2,849.50	205,733,900	
名村造船所	5,700	4,455.00	25,393,500	
いすゞ自動車	47,200	2,265.50	106,931,600	

トヨタ自動車	287,800	3,020.00	869,156,000	
三菱自動車工業	72,700	342.80	24,921,560	
アイシン	44,800	2,265.00	101,472,000	
マツダ	60,600	1,169.00	70,841,400	
本田技研工業	341,900	1,658.00	566,870,200	
スズキ	134,600	2,086.50	280,842,900	
S U B A R U	54,100	2,583.00	139,740,300	
ヤマハ発動機	90,800	1,949.00	176,969,200	
豊田合成	6,100	5,208.00	31,768,800	
シマノ	7,900	20,130.00	159,027,000	
テルモ	121,800	2,672.50	325,510,500	
島津製作所	24,400	4,221.00	102,992,400	
ナカニシ	7,800	3,280.00	25,584,000	
東京精密	3,500	19,145.00	67,007,500	
オリンパス	99,200	2,110.50	209,361,600	
タムロン	9,400	1,434.00	13,479,600	
H O Y A	34,500	26,645.00	919,252,500	
ノーリツ鋼機	5,400	2,168.00	11,707,200	
朝日インテック	22,900	3,874.00	88,714,600	
シチズン時計	15,300	2,751.00	42,090,300	
三井松島ホールディングス	3,100	2,349.00	7,281,900	
バンダイナムコホールディングス	48,800	5,435.00	265,228,000	
パイロットコーポレーション	8,700	1,983.00	17,252,100	
タカラトミー	9,000	3,598.00	32,382,000	
ヨネックス	6,500	2,830.00	18,395,000	
大日本印刷	39,600	3,315.00	131,274,000	
アシックス	75,600	5,281.00	399,243,600	
ローランド	2,600	4,310.00	11,206,000	
ヤマハ	28,600	1,356.50	38,795,900	
任天堂	55,900	8,900.00	497,510,000	
オカムラ	5,500	2,359.00	12,974,500	
中部電力	67,400	2,818.00	189,933,200	
関西電力	99,400	2,401.00	238,659,400	
東北電力	48,300	1,254.00	60,568,200	
四国電力	17,200	1,798.50	30,934,200	
九州電力	43,200	1,872.50	80,892,000	

北海道電力	19,400	1,043.50	20,243,900	
電源開発	13,800	3,916.00	54,040,800	
東京瓦斯	29,900	6,015.00	179,848,500	
大阪瓦斯	31,600	5,423.00	171,366,800	
SBSホールディングス	1,600	4,865.00	7,784,000	
東急	47,000	1,639.00	77,033,000	
京浜急行電鉄	20,900	1,518.50	31,736,650	
小田急電鉄	27,800	1,706.00	47,426,800	
京王電鉄	41,500	759.50	31,519,250	
京成電鉄	32,000	1,280.00	40,960,000	
西日本旅客鉄道	43,600	2,920.00	127,312,000	
東海旅客鉄道	75,500	3,861.00	291,505,500	
西武ホールディングス	18,900	3,348.00	63,277,200	
近鉄グループホールディングス	19,500	3,555.00	69,322,500	
ヤマトホールディングス	22,700	1,971.00	44,741,700	
山九	4,200	8,527.00	35,813,400	
センコーグループホールディングス	13,200	2,305.00	30,426,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	4,600	880.00	4,048,000	
九州旅客鉄道	14,000	3,487.00	48,818,000	
SGホールディングス	31,200	1,644.00	51,292,800	
NIPPON EXPRESSホールディングス	20,000	5,684.00	113,680,000	
日本郵船	36,400	6,400.00	232,960,000	
商船三井	34,700	6,471.00	224,543,700	
川崎汽船	39,500	3,030.00	119,685,000	
NSユニテッド海運	900	10,440.00	9,396,000	
飯野海運	6,800	1,592.00	10,825,600	
日本航空	41,900	3,054.00	127,962,600	
ANAホールディングス	49,800	3,126.00	155,674,800	
三井倉庫ホールディングス	5,100	3,385.00	17,263,500	
システナ	28,500	438.00	12,483,000	
日鉄ソリューションズ	5,000	3,837.00	19,185,000	
TISI	19,700	3,848.00	75,805,600	
コーエーテクモホールディングス	11,900	1,666.00	19,825,400	
ネクソン	38,100	3,022.00	115,138,200	
SHIFT	16,500	956.10	15,775,650	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,448.00	9,302,400	
GMOペイメントゲートウェイ	4,200	10,150.00	42,630,000	
インターネットイニシアティブ	10,100	3,504.00	35,390,400	
ラクス	17,600	1,175.00	20,680,000	
ビジョナル	2,200	9,347.00	20,563,400	
野村総合研究所	34,700	5,131.00	178,045,700	
メルカリ	7,900	4,851.00	38,322,900	
オービック	34,100	4,699.00	160,235,900	
ジャストシステム	2,800	4,125.00	11,550,000	
L I N Eヤフー	282,900	506.30	143,232,270	
トレンドマイクロ	9,700	5,851.00	56,754,700	
日本オラクル	3,600	9,536.00	34,329,600	
フューチャー	4,600	2,444.00	11,242,400	
大塚商会	21,200	3,536.00	74,963,200	
電通総研	8,100	2,694.00	21,821,400	
東映アニメーション	7,200	2,828.00	20,361,600	
ANYCOLOR	2,500	2,830.00	7,075,000	
B I P R O G Y	6,200	4,653.00	28,848,600	
U-NEXT HOLDINGS	6,500	1,727.00	11,225,500	
NTT	4,648,400	162.70	756,294,680	
KDDI	247,400	2,877.50	711,893,500	
ソフトバンク	2,948,700	234.90	692,649,630	
光通信	1,800	38,580.00	69,444,000	
GMOインターネットグループ	5,200	4,343.00	22,583,600	
東宝	48,500	1,506.00	73,041,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,300	2,930.50	88,794,150	
カプコン	36,500	4,180.00	152,570,000	
NSD	6,600	2,834.00	18,704,400	
コナミグループ	7,900	21,990.00	173,721,000	
ソフトバンクグループ	286,500	5,739.00	1,644,223,500	
東京エレクトロン デバイス	2,000	4,415.00	8,830,000	
円谷フィールズホールディングス	3,100	2,473.00	7,666,300	
双日	18,700	5,684.00	106,290,800	
神戸物産	15,000	2,785.00	41,775,000	
ダイワボウホールディングス	7,900	3,790.00	29,941,000	
マクニカホールディングス	13,900	3,798.00	52,792,200	

シップヘルスケアホールディングス	7,100	2,358.00	16,741,800	
メディパルホールディングス	20,200	2,827.50	57,115,500	
I D O M	5,600	1,298.00	7,268,800	
伊藤忠商事	513,000	2,064.50	1,059,088,500	
丸紅	148,100	4,930.00	730,133,000	
豊田通商	51,800	7,325.00	379,435,000	
兼松	16,500	2,210.50	36,473,250	
三井物産	259,600	4,825.00	1,252,570,000	
住友商事	458,800	1,791.00	821,710,800	
三菱商事	267,000	4,769.00	1,273,323,000	
キヤノンマーケティングジャパン	9,200	3,696.00	34,003,200	
阪和興業	17,000	1,842.00	31,314,000	
岩谷産業	18,000	2,249.50	40,491,000	
稲畑産業	4,600	4,190.00	19,274,000	
サンゲツ	4,800	3,150.00	15,120,000	
伊藤忠エネクス	4,600	2,145.00	9,867,000	
サンリオ	97,000	1,282.50	124,402,500	
加賀電子	3,400	5,100.00	17,340,000	
ミスミグループ本社	27,300	3,831.00	104,586,300	
エービーシー・マート	10,100	2,847.00	28,754,700	
アスクル	4,600	1,270.00	5,842,000	
アンドエスティHD	2,600	3,450.00	8,970,000	
日本マクドナルドホールディングス	12,000	7,800.00	93,600,000	
パルグループホールディングス	8,000	1,500.00	12,000,000	
M o n o t a R O	28,100	1,861.50	52,308,150	
J. フロント リテイリング	22,200	2,914.00	64,690,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	34,100	2,516.00	85,795,600	
Z O Z O	30,500	1,141.00	34,800,500	
クリエイトSDホールディングス	3,100	3,335.00	10,338,500	
ネクステージ	4,600	3,610.00	16,606,000	
コスモス薬品	3,300	6,584.00	21,727,200	
セブン&アイ・ホールディングス	214,100	2,070.50	443,294,050	
ツルハホールディングス	30,400	2,404.50	73,096,800	
クスリのアオキホールディングス	5,000	4,035.00	20,175,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	22,200	5,861.00	130,114,200	
ブルーゾーンホールディングス	12,000	1,800.00	21,600,000	

ノジマ	18,600	1,318.00	24,514,800	
良品計画	42,200	4,499.00	189,857,800	
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	926.40	181,389,120	
ゼンショーホールディングス	10,000	11,350.00	113,500,000	
ワークマン	2,800	6,150.00	17,220,000	
スギホールディングス	10,300	2,835.00	29,200,500	
日本瓦斯	9,200	2,872.00	26,422,400	
ライフコーポレーション	4,000	2,602.00	10,408,000	
しまむら	13,800	3,386.00	46,726,800	
丸井グループ	11,300	2,968.00	33,538,400	
ニトリホールディングス	31,400	2,983.00	93,666,200	
ファーストリテイリング	13,100	77,120.00	1,010,272,000	
サンドラッグ	5,700	3,746.00	21,352,200	
めぶきフィナンシャルグループ	84,400	1,658.50	139,977,400	
横浜フィナンシャルグループ	94,200	1,934.50	182,229,900	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	384,400	3,686.00	1,416,898,400	
りそなホールディングス	221,400	2,454.00	543,315,600	
三井住友トラストグループ	251,600	1,737.00	437,029,200	
三井住友フィナンシャルグループ	225,400	6,969.00	1,570,812,600	
千葉銀行	53,200	2,828.50	150,476,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,400	7,730.00	111,312,000	
セブン銀行	58,100	336.10	19,527,410	
みずほフィナンシャルグループ	202,400	8,620.00	1,744,688,000	
FPG	5,700	1,625.00	9,262,500	
SBIホールディングス	63,500	3,070.00	194,945,000	
大和証券グループ本社	129,000	1,801.00	232,329,000	
野村ホールディングス	296,500	1,570.00	465,505,000	
SOMPOホールディングス	89,600	7,011.00	628,185,600	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	112,500	4,836.00	544,050,000	
ソニーフィナンシャルグループ	208,000	155.80	32,406,400	
第一ライフグループ	347,700	1,874.00	651,589,800	
東京海上ホールディングス	136,700	7,540.00	1,030,718,000	
ムニロホールディングス	30,000	455.00	13,650,000	
全国保証	9,800	3,131.00	30,683,800	
クレディセゾン	8,800	4,735.00	41,668,000	

芙蓉総合リース	5,100	4,494.00	22,919,400	
みずほリース	13,700	1,359.00	18,618,300	
東京センチュリー	13,800	2,547.50	35,155,500	
アコム	32,300	483.60	15,620,280	
ジャックス	1,900	3,790.00	7,201,000	
オリックス	107,900	6,376.00	687,970,400	
三菱HCキャピタル	90,500	1,401.00	126,790,500	
日本取引所グループ	100,200	2,244.00	224,848,800	
大東建託	30,400	3,237.00	98,404,800	
ヒューリック	52,500	1,757.00	92,242,500	
野村不動産ホールディングス	50,400	918.90	46,312,560	
オープンハウスグループ	5,800	8,247.00	47,832,600	
東急不動産ホールディングス	49,300	1,321.00	65,125,300	
飯田グループホールディングス	15,500	2,324.00	36,022,000	
ケイアイスター不動産	1,800	3,900.00	7,020,000	
パーク24	12,900	2,010.00	25,929,000	
三井不動産	261,100	1,457.00	380,422,700	
三菱地所	108,400	3,677.00	398,586,800	
東京建物	15,700	3,383.00	53,113,100	
住友不動産	51,300	3,382.00	173,496,600	
レオパレス21	15,700	620.00	9,734,000	
スターツコーポレーション	3,300	4,680.00	15,444,000	
カチタス	4,700	3,570.00	16,779,000	
トーセイ	5,300	1,795.00	9,513,500	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,045.00	7,210,500	
日本M&Aセンターホールディングス	27,900	672.20	18,754,380	
オープンアップグループ	6,400	2,035.00	13,024,000	
パソナグループ	2,200	1,640.00	3,608,000	
パーソルホールディングス	175,400	287.90	50,497,660	
カカコム	12,500	3,715.00	46,437,500	
ディップ	2,900	1,860.00	5,394,000	
エムスリー	37,800	1,697.50	64,165,500	
オリエンタルランド	111,100	2,966.50	329,578,150	
ラウンドワン	18,100	1,339.50	24,244,950	
リゾートトラスト	17,800	1,831.50	32,600,700	
ユー・エス・エス	35,900	2,011.00	72,194,900	

リクルートホールディングス	85,600	16,455.00	1,408,548,000	
ペイカレント	14,000	7,687.00	107,618,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	15,800	1,535.50	24,260,900	
リログループ	8,300	2,161.00	17,936,300	
セコム	35,200	6,511.00	229,187,200	
メイテックグループホールディングス	6,500	3,356.00	21,814,000	
合 計	27,245,900		75,335,820,200	

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。