

2024年8月期 決算短信 (2024年2月16日～2024年8月15日)

2024年9月24日

ファンド名 NZAM 上場投信 日経225 上場取引所 東証
 コード番号 2525 売買単位 1口
 連動対象指標 日経平均トータルリターン・インデックス
 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 2024年11月15日
 分配金支払開始予定日 2024年9月20日

I ファンドの運用状況

1. 2024年8月期の運用状況 (2024年2月16日～2024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	%
2024年8月期	97,739	(97.1)	2,900	(2.9)	100,640	(100.0)
2024年2月期	232,609	(98.8)	2,815	(1.2)	235,424	(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
2024年8月期	6,100	1,047	4,412	2,735
2024年2月期	6,129	737	766	6,100

(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
2024年8月期	102,748	2,107	100,640	36,784
2024年2月期	237,765	2,340	235,424	38,590

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2024年8月期	671
2024年2月期	268

(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 日経 225

(1) 【貸借対照表】

	第 10 期 2024 年 2 月 15 日現在	第 11 期 2024 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	4,024,977,933	4,237,065,939
株式	232,609,025,810	97,739,948,160
派生商品評価勘定	339,272,100	53,086,800
未収入金	219,917,700	-
未収配当金	331,984,000	85,310,200
未収利息	-	26,590
前払金	-	128,820,000
差入委託証拠金	240,111,183	503,820,767
流動資産合計	237,765,288,726	102,748,078,456
資産合計	237,765,288,726	102,748,078,456
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	38,133,740
前受金	516,225,000	-
未払金	-	111,272,000
未払収益分配金	1,634,998,856	1,835,837,212
未払受託者報酬	56,532,370	35,125,959
未払委託者報酬	96,104,977	59,714,056
未払利息	258	-
その他未払費用	36,468,902	27,165,875
流動負債合計	2,340,330,363	2,107,248,842
負債合計	2,340,330,363	2,107,248,842
純資産の部		
元本等		
元本	127,407,895,928	57,138,039,248
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	108,017,062,435	43,502,790,366
(分配準備積立金)	3,094,734	2,562,214
元本等合計	235,424,958,363	100,640,829,614
純資産合計	235,424,958,363	100,640,829,614
負債純資産合計	237,765,288,726	102,748,078,456

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第10期 自 2023年 8月 16日 至 2024年 2月 15日	第11期 自 2024年 2月 16日 至 2024年 8月 15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,823,459,000	1,955,928,376
受取利息	12,429	1,203,501
有価証券売買等損益	35,949,118,723	2,197,273,534
派生商品取引等損益	655,694,660	△136,367,820
その他収益	361,071	196,886
営業収益合計	38,428,645,883	4,018,234,477
営業費用		
支払利息	486,379	18,181
受託者報酬	56,532,370	35,125,959
委託者報酬	96,104,977	59,714,056
その他費用	36,468,902	27,165,875
営業費用合計	189,592,628	122,024,071
営業利益又は営業損失 (△)	38,239,053,255	3,896,210,406
経常利益又は経常損失 (△)	38,239,053,255	3,896,210,406
当期純利益又は当期純損失 (△)	38,239,053,255	3,896,210,406
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 (△)	71,531,321,180	108,017,062,435
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,545,296,398	18,907,954,705
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	9,545,296,398	18,907,954,705
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,663,609,542	85,482,599,968
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,663,609,542	85,482,599,968
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	1,634,998,856	1,835,837,212
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	108,017,062,435	43,502,790,366

(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10期 (2024年2月15日現在)	第11期 (2024年8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10期 2024年2月15日現在	第11期 2024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	127,998,766,940円	127,407,895,928円
	期中追加設定元本額	15,409,238,516円	21,881,273,652円
	期中一部交換元本額	16,000,109,528円	92,151,130,332円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	6,100,742口	2,735,972口
3.	1口当たり純資産額	38,590円	36,784円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自2023年8月16日 至2024年2月15日		第11期 自2024年2月16日 至2024年8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	1,823,346,121円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	3,853,718円	B. 分配準備積立金額	3,094,734円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,827,199,839円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,960,405,316円
	D. 経費	189,106,249円	D. 経費	122,005,890円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,638,093,590円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,838,399,426円
	F. 収益分配金	1,634,998,856円	F. 収益分配金	1,835,837,212円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	3,094,734円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	2,562,214円
	H. 口数	6,100,742口	H. 口数	2,735,972口
	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	268円	I. 1口当たり分配金 (F/H×1)	671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 10 期 自 2023 年 8 月 16 日 至 2024 年 2 月 15 日	第 11 期 自 2024 年 2 月 16 日 至 2024 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 10 期 2024 年 2 月 15 日現在	第 11 期 2024 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 10 期(自 2023 年 8 月 16 日 至 2024 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	35,337,968,350
合計	35,337,968,350

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	△3,701,795,799
合計	△3,701,795,799

(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10期 (2024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	2,330,512,500	—	2,669,800,000	339,287,500
合計		2,330,512,500	—	2,669,800,000	339,287,500

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	2,807,080,000	—	2,822,050,000	14,970,000
合計		2,807,080,000	—	2,822,050,000	14,970,000

(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	87,000	866.20	75,359,400	
I N P E X	34,800	2,149.00	74,785,200	
コムシスホールディングス	87,000	3,029.00	263,523,000	
大成建設	17,400	6,158.00	107,149,200	
大林組	87,000	1,864.00	162,168,000	
清水建設	87,000	899.40	78,247,800	
長谷工コーポレーション	17,400	1,735.50	30,197,700	
鹿島建設	43,500	2,559.00	111,316,500	
大和ハウス工業	87,000	4,378.00	380,886,000	
積水ハウス	87,000	3,512.00	305,544,000	
日揮ホールディングス	87,000	1,269.50	110,446,500	
日清製粉グループ本社	87,000	1,843.50	160,384,500	
明治ホールディングス	34,800	3,443.00	119,816,400	
日本ハム	43,500	5,225.00	227,287,500	
サッポロホールディングス	17,400	7,045.00	122,583,000	
アサヒグループホールディングス	87,000	5,203.00	452,661,000	
キリンホールディングス	87,000	2,046.50	178,045,500	
キッコーマン	435,000	1,712.00	744,720,000	
味の素	87,000	5,397.00	469,539,000	
ニチレイ	43,500	3,957.00	172,129,500	
日本たばこ産業	87,000	4,141.00	360,267,000	
帝人	17,400	1,324.00	23,037,600	
東レ	87,000	725.10	63,083,700	
王子ホールディングス	87,000	569.50	49,546,500	
日本製紙	8,700	893.00	7,769,100	
クラレ	87,000	1,805.50	157,078,500	
旭化成	87,000	997.40	86,773,800	
レゾナック・ホールディングス	8,700	3,430.00	29,841,000	
住友化学	87,000	428.40	37,270,800	
日産化学	87,000	4,686.00	407,682,000	
東ソー	43,500	1,856.50	80,757,750	
トクヤマ	17,400	2,741.50	47,702,100	

デンカ	17,400	2,154.00	37,479,600
信越化学工業	435,000	6,067.00	2,639,145,000
三井化学	17,400	3,565.00	62,031,000
三菱ケミカルグループ	43,500	833.00	36,235,500
UBE	8,700	2,600.50	22,624,350
花王	87,000	6,327.00	550,449,000
DIC	8,700	2,928.00	25,473,600
富士フイルムホールディングス	261,000	3,526.00	920,286,000
資生堂	87,000	3,400.00	295,800,000
日東電工	87,000	11,070.00	963,090,000
協和キリン	87,000	3,051.00	265,437,000
武田薬品工業	87,000	4,292.00	373,404,000
アステラス製薬	435,000	1,695.50	737,542,500
住友ファーマ	87,000	502.00	43,674,000
塩野義製薬	87,000	6,422.00	558,714,000
中外製薬	261,000	6,588.00	1,719,468,000
エーザイ	87,000	5,834.00	507,558,000
第一三共	261,000	5,751.00	1,501,011,000
大塚ホールディングス	87,000	8,075.00	702,525,000
出光興産	174,000	1,054.00	183,396,000
ENEOSホールディングス	87,000	725.40	63,109,800
横浜ゴム	43,500	3,321.00	144,463,500
ブリヂストン	87,000	5,834.00	507,558,000
AGC	17,400	4,594.00	79,935,600
日本電気硝子	26,100	3,474.00	90,671,400
太平洋セメント	8,700	3,381.00	29,414,700
東海カーボン	87,000	884.50	76,951,500
TOTO	43,500	4,485.00	195,097,500
日本碍子	87,000	1,855.50	161,428,500
日本製鉄	8,700	3,234.00	28,135,800
神戸製鋼所	8,700	1,708.00	14,859,600
JFEホールディングス	8,700	1,918.50	16,690,950
三井金属鉱業	8,700	4,573.00	39,785,100
三菱マテリアル	8,700	2,579.00	22,437,300
住友金属鉱山	43,500	3,915.00	170,302,500
DOWAホールディングス	17,400	4,747.00	82,597,800
古河電気工業	8,700	3,637.00	31,641,900
住友電気工業	87,000	2,383.00	207,321,000

フジクラ	87,000	3,567.00	310,329,000
SUMCO	8,700	1,706.00	14,842,200
日本製鋼所	17,400	4,352.00	75,724,800
オークマ	17,400	6,326.00	110,072,400
アマダ	87,000	1,524.00	132,588,000
ディスコ	17,400	45,180.00	786,132,000
SMC	8,700	64,400.00	560,280,000
小松製作所	87,000	4,100.00	356,700,000
住友重機械工業	17,400	3,315.00	57,681,000
日立建機	87,000	3,456.00	300,672,000
クボタ	87,000	2,015.00	175,305,000
荏原製作所	87,000	2,014.50	175,261,500
ダイキン工業	87,000	17,735.00	1,542,945,000
日本精工	87,000	734.10	63,866,700
NTN	87,000	264.70	23,028,900
ジェイテクト	87,000	973.60	84,703,200
日立造船	17,400	917.00	15,955,800
三菱重工業	87,000	1,920.50	167,083,500
IHI	8,700	5,496.00	47,815,200
コニカミノルタ	87,000	396.10	34,460,700
ミネベアミツミ	87,000	2,963.00	257,781,000
日立製作所	87,000	3,396.00	295,452,000
三菱電機	87,000	2,301.50	200,230,500
富士電機	17,400	8,138.00	141,601,200
安川電機	87,000	4,567.00	397,329,000
ソシオネクスト	87,000	3,152.00	274,224,000
ニデック	69,600	6,054.00	421,358,400
オムロン	87,000	5,337.00	464,319,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	17,400	2,512.50	43,717,500
日本電気	8,700	12,500.00	108,750,000
富士通	87,000	2,453.50	213,454,500
ルネサスエレクトロニクス	87,000	2,335.00	203,145,000
セイコーエプソン	174,000	2,591.00	450,834,000
パナソニック ホールディングス	87,000	1,114.50	96,961,500
シャープ	87,000	871.20	75,794,400
ソニーグループ	87,000	12,880.00	1,120,560,000
TDK	261,000	9,594.00	2,504,034,000
アルプスアルパイン	87,000	1,454.50	126,541,500

横河電機	87,000	3,504.00	304,848,000
アドバンテスト	696,000	6,235.00	4,339,560,000
キーエンス	8,700	64,420.00	560,454,000
レーザーテック	34,800	28,540.00	993,192,000
カシオ計算機	87,000	1,134.00	98,658,000
ファナック	435,000	4,076.00	1,773,060,000
京セラ	696,000	1,655.50	1,152,228,000
太陽誘電	87,000	3,661.00	318,507,000
村田製作所	208,800	2,894.50	604,371,600
S C R E E Nホールディングス	34,800	11,045.00	384,366,000
キヤノン	130,500	4,673.00	609,826,500
リコー	87,000	1,317.50	114,622,500
東京エレクトロン	261,000	27,620.00	7,208,820,000
デンソー	348,000	2,255.50	784,914,000
川崎重工業	8,700	4,845.00	42,151,500
日産自動車	87,000	435.80	37,914,600
いすゞ自動車	43,500	2,082.50	90,588,750
トヨタ自動車	435,000	2,657.50	1,156,012,500
日野自動車	87,000	467.00	40,629,000
三菱自動車工業	8,700	400.40	3,483,480
マツダ	17,400	1,225.50	21,323,700
本田技研工業	522,000	1,546.50	807,273,000
スズキ	348,000	1,705.00	593,340,000
S U B A R U	87,000	2,701.50	235,030,500
ヤマハ発動機	261,000	1,238.00	323,118,000
テルモ	696,000	2,665.00	1,854,840,000
ニコン	87,000	1,540.00	133,980,000
オリンパス	348,000	2,489.50	866,346,000
HOYA	43,500	19,575.00	851,512,500
シチズン時計	87,000	912.00	79,344,000
バンダイナムコホールディングス	261,000	2,920.50	762,250,500
T O P P A Nホールディングス	43,500	4,050.00	176,175,000
大日本印刷	43,500	4,819.00	209,626,500
ヤマハ	87,000	3,007.00	261,609,000
任天堂	87,000	7,898.00	687,126,000
東京電力ホールディングス	8,700	675.50	5,876,850
中部電力	8,700	1,725.50	15,011,850
関西電力	8,700	2,460.50	21,406,350

東京瓦斯	17,400	3,495.00	60,813,000
大阪瓦斯	17,400	3,359.00	58,446,600
東武鉄道	17,400	2,443.50	42,516,900
東急	43,500	1,695.00	73,732,500
小田急電鉄	43,500	1,560.00	67,860,000
京王電鉄	17,400	3,492.00	60,760,800
京成電鉄	43,500	4,266.00	185,571,000
東日本旅客鉄道	26,100	2,614.00	68,225,400
西日本旅客鉄道	17,400	2,684.50	46,710,300
東海旅客鉄道	43,500	3,251.00	141,418,500
ヤマトホールディングス	87,000	1,587.00	138,069,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	8,700	6,997.00	60,873,900
日本郵船	26,100	4,929.00	128,646,900
商船三井	26,100	4,936.00	128,829,600
川崎汽船	78,300	2,100.50	164,469,150
日本航空	87,000	2,291.00	199,317,000
ANAホールディングス	8,700	2,741.00	23,846,700
三菱倉庫	43,500	4,722.00	205,407,000
ネクソン	174,000	2,906.50	505,731,000
メルカリ	87,000	2,096.00	182,352,000
LINEヤフー	34,800	376.20	13,091,760
トレンドマイクロ	87,000	8,200.00	713,400,000
日本電信電話	870,000	149.30	129,891,000
KDDI	522,000	4,578.00	2,389,716,000
ソフトバンク	87,000	1,895.00	164,865,000
東宝	8,700	5,303.00	46,136,100
NTTデータグループ	435,000	1,973.50	858,472,500
コナミグループ	87,000	11,660.00	1,014,420,000
ソフトバンクグループ	522,000	8,187.00	4,273,614,000
双日	8,700	3,349.00	29,136,300
伊藤忠商事	87,000	7,069.00	615,003,000
丸紅	87,000	2,439.00	212,193,000
豊田通商	261,000	2,648.00	691,128,000
三井物産	174,000	3,031.00	527,394,000
住友商事	87,000	3,378.00	293,886,000
三菱商事	261,000	2,945.50	768,775,500
J. フロント リテイリング	43,500	1,488.00	64,728,000
ZOZO	87,000	4,279.00	372,273,000

三越伊勢丹ホールディングス	87,000	2,461.00	214,107,000
セブン&アイ・ホールディングス	261,000	1,757.50	458,707,500
高島屋	43,500	2,328.50	101,289,750
丸井グループ	87,000	2,325.00	202,275,000
イオン	87,000	3,430.00	298,410,000
ニトリホールディングス	43,500	19,360.00	842,160,000
ファーストリテイリング	261,000	41,210.00	10,755,810,000
しずおかフィナンシャルグループ	87,000	1,333.50	116,014,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	87,000	832.30	72,410,100
あおぞら銀行	8,700	2,424.50	21,093,150
三菱UFJフィナンシャル・グループ	87,000	1,503.00	130,761,000
りそなホールディングス	8,700	986.80	8,585,160
三井住友トラスト・ホールディングス	17,400	3,546.00	61,700,400
三井住友フィナンシャルグループ	8,700	9,699.00	84,381,300
千葉銀行	87,000	1,197.00	104,139,000
ふくおかフィナンシャルグループ	17,400	3,929.00	68,364,600
みずほフィナンシャルグループ	8,700	3,041.00	26,456,700
大和証券グループ本社	87,000	1,076.00	93,612,000
野村ホールディングス	87,000	817.30	71,105,100
SOMPOホールディングス	52,200	3,276.00	171,007,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	78,300	3,254.00	254,788,200
第一生命ホールディングス	8,700	4,034.00	35,095,800
東京海上ホールディングス	130,500	5,393.00	703,786,500
T&Dホールディングス	17,400	2,411.00	41,951,400
クレディセゾン	87,000	3,142.00	273,354,000
オリックス	87,000	3,406.00	296,322,000
日本取引所グループ	87,000	3,411.00	296,757,000
東急不動産ホールディングス	87,000	1,003.50	87,304,500
三井不動産	261,000	1,470.50	383,800,500
三菱地所	87,000	2,338.00	203,406,000
東京建物	43,500	2,430.50	105,726,750
住友不動産	87,000	4,613.00	401,331,000
エムスリー	208,800	1,246.00	260,164,800
ディー・エヌ・エー	26,100	1,631.50	42,582,150
電通グループ	87,000	4,250.00	369,750,000
オリエンタルランド	87,000	3,882.00	337,734,000
サイバーエージェント	69,600	955.60	66,509,760

楽天グループ	87,000	864.90	75,246,300	
リクルートホールディングス	261,000	8,286.00	2,162,646,000	
日本郵政	87,000	1,427.50	124,192,500	
セコム	87,000	9,576.00	833,112,000	
合 計	23,646,600		97,739,948,160	

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。