

平成28年7月期（平成27年7月16日～平成28年7月15日）決算短信

平成28年8月24日

上場取引所

東証

ファンド名 ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託
 コード番号 (1312)
 連動対象指標 ラッセル野村小型コア・インデックス
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成28年9月29日
 分配金支払開始日 平成28年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年7月期の運用状況（平成27年7月16日～平成28年7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	%
平成28年7月期	3,311	(99.8)	5	(0.2)	3,316	(100)
平成27年7月期	3,793	(99.9)	3	(0.1)	3,796	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	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
平成28年7月期	209	0	0	209
平成27年7月期	309	0	99	209

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 10
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年7月期	3,372	55	3,316	158,509
平成27年7月期	3,867	70	3,796	181,447

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成28年7月期	2,100.00
平成27年7月期	2,560.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有 無
 ② ①以外の変更 有 無

Ⅱ 財務諸表等

ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投資信託

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 8 期 (平成 27 年 7 月 15 日現在)	第 9 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,630,410	24,103,938
株式	3,793,819,300	3,311,584,900
未収入金	44,372,200	31,874,400
未収配当金	3,956,169	4,808,099
未収利息	48	-
流動資産合計	3,867,778,127	3,372,371,337
資産合計	3,867,778,127	3,372,371,337
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	53,570,560	43,944,600
未払受託者報酬	1,383,104	900,583
未払委託者報酬	12,447,846	8,105,167
未払利息	-	32
その他未払費用	3,418,775	2,460,537
流動負債合計	70,820,285	55,410,919
負債合計	70,820,285	55,410,919
純資産の部		
元本等		
元本	2,975,677,200	2,975,677,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	821,280,642	341,283,218
(分配準備積立金)	64,851	177,640
元本等合計	3,796,957,842	3,316,960,418
純資産合計	3,796,957,842	3,316,960,418
負債純資産合計	3,867,778,127	3,372,371,337

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	83,428,001	65,629,105
受取利息	8,124	3,966
有価証券売買等損益	1,262,787,216	△480,110,213
その他収益	18,534	30,686
営業収益合計	1,346,241,875	△414,446,456
営業費用		
支払利息	-	1,394

受託者報酬	2,617,016	1,898,066
委託者報酬	23,553,011	17,082,419
その他費用	3,673,595	2,624,489
営業費用合計	29,843,622	21,606,368
営業利益又は営業損失(△)	1,316,398,253	△436,052,824
経常利益又は経常損失(△)	1,316,398,253	△436,052,824
当期純利益又は当期純損失(△)	1,316,398,253	△436,052,824
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(△)	△1,682,671	821,280,642
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	439,864,380	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	439,864,380	-
分配金	53,570,560	43,944,600
期末剰余金又は期末欠損金(△)	821,280,642	341,283,218

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 27 年 7 月 16 日から平成 28 年 7 月 15 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 209,260 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 209,260 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 18,144.7 円 (10 口当たり純資産額) (181,447 円)	2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 15,850.9 円 (10 口当たり純資産額) (158,509 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>83,454,659 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>24,374 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>83,479,033 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>29,843,622 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>53,635,411 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>53,570,560 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	83,454,659 円	分配準備積立金	B	24,374 円	配当等収益合計額	C=A+B	83,479,033 円	経費	D	29,843,622 円	収益分配可能額	E=C-D	53,635,411 円	収益分配金	F	53,570,560 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>65,662,363 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>64,851 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>65,727,214 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>21,604,974 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>44,122,240 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>43,944,600 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	65,662,363 円	分配準備積立金	B	64,851 円	配当等収益合計額	C=A+B	65,727,214 円	経費	D	21,604,974 円	収益分配可能額	E=C-D	44,122,240 円	収益分配金	F	43,944,600 円
項目																																											
当期配当等収益額	A	83,454,659 円																																									
分配準備積立金	B	24,374 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	83,479,033 円																																									
経費	D	29,843,622 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	53,635,411 円																																									
収益分配金	F	53,570,560 円																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	65,662,363 円																																									
分配準備積立金	B	64,851 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	65,727,214 円																																									
経費	D	21,604,974 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	44,122,240 円																																									
収益分配金	F	43,944,600 円																																									

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	64,851 円
口数	H	209,260 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,560 円

2. その他費用

その他費用のうち 3,152,738 円は、対象指数についての商標使用料であります。

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	177,640 円
口数	H	209,260 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	2,100 円

2. その他費用

その他費用のうち 2,276,496 円は、対象指数についての商標使用料であります。

3. 追加情報

平成 28 年 1 月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <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> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 8 期 平成 27 年 7 月 15 日現在	第 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表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。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

ります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
期首元本額 4,394,065,320 円	期首元本額 2,975,677,200 円
期中追加設定元本額 0 円	期中追加設定元本額 0 円
期中一部交換元本額 1,418,388,120 円	期中一部交換元本額 0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	702,971,550	△502,617,607
合計	702,971,550	△502,617,607

3 デリバティブ取引関係

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(平成 28 年 7 月 15 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	23,700	504.00	11,944,800	
		マルハニチロ	4,100	2,622.00	10,750,200	
		サカタのタネ	3,000	2,382.00	7,146,000	
		石油資源開発	3,200	2,101.00	6,723,200	
		ショーボンドホールディングス	2,000	5,120.00	10,240,000	
		ミライト・ホールディングス	5,900	1,091.00	6,436,900	
		安藤・間	12,200	591.00	7,210,200	
		東急建設	6,500	969.00	6,298,500	
		コムシスホールディングス	10,500	1,714.00	17,997,000	
		東建コーポレーション	700	8,440.00	5,908,000	
		西松建設	26,000	494.00	12,844,000	
		三井住友建設	80,100	92.00	7,369,200	

前田建設工業	12,000	899.00	10,788,000
奥村組	17,000	593.00	10,081,000
東鉄工業	2,700	3,050.00	8,235,000
戸田建設	21,000	488.00	10,248,000
熊谷組	36,000	309.00	11,124,000
N I P P O	6,000	1,830.00	10,980,000
前田道路	6,000	1,923.00	11,538,000
五洋建設	28,600	583.00	16,673,800
住友林業	13,000	1,516.00	19,708,000
パナホーム	8,000	872.00	6,976,000
中電工	2,300	2,165.00	4,979,500
関電工	10,000	861.00	8,610,000
日本電設工業	3,000	1,910.00	5,730,000
協和エクシオ	8,300	1,337.00	11,097,100
九電工	3,600	3,120.00	11,232,000
高砂熱学工業	4,600	1,291.00	5,938,600
大気社	2,300	2,612.00	6,007,600
千代田化工建設	16,000	725.00	11,600,000
日本製粉	10,000	784.00	7,840,000
森永製菓	17,000	651.00	11,067,000
森永乳業	18,000	724.00	13,032,000
雪印メグミルク	3,900	3,425.00	13,357,500
伊藤ハム米久ホールディングス	12,400	999.00	12,387,600
サッポロホールディングス	5,800	2,951.00	17,115,800
宝ホールディングス	16,100	945.00	15,214,500
コカ・コーラウエスト	6,800	2,899.00	19,713,200
コカ・コーライーストジャパン	6,400	2,015.00	12,896,000
伊藤園	6,100	3,845.00	23,454,500
不二製油グループ本社	5,200	2,090.00	10,868,000
ハウス食品グループ本社	5,500	2,389.00	13,139,500
カゴメ	7,600	2,657.00	20,193,200
アリアケジャパン	1,900	5,560.00	10,564,000
ニチレイ	21,000	923.00	19,383,000
ユーグレナ	5,300	1,395.00	7,393,500
ゲンゼ	16,000	289.00	4,624,000
東洋紡	81,000	199.00	16,119,000

セーレン	4,500	1,015.00	4,567,500
ワコールホールディングス	10,000	1,122.00	11,220,000
ホギメディカル	1,200	7,180.00	8,616,000
T S I ホールディングス	7,700	629.00	4,843,300
オンワードホールディングス	11,000	674.00	7,414,000
デサント	3,400	1,143.00	3,886,200
北越紀州製紙	12,400	726.00	9,002,400
大王製紙	7,300	1,163.00	8,489,900
レンゴー	17,000	668.00	11,356,000
クレハ	13,000	392.00	5,096,000
日本曹達	13,000	451.00	5,863,000
トクヤマ	31,000	289.00	8,959,000
セントラル硝子	19,000	464.00	8,816,000
東亜合成	10,300	1,044.00	10,753,200
大陽日酸	12,100	978.00	11,833,800
日本パーカライジング	8,000	1,251.00	10,008,000
東京応化工業	3,600	2,776.00	9,993,600
住友ベークライト	18,000	494.00	8,892,000
日本ゼオン	14,000	719.00	10,066,000
アイカ工業	5,000	2,445.00	12,225,000
日本化薬	15,000	985.00	14,775,000
A D E K A	7,400	1,315.00	9,731,000
日油	14,000	856.00	11,984,000
太陽ホールディングス	1,700	3,460.00	5,882,000
エスケー化研	1,000	9,370.00	9,370,000
東洋インキ S C ホールディングス	17,000	454.00	7,718,000
マンダム	2,000	4,860.00	9,720,000
ファンケル	3,600	1,470.00	5,292,000
シーズ・ホールディングス	2,700	2,546.00	6,874,200
ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	10,230.00	22,506,000
タカラバイオ	4,900	1,299.00	6,365,100
アース製薬	1,300	5,000.00	6,500,000
エフピコ	2,500	5,390.00	13,475,000
大日本住友製薬	13,700	1,925.00	26,372,500
持田製薬	1,200	8,360.00	10,032,000
ツムラ	6,500	2,793.00	18,154,500

日医工	4,400	2,195.00	9,658,000
キッセイ薬品工業	2,600	2,244.00	5,834,400
生化学工業	3,700	1,660.00	6,142,000
東和薬品	900	5,310.00	4,779,000
そーせいグループ	1,500	16,670.00	25,005,000
キョーリン製薬ホールディングス	4,800	2,149.00	10,315,200
ペプチドリーム	3,000	4,955.00	14,865,000
出光興産	7,500	2,001.00	15,007,500
コスモエネルギーホールディングス	4,800	1,239.00	5,947,200
オカモト	6,000	1,060.00	6,360,000
日本板硝子	92,000	74.00	6,808,000
住友大阪セメント	39,000	463.00	18,057,000
東海カーボン	19,000	284.00	5,396,000
ニチアス	9,000	816.00	7,344,000
日新製鋼	7,800	1,360.00	10,608,000
東京製鐵	10,700	649.00	6,944,300
大和工業	3,700	2,578.00	9,538,600
丸一鋼管	4,900	3,750.00	18,375,000
大同特殊鋼	28,000	404.00	11,312,000
山陽特殊製鋼	11,000	526.00	5,786,000
日本軽金属ホールディングス	46,100	231.00	10,649,100
三井金属鉱業	58,000	201.00	11,658,000
古河機械金属	29,000	153.00	4,437,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	1,341.00	2,682,000
古河電気工業	66,000	257.00	16,962,000
フジクラ	29,000	493.00	14,297,000
三和ホールディングス	20,100	980.00	19,698,000
東プレ	3,100	2,250.00	6,975,000
パイオラックス	1,000	5,110.00	5,110,000
日本製鋼所	30,000	447.00	13,410,000
三浦工業	7,900	2,276.00	17,980,400
タクマ	6,000	852.00	5,112,000
オークマ	12,000	754.00	9,048,000
富士機械製造	6,900	1,006.00	6,941,400
牧野フライス製作所	10,000	582.00	5,820,000
オーエスジー	7,900	1,722.00	13,603,800

旭ダイヤモンド工業	5,300	801.00	4,245,300
DMG 森精機	11,900	1,130.00	13,447,000
サトーホールディングス	2,500	2,299.00	5,747,500
小森コーポレーション	5,300	1,301.00	6,895,300
椿本チエイン	12,000	686.00	8,232,000
ダイフク	8,900	1,967.00	17,506,300
タダノ	8,000	930.00	7,440,000
フジテック	6,800	966.00	6,568,800
平和	5,500	2,116.00	11,638,000
理想科学工業	2,600	1,433.00	3,725,800
竹内製作所	3,200	1,414.00	4,524,800
アマノ	5,500	1,828.00	10,054,000
グローリー	6,000	3,045.00	18,270,000
T P R	2,100	2,130.00	4,473,000
不二越	13,000	320.00	4,160,000
日立造船	16,800	525.00	8,820,000
明電舎	16,000	345.00	5,520,000
東芝テック	13,000	384.00	4,992,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33,000	424.00	13,992,000
沖電気工業	86,000	136.00	11,696,000
ワコム	15,300	411.00	6,288,300
アルバック	3,000	3,100.00	9,300,000
ジャパンディスプレイ	38,300	192.00	7,353,600
アンリツ	13,900	626.00	8,701,400
富士通ゼネラル	6,000	2,221.00	13,326,000
日立国際電気	5,200	1,643.00	8,543,600
ミツミ電機	9,100	464.00	4,222,400
パイオニア	30,300	186.00	5,635,800
フォスター電機	2,400	1,803.00	4,327,200
日本航空電子工業	6,000	1,467.00	8,802,000
日立マクセル	3,200	1,500.00	4,800,000
アルパイン	4,200	1,045.00	4,389,000
アズビル	5,900	3,100.00	18,290,000
日本光電工業	7,200	3,075.00	22,140,000
堀場製作所	3,600	4,635.00	16,686,000

アドバンテスト	16,600	1,159.00	19,239,400
OBARA GROUP	1,200	4,010.00	4,812,000
ウシオ電機	10,600	1,268.00	13,440,800
新光電気工業	7,100	545.00	3,869,500
太陽誘電	10,800	920.00	9,936,000
ミツバ	3,200	1,258.00	4,025,600
SCREENホールディングス	20,000	1,101.00	22,020,000
トヨタ紡織	5,400	2,193.00	11,842,200
ユニプレス	3,700	1,726.00	6,386,200
東海理化電機製作所	5,000	1,614.00	8,070,000
三井造船	71,000	152.00	10,792,000
日産車体	8,100	1,089.00	8,820,900
新明和工業	9,000	708.00	6,372,000
日信工業	3,800	1,398.00	5,312,400
KYB	17,000	368.00	6,256,000
カルソニックカンセイ	14,000	827.00	11,578,000
ケーヒン	4,400	1,620.00	7,128,000
エクセディ	2,100	2,274.00	4,775,400
ハイレックスコーポレーション	1,900	2,337.00	4,440,300
豊田合成	6,500	1,960.00	12,740,000
日本精機	4,000	1,680.00	6,720,000
エフ・シー・シー	3,300	1,895.00	6,253,500
テイ・エス テック	4,200	2,598.00	10,911,600
ナカニシ	2,300	3,440.00	7,912,000
東京精密	3,900	2,363.00	9,215,700
トプコン	7,100	1,014.00	7,199,400
CYBERDYNE	8,000	2,140.00	17,120,000
セイコーホールディングス	14,000	336.00	4,704,000
ニプロ	12,500	1,271.00	15,887,500
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,740.00	8,532,000
パイロットコーポレーション	2,900	4,435.00	12,861,500
トッパン・フォームズ	4,400	1,167.00	5,134,800
フジシールインターナショナル	2,200	3,870.00	8,514,000
日本写真印刷	2,800	1,953.00	5,468,400
リンテック	4,700	2,100.00	9,870,000

三菱鉛筆	1,100	4,945.00	5,439,500
タカラスタンダード	7,000	987.00	6,909,000
コクヨ	7,500	1,449.00	10,867,500
岡村製作所	5,400	1,043.00	5,632,200
沖縄電力	3,200	2,138.00	6,841,600
西日本鉄道	27,000	549.00	14,823,000
山九	25,000	574.00	14,350,000
ニッコンホールディングス	4,100	1,970.00	8,077,000
福山通運	8,000	585.00	4,680,000
セイノーホールディングス	14,100	1,068.00	15,058,800
日立物流	4,400	1,744.00	7,673,600
住友倉庫	12,000	518.00	6,216,000
近鉄エクスプレス	3,500	1,383.00	4,840,500
NEC ネットエスアイ	2,400	1,956.00	4,694,400
新日鉄住金ソリューションズ	3,500	1,751.00	6,128,500
グリー	11,200	495.00	5,544,000
コーエーテクモホールディングス	3,900	1,916.00	7,472,400
コロプラ	5,100	1,954.00	9,965,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,500	285.00	11,542,500
GMO ペイメントゲートウェイ	1,800	5,250.00	9,450,000
インターネットイニシアティブ	3,000	2,187.00	6,561,000
日本オラクル	3,500	5,910.00	20,685,000
オービック ビジネスコンサルタント	1,000	4,810.00	4,810,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,900	2,363.00	11,578,700
デジタルガレージ	3,600	1,990.00	7,164,000
ネットワンシステムズ	8,600	661.00	5,684,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,800	1,218.00	4,628,400
日本ユニシス	5,800	1,294.00	7,505,200
東京放送ホールディングス	8,600	1,427.00	12,272,200
テレビ朝日ホールディングス	4,800	1,707.00	8,193,600
スカパー J S A Tホールディングス	13,300	468.00	6,224,400
光通信	1,900	8,370.00	15,903,000
GMO インターネット	7,000	1,240.00	8,680,000
カドカワ	5,000	1,407.00	7,035,000
松竹	9,000	1,147.00	10,323,000

東映	7,000	931.00	6,517,000
D T S	2,000	2,010.00	4,020,000
カプコン	4,800	2,206.00	10,588,800
N S D	3,800	1,667.00	6,334,600
あい ホールディングス	3,700	2,430.00	8,991,000
シップヘルスケアホールディングス	4,400	3,230.00	14,212,000
第一興商	3,700	4,400.00	16,280,000
アズワン	1,500	4,265.00	6,397,500
黒田電気	3,700	1,867.00	6,907,900
I D O M	6,200	565.00	3,503,000
長瀬産業	9,800	1,201.00	11,769,800
兼松	37,000	171.00	6,327,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	1,956.00	9,388,800
阪和興業	18,000	576.00	10,368,000
岩谷産業	18,000	600.00	10,800,000
稲畑産業	4,100	1,013.00	4,153,300
東邦ホールディングス	4,700	2,306.00	10,838,200
サンゲツ	5,600	2,050.00	11,480,000
サンリオ	4,700	1,915.00	9,000,500
リョーサン	2,800	3,045.00	8,526,000
モスフードサービス	2,200	2,982.00	6,560,400
P A L T A C	3,000	2,133.00	6,399,000
日鉄住金物産	15,000	353.00	5,295,000
トラスコ中山	1,800	5,200.00	9,360,000
オートバックスセブン	5,800	1,475.00	8,555,000
因幡電機産業	2,300	3,675.00	8,452,500
サンエー	1,600	5,130.00	8,208,000
アスクル	2,400	3,700.00	8,880,000
ゲオホールディングス	3,500	1,454.00	5,089,000
アダストリア	3,100	3,175.00	9,842,500
日本マクドナルドホールディングス	7,000	3,040.00	21,280,000
エディオン	7,300	864.00	6,307,200
セリア	1,600	7,480.00	11,968,000
ジェイアイエヌ	1,200	4,150.00	4,980,000
ビックカメラ	8,000	926.00	7,408,000
D C Mホールディングス	8,300	904.00	7,503,200

Monotaro	6,500	3,200.00	20,800,000
ココカラファイン	1,500	4,895.00	7,342,500
ウエルシアホールディングス	1,600	6,740.00	10,784,000
クリエイトSDホールディングス	2,400	2,681.00	6,434,400
すかいらーく	10,700	1,357.00	14,519,900
コスモス薬品	900	21,150.00	19,035,000
クスリのアオキ	1,500	4,840.00	7,260,000
ゼンショーホールディングス	9,400	1,534.00	14,419,600
サイゼリヤ	2,900	2,269.00	6,580,100
ユナイテッドアローズ	2,300	3,025.00	6,957,500
コロワイド	5,900	1,881.00	11,097,900
日本瓦斯	2,500	2,322.00	5,805,000
島忠	4,800	2,264.00	10,867,200
チヨダ	1,700	2,299.00	3,908,300
ラオックス	2,000	736.00	1,472,000
AOKIホールディングス	4,100	1,099.00	4,505,900
コメリ	3,100	2,669.00	8,273,900
ユニグループ・ホールディングス	20,700	836.00	17,305,200
イズミ	3,100	4,170.00	12,927,000
平和堂	2,600	2,025.00	5,265,000
ヤオコー	1,500	4,680.00	7,020,000
ケーズホールディングス	8,500	1,983.00	16,855,500
アインホールディングス	2,000	6,820.00	13,640,000
吉野家ホールディングス	5,700	1,423.00	8,111,100
アークス	3,200	2,693.00	8,617,600
パローホールディングス	3,300	2,825.00	9,322,500
東京TYフィナンシャルグループ	2,200	2,474.00	5,442,800
第四銀行	28,000	362.00	10,136,000
武蔵野銀行	3,000	2,509.00	7,527,000
七十七銀行	28,000	378.00	10,584,000
青森銀行	18,000	311.00	5,598,000
山形銀行	12,000	436.00	5,232,000
岩手銀行	1,400	4,290.00	6,006,000
東邦銀行	18,000	359.00	6,462,000
十六銀行	29,000	286.00	8,294,000
山梨中央銀行	15,000	409.00	6,135,000

大垣共立銀行	28,000	315.00	8,820,000
北國銀行	22,000	304.00	6,688,000
滋賀銀行	20,000	482.00	9,640,000
南都銀行	20,000	356.00	7,120,000
百五銀行	21,000	389.00	8,169,000
紀陽銀行	6,700	1,451.00	9,721,700
山陰合同銀行	13,100	731.00	9,576,100
百十四銀行	20,000	339.00	6,780,000
阿波銀行	18,000	599.00	10,782,000
大分銀行	14,000	321.00	4,494,000
沖縄銀行	2,040	3,265.00	6,660,600
琉球銀行	3,600	1,127.00	4,057,200
北洋銀行	28,800	314.00	9,043,200
京葉銀行	22,000	434.00	9,548,000
栃木銀行	10,000	382.00	3,820,000
トモニホールディングス	14,100	361.00	5,090,100
池田泉州ホールディングス	23,800	420.00	9,996,000
ジャフコ	2,800	2,886.00	8,080,800
岡三証券グループ	14,000	517.00	7,238,000
丸三証券	5,500	887.00	4,878,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,700	494.00	10,225,800
松井証券	11,600	920.00	10,672,000
マネックスグループ	20,100	249.00	5,004,900
カブドットコム証券	15,500	341.00	5,285,500
芙蓉総合リース	1,600	4,555.00	7,288,000
興銀リース	2,300	1,933.00	4,445,900
東京センチュリーリース	4,300	3,545.00	15,243,500
Jトラスト	8,200	782.00	6,412,400
日本証券金融	9,800	416.00	4,076,800
アイフル	29,100	324.00	9,428,400
オリエントコーポレーション	58,700	198.00	11,622,600
日立キャピタル	4,800	2,072.00	9,945,600
オープンハウス	3,000	2,670.00	8,010,000
大京	30,000	160.00	4,800,000
レオパレス 21	27,000	755.00	20,385,000

	エヌ・ティ・ティ都市開発	11,700	1,097.00	12,834,900	
	ミクシィ	4,000	3,585.00	14,340,000	
	日本M&Aセンター	3,300	6,700.00	22,110,000	
	アコーディア・ゴルフ	6,900	1,203.00	8,300,700	
	クックパッド	4,600	1,412.00	6,495,200	
	ケネディクス	25,400	412.00	10,464,800	
	ダスキン	4,700	1,749.00	8,220,300	
	テクノプロ・ホールディングス	3,700	3,295.00	12,191,500	
	リログループ	1,100	16,900.00	18,590,000	
	エイチ・アイ・エス	3,500	3,000.00	10,500,000	
	共立メンテナンス	1,200	7,020.00	8,424,000	
	カナモト	2,600	2,179.00	5,665,400	
	東京ドーム	16,000	466.00	7,456,000	
	トランス・コスモス	2,400	2,945.00	7,068,000	
	メイテック	2,800	3,575.00	10,010,000	
	アサツー ディ・ケイ	3,300	2,370.00	7,821,000	
	イオンディライト	1,900	2,971.00	5,644,900	
	ダイセキ	3,700	1,919.00	7,100,300	
	小計 銘柄数 : 350			3,311,584,900	
	組入時価比率 : 99.8%			100.0%	
	合計			3,311,584,900	

(注 1) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 28 年 7 月 15 日現在)

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

該当事項はありません。