

平成29年7月期（平成28年7月16日～平成29年7月15日）決算短信

平成29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29年9月28日
 分配金支払開始日 平成29年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成28年7月16日～平成29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29年7月期	2,210	(99.9)	2	(0.1)	2,212	(100)
平成28年7月期	3,311	(99.8)	5	(0.2)	3,316	(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29年7月期	209	0	99	110
平成28年7月期	209	0	0	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29年7月期	2,256	43	2,212	200,923
平成28年7月期	3,372	55	3,316	158,509

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成29年7月期	3,280.00
平成28年7月期	2,100.00

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 9 期 (平成 28 年 7 月 15 日現在)	第 10 期 (平成 29 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,103,938	21,141,506
株式	3,311,584,900	2,210,511,100
未収入金	31,874,400	23,283,200
未収配当金	4,808,099	1,504,922
流動資産合計	3,372,371,337	2,256,440,728
資産合計	3,372,371,337	2,256,440,728
負債の部		
流動負債		
未払金	-	285,753
未払収益分配金	43,944,600	36,119,360
未払受託者報酬	900,583	567,123
未払委託者報酬	8,105,167	5,104,059
未払利息	32	52
その他未払費用	2,460,537	1,803,364
流動負債合計	55,410,919	43,879,711
負債合計	55,410,919	43,879,711
純資産の部		
元本等		
元本	2,975,677,200	1,565,906,400
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	341,283,218	646,654,617
(分配準備積立金)	177,640	58,878
元本等合計	3,316,960,418	2,212,561,017
純資産合計	3,316,960,418	2,212,561,017
負債純資産合計	3,372,371,337	2,256,440,728

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	65,629,105	51,979,462
受取利息	3,966	-
有価証券売買等損益	△480,110,213	671,222,961
その他収益	30,686	26,002
営業収益合計	△414,446,456	723,228,425
営業費用		
支払利息	1,394	5,830

受託者報酬	1,898,066	1,407,483
委託者報酬	17,082,419	12,667,247
その他費用	2,624,489	1,924,306
営業費用合計	21,606,368	16,004,866
営業利益又は営業損失(△)	△436,052,824	707,223,559
経常利益又は経常損失(△)	△436,052,824	707,223,559
当期純利益又は当期純損失(△)	△436,052,824	707,223,559
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(△)	821,280,642	341,283,218
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	-	365,732,800
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	365,732,800
分配金	43,944,600	36,119,360
期末剰余金又は期末欠損金(△)	341,283,218	646,654,617

(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る場合、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 28 年 7 月 16 日から平成 29 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 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 10 期 平成 29 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 110,120 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 15,850.9 円 (10 口当たり純資産額) (158,509 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 20,092.3 円 (10 口当たり純資産額) (200,923 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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>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	<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>51,999,634 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>177,640 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>52,177,274 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>15,999,036 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>36,178,238 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>36,119,360 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	51,999,634 円	分配準備積立金	B	177,640 円	配当等収益合計額	C=A+B	52,177,274 円	経費	D	15,999,036 円	収益分配可能額	E=C-D	36,178,238 円	収益分配金	F	36,119,360 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																																									
項目																																											
当期配当等収益額	A	51,999,634 円																																									
分配準備積立金	B	177,640 円																																									
配当等収益合計額	C=A+B	52,177,274 円																																									
経費	D	15,999,036 円																																									
収益分配可能額	E=C-D	36,178,238 円																																									
収益分配金	F	36,119,360 円																																									

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。

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	58,878 円
口数	H	110,120 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	3,280 円

2. その他費用

その他費用のうち 1,688,013 円は、対象指数についての商標使用料であります。

(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 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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 9 期 平成 28 年 7 月 15 日現在	第 10 期 平成 29 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 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 年 7 月 15 日
期首元本額 2,975,677,200 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 0 円	期中一部交換元本額 1,409,770,800 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 9 期 自 平成 27 年 7 月 16 日 至 平成 28 年 7 月 15 日	第 10 期 自 平成 28 年 7 月 16 日 至 平成 29 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	△502,617,607	437,350,436
合計	△502,617,607	437,350,436

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 29 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	13,400	632.00	8,468,800	
		マルハニチロ	2,000	2,929.00	5,858,000	
		サカタのタネ	1,500	3,500.00	5,250,000	
		石油資源開発	1,600	2,298.00	3,676,800	
		ショーボンドホールディングス	1,000	5,660.00	5,660,000	
		ミライト・ホールディングス	2,900	1,280.00	3,712,000	
		安藤・間	6,400	727.00	4,652,800	
		東急建設	3,300	883.00	2,913,900	
		東建コーポレーション	400	13,450.00	5,380,000	
		西松建設	13,000	625.00	8,125,000	
		三井住友建設	39,700	123.00	4,883,100	
		前田建設工業	6,000	1,356.00	8,136,000	

奥村組	8,000	757.00	6,056,000
東鉄工業	1,300	3,415.00	4,439,500
戸田建設	11,000	738.00	8,118,000
熊谷組	19,000	380.00	7,220,000
N I P P O	3,000	2,247.00	6,741,000
前田道路	3,000	2,286.00	6,858,000
五洋建設	14,100	657.00	9,263,700
住友林業	6,400	1,752.00	11,212,800
パナホーム	2,000	1,197.00	2,394,000
ライト工業	2,100	1,191.00	2,501,100
中電工	1,100	2,979.00	3,276,900
関電工	5,000	1,122.00	5,610,000
きんでん	6,700	1,880.00	12,596,000
日本電設工業	1,500	2,246.00	3,369,000
協和エクシオ	4,000	1,890.00	7,560,000
九電工	2,000	4,355.00	8,710,000
高砂熱学工業	2,300	1,835.00	4,220,500
大気社	1,000	2,946.00	2,946,000
東芝プラントシステム	1,900	1,822.00	3,461,800
千代田化工建設	8,000	655.00	5,240,000
日本製粉	2,500	1,778.00	4,445,000
森永製菓	1,700	6,490.00	11,033,000
亀田製菓	500	5,590.00	2,795,000
森永乳業	9,000	832.00	7,488,000
雪印メグミルク	1,900	3,195.00	6,070,500
プリマハム	7,000	690.00	4,830,000
伊藤ハム米久ホールディングス	6,200	1,022.00	6,336,400
サッポロホールディングス	2,900	3,010.00	8,729,000
宝ホールディングス	8,000	1,159.00	9,272,000
ダイドーグループホールディングス	500	5,610.00	2,805,000
日清オイリオグループ	6,000	644.00	3,864,000
不二製油グループ本社	2,700	2,575.00	6,952,500
ハウス食品グループ本社	2,800	2,873.00	8,044,400
アリアケジャパン	900	7,740.00	6,966,000
ユーグレナ	2,900	1,172.00	3,398,800
グンゼ	8,000	410.00	3,280,000

東洋紡	40,000	215.00	8,600,000
セーレン	2,200	1,807.00	3,975,400
ワコールホールディングス	5,000	1,509.00	7,545,000
ホギメディカル	600	7,750.00	4,650,000
オンワードホールディングス	5,000	798.00	3,990,000
デサント	1,700	1,576.00	2,679,200
日本製紙	4,400	2,286.00	10,058,400
北越紀州製紙	6,100	835.00	5,093,500
大王製紙	3,700	1,470.00	5,439,000
レンゴー	8,600	643.00	5,529,800
昭和電工	6,600	2,907.00	19,186,200
クレハ	600	5,500.00	3,300,000
日本曹達	6,000	621.00	3,726,000
トクヤマ	16,000	559.00	8,944,000
セントラル硝子	10,000	490.00	4,900,000
東亜合成	5,100	1,424.00	7,262,400
大陽日酸	6,300	1,263.00	7,956,900
日本パーカライジング	4,000	1,628.00	6,512,000
日本触媒	1,400	7,350.00	10,290,000
東京応化工業	1,700	3,735.00	6,349,500
住友ベークライト	9,000	854.00	7,686,000
日本ゼオン	7,000	1,272.00	8,904,000
アイカ工業	2,500	3,475.00	8,687,500
日本化薬	7,000	1,634.00	11,438,000
ADEKA	3,600	1,695.00	6,102,000
日油	7,000	1,506.00	10,542,000
三洋化成工業	500	5,320.00	2,660,000
太陽ホールディングス	800	5,020.00	4,016,000
サカタインクス	1,800	1,887.00	3,396,600
東洋インキSCホールディングス	8,000	589.00	4,712,000
マンダム	1,000	6,260.00	6,260,000
ファンケル	1,800	2,074.00	3,733,200
シーズ・ホールディングス	1,300	3,980.00	5,174,000
ノエビアホールディングス	800	5,600.00	4,480,000
タカラバイオ	2,500	1,590.00	3,975,000
アース製薬	700	6,170.00	4,319,000

エフピコ	1,200	6,000.00	7,200,000
ロート製薬	5,100	2,293.00	11,694,300
持田製薬	600	7,840.00	4,704,000
日医工	2,200	1,712.00	3,766,400
キッセイ薬品工業	1,300	2,936.00	3,816,800
生化学工業	1,900	1,819.00	3,456,100
栄研化学	800	3,540.00	2,832,000
ゼリア新薬工業	1,600	2,054.00	3,286,400
キョーリン製薬ホールディングス	2,200	2,483.00	5,462,600
ペプチドリーム	3,300	3,415.00	11,269,500
コスモエネルギーホールディングス	2,600	1,818.00	4,726,800
東洋ゴム工業	4,800	2,381.00	11,428,800
オカモト	3,000	1,327.00	3,981,000
ニッタ	900	3,565.00	3,208,500
日本板硝子	4,500	990.00	4,455,000
住友大阪セメント	19,000	549.00	10,431,000
東海カーボン	9,300	690.00	6,417,000
ニチアス	5,000	1,416.00	7,080,000
ニチハ	1,100	4,065.00	4,471,500
日新製鋼	2,900	1,279.00	3,709,100
東京製鐵	5,200	999.00	5,194,800
大和工業	1,800	3,050.00	5,490,000
淀川製鋼所	1,000	3,065.00	3,065,000
丸一鋼管	2,500	3,435.00	8,587,500
大同特殊鋼	14,000	678.00	9,492,000
山陽特殊製鋼	5,000	672.00	3,360,000
愛知製鋼	500	4,615.00	2,307,500
大平洋金属	8,000	296.00	2,368,000
日本軽金属ホールディングス	27,000	285.00	7,695,000
三井金属鉱業	29,000	483.00	14,007,000
DOWAホールディングス	12,000	881.00	10,572,000
古河機械金属	14,000	208.00	2,912,000
UACJ	13,000	319.00	4,147,000
フジクラ	12,200	989.00	12,065,800
リョービ	5,000	501.00	2,505,000
アサヒホールディングス	1,300	1,909.00	2,481,700

ノーリツ	1,300	2,235.00	2,905,500
長府製作所	1,000	2,604.00	2,604,000
東プレ	1,500	2,978.00	4,467,000
パイオラックス	1,500	3,130.00	4,695,000
日本発條	7,900	1,227.00	9,693,300
日本製鋼所	3,000	1,883.00	5,649,000
三浦工業	3,900	2,149.00	8,381,100
タクマ	3,200	1,124.00	3,596,800
オークマ	6,000	1,092.00	6,552,000
富士機械製造	3,400	1,767.00	6,007,800
牧野フライス製作所	5,000	979.00	4,895,000
オーエスジー	3,800	2,438.00	9,264,400
DMG 森精機	5,800	1,918.00	11,124,400
島精機製作所	1,200	5,850.00	7,020,000
サトーホールディングス	1,300	2,668.00	3,468,400
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,200	4,295.00	5,154,000
小森コーポレーション	2,500	1,427.00	3,567,500
椿本チエイン	6,000	1,013.00	6,078,000
ダイフク	4,500	3,520.00	15,840,000
タダノ	4,200	1,407.00	5,909,400
フジテック	3,100	1,515.00	4,696,500
CKD	2,300	1,987.00	4,570,100
平和	2,700	2,416.00	6,523,200
SANKYO	2,500	3,650.00	9,125,000
ユニバーサルエンターテインメント	800	3,225.00	2,580,000
竹内製作所	1,700	2,134.00	3,627,800
アマノ	2,800	2,465.00	6,902,000
T P R	1,000	3,620.00	3,620,000
N T N	21,000	540.00	11,340,000
不二越	7,000	635.00	4,445,000
日立造船	8,400	556.00	4,670,400
スター精密	1,900	1,938.00	3,682,200
日清紡ホールディングス	6,100	1,150.00	7,015,000
イビデン	5,900	1,977.00	11,664,300
明電舎	8,000	396.00	3,168,000

東芝テック	7,000	611.00	4,277,000
ダブル・スコープ	1,300	2,170.00	2,821,000
ダイヘン	5,000	943.00	4,715,000
日新電機	2,100	1,209.00	2,538,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	17,000	504.00	8,568,000
沖電気工業	4,200	1,677.00	7,043,400
アルバック	1,700	5,660.00	9,622,000
E I Z O	900	4,290.00	3,861,000
ジャパンディスプレイ	19,300	199.00	3,840,700
アンリツ	6,600	996.00	6,573,600
富士通ゼネラル	2,800	2,558.00	7,162,400
日立国際電気	2,600	2,669.00	6,939,400
パイオニア	16,300	213.00	3,471,900
フォスター電機	1,200	1,978.00	2,373,600
日本航空電子工業	3,000	1,665.00	4,995,000
アルパイン	2,100	1,697.00	3,563,700
堀場製作所	1,800	7,040.00	12,672,000
OBARA GROUP	600	6,160.00	3,696,000
ウシオ電機	5,300	1,420.00	7,526,000
太陽誘電	5,400	1,800.00	9,720,000
ミツバ	1,600	2,120.00	3,392,000
トヨタ紡織	2,600	2,335.00	6,071,000
ユニプレス	1,900	2,751.00	5,226,900
東海理化電機製作所	2,500	2,184.00	5,460,000
三井造船	35,000	162.00	5,670,000
武蔵精密工業	1,100	3,235.00	3,558,500
日産車体	4,000	1,134.00	4,536,000
新明和工業	4,300	962.00	4,136,600
日信工業	1,900	1,869.00	3,551,100
NOK	3,900	2,486.00	9,695,400
KYB	8,000	612.00	4,896,000
ケーヒン	2,200	1,654.00	3,638,800
エクセディ	1,000	3,245.00	3,245,000
ハイレックスコーポレーション	1,000	2,874.00	2,874,000
豊田合成	3,200	2,756.00	8,819,200

日本精機	2,000	2,249.00	4,498,000
エフ・シー・シー	1,600	2,349.00	3,758,400
テイ・エス テック	2,100	3,365.00	7,066,500
日機装	2,600	1,168.00	3,036,800
ナカニシ	1,100	4,460.00	4,906,000
ブイ・テクノロジー	200	19,510.00	3,902,000
東京精密	2,000	3,810.00	7,620,000
トプコン	4,200	1,948.00	8,181,600
シチズン時計	12,400	823.00	10,205,200
パラマウントベッドホールディングス	900	5,090.00	4,581,000
パイロットコーポレーション	1,400	4,800.00	6,720,000
フジシールインターナショナル	2,200	3,055.00	6,721,000
タカラトミー	3,700	1,391.00	5,146,700
日本写真印刷	1,300	3,065.00	3,984,500
リンテック	2,300	2,744.00	6,311,200
三菱鉛筆	1,200	3,115.00	3,738,000
タカラスタANDARD	1,800	1,884.00	3,391,200
コクヨ	3,700	1,504.00	5,564,800
岡村製作所	2,700	1,055.00	2,848,500
美津濃	4,000	653.00	2,612,000
四国電力	8,600	1,281.00	11,016,600
北海道電力	9,100	862.00	7,844,200
沖縄電力	1,700	2,645.00	4,496,500
西部瓦斯	9,000	268.00	2,412,000
富士急行	2,000	1,168.00	2,336,000
西日本鉄道	13,000	493.00	6,409,000
山九	12,000	743.00	8,916,000
ニッコンホールディングス	2,100	2,543.00	5,340,300
福山通運	5,000	720.00	3,600,000
セイノーホールディングス	6,900	1,483.00	10,232,700
日立物流	2,200	2,492.00	5,482,400
三菱倉庫	6,000	1,447.00	8,682,000
住友倉庫	6,000	708.00	4,248,000
近鉄エクスプレス	1,800	1,897.00	3,414,600
新日鉄住金ソリューションズ	1,800	2,621.00	4,717,800

グリーン	5,800	954.00	5,533,200
コーエーテクモホールディングス	1,900	2,164.00	4,111,600
コロプラ	2,600	1,160.00	3,016,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	21,000	297.00	6,237,000
GMOペイメントゲートウェイ	800	6,290.00	5,032,000
インターネットイニシアティブ	1,500	2,052.00	3,078,000
オービックビジネスコンサルタント	500	5,980.00	2,990,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	3,905.00	9,372,000
デジタルガレージ	1,800	2,109.00	3,796,200
ネットワンシステムズ	4,300	1,140.00	4,902,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,800	1,460.00	2,628,000
日本ユニシス	3,200	1,886.00	6,035,200
東京放送ホールディングス	4,500	1,994.00	8,973,000
テレビ朝日ホールディングス	2,500	1,953.00	4,882,500
スカパーJ S A Tホールディングス	6,600	471.00	3,108,600
GMOインターネット	3,500	1,419.00	4,966,500
カドカワ	2,800	1,397.00	3,911,600
松竹	4,000	1,425.00	5,700,000
東映	3,000	1,069.00	3,207,000
カプコン	2,300	2,595.00	5,968,500
富士ソフト	1,100	3,245.00	3,569,500
N S D	1,800	2,071.00	3,727,800
あい ホールディングス	1,900	3,020.00	5,738,000
シップヘルスケアホールディングス	2,200	3,360.00	7,392,000
第一興商	1,900	5,350.00	10,165,000
アズワン	700	5,420.00	3,794,000
黒田電気	1,600	2,141.00	3,425,600
日本ライフライン	900	4,490.00	4,041,000
シークス	800	4,490.00	3,592,000
長瀬産業	5,000	1,756.00	8,780,000
兼松	19,000	237.00	4,503,000
キヤノンマーケティングジャパン	2,400	2,543.00	6,103,200
阪和興業	9,000	843.00	7,587,000
岩谷産業	9,000	720.00	6,480,000
東邦ホールディングス	2,300	2,156.00	4,958,800

サンゲツ	2,600	1,981.00	5,150,600
サンリオ	2,300	2,222.00	5,110,600
リョーサン	1,300	4,285.00	5,570,500
モスフードサービス	1,100	3,385.00	3,723,500
PAL TAC	1,500	3,935.00	5,902,500
日鉄住金物産	700	5,760.00	4,032,000
トラスコ中山	1,800	2,742.00	4,935,600
オートバックスセブン	3,100	1,895.00	5,874,500
加藤産業	1,000	2,924.00	2,924,000
因幡電機産業	1,200	4,290.00	5,148,000
サンエー	800	4,765.00	3,812,000
アスクル	1,300	3,555.00	4,621,500
アダストリア	1,500	2,746.00	4,119,000
くらコーポレーション	500	5,410.00	2,705,000
エディオン	3,400	992.00	3,372,800
セリア	1,700	5,160.00	8,772,000
ジンズ	600	6,160.00	3,696,000
ビックカメラ	4,200	1,151.00	4,834,200
DCMホールディングス	4,400	961.00	4,228,400
MonotaRO	3,300	3,610.00	11,913,000
ドトール・日レスホールディングス	1,500	2,436.00	3,654,000
ココカラファイン	800	5,480.00	4,384,000
ウエルシアホールディングス	2,000	4,115.00	8,230,000
クリエイトSDホールディングス	1,300	2,902.00	3,772,600
ジョイフル本田	900	3,090.00	2,781,000
すかいらーく	5,300	1,671.00	8,856,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	2,600	1,101.00	2,862,600
トリドールホールディングス	1,100	2,945.00	3,239,500
クスリのアオキホールディングス	800	5,620.00	4,496,000
アトム	3,700	799.00	2,956,300
コーナン商事	1,300	2,052.00	2,667,600
ゼンショーホールディングス	4,600	2,025.00	9,315,000
サイゼリヤ	1,500	3,365.00	5,047,500
ユナイテッドアローズ	1,100	3,400.00	3,740,000
コロワイド	2,900	1,893.00	5,489,700

売番屋	700	3,810.00	2,667,000
日本瓦斯	1,400	3,560.00	4,984,000
島忠	2,400	2,675.00	6,420,000
AOKIホールディングス	2,000	1,423.00	2,846,000
コメリ	1,500	2,873.00	4,309,500
青山商事	2,200	4,000.00	8,800,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,400	1,926.00	8,474,400
アクシアル リテイリング	600	4,195.00	2,517,000
イズミ	1,600	5,790.00	9,264,000
平和堂	1,300	2,293.00	2,980,900
ヤオコー	700	4,750.00	3,325,000
ケーズホールディングス	4,200	2,139.00	8,983,800
アインホールディングス	1,000	8,320.00	8,320,000
吉野家ホールディングス	3,000	1,993.00	5,979,000
王将フードサービス	600	4,320.00	2,592,000
アークス	1,700	2,358.00	4,008,600
パローホールディングス	1,700	2,500.00	4,250,000
東京TYフィナンシャルグループ	1,100	3,075.00	3,382,500
西日本フィナンシャルホールディングス	6,400	1,239.00	7,929,600
第四銀行	14,000	517.00	7,238,000
群馬銀行	18,000	661.00	11,898,000
武蔵野銀行	1,500	3,400.00	5,100,000
七十七銀行	14,000	557.00	7,798,000
青森銀行	9,000	388.00	3,492,000
山形銀行	6,000	496.00	2,976,000
岩手銀行	700	4,495.00	3,146,500
東邦銀行	9,000	391.00	3,519,000
十六銀行	15,000	363.00	5,445,000
山梨中央銀行	7,000	458.00	3,206,000
大垣共立銀行	16,000	319.00	5,104,000
福井銀行	10,000	271.00	2,710,000
北國銀行	11,000	430.00	4,730,000
滋賀銀行	10,000	586.00	5,860,000
南都銀行	1,200	3,200.00	3,840,000
百五銀行	10,000	454.00	4,540,000

紀陽銀行	3,300	1,961.00	6,471,300
ほくほくフィナンシャルグループ	6,000	1,811.00	10,866,000
山陰合同銀行	6,500	908.00	5,902,000
伊予銀行	11,100	930.00	10,323,000
百十四銀行	10,000	363.00	3,630,000
阿波銀行	9,000	743.00	6,687,000
大分銀行	7,000	422.00	2,954,000
沖縄銀行	1,000	4,495.00	4,495,000
琉球銀行	1,800	1,601.00	2,881,800
北洋銀行	14,200	386.00	5,481,200
京葉銀行	11,000	478.00	5,258,000
トモニホールディングス	7,000	532.00	3,724,000
池田泉州ホールディングス	12,100	458.00	5,541,800
F P G	3,300	1,202.00	3,966,600
ジャフコ	1,400	4,575.00	6,405,000
岡三証券グループ	7,000	734.00	5,138,000
丸三証券	2,800	912.00	2,553,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,500	634.00	6,657,000
松井証券	5,700	919.00	5,238,300
カブドットコム証券	7,400	380.00	2,812,000
かんぽ生命保険	3,500	2,501.00	8,753,500
芙蓉総合リース	800	6,470.00	5,176,000
興銀リース	1,100	2,644.00	2,908,400
東京センチュリー	2,200	4,725.00	10,395,000
J トラスト	3,600	883.00	3,178,800
アイフル	14,900	390.00	5,811,000
アコム	17,400	496.00	8,630,400
オリエントコーポレーション	23,400	190.00	4,446,000
日立キャピタル	2,400	2,705.00	6,492,000
いちご	9,900	320.00	3,168,000
オープンハウス	1,600	3,480.00	5,568,000
平和不動産	1,800	1,775.00	3,195,000
大京	15,000	232.00	3,480,000
テーオーシー	2,900	1,028.00	2,981,200
レオパレス 2 1	13,500	755.00	10,192,500

スターツコーポレーション	1,400	2,709.00	3,792,600	
タカラレーベン	4,300	493.00	2,119,900	
イオンモール	5,700	2,117.00	12,066,900	
エヌ・ティ・ティ都市開発	5,800	1,096.00	6,356,800	
日本空港ビルデング	1,800	4,250.00	7,650,000	
L I F U L L	3,000	937.00	2,811,000	
ミクシィ	2,300	6,150.00	14,145,000	
エス・エム・エス	1,300	3,380.00	4,394,000	
クックパッド	2,400	932.00	2,236,800	
ディップ	1,400	2,392.00	3,348,800	
アウトソーシング	600	5,560.00	3,336,000	
ぐるなび	1,300	1,823.00	2,369,900	
インフォマート	4,400	830.00	3,652,000	
ケネディクス	12,700	532.00	6,756,400	
ダスキン	2,200	2,823.00	6,210,600	
ラウンドワン	3,400	1,160.00	3,944,000	
リゾートトラスト	3,800	2,075.00	7,885,000	
ビー・エム・エル	1,100	2,166.00	2,382,600	
エン・ジャパン	1,200	2,971.00	3,565,200	
テクノプロ・ホールディングス	1,800	4,695.00	8,451,000	
エイチ・アイ・エス	1,800	3,350.00	6,030,000	
共立メンテナンス	1,400	3,295.00	4,613,000	
カナモト	1,300	3,785.00	4,920,500	
東京ドーム	4,000	1,009.00	4,036,000	
トランス・コスモス	1,200	2,702.00	3,242,400	
乃村工藝社	1,700	2,224.00	3,780,800	
メイテック	1,300	4,725.00	6,142,500	
アサツー ディ・ケイ	1,700	2,923.00	4,969,100	
イオンディライト	900	3,860.00	3,474,000	
ダイセキ	1,800	2,696.00	4,852,800	
小計	銘柄数：395		2,210,511,100	
	組入時価比率：99.9%		100.0%	
合計			2,210,511,100	

(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 29 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。