

2018年7月期（2017年7月16日～2018年7月15日）決算短信

2018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 増田 真一 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 2018年9月27日
 分配金支払開始日 2018年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 2018年7月期の運用状況（2017年7月16日～2018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	%
2018年7月期	2,403	(99.9)	2	(0.1)	2,406	(100)
2017年7月期	2,210	(99.9)	2	(0.1)	2,212	(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
2018年7月期	110	0	0	110
2017年7月期	209	0	99	110

(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
2018年7月期	2,441	34	2,406	218,558
2017年7月期	2,256	43	2,212	200,923

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
2018年7月期	2,370.00
2017年7月期	3,280.00

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10期 (2017年7月15日現在)	第11期 (2018年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,141,506	25,322,638
株式	2,210,511,100	2,403,944,800
未収入金	23,283,200	10,324,200
未収配当金	1,504,922	1,611,555
流動資産合計	2,256,440,728	2,441,203,193
資産合計	2,256,440,728	2,441,203,193
負債の部		
流動負債		
未払金	285,753	-
未払収益分配金	36,119,360	26,098,440
未払受託者報酬	567,123	663,892
未払委託者報酬	5,104,059	5,975,016
未払利息	52	142
その他未払費用	1,803,364	1,701,120
流動負債合計	43,879,711	34,438,610
負債合計	43,879,711	34,438,610
純資産の部		
元本等		
元本	1,565,906,400	1,565,906,400
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	646,654,617	840,858,183
(分配準備積立金)	58,878	40,589
元本等合計	2,212,561,017	2,406,764,583
純資産合計	2,212,561,017	2,406,764,583
負債純資産合計	2,256,440,728	2,441,203,193

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
営業収益		
受取配当金	51,979,462	40,932,699
有価証券売買等損益	671,222,961	194,221,855
その他収益	26,002	24,985
営業収益合計	723,228,425	235,179,539

営業費用

支払利息	5,830	4,282
受託者報酬	1,407,483	1,305,538
委託者報酬	12,667,247	11,749,779
その他費用	1,924,306	1,817,934
営業費用合計	16,004,866	14,877,533
営業利益又は営業損失(△)	707,223,559	220,302,006
経常利益又は経常損失(△)	707,223,559	220,302,006
当期純利益又は当期純損失(△)	707,223,559	220,302,006
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(△)	341,283,218	646,654,617
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	36,119,360	26,098,440
期末剰余金又は期末欠損金(△)	646,654,617	840,858,183

(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 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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配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、2017年7月16日から2018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10期 2017年7月15日現在	第11期 2018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 110,120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 20,092.3円 (10口当たり純資産額) (200,923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 21,855.8円 (10口当たり純資産額) (218,558円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2016年7月16日 至2017年7月15日	第11期 自2017年7月16日 至2018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>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> </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	<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>40,953,402円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>58,878円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	40,953,402円	分配準備積立金	B	58,878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																	
項目																			
当期配当等収益額	A	40,953,402円																	
分配準備積立金	B	58,878円																	

配当等収益合計額	C=A+B	52,177,274円	配当等収益合計額	C=A+B	41,012,280円
経費	D	15,999,036円	経費	D	14,873,251円
収益分配可能額	E=C-D	36,178,238円	収益分配可能額	E=C-D	26,139,029円
収益分配金	F	36,119,360円	収益分配金	F	26,098,440円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	58,878円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	40,589円
口数	H	110,120口	口数	H	110,120口
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,280円	10口当たり分配金	I=F/H×10	2,370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。

2. その他費用
 その他費用のうち1,564,572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10期 自 2016年7月16日 至 2017年7月15日	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日
<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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。 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 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。 ○市場リスクの管理 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。 ○信用リスクの管理 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。 ○流動性リスクの管理 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 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第10期 2017年7月15日現在	第11期 2018年7月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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 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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期	第11期
------	------

自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	自 2017年 7月 16日 至 2018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。	

(その他の注記)

1 元本の移動

第10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日
期首元本額 2,975,677,200円	期首元本額 1,565,906,400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 1,409,770,800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10期 自 2016年 7月 16日 至 2017年 7月 15日	第11期 自 2017年 7月 16日 至 2018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	437,350,436	146,407,600
合計	437,350,436	146,407,600

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(2018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	12,900	528.00	6,811,200	
		マルハニチロ	1,900	4,035.00	7,666,500	
		サカタのタネ	1,400	4,320.00	6,048,000	
		石油資源開発	1,600	2,667.00	4,267,200	
		ショーボンドホールディングス	900	7,750.00	6,975,000	
		ミライト・ホールディングス	2,700	1,618.00	4,368,600	
		安藤・間	6,500	1,032.00	6,708,000	
		東急建設	3,200	1,098.00	3,513,600	
		東建コーポレーション	300	8,570.00	2,571,000	
		西松建設	2,500	3,130.00	7,825,000	
		三井住友建設	7,500	819.00	6,142,500	
		前田建設工業	6,100	1,248.00	7,612,800	
		奥村組	1,500	3,435.00	5,152,500	
		東鉄工業	1,200	3,350.00	4,020,000	

戸田建設	10,300	937.00	9,651,100
熊谷組	1,800	3,855.00	6,939,000
NIPPON	2,600	2,021.00	5,254,600
前田道路	2,800	2,116.00	5,924,800
五洋建設	13,200	696.00	9,187,200
中電工	1,000	2,780.00	2,780,000
関電工	4,500	1,222.00	5,499,000
日本電設工業	1,400	2,336.00	3,270,400
協和エクシオ	3,600	2,935.00	10,566,000
九電工	1,900	5,210.00	9,899,000
高砂熱学工業	2,200	1,945.00	4,279,000
大気社	1,000	3,180.00	3,180,000
東芝プラントシステム	2,000	2,569.00	5,138,000
千代田化工建設	7,900	907.00	7,165,300
日本製粉	2,300	1,894.00	4,356,200
三井製糖	800	3,325.00	2,660,000
森永製菓	1,600	4,930.00	7,888,000
山崎製パン	4,800	2,812.00	13,497,600
亀田製菓	500	5,820.00	2,910,000
寿スピリッツ	800	5,290.00	4,232,000
森永乳業	1,600	3,730.00	5,968,000
雪印メグミルク	1,800	2,809.00	5,056,200
プリマハム	7,000	561.00	3,927,000
伊藤ハム米久ホールディングス	5,900	901.00	5,315,900
サッポロホールディングス	2,700	2,687.00	7,254,900
宝ホールディングス	7,500	1,331.00	9,982,500
日清オイリオグループ	1,200	3,155.00	3,786,000
不二製油グループ本社	2,500	3,720.00	9,300,000
ハウス食品グループ本社	2,900	3,700.00	10,730,000
アリアケジャパン	900	9,220.00	8,298,000
ユーグレナ	3,000	778.00	2,334,000
グンゼ	700	6,890.00	4,823,000
東洋紡	3,700	1,801.00	6,663,700
倉敷紡績	8,000	356.00	2,848,000
セーレン	2,000	1,753.00	3,506,000
ワコールホールディングス	2,200	3,070.00	6,754,000

ホギメディカル	1,100	4,045.00	4,449,500
T S I ホールディングス	3,500	791.00	2,768,500
オンワードホールディングス	4,800	722.00	3,465,600
日本製紙	3,800	1,744.00	6,627,200
北越コーポレーション	5,700	595.00	3,391,500
大王製紙	3,300	1,525.00	5,032,500
レンゴー	8,100	992.00	8,035,200
クレハ	700	7,530.00	5,271,000
石原産業	1,700	1,286.00	2,186,200
日本曹達	6,000	605.00	3,630,000
トクヤマ	2,900	3,335.00	9,671,500
セントラル硝子	1,800	2,833.00	5,099,400
東亜合成	4,800	1,246.00	5,980,800
大陽日酸	6,200	1,826.00	11,321,200
日本パーカライジング	3,800	1,587.00	6,030,600
日本触媒	1,300	8,090.00	10,517,000
カネカ	12,000	968.00	11,616,000
東京応化工業	1,600	3,930.00	6,288,000
KHネオケム	1,400	3,310.00	4,634,000
住友ベークライト	8,000	1,115.00	8,920,000
日本ゼオン	6,000	1,413.00	8,478,000
アイカ工業	2,400	3,870.00	9,288,000
積水樹脂	1,300	2,168.00	2,818,400
ダイキョーニシカワ	1,700	1,554.00	2,641,800
扶桑化学工業	900	2,660.00	2,394,000
ADEKA	3,400	1,795.00	6,103,000
日油	3,100	3,680.00	11,408,000
三洋化成工業	500	5,010.00	2,505,000
太陽ホールディングス	700	4,495.00	3,146,500
サカタインクス	1,700	1,469.00	2,497,300
東洋インキSCホールディングス	1,600	2,920.00	4,672,000
マンダム	1,800	3,625.00	6,525,000
ミルボン	900	4,825.00	4,342,500
ファンケル	1,600	6,050.00	9,680,000
シーズ・ホールディングス	1,300	5,160.00	6,708,000
ノエビアホールディングス	700	7,940.00	5,558,000

タカラバイオ	2,300	2,346.00	5,395,800
デクセリアルズ	2,300	1,125.00	2,587,500
アース製薬	600	5,740.00	3,444,000
クミアイ化学工業	3,500	873.00	3,055,500
藤森工業	700	3,605.00	2,523,500
エフピコ	1,100	5,980.00	6,578,000
大日本住友製薬	6,500	2,412.00	15,678,000
科研製薬	1,600	5,580.00	8,928,000
持田製薬	600	7,900.00	4,740,000
日医工	2,000	1,592.00	3,184,000
キッセイ薬品工業	1,300	3,045.00	3,958,500
生化学工業	1,800	1,421.00	2,557,800
栄研化学	1,400	2,417.00	3,383,800
JCRファーマ	800	6,130.00	4,904,000
沢井製薬	1,800	5,140.00	9,252,000
ゼリア新薬工業	1,500	2,318.00	3,477,000
そーせいグループ	3,100	1,412.00	4,377,200
キョーリン製薬ホールディングス	2,000	2,172.00	4,344,000
コスモエネルギーホールディングス	2,600	3,720.00	9,672,000
オカモト	3,000	1,224.00	3,672,000
ニッタ	900	4,115.00	3,703,500
日東紡績	1,200	2,650.00	3,180,000
日本板硝子	4,200	1,080.00	4,536,000
住友大阪セメント	18,000	546.00	9,828,000
東海カーボン	8,700	2,144.00	18,652,800
ニチアス	5,000	1,285.00	6,425,000
ニチハ	1,100	3,875.00	4,262,500
日新製鋼	2,300	1,492.00	3,431,600
東京製鐵	4,800	985.00	4,728,000
大和工業	1,700	3,345.00	5,686,500
淀川製鋼所	1,000	2,838.00	2,838,000
丸一鋼管	2,400	3,660.00	8,784,000
大同特殊鋼	1,300	4,900.00	6,370,000
山陽特殊製鋼	1,000	2,807.00	2,807,000
日本軽金属ホールディングス	25,900	241.00	6,241,900
東邦亜鉛	600	3,850.00	2,310,000

DOWAホールディングス	2,300	3,375.00	7,762,500
古河機械金属	1,400	1,629.00	2,280,600
UACJ	1,300	2,335.00	3,035,500
リョービ	1,000	3,475.00	3,475,000
アサヒホールディングス	1,300	2,032.00	2,641,600
トーカロ	2,600	1,170.00	3,042,000
横河ブリッジホールディングス	1,300	2,522.00	3,278,600
東プレ	1,500	2,717.00	4,075,500
パイオラックス	1,300	2,587.00	3,363,100
日本発條	7,500	1,070.00	8,025,000
日本製鋼所	2,900	2,770.00	8,033,000
三浦工業	3,700	2,760.00	10,212,000
タクマ	3,000	1,277.00	3,831,000
オークマ	1,100	6,050.00	6,655,000
東芝機械	5,000	537.00	2,685,000
アイダエンジニアリング	2,200	1,053.00	2,316,600
FUJ I	3,000	1,958.00	5,874,000
牧野フライス製作所	5,000	853.00	4,265,000
オーエスジー	3,500	2,359.00	8,256,500
ソディック	2,000	983.00	1,966,000
日特エンジニアリング	600	2,953.00	1,771,800
島精機製作所	1,200	5,800.00	6,960,000
三井海洋開発	1,000	2,856.00	2,856,000
サトーホールディングス	1,200	3,235.00	3,882,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,100	4,725.00	5,197,500
小森コーポレーション	2,400	1,324.00	3,177,600
椿本チエイン	5,000	935.00	4,675,000
タダノ	3,900	1,366.00	5,327,400
フジテック	2,800	1,422.00	3,981,600
CKD	2,100	1,767.00	3,710,700
平和	2,600	2,587.00	6,726,200
SANKYO	2,200	4,330.00	9,526,000
ユニバーサルエンターテインメント	900	4,330.00	3,897,000
竹内製作所	1,600	2,693.00	4,308,800
アマノ	2,600	2,549.00	6,627,400

TPR	1,000	2,654.00	2,654,000
ツバキ・ナカシマ	1,500	2,552.00	3,828,000
NTN	19,100	455.00	8,690,500
不二越	600	4,915.00	2,949,000
日立造船	7,900	514.00	4,060,600
スター精密	1,700	1,931.00	3,282,700
日清紡ホールディングス	6,400	1,178.00	7,539,200
イビデン	5,400	1,761.00	9,509,400
明電舎	7,000	393.00	2,751,000
東芝テック	6,000	650.00	3,900,000
ダブル・スコープ	1,400	1,424.00	1,993,600
ダイヘン	4,000	667.00	2,668,000
日新電機	1,900	970.00	1,843,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	16,000	498.00	7,968,000
沖電気工業	4,000	1,241.00	4,964,000
サンケン電気	5,000	625.00	3,125,000
ワコム	7,100	580.00	4,118,000
EIZO	800	5,050.00	4,040,000
ジャパンディスプレイ	18,200	133.00	2,420,600
アンリツ	6,200	1,504.00	9,324,800
富士通ゼネラル	2,600	1,730.00	4,498,000
パイオニア	15,300	146.00	2,233,800
フォスター電機	1,100	1,556.00	1,711,600
ホシデン	2,400	898.00	2,155,200
日本航空電子工業	2,000	1,778.00	3,556,000
マクセルホールディングス	1,400	1,801.00	2,521,400
アルパイン	2,000	2,458.00	4,916,000
日本光電工業	3,500	3,190.00	11,165,000
メガチップス	800	2,757.00	2,205,600
OBARA GROUP	500	5,940.00	2,970,000
フェローテックホールディングス	1,700	1,740.00	2,958,000
イリソ電子工業	800	6,570.00	5,256,000
オプテックスグループ	1,300	3,230.00	4,199,000
レーザーテック	1,800	3,110.00	5,598,000
ウシオ電機	4,900	1,419.00	6,953,100

日本セラミック	900	2,887.00	2,598,300
フクダ電子	300	7,720.00	2,316,000
新光電気工業	3,300	1,040.00	3,432,000
太陽誘電	5,000	3,465.00	17,325,000
ニチコン	2,200	1,370.00	3,014,000
日本ケミコン	700	4,380.00	3,066,000
KOA	1,200	2,836.00	3,403,200
ミツバ	1,500	869.00	1,303,500
トヨタ紡織	2,400	2,046.00	4,910,400
ユニプレス	1,800	2,141.00	3,853,800
東海理化電機製作所	2,300	2,008.00	4,618,400
三井E&Sホールディングス	3,300	1,459.00	4,814,700
武蔵精密工業	1,000	3,595.00	3,595,000
日産車体	3,800	982.00	3,731,600
新明和工業	4,100	1,288.00	5,280,800
日信工業	1,800	1,905.00	3,429,000
NOK	3,700	2,099.00	7,766,300
フタバ産業	2,500	702.00	1,755,000
KYB	800	4,920.00	3,936,000
ケーヒン	2,000	2,138.00	4,276,000
ショーワ	2,400	1,818.00	4,363,200
エクセディ	900	3,490.00	3,141,000
ハイレックスコーポレーション	900	2,726.00	2,453,400
豊田合成	3,100	2,657.00	8,236,700
日本精機	1,800	2,232.00	4,017,600
エフ・シー・シー	1,500	3,140.00	4,710,000
テイ・エス テック	1,900	4,485.00	8,521,500
ナカニシ	3,100	2,413.00	7,480,300
ブイ・テクノロジー	200	20,010.00	4,002,000
東京精密	1,800	3,625.00	6,525,000
マニー	900	5,130.00	4,617,000
トプコン	4,700	1,821.00	8,558,700
シチズン時計	11,500	694.00	7,981,000
CYBERDYNE	4,900	1,384.00	6,781,600
セイコーホールディングス	1,300	2,333.00	3,032,900
パラマウントベッドホールディング	800	4,805.00	3,844,000

ス			
パイロットコーポレーション	1,400	6,120.00	8,568,000
フジシールインターナショナル	2,000	4,005.00	8,010,000
タカラトミー	3,900	867.00	3,381,300
N I S S H A	1,400	2,183.00	3,056,200
リンテック	2,200	3,145.00	6,919,000
三菱鉛筆	1,100	2,258.00	2,483,800
タカラスタンダード	1,700	1,865.00	3,170,500
コクヨ	3,500	1,889.00	6,611,500
オカムラ	2,600	1,596.00	4,149,600
美津濃	800	3,690.00	2,952,000
北陸電力	8,200	1,099.00	9,011,800
北海道電力	8,500	691.00	5,873,500
沖縄電力	2,000	2,346.00	4,692,000
相鉄ホールディングス	3,600	3,370.00	12,132,000
西日本鉄道	2,600	2,810.00	7,306,000
ハマキョウレックス	800	3,080.00	2,464,000
山九	2,300	5,590.00	12,857,000
センコーグループホールディングス	3,200	844.00	2,700,800
ニッコンホールディングス	2,300	2,830.00	6,509,000
福山通運	1,000	5,630.00	5,630,000
セイノーホールディングス	6,300	1,893.00	11,925,900
日立物流	2,900	2,755.00	7,989,500
三菱倉庫	2,900	2,405.00	6,974,500
住友倉庫	5,000	683.00	3,415,000
近鉄エクスプレス	1,700	2,135.00	3,629,500
NEC ネットエスアイ	1,100	2,375.00	2,612,500
新日鉄住金ソリューションズ	1,600	2,958.00	4,732,800
T I S	3,200	5,460.00	17,472,000
グリー	5,600	593.00	3,320,800
コーエーテクモホールディングス	1,700	2,105.00	3,578,500
コロプラ	2,800	745.00	2,086,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,700	262.00	5,161,400
GMO ペイメントゲートウェイ	800	13,760.00	11,008,000
インターネットイニシアティブ	1,300	2,105.00	2,736,500

LINE	2,200	5,090.00	11,198,000
マクロミル	1,100	2,725.00	2,997,500
ジャストシステム	1,500	2,319.00	3,478,500
伊藤忠テクノソリューションズ	4,400	2,063.00	9,077,200
デジタルガレージ	1,700	4,335.00	7,369,500
ネットワンシステムズ	4,000	1,943.00	7,772,000
エイベックス	1,700	1,459.00	2,480,300
日本ユニシス	3,400	2,724.00	9,261,600
東京放送ホールディングス	4,500	2,373.00	10,678,500
テレビ朝日ホールディングス	2,300	2,278.00	5,239,400
スカパーJ SATホールディングス	6,200	536.00	3,323,200
GMOインターネット	3,400	2,513.00	8,544,200
カドカワ	2,600	1,158.00	3,010,800
ゼンリン	1,800	2,721.00	4,897,800
松竹	400	14,160.00	5,664,000
東映	300	10,650.00	3,195,000
D T S	900	4,115.00	3,703,500
カプコン	4,200	2,640.00	11,088,000
富士ソフト	1,000	4,560.00	4,560,000
N S D	1,500	2,460.00	3,690,000
あらた	500	5,340.00	2,670,000
ペッパーフードサービス	500	3,980.00	1,990,000
あい ホールディングス	1,700	2,329.00	3,959,300
ダイワボウホールディングス	800	5,650.00	4,520,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,700	1,814.00	3,083,800
TOKAIホールディングス	3,400	1,033.00	3,512,200
シップヘルスケアホールディングス	2,100	4,345.00	9,124,500
コメダホールディングス	1,600	2,165.00	3,464,000
ナガイレーベン	1,000	2,726.00	2,726,000
第一興商	1,800	5,250.00	9,450,000
アズワン	700	7,710.00	5,397,000
日本ライフライン	1,900	2,965.00	5,633,500
シークス	1,500	2,444.00	3,666,000
長瀬産業	4,800	1,766.00	8,476,800
兼松	3,500	1,551.00	5,428,500

山善	2,200	1,079.00	2,373,800
キヤノンマーケティングジャパン	2,200	2,205.00	4,851,000
阪和興業	1,700	4,170.00	7,089,000
岩谷産業	1,700	3,780.00	6,426,000
稲畑産業	1,900	1,623.00	3,083,700
東邦ホールディングス	2,200	2,704.00	5,948,800
サンゲツ	2,300	2,170.00	4,991,000
サンリオ	2,100	2,112.00	4,435,200
リョーサン	1,100	3,930.00	4,323,000
モスフードサービス	1,000	3,125.00	3,125,000
加賀電子	700	2,490.00	1,743,000
PAL TAC	1,400	6,130.00	8,582,000
日鉄住金物産	700	5,640.00	3,948,000
トラスコ中山	1,700	2,587.00	4,397,900
オートバックスセブン	2,900	1,912.00	5,544,800
加藤産業	900	3,745.00	3,370,500
因幡電機産業	1,100	4,395.00	4,834,500
サンエー	800	5,190.00	4,152,000
エービーシー・マート	1,500	6,180.00	9,270,000
アスクル	1,000	3,045.00	3,045,000
ゲオホールディングス	1,600	1,416.00	2,265,600
アダストリア	1,300	1,319.00	1,714,700
エディオン	3,000	1,132.00	3,396,000
セリア	1,700	5,700.00	9,690,000
ジンズ	500	5,900.00	2,950,000
ビックカメラ	4,200	1,748.00	7,341,600
DCMホールディングス	4,200	989.00	4,153,800
MonotaRO	3,100	5,360.00	16,616,000
ドトール・日レスホールディングス	1,400	2,093.00	2,930,200
ココカラファイン	700	6,950.00	4,865,000
ウエルシアホールディングス	2,200	5,800.00	12,760,000
クリエイトSDホールディングス	1,200	2,831.00	3,397,200
すかいらーくホールディングス	6,200	1,565.00	9,703,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	2,500	1,299.00	3,247,500
コスモス薬品	400	25,620.00	10,248,000

トリドールホールディングス	1,100	2,370.00	2,607,000
クスリのアオキホールディングス	800	8,750.00	7,000,000
スシログローバルホールディングス	1,000	6,730.00	6,730,000
アトム	4,400	1,018.00	4,479,200
ノジマ	1,100	2,281.00	2,509,100
コーナン商事	1,300	2,424.00	3,151,200
ゼンショーホールディングス	4,200	2,518.00	10,575,600
サイゼリヤ	1,400	2,207.00	3,089,800
ユニテッドアローズ	1,000	4,415.00	4,415,000
コロワイド	2,800	2,784.00	7,795,200
荅番屋	600	4,620.00	2,772,000
スギホールディングス	1,700	6,020.00	10,234,000
上新電機	800	3,210.00	2,568,000
日本瓦斯	1,600	5,960.00	9,536,000
ロイヤルホールディングス	1,200	2,796.00	3,355,200
島忠	2,200	3,450.00	7,590,000
AOKIホールディングス	1,800	1,572.00	2,829,600
コメリ	1,400	2,718.00	3,805,200
青山商事	1,900	3,570.00	6,783,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,200	1,704.00	7,156,800
アクシアル リテイリング	600	4,140.00	2,484,000
イズミ	1,400	6,560.00	9,184,000
平和堂	1,200	2,714.00	3,256,800
ヤオコー	700	5,900.00	4,130,000
ケーズホールディングス	7,900	1,273.00	10,056,700
アインホールディングス	1,000	8,010.00	8,010,000
吉野家ホールディングス	3,000	1,805.00	5,415,000
アークス	1,700	2,862.00	4,865,400
パローホールディングス	1,600	2,368.00	3,788,800
ベルク	400	5,240.00	2,096,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,100	2,302.00	2,532,200
西日本フィナンシャルホールディングス	6,000	1,247.00	7,482,000
第四銀行	1,300	4,265.00	5,544,500
武蔵野銀行	1,400	3,070.00	4,298,000

七十七銀行	2,600	2,391.00	6,216,600
青森銀行	800	3,135.00	2,508,000
山形銀行	1,100	2,285.00	2,513,500
岩手銀行	700	4,210.00	2,947,000
東邦銀行	8,700	401.00	3,488,700
十六銀行	1,400	2,690.00	3,766,000
山梨中央銀行	7,000	389.00	2,723,000
大垣共立銀行	1,600	2,739.00	4,382,400
福井銀行	900	2,293.00	2,063,700
北國銀行	1,000	4,285.00	4,285,000
滋賀銀行	10,000	574.00	5,740,000
南都銀行	1,200	2,696.00	3,235,200
百五銀行	9,900	427.00	4,227,300
紀陽銀行	3,100	1,791.00	5,552,100
ほくほくフィナンシャルグループ	5,500	1,456.00	8,008,000
広島銀行	11,600	699.00	8,108,400
山陰合同銀行	6,100	965.00	5,886,500
伊予銀行	9,200	708.00	6,513,600
百十四銀行	9,000	331.00	2,979,000
四国銀行	1,700	1,257.00	2,136,900
阿波銀行	8,000	667.00	5,336,000
大分銀行	700	3,835.00	2,684,500
沖縄銀行	1,000	3,955.00	3,955,000
琉球銀行	1,700	1,632.00	2,774,400
北洋銀行	13,300	374.00	4,974,200
京葉銀行	10,000	460.00	4,600,000
トモニホールディングス	6,800	448.00	3,046,400
池田泉州ホールディングス	11,800	371.00	4,377,800
FPG	3,200	1,301.00	4,163,200
ジャフコ	1,100	4,155.00	4,570,500
岡三証券グループ	6,000	521.00	3,126,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,000	697.00	6,970,000
松井証券	5,300	1,056.00	5,596,800
マネックスグループ	8,700	592.00	5,150,400
かんぽ生命保険	3,300	2,286.00	7,543,800

全国保証	2,400	4,985.00	11,964,000
芙蓉総合リース	800	7,050.00	5,640,000
興銀リース	1,100	2,693.00	2,962,300
東京センチュリー	2,000	5,770.00	11,540,000
Jトラスト	2,800	884.00	2,475,200
日本証券金融	4,300	571.00	2,455,300
アイフル	14,400	349.00	5,025,600
リコーリース	600	3,435.00	2,061,000
アコム	16,400	415.00	6,806,000
ジャックス	1,000	2,264.00	2,264,000
オリエントコーポレーション	26,000	146.00	3,796,000
日立キャピタル	2,300	2,815.00	6,474,500
いちご	11,000	524.00	5,764,000
オープンハウス	1,500	6,160.00	9,240,000
平和不動産	1,600	2,020.00	3,232,000
ダイビル	2,200	1,078.00	2,371,600
大京	1,400	2,395.00	3,353,000
テーオーシー	2,700	763.00	2,060,100
レオパレス21	12,400	595.00	7,378,000
スターツコーポレーション	1,300	2,542.00	3,304,600
イオンモール	5,200	1,950.00	10,140,000
エス・ティ・ティ都市開発	5,400	1,138.00	6,145,200
日本空港ビルデング	1,700	5,030.00	8,551,000
LIFULL	3,000	707.00	2,121,000
UTグループ	1,200	4,035.00	4,842,000
エス・エム・エス	2,800	1,977.00	5,535,600
ディップ	1,500	2,900.00	4,350,000
ベネフィット・ワン	1,400	3,140.00	4,396,000
アウトソーシング	3,800	2,148.00	8,162,400
インフォマート	4,400	1,494.00	6,573,600
RIZAPグループ	3,700	1,506.00	5,572,200
EPSホールディングス	1,500	2,178.00	3,267,000
ケネディクス	11,900	626.00	7,449,400
ダスキン	2,000	2,633.00	5,266,000
ラウンドワン	3,200	1,746.00	5,587,200
リゾートトラスト	3,700	1,891.00	6,996,700

	エン・ジャパン	1,200	5,280.00	6,336,000	
	テクノプロ・ホールディングス	1,800	6,810.00	12,258,000	
	エイチ・アイ・エス	1,600	3,065.00	4,904,000	
	共立メンテナンス	1,400	5,770.00	8,078,000	
	カナモト	1,200	3,485.00	4,182,000	
	東京ドーム	3,800	934.00	3,549,200	
	西尾レントオール	700	3,595.00	2,516,500	
	トランス・コスモス	1,100	2,583.00	2,841,300	
	乃村工藝社	1,600	2,318.00	3,708,800	
	メイテック	1,200	5,330.00	6,396,000	
	船井総研ホールディングス	1,600	2,406.00	3,849,600	
	イオンディライト	1,000	4,075.00	4,075,000	
	ダイセキ	1,600	3,105.00	4,968,000	
	小計 銘柄数：450			2,403,944,800	
	組入時価比率：99.9%			100.0%	
	合計			2,403,944,800	

(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(2018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。