

平成27年7月期（平成26年7月16日～平成27年7月15日）決算短信

平成27年8月26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27年9月30日
 分配金支払開始日 平成27年8月21日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月16日～平成27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27年7月期	3,793	(99.9)	3	(0.1)	3,796	(100)
平成26年7月期	4,390	(99.9)	2	(0.1)	4,392	(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27年7月期	309	0	99	209
平成26年7月期	309	0	0	309

(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27年7月期	3,867	70	3,796	181,447
平成26年7月期	4,451	59	4,392	142,146

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成27年7月期	2,560.00
平成26年7月期	1,470.00

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 7 期 (平成 26 年 7 月 15 日現在)	第 8 期 (平成 27 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,133,593	25,630,410
株式	4,390,036,500	3,793,819,300
未収入金	42,222,686	44,372,200
未収配当金	3,262,522	3,956,169
未収利息	29	48
流動資産合計	4,451,655,330	3,867,778,127
資産合計	4,451,655,330	3,867,778,127
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	45,423,882	53,570,560
未払受託者報酬	1,102,967	1,383,104
未払委託者報酬	9,926,665	12,447,846
その他未払費用	2,819,167	3,418,775
流動負債合計	59,272,681	70,820,285
負債合計	59,272,681	70,820,285
純資産の部		
元本等		
元本	4,394,065,320	2,975,677,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,682,671	821,280,642
(分配準備積立金)	24,374	64,851
元本等合計	4,392,382,649	3,796,957,842
純資産合計	4,392,382,649	3,796,957,842
負債純資産合計	4,451,655,330	3,867,778,127

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	69,952,972	83,428,001
受取利息	9,425	8,124
有価証券売買等損益	460,526,387	1,262,787,216
その他収益	27,231	18,534
営業収益合計	530,516,015	1,346,241,875
営業費用		
受託者報酬	2,172,649	2,617,016
委託者報酬	19,553,721	23,553,011
その他費用	2,951,824	3,673,595

営業費用合計	24,678,194	29,843,622
営業利益又は営業損失(△)	505,837,821	1,316,398,253
経常利益又は経常損失(△)	505,837,821	1,316,398,253
当期純利益又は当期純損失(△)	505,837,821	1,316,398,253
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(△)	△462,096,610	△1,682,671
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	45,423,882	53,570,560
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,682,671	821,280,642

(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 26 年 7 月 16 日から平成 27 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 7 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 27 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 309,006 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 209,260 口
2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額 元本の欠損 1,682,671 円	
3. 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 14,214.6 円 (10 口当たり純資産額) (142,146 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 18,144.7 円 (10 口当たり純資産額) (181,447 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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>69,989,628 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>136,822 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>70,126,450 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>24,678,194 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>45,448,256 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	69,989,628 円	分配準備積立金	B	136,822 円	配当等収益合計額	C=A+B	70,126,450 円	経費	D	24,678,194 円	収益分配可能額	E=C-D	45,448,256 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>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> </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
項目																																					
当期配当等収益額	A	69,989,628 円																																			
分配準備積立金	B	136,822 円																																			
配当等収益合計額	C=A+B	70,126,450 円																																			
経費	D	24,678,194 円																																			
収益分配可能額	E=C-D	45,448,256 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	45,423,882 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	24,374 円
口数	H	309,006 口
10 口当たり分配金	I=F/H×10	1,470 円

2. その他費用

その他費用のうち 2,607,047 円は、対象指数についての商標使用料であります。

収益分配金	F	53,570,560 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。

(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 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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 7 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 8 期 平成 27 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ります。</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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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	同左

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 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日		第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	
期首元本額	4,394,065,320 円	期首元本額	4,394,065,320 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	1,418,388,120 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 7 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 8 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 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	363,452,595	702,971,550
合計	363,452,595	702,971,550

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 27 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	24,000	365.00	8,760,000	
		マルハニチロ	4,000	2,178.00	8,712,000	
		サカタのタネ	3,100	2,294.00	7,111,400	
		石油資源開発	3,200	3,885.00	12,432,000	
		ショーボンドホールディングス	2,000	5,290.00	10,580,000	
		ミライト・ホールディングス	6,000	1,450.00	8,700,000	
		安藤・間	12,400	661.00	8,196,400	
		鉄建建設	11,000	357.00	3,927,000	
		西松建設	27,000	464.00	12,528,000	
		三井住友建設	71,600	157.00	11,241,200	
		前田建設工業	12,000	840.00	10,080,000	
		奥村組	17,000	638.00	10,846,000	
		東鉄工業	2,500	2,567.00	6,417,500	
		戸田建設	21,000	576.00	12,096,000	
		熊谷組	34,000	353.00	12,002,000	

N I P P O	6,000	2,106.00	12,636,000	
前田道路	6,000	2,261.00	13,566,000	
五洋建設	28,900	511.00	14,767,900	
パナホーム	8,000	866.00	6,928,000	
関電工	10,000	780.00	7,800,000	
きんでん	13,800	1,642.00	22,659,600	
日本電設工業	3,000	2,314.00	6,942,000	
協和エクシオ	8,400	1,514.00	12,717,600	
高砂熱学工業	4,900	1,550.00	7,595,000	
大気社	2,600	2,946.00	7,659,600	
東芝プラントシステム	4,000	1,409.00	5,636,000	
東洋エンジニアリング	12,000	314.00	3,768,000	
日本製粉	10,000	809.00	8,090,000	
江崎グリコ	3,300	6,330.00	20,889,000	
森永乳業	18,000	464.00	8,352,000	
雪印メグミルク	4,000	1,622.00	6,488,000	
伊藤ハム	11,000	698.00	7,678,000	
サッポロホールディングス	30,000	465.00	13,950,000	
宝ホールディングス	16,700	985.00	16,449,500	
コカ・コーラウエスト	7,100	2,182.00	15,492,200	
コカ・コーライーストジャパン	5,700	2,171.00	12,374,700	
伊藤園	6,200	2,601.00	16,126,200	
不二製油	5,200	2,161.00	11,237,200	
ハウス食品グループ本社	5,700	2,333.00	13,298,100	
カゴメ	7,700	2,015.00	15,515,500	
アリアケジャパン	1,900	5,360.00	10,184,000	
ニチレイ	21,000	906.00	19,026,000	
ユーグレナ	5,400	1,724.00	9,309,600	
ゲンゼ	16,000	339.00	5,424,000	
東洋紡	84,000	187.00	15,708,000	
日清紡ホールディングス	14,000	1,373.00	19,222,000	
ワコールホールディングス	10,000	1,462.00	14,620,000	
ホギメディカル	1,200	6,100.00	7,320,000	
T S I ホールディングス	8,400	841.00	7,064,400	
オンワードホールディングス	11,000	799.00	8,789,000	
北越紀州製紙	13,200	707.00	9,332,400	

大王製紙	8,000	1,275.00	10,200,000
レンゴー	17,000	497.00	8,449,000
クレハ	13,000	472.00	6,136,000
日本曹達	13,000	755.00	9,815,000
トクヤマ	32,000	230.00	7,360,000
セントラル硝子	20,000	525.00	10,500,000
東亜合成	10,700	972.00	10,400,400
日本パーカライジング	8,300	1,164.00	9,661,200
東京応化工業	3,700	3,485.00	12,894,500
住友ベークライト	18,000	523.00	9,414,000
日本ゼオン	14,000	1,107.00	15,498,000
アイカ工業	5,100	2,761.00	14,081,100
ADEKA	7,800	1,652.00	12,885,600
日油	14,000	1,029.00	14,406,000
太陽ホールディングス	1,800	4,880.00	8,784,000
エスケー化研	1,000	12,600.00	12,600,000
東洋インキSCホールディングス	18,000	489.00	8,802,000
ライオン	21,000	1,055.00	22,155,000
マダム	2,000	5,270.00	10,540,000
ファンケル	3,700	1,732.00	6,408,400
コーセー	3,100	11,160.00	34,596,000
ドクターシーラボ	1,400	4,610.00	6,454,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,200	7,260.00	15,972,000
タカラバイオ	4,400	1,411.00	6,208,400
アース製薬	1,400	4,685.00	6,559,000
エフピコ	2,700	4,350.00	11,745,000
ニフコ	4,500	5,120.00	23,040,000
日本新薬	5,000	4,000.00	20,000,000
ロート製薬	9,300	2,095.00	19,483,500
持田製薬	1,300	6,920.00	8,996,000
日医工	4,400	3,640.00	16,016,000
キッセイ薬品工業	2,700	3,060.00	8,262,000
生化学工業	3,700	2,038.00	7,540,600
ゼリア新薬工業	2,900	1,790.00	5,191,000
そーせいグループ	1,400	6,830.00	9,562,000
キョーリン製薬ホールディングス	5,300	2,509.00	13,297,700

ペプチドリーム	2,700	3,470.00	9,369,000
コスモ石油	49,000	196.00	9,604,000
日東紡績	14,000	607.00	8,498,000
日本板硝子	95,000	125.00	11,875,000
住友大阪セメント	40,000	467.00	18,680,000
東海カーボン	19,000	370.00	7,030,000
ニチアス	9,000	748.00	6,732,000
日新製鋼	7,600	1,429.00	10,860,400
東京製鐵	11,100	883.00	9,801,300
大和工業	3,800	2,600.00	9,880,000
丸一鋼管	4,900	3,090.00	15,141,000
大同特殊鋼	27,000	484.00	13,068,000
大平洋金属	16,000	360.00	5,760,000
日本軽金属ホールディングス	45,900	205.00	9,409,500
東邦亜鉛	13,000	364.00	4,732,000
古河機械金属	30,000	226.00	6,780,000
UACJ	24,000	291.00	6,984,000
古河電気工業	68,000	205.00	13,940,000
SUMCO	14,200	1,384.00	19,652,800
三和ホールディングス	20,000	1,032.00	20,640,000
三協立山	2,500	1,921.00	4,802,500
ノーリツ	2,700	1,984.00	5,356,800
長府製作所	1,900	2,942.00	5,589,800
東プレ	3,200	2,256.00	7,219,200
日本製鋼所	32,000	482.00	15,424,000
三浦工業	7,800	1,418.00	11,060,400
オークマ	12,000	1,283.00	15,396,000
東芝機械	11,000	513.00	5,643,000
富士機械製造	7,000	1,257.00	8,799,000
牧野フライス製作所	10,000	1,162.00	11,620,000
オーエスジー	7,800	2,727.00	21,270,600
旭ダイヤモンド工業	5,200	1,305.00	6,786,000
DMG 森精機	12,200	2,313.00	28,218,600
三井海洋開発	2,200	1,825.00	4,015,000
サトーホールディングス	2,300	3,165.00	7,279,500
小森コーポレーション	5,600	1,517.00	8,495,200

椿本チエイン	12,000	1,090.00	13,080,000
ダイフク	8,300	1,922.00	15,952,600
タダノ	8,000	1,850.00	14,800,000
フジテック	6,900	1,371.00	9,459,900
平和	4,200	2,541.00	10,672,200
理想科学工業	3,100	2,341.00	7,257,100
アマノ	5,600	1,713.00	9,592,800
サンデンホールディングス	10,000	542.00	5,420,000
不二越	14,000	676.00	9,464,000
イーグル工業	2,200	2,602.00	5,724,400
日立工機	5,200	992.00	5,158,400
日立造船	17,000	688.00	11,696,000
明電舎	16,000	427.00	6,832,000
東芝テック	13,000	634.00	8,242,000
サンケン電気	12,000	749.00	8,988,000
ワコム	15,800	459.00	7,252,200
日本信号	4,600	1,353.00	6,223,800
アンリツ	14,500	833.00	12,078,500
富士通ゼネラル	6,000	1,598.00	9,588,000
日立国際電気	5,000	1,845.00	9,225,000
ミツミ電機	9,200	851.00	7,829,200
パイオニア	27,800	228.00	6,338,400
ローランド ディー. ジー.	1,100	3,335.00	3,668,500
日本航空電子工業	6,000	2,943.00	17,658,000
日立マクセル	3,500	1,920.00	6,720,000
アルパイン	4,300	2,167.00	9,318,100
堀場製作所	3,700	5,220.00	19,314,000
日本マイクロニクス	1,300	2,675.00	3,477,500
OBARA GROUP	1,200	6,150.00	7,380,000
イリソ電子工業	800	8,450.00	6,760,000
ウシオ電機	10,800	1,550.00	16,740,000
エンプラス	1,000	5,020.00	5,020,000
新光電気工業	7,200	854.00	6,148,800
太陽誘電	10,900	1,614.00	17,592,600
ミツバ	3,300	2,990.00	9,867,000
スター精密	3,800	1,908.00	7,250,400

SCREENホールディングス	21,000	758.00	15,918,000
トヨタ紡織	5,400	2,087.00	11,269,800
ユニプレス	3,700	2,404.00	8,894,800
東海理化電機製作所	5,000	2,957.00	14,785,000
武蔵精密工業	2,200	2,210.00	4,862,000
日産車体	8,300	1,691.00	14,035,300
新明和工業	9,000	1,112.00	10,008,000
日信工業	3,900	2,032.00	7,924,800
カヤバ工業	17,000	416.00	7,072,000
カルソニックカンセイ	14,000	847.00	11,858,000
ケーヒン	4,500	1,642.00	7,389,000
ショーワ	5,200	1,172.00	6,094,400
エクセディ	2,000	3,015.00	6,030,000
ハイレックスコーポレーション	2,000	4,010.00	8,020,000
豊田合成	6,400	2,793.00	17,875,200
日本精機	4,000	2,496.00	9,984,000
エフ・シー・シー	3,500	1,892.00	6,622,000
タカタ	3,200	1,231.00	3,939,200
テイ・エス テック	4,200	3,210.00	13,482,000
日機装	5,500	1,243.00	6,836,500
ナカニシ	2,300	4,900.00	11,270,000
東京精密	4,000	2,624.00	10,496,000
朝日インテック	2,500	8,090.00	20,225,000
CYBERDYNE	2,300	3,115.00	7,164,500
セイコーホールディングス	13,000	655.00	8,515,000
ニプロ	11,300	1,240.00	14,012,000
パラマウントベッドホールディングス	1,800	3,710.00	6,678,000
パイロットコーポレーション	3,400	4,855.00	16,507,000
フジシールインターナショナル	2,300	3,665.00	8,429,500
日本写真印刷	2,900	2,196.00	6,368,400
リンテック	4,900	2,757.00	13,509,300
タカラスタンダード	8,000	865.00	6,920,000
コクヨ	7,700	1,071.00	8,246,700
美津濃	8,000	594.00	4,752,000
沖縄電力	2,200	3,175.00	6,985,000

西部瓦斯	19,000	296.00	5,624,000
西日本鉄道	28,000	594.00	16,632,000
山九	25,000	645.00	16,125,000
日本梱包運輸倉庫	4,200	2,110.00	8,862,000
福山通運	9,000	660.00	5,940,000
セイノーホールディングス	14,200	1,372.00	19,482,400
日立物流	4,500	2,147.00	9,661,500
飯野海運	8,000	582.00	4,656,000
住友倉庫	12,000	695.00	8,340,000
近鉄エクスプレス	1,800	5,610.00	10,098,000
NEC ネットエスアイ	2,500	2,644.00	6,610,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,800	4,095.00	7,371,000
ITホールディングス	7,900	2,909.00	22,981,100
グリー	11,400	720.00	8,208,000
コーエーテクモホールディングス	3,100	2,120.00	6,572,000
ネクソン	14,500	1,717.00	24,896,500
コロプラ	3,700	2,441.00	9,031,700
インターネットイニシアティブ	2,800	2,182.00	6,109,600
伊藤忠テクノソリューションズ	5,200	3,095.00	16,094,000
デジタルガレージ	3,700	1,739.00	6,434,300
ネットワンシステムズ	8,700	849.00	7,386,300
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,700	2,064.00	7,636,800
日本ユニシス	5,800	1,301.00	7,545,800
東京放送ホールディングス	8,800	1,800.00	15,840,000
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,969.00	9,057,400
スカパーJ SATホールディングス	13,700	661.00	9,055,700
日本通信	10,500	381.00	4,000,500
光通信	1,900	8,440.00	16,036,000
GMOインターネット	7,100	1,802.00	12,794,200
KADOKAWA・DWANGO	4,300	1,470.00	6,321,000
松竹	9,000	1,094.00	9,846,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	3,115.00	22,739,500
カプコン	5,000	2,589.00	12,945,000
SCSK	5,200	3,905.00	20,306,000
富士ソフト	2,100	2,514.00	5,279,400

N S D	3,900	1,662.00	6,481,800
あい ホールディングス	3,600	2,012.00	7,243,200
シップヘルスケアホールディングス	4,200	2,600.00	10,920,000
第一興商	3,800	4,585.00	17,423,000
アズワン	1,400	4,255.00	5,957,000
黒田電気	3,800	2,418.00	9,188,400
ガリバーインターナショナル	6,200	1,216.00	7,539,200
長瀬産業	10,100	1,624.00	16,402,400
兼松	38,000	225.00	8,550,000
キヤノンマーケティングジャパン	5,100	2,119.00	10,806,900
阪和興業	19,000	539.00	10,241,000
岩谷産業	19,000	783.00	14,877,000
東邦ホールディングス	4,700	3,000.00	14,100,000
サンゲツ	6,000	1,965.00	11,790,000
サンリオ	4,400	3,375.00	14,850,000
リョーサン	3,000	3,200.00	9,600,000
モスフードサービス	2,300	2,571.00	5,913,300
日鉄住金物産	15,000	426.00	6,390,000
トラスコ中山	1,900	4,225.00	8,027,500
オートバックスセブン	5,800	2,059.00	11,942,200
因幡電機産業	2,200	4,230.00	9,306,000
サンエー	1,700	5,750.00	9,775,000
アスクル	2,200	4,200.00	9,240,000
エディオン	7,700	871.00	6,706,700
セリア	1,600	5,260.00	8,416,000
ビックカメラ	7,200	1,374.00	9,892,800
DCMホールディングス	8,300	1,091.00	9,055,300
MonotaRO	3,200	5,610.00	17,952,000
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,055.00	6,165,000
マツモトキヨシホールディングス	4,000	5,430.00	21,720,000
スタートトゥデイ	6,000	3,815.00	22,890,000
ウエルシアホールディングス	1,500	6,020.00	9,030,000
コスモス薬品	1,000	16,720.00	16,720,000
ゼンショーホールディングス	9,100	1,167.00	10,619,700
ユナイテッドアローズ	2,300	4,270.00	9,821,000
コロワイド	5,900	1,922.00	11,339,800

日本瓦斯	2,400	4,105.00	9,852,000
島忠	4,900	3,545.00	17,370,500
AOKIホールディングス	3,800	1,632.00	6,201,600
コメリ	3,200	2,805.00	8,976,000
青山商事	5,600	4,815.00	26,964,000
ユニーグループ・ホールディングス	20,900	812.00	16,970,800
イズミ	3,300	5,840.00	19,272,000
平和堂	2,500	2,650.00	6,625,000
ヤオコー	1,400	5,640.00	7,896,000
ケーズホールディングス	4,500	3,905.00	17,572,500
アインファーマシーズ	2,000	5,460.00	10,920,000
吉野家ホールディングス	5,800	1,433.00	8,311,400
王将フードサービス	1,200	4,070.00	4,884,000
アークス	3,000	2,616.00	7,848,000
バロー	3,400	2,834.00	9,635,600
東京T Yフィナンシャルグループ	2,200	4,045.00	8,899,000
第四銀行	29,000	533.00	15,457,000
武蔵野銀行	3,100	4,850.00	15,035,000
青森銀行	18,000	407.00	7,326,000
山形銀行	13,000	540.00	7,020,000
岩手銀行	1,400	5,470.00	7,658,000
東邦銀行	19,000	565.00	10,735,000
十六銀行	29,000	506.00	14,674,000
山梨中央銀行	16,000	583.00	9,328,000
大垣共立銀行	30,000	453.00	13,590,000
福井銀行	20,000	267.00	5,340,000
北國銀行	22,000	450.00	9,900,000
滋賀銀行	21,000	661.00	13,881,000
南都銀行	21,000	440.00	9,240,000
百五銀行	22,000	595.00	13,090,000
紀陽銀行	7,000	1,871.00	13,097,000
山陰合同銀行	13,000	1,238.00	16,094,000
百十四銀行	21,000	436.00	9,156,000
阿波銀行	19,000	793.00	15,067,000
鹿児島銀行	14,000	857.00	11,998,000
大分銀行	15,000	539.00	8,085,000

肥後銀行	16,000	766.00	12,256,000
沖縄銀行	1,700	5,290.00	8,993,000
琉球銀行	3,700	1,840.00	6,808,000
名古屋銀行	13,000	489.00	6,357,000
北洋銀行	29,500	563.00	16,608,500
京葉銀行	22,000	632.00	13,904,000
トモニホールディングス	14,400	557.00	8,020,800
池田泉州ホールディングス	24,100	562.00	13,544,200
ジャフコ	2,700	5,400.00	14,580,000
岡三証券グループ	14,000	871.00	12,194,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,000	929.00	19,509,000
いちよし証券	4,000	1,192.00	4,768,000
松井証券	11,800	1,123.00	13,251,400
マネックスグループ	19,800	333.00	6,593,400
全国保証	4,800	4,515.00	21,672,000
芙蓉総合リース	1,600	5,180.00	8,288,000
興銀リース	2,000	2,888.00	5,776,000
東京センチュリーリース	4,600	4,055.00	18,653,000
Jトラスト	7,000	1,061.00	7,427,000
日本証券金融	10,200	721.00	7,354,200
アイフル	30,000	380.00	11,400,000
アコム	36,000	534.00	19,224,000
ジャックス	11,000	574.00	6,314,000
オリエン트コーポレーション	36,200	216.00	7,819,200
日立キャピタル	4,900	3,270.00	16,023,000
平和不動産	3,800	1,746.00	6,634,800
ダイビル	4,800	1,115.00	5,352,000
大京	30,000	217.00	6,510,000
エス・ティ・ティ都市開発	12,000	1,214.00	14,568,000
日本M&Aセンター	3,200	5,310.00	16,992,000
アコーディア・ゴルフ	7,900	1,262.00	9,969,800
テンブホールディングス	4,200	4,925.00	20,685,000
クックパッド	4,300	2,485.00	10,685,500
総合警備保障	5,300	5,240.00	27,772,000
メッセージ	1,400	3,465.00	4,851,000

	ケネディクス	26,400	461.00	12,170,400	
	ダスキン	5,000	2,123.00	10,615,000	
	ラウンドワン	7,100	622.00	4,416,200	
	リロ・ホールディング	1,100	13,470.00	14,817,000	
	エイチ・アイ・エス	3,600	4,500.00	16,200,000	
	カナモト	2,500	3,035.00	7,587,500	
	東京ドーム	16,000	506.00	8,096,000	
	西尾レントオール	1,400	3,095.00	4,333,000	
	トランス・コスモス	2,500	3,165.00	7,912,500	
	メイテック	2,800	4,810.00	13,468,000	
	アサツー ディ・ケイ	3,400	2,874.00	9,771,600	
	イオンディライト	2,000	4,060.00	8,120,000	
	ダイセキ	3,700	2,496.00	9,235,200	
	小計 銘柄数 : 349			3,793,819,300	
	組入時価比率 : 99.9%			100.0%	
	合計			3,793,819,300	

(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 27 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。