



2019年7月期 (2018年7月16日～2019年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2019 (July 16, 2018 – July 15, 2019)

2019年8月26日
 August 26, 2019

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

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 Russell/Nomura Small Cap Core 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 兼代表取締役社長 中川 順子
 問合せ先責任者 商品企画部長 増田 真一 TEL(03)-3241-9511

Fund name: Russell/Nomura Small Cap Core Index Linked Exchange Traded Fund
 Code: 1312
 Underlying index: Russell/Nomura Small Cap Core Index
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Junko Nakagawa, President & CEO
 Contact person: Shinichi Masuda, General Manager of Products Planning & Development Dept.

有価証券報告書提出予定日 2019年9月26日
 分配金支払開始日 2019年8月23日
 Scheduled date of submission of securities report: September 26, 2019
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2019

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2019年7月期の運用状況 (2018年7月16日～2019年7月15日)

Management Status for Year ended July 2019 (from July 16, 2018 to July 15, 2019)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	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)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %	百万円 JPY mil.	% %
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,072	(99.7)	5	(0.3)	2,077	(100.0)
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	2,403	(99.9)	2	(0.1)	2,406	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	110	0	0	110
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	110	0	0	110

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,117	39	2,077	188,659
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	2,441	34	2,406	218,558

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,940
2018年7月期 FY ended Jul. 2018	2,370

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第 11 期 (2018 年 7 月 15 日現在) 11th Fiscal Year As of July 15, 2018	第 12 期 (2019 年 7 月 15 日現在) 12th Fiscal Year As of July 15, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	25,322,638	8,852,014
株式 Stocks	2,403,944,800	2,072,300,690
未収入金 Accounts receivable - other	10,324,200	33,129,900
未収配当金 Accrued dividends receivable	1,611,555	2,849,280
流動資産合計 Total current assets	2,441,203,193	2,117,131,884
資産合計 Total assets	2,441,203,193	2,117,131,884
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	26,098,440	32,375,280
未払受託者報酬 Trustee fee payable	663,892	569,594
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	5,975,016	5,126,271
未払利息 Accrued interest expenses	142	74
その他未払費用 Other accrued expenses	1,701,120	1,545,904
流動負債合計 Total current liabilities	34,438,610	39,617,123
負債合計 Total liabilities	34,438,610	39,617,123
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	1,565,906,400	1,565,906,400
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	840,858,183	511,608,361
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	40,589	104,461
元本等合計 Total principal and other	2,406,764,583	2,077,514,761
純資産合計 Total net assets	2,406,764,583	2,077,514,761
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,441,203,193	2,117,131,884

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit: JPY)

	第11期 自 2017年7月16日 至 2018年7月15日 11th Fiscal Year From July 16, 2017 to July 15, 2018	第12期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日 12th Fiscal Year From July 16, 2018 to July 15, 2019
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	40,932,699	45,991,391
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	194,221,855	△329,313,694
その他収益 Other revenue	24,985	26,765
営業収益合計 Total operating revenue	235,179,539	△283,295,538
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	4,282	5,484
受託者報酬 Trustee fee	1,305,538	1,192,620
委託者報酬 Investment trust management fee	11,749,779	10,733,491
その他費用 Other expenses	1,817,934	1,647,409
営業費用合計 Total operating expenses	14,877,533	13,579,004
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	220,302,006	△296,874,542
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	220,302,006	△296,874,542
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	220,302,006	△296,874,542
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 (△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	646,654,617	840,858,183

Surplus (deficit) at beginning of period		
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit		
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit		
分配金 Dividends	26,098,440	32,375,280
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	840,858,183	511,608,361

(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、2018年7月16日から2019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11期 2018年7月15日現在	第12期 2019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 21,855.8円 (10口当たり純資産額) (218,558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 18,865.9円 (10口当たり純資産額) (188,659円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自2017年7月16日 至2018年7月15日	第12期 自2018年7月16日 至2019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>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> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>41,012,280円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>14,873,251円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>26,139,029円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>26,098,440円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>40,589円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>110,120口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>2,370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	配当等収益合計額	C=A+B	41,012,280円	経費	D	14,873,251円	収益分配可能額	E=C-D	26,139,029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	40,589円	口数	H	110,120口	10口当たり分配金	I=F/H×10	2,370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>46,012,672円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>40,589円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>46,053,261円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>13,573,520円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>32,479,741円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>32,375,280円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>104,461円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>110,120口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>2,940円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	46,012,672円	分配準備積立金	B	40,589円	配当等収益合計額	C=A+B	46,053,261円	経費	D	13,573,520円	収益分配可能額	E=C-D	32,479,741円	収益分配金	F	32,375,280円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	104,461円	口数	H	110,120口	10口当たり分配金	I=F/H×10	2,940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	41,012,280円																																																											
経費	D	14,873,251円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	26,139,029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	40,589円																																																											
口数	H	110,120口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	2,370円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	46,012,672円																																																											
分配準備積立金	B	40,589円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	46,053,261円																																																											
経費	D	13,573,520円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	32,479,741円																																																											
収益分配金	F	32,375,280円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	104,461円																																																											
口数	H	110,120口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	2,940円																																																											
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	2. その他費用 その他費用のうち1,431,373円は、対象指数についての商標																																																												

使用料であります。	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 11 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 年 7 月 15 日	第 12 期 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 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 11 期 2018 年 7 月 15 日現在	第 12 期 2019 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 11 期 自 2017 年 7 月 16 日 至 2018 年 7 月 15 日	第 12 期 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 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 11 期	第 12 期

自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日	自 2018年 7月 16日 至 2019年 7月 15日
期首元本額 1,565,906,400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 0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11期 自 2017年 7月 16日 至 2018年 7月 15日	第12期 自 2018年 7月 16日 至 2019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	146,407,600	△291,982,689
合計	146,407,600	△291,982,689

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(2019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	13,300	710.00	9,443,000	
		マルハニチロ	1,900	3,290.00	6,251,000	
		サカタのタネ	1,500	3,400.00	5,100,000	
		石油資源開発	1,600	2,511.00	4,017,600	
		ショーボンドホールディングス	1,800	3,895.00	7,011,000	
		ミライト・ホールディングス	3,300	1,664.00	5,491,200	
		安藤・間	6,900	748.00	5,161,200	
		東急建設	3,300	758.00	2,501,400	
		西松建設	2,500	2,131.00	5,327,500	
		三井住友建設	7,700	591.00	4,550,700	
		前田建設工業	6,300	854.00	5,380,200	
		奥村組	1,500	3,355.00	5,032,500	
		東鉄工業	1,200	3,040.00	3,648,000	
		戸田建設	10,400	609.00	6,333,600	
		熊谷組	2,000	3,085.00	6,170,000	
		N I P P O	2,600	2,132.00	5,543,200	
		前田道路	2,900	2,332.00	6,762,800	
		五洋建設	13,300	526.00	6,995,800	

ライト工業	2,000	1,450.00	2,900,000
中電工	1,200	2,379.00	2,854,800
関電工	4,500	940.00	4,230,000
日本電設工業	1,400	2,168.00	3,035,200
九電工	2,000	3,385.00	6,770,000
高砂熱学工業	2,200	1,782.00	3,920,400
大気社	1,000	3,395.00	3,395,000
東芝プラントシステム	2,300	2,048.00	4,710,400
千代田化工建設	8,000	306.00	2,448,000
日本製粉	2,300	1,778.00	4,089,400
森永製菓	1,700	5,390.00	9,163,000
山崎製パン	4,900	1,666.00	8,163,400
亀田製菓	500	4,985.00	2,492,500
寿スピリッツ	800	6,090.00	4,872,000
森永乳業	1,700	4,405.00	7,488,500
雪印メグミルク	1,900	2,390.00	4,541,000
プリマハム	1,400	2,127.00	2,977,800
S F o o d s	700	3,825.00	2,677,500
伊藤ハム米久ホールディングス	6,000	737.00	4,422,000
サッポロホールディングス	2,700	2,344.00	6,328,800
ダイドーグループホールディングス	500	4,710.00	2,355,000
日清オイリオグループ	1,200	3,140.00	3,768,000
不二製油グループ本社	2,400	3,350.00	8,040,000
ハウス食品グループ本社	2,900	4,150.00	12,035,000
アリアケジャパン	900	6,970.00	6,273,000
グンゼ	700	5,030.00	3,521,000
東洋紡	3,700	1,334.00	4,935,800
セーレン	2,000	1,540.00	3,080,000
ワコールホールディングス	2,100	2,867.00	6,020,700
ホギメディカル	1,100	3,175.00	3,492,500
オンワードホールディングス	4,700	586.00	2,754,200
ゴールドウイン	500	13,820.00	6,910,000
デサント	1,700	1,704.00	2,896,800
日本製紙	3,900	1,935.00	7,546,500
北越コーポレーション	5,700	577.00	3,288,900

大王製紙	3,400	1,283.00	4,362,200
レンゴー	8,300	822.00	6,822,600
クレハ	800	7,060.00	5,648,000
石原産業	1,700	1,246.00	2,118,200
日本曹達	1,200	2,730.00	3,276,000
トクヤマ	2,800	2,698.00	7,554,400
セントラル硝子	1,800	2,461.00	4,429,800
東亜合成	4,800	1,182.00	5,673,600
大陽日酸	6,200	2,168.00	13,441,600
日本パーカライジング	3,800	1,198.00	4,552,400
日本触媒	1,300	7,150.00	9,295,000
東京応化工業	1,600	3,370.00	5,392,000
KHネオケム	1,500	2,731.00	4,096,500
住友ベークライト	1,700	3,565.00	6,060,500
日本ゼオン	6,000	1,174.00	7,044,000
アイカ工業	2,400	3,605.00	8,652,000
積水樹脂	1,300	2,139.00	2,780,700
日立化成	4,900	3,010.00	14,749,000
日本化薬	6,900	1,329.00	9,170,100
ADEKA	3,400	1,605.00	5,457,000
三洋化成工業	500	5,520.00	2,760,000
中国塗料	2,600	927.00	2,410,200
太陽ホールディングス	700	3,255.00	2,278,500
エスケー化研	100	46,950.00	4,695,000
東洋インキSCホールディングス	1,600	2,356.00	3,769,600
マンダム	1,900	2,656.00	5,046,400
ミルボン	900	5,430.00	4,887,000
ファンケル	3,300	2,680.00	8,844,000
ノエビアホールディングス	700	5,880.00	4,116,000
タカラバイオ	2,400	2,142.00	5,140,800
デクセリアルズ	2,500	701.00	1,752,500
アース製薬	600	4,780.00	2,868,000
クミアイ化学工業	3,400	776.00	2,638,400
レック	1,100	1,243.00	1,367,300
藤森工業	800	2,990.00	2,392,000

エフピコ	1,100	6,560.00	7,216,000
科研製薬	1,600	5,480.00	8,768,000
持田製薬	1,100	4,785.00	5,263,500
日医工	2,000	1,255.00	2,510,000
キッセイ薬品工業	1,300	2,749.00	3,573,700
生化学工業	1,800	1,272.00	2,289,600
栄研化学	1,500	1,774.00	2,661,000
JCRファーマ	800	6,700.00	5,360,000
東和薬品	1,200	2,842.00	3,410,400
ゼリア新薬工業	1,500	2,097.00	3,145,500
そーせいグループ	3,200	2,273.00	7,273,600
キョーリン製薬ホールディングス	2,100	1,868.00	3,922,800
サンバイオ	1,200	3,415.00	4,098,000
TOYO TIRE	4,700	1,512.00	7,106,400
オカモト	600	5,010.00	3,006,000
ニッタ	900	3,025.00	2,722,500
三ツ星ベルト	1,000	1,999.00	1,999,000
日東紡績	1,100	2,381.00	2,619,100
日本板硝子	4,200	714.00	2,998,800
住友大阪セメント	1,800	4,130.00	7,434,000
日本カーボン	500	4,140.00	2,070,000
MARUWA	400	5,540.00	2,216,000
ニチアス	2,400	1,951.00	4,682,400
ニチハ	1,100	3,040.00	3,344,000
東京製鐵	4,700	829.00	3,896,300
大和工業	1,700	3,045.00	5,176,500
丸一鋼管	2,500	2,838.00	7,095,000
大同特殊鋼	1,300	3,950.00	5,135,000
山陽特殊製鋼	1,000	1,434.00	1,434,000
大太平洋金属	700	2,256.00	1,579,200
日本軽金属ホールディングス	26,700	232.00	6,194,400
三井金属鉱業	2,800	2,488.00	6,966,400
東邦亜鉛	600	2,438.00	1,462,800
DOWAホールディングス	2,400	3,420.00	8,208,000
UACJ	1,400	1,830.00	2,562,000

古河電気工業	3,100	3,150.00	9,765,000
フジクラ	11,700	408.00	4,773,600
リョービ	1,000	2,019.00	2,019,000
アサヒホールディングス	1,500	2,282.00	3,423,000
トーカロ	2,800	798.00	2,234,400
横河ブリッジホールディングス	1,300	1,693.00	2,200,900
東プレ	1,500	1,715.00	2,572,500
パイオラックス	1,400	1,900.00	2,660,000
日本発條	7,800	832.00	6,489,600
日本製鋼所	2,900	1,846.00	5,353,400
タクマ	3,000	1,402.00	4,206,000
オークマ	1,100	5,550.00	6,105,000
F U J I	2,900	1,372.00	3,978,800
牧野フライス製作所	1,000	4,250.00	4,250,000
オーエスジー	3,700	2,164.00	8,006,800
DMG 森精機	5,600	1,575.00	8,820,000
島精機製作所	1,300	3,110.00	4,043,000
オプトラン	1,100	2,541.00	2,795,100
三井海洋開発	1,000	2,915.00	2,915,000
サトーホールディングス	1,200	2,688.00	3,225,600
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,300	3,820.00	4,966,000
小森コーポレーション	2,300	1,166.00	2,681,800
椿本チエイン	1,100	3,485.00	3,833,500
タダノ	3,700	1,065.00	3,940,500
フジテック	2,900	1,409.00	4,086,100
CKD	2,100	1,077.00	2,261,700
平和	2,600	2,166.00	5,631,600
SANKYO	2,200	3,890.00	8,558,000
福島工業	500	3,440.00	1,720,000
ユニバーサルエンターテインメント	1,000	3,580.00	3,580,000
竹内製作所	1,600	1,720.00	2,752,000
アマノ	2,600	3,050.00	7,930,000
グローリー	2,600	2,901.00	7,542,600
T P R	1,000	1,858.00	1,858,000
ツバキ・ナカシマ	1,900	1,810.00	3,439,000

NTN	19,000	313.00	5,947,000
不二越	600	4,440.00	2,664,000
日立造船	8,000	397.00	3,176,000
スター精密	1,700	1,363.00	2,317,100
日清紡ホールディングス	6,500	830.00	5,395,000
イビデン	5,400	1,880.00	10,152,000
明電舎	1,500	1,688.00	2,532,000
東芝テック	1,200	3,130.00	3,756,000
マブチモーター	2,300	3,715.00	8,544,500
ヤーマン	1,400	929.00	1,300,600
I D E C	1,200	1,988.00	2,385,600
MC J	3,000	777.00	2,331,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,200	2,091.00	6,691,200
沖電気工業	4,100	1,353.00	5,547,300
サンケン電気	1,100	2,257.00	2,482,700
ワコム	7,200	369.00	2,656,800
アルバック	1,900	3,660.00	6,954,000
E I Z O	800	4,020.00	3,216,000
富士通ゼネラル	2,700	1,682.00	4,541,400
メイコー	1,000	1,717.00	1,717,000
日本航空電子工業	2,300	1,538.00	3,537,400
マクセルホールディングス	1,700	1,491.00	2,534,700
堀場製作所	1,700	5,600.00	9,520,000
O B A R A G R O U P	600	3,610.00	2,166,000
イリソ電子工業	900	5,270.00	4,743,000
オプテックスグループ	1,400	1,340.00	1,876,000
レーザーテック	1,800	4,285.00	7,713,000
ウシオ電機	4,900	1,429.00	7,002,100
日本セラミック	1,000	2,967.00	2,967,000
日本電子	1,700	2,486.00	4,226,200
フクダ電子	300	7,380.00	2,214,000
新光電気工業	3,300	938.00	3,095,400
トヨタ紡織	2,400	1,435.00	3,444,000
ユニプレス	1,800	1,782.00	3,207,600
モリタホールディングス	1,400	1,898.00	2,657,200

東海理化電機製作所	2,300	1,807.00	4,156,100
三井E&Sホールディングス	3,300	928.00	3,062,400
武蔵精密工業	2,200	1,398.00	3,075,600
日産車体	3,500	1,082.00	3,787,000
新明和工業	4,000	1,347.00	5,388,000
日信工業	1,800	1,473.00	2,651,400
NOK	3,900	1,646.00	6,419,400
KYB	800	3,050.00	2,440,000
太平洋工業	1,800	1,578.00	2,840,400
ケーヒン	2,100	1,496.00	3,141,600
ショーワ	2,400	1,429.00	3,429,600
エクセディ	900	2,231.00	2,007,900
豊田合成	3,100	2,095.00	6,494,500
日本精機	1,900	1,969.00	3,741,100
エフ・シー・シー	1,500	2,169.00	3,253,500
テイ・エス テック	1,900	2,941.00	5,587,900
日機装	2,200	1,388.00	3,053,600
ナカニシ	3,300	2,067.00	6,821,100
ブイ・テクノロジー	400	4,995.00	1,998,000
東京精密	1,900	2,731.00	5,188,900
マニー	900	7,980.00	7,182,000
トプコン	4,900	1,339.00	6,561,100
シチズン時計	11,600	558.00	6,472,800
CYBERDYNE	4,900	661.00	3,238,900
セイコーホールディングス	1,300	2,280.00	2,964,000
ニプロ	6,700	1,226.00	8,214,200
パラマウントベッドホールディングス	900	4,150.00	3,735,000
パイロットコーポレーション	1,400	4,105.00	5,747,000
フジシールインターナショナル	2,000	3,395.00	6,790,000
タカラトミー	4,200	1,331.00	5,590,200
NISSHA	1,600	1,171.00	1,873,600
リンテック	2,200	2,245.00	4,939,000
タカラスタンダード	1,700	1,744.00	2,964,800
コクヨ	3,500	1,515.00	5,302,500
オカムラ	2,700	1,072.00	2,894,400

北陸電力	8,300	790.00	6,557,000
北海道電力	8,600	604.00	5,194,400
沖縄電力	2,100	1,744.00	3,662,400
富士急行	1,000	4,120.00	4,120,000
西日本鉄道	2,900	2,389.00	6,928,100
ハマキョウレックス	800	3,870.00	3,096,000
センコーグループホールディングス	4,000	877.00	3,508,000
ニッコンホールディングス	2,500	2,596.00	6,490,000
福山通運	1,000	4,110.00	4,110,000
セイノーホールディングス	6,100	1,404.00	8,564,400
日立物流	2,900	3,440.00	9,976,000
川崎汽船	4,100	1,415.00	5,801,500
トランコム	300	6,380.00	1,914,000
三菱倉庫	2,900	3,040.00	8,816,000
住友倉庫	2,700	1,406.00	3,796,200
近鉄エクスプレス	1,700	1,415.00	2,405,500
NEC ネットエスアイ	1,100	2,769.00	3,045,900
システナ	3,200	1,843.00	5,897,600
デジタルアーツ	500	10,250.00	5,125,000
日鉄ソリューションズ	1,700	3,490.00	5,933,000
夢の街創造委員会	1,100	1,601.00	1,761,100
グリー	5,800	519.00	3,010,200
コーエーテクモホールディングス	2,000	2,048.00	4,096,000
ブロードリーフ	4,300	584.00	2,511,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,190	2,941.00	6,440,790
GMO ペイメントゲートウェイ	1,600	6,980.00	11,168,000
インターネットイニシアティブ	1,300	2,141.00	2,783,300
L I N E	2,600	3,030.00	7,878,000
マクロミル	1,400	1,300.00	1,820,000
ジャストシステム	1,500	3,670.00	5,505,000
オービックビジネスコンサルタント	900	4,930.00	4,437,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,500	2,792.00	12,564,000
デジタルガレージ	1,700	3,665.00	6,230,500
ネットワンシステムズ	4,100	2,940.00	12,054,000
エイベックス	1,800	1,390.00	2,502,000

日本ユニシス	3,400	3,705.00	12,597,000
東京放送ホールディングス	4,500	1,910.00	8,595,000
テレビ朝日ホールディングス	2,300	1,896.00	4,360,800
スカパーJ S A Tホールディングス	6,300	436.00	2,746,800
GMOインターネット	3,500	1,851.00	6,478,500
KADOKAWA	2,600	1,449.00	3,767,400
ゼンリン	1,700	1,941.00	3,299,700
松竹	400	12,450.00	4,980,000
東映	300	15,090.00	4,527,000
D T S	1,900	2,279.00	4,330,100
シーイーシー	1,100	2,475.00	2,722,500
T K C	600	4,810.00	2,886,000
富士ソフト	1,100	4,875.00	5,362,500
N S D	1,300	3,290.00	4,277,000
あらた	600	3,755.00	2,253,000
神戸物産	1,100	5,510.00	6,061,000
あい ホールディングス	1,700	1,781.00	3,027,700
ダイワボウホールディングス	800	5,180.00	4,144,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,516.00	3,183,600
T O K A Iホールディングス	3,900	936.00	3,650,400
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,920.00	10,824,000
コメダホールディングス	1,900	2,017.00	3,832,300
第一興商	1,800	4,970.00	8,946,000
アズワン	600	9,260.00	5,556,000
日本ライフライン	2,400	1,936.00	4,646,400
長瀬産業	4,900	1,622.00	7,947,800
兼松	3,600	1,242.00	4,471,200
山善	2,400	1,068.00	2,563,200
キャノンマーケティングジャパン	2,300	2,379.00	5,471,700
三谷商事	500	5,490.00	2,745,000
阪和興業	1,600	3,000.00	4,800,000
岩谷産業	1,700	3,760.00	6,392,000
稲畑産業	1,900	1,415.00	2,688,500
東邦ホールディングス	2,200	2,518.00	5,539,600
サンゲツ	2,200	2,062.00	4,536,400

サンリオ	2,100	2,394.00	5,027,400
リョーサン	900	2,533.00	2,279,700
モスフードサービス	1,000	2,409.00	2,409,000
PAL TAC	1,400	6,050.00	8,470,000
日鉄物産	700	4,495.00	3,146,500
トラスコ中山	1,800	2,287.00	4,116,600
オートバックスセブン	3,000	1,800.00	5,400,000
加藤産業	1,000	3,295.00	3,295,000
因幡電機産業	1,100	4,785.00	5,263,500
サンエー	800	4,555.00	3,644,000
エービーシー・マート	1,500	6,640.00	9,960,000
アスクル	1,000	2,357.00	2,357,000
くら寿司	500	4,345.00	2,172,500
エディオン	3,400	1,068.00	3,631,200
セリア	1,800	2,475.00	4,455,000
ジズホールディングス	500	6,180.00	3,090,000
ビックカメラ	4,300	1,096.00	4,712,800
DCMホールディングス	4,100	1,084.00	4,444,400
ドトール・日レスホールディングス	1,400	2,085.00	2,919,000
物語コーポレーション	200	9,180.00	1,836,000
ココカラファイン	700	5,890.00	4,123,000
クリエイトSDホールディングス	1,200	2,501.00	3,001,200
ジョイフル本田	1,700	1,256.00	2,135,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	2,500	986.00	2,465,000
クスリのアオキホールディングス	800	7,540.00	6,032,000
スシローグローバルホールディングス	1,000	6,810.00	6,810,000
アトム	4,500	992.00	4,464,000
ノジマ	1,200	1,823.00	2,187,600
コーナン商事	1,300	2,373.00	3,084,900
ゼンショーホールディングス	4,200	2,301.00	9,664,200
サイゼリヤ	1,400	2,633.00	3,686,200
ユナイテッドアローズ	1,000	3,285.00	3,285,000
コロワイド	2,800	2,168.00	6,070,400
壺番屋	600	4,960.00	2,976,000

スギホールディングス	1,800	5,300.00	9,540,000
木曾路	900	2,623.00	2,360,700
日本瓦斯	1,600	2,953.00	4,724,800
ロイヤルホールディングス	1,200	2,758.00	3,309,600
島忠	2,100	2,537.00	5,327,700
AOKIホールディングス	1,800	1,066.00	1,918,800
コメリ	1,500	2,273.00	3,409,500
青山商事	1,900	2,108.00	4,005,200
しまむら	1,000	8,200.00	8,200,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,200	1,275.00	5,355,000
イズミ	1,500	4,355.00	6,532,500
平和堂	1,200	2,054.00	2,464,800
ヤオコー	700	5,000.00	3,500,000
アインホールディングス	1,100	6,430.00	7,073,000
吉野家ホールディングス	2,900	2,137.00	6,197,300
王将フードサービス	600	6,510.00	3,906,000
アークス	1,700	2,275.00	3,867,500
バローホールディングス	1,600	2,327.00	3,723,200
ベルーナ	2,100	735.00	1,543,500
九州フィナンシャルグループ	16,100	443.00	7,132,300
西日本フィナンシャルホールディングス	5,800	802.00	4,651,600
関西みらいフィナンシャルグループ	4,500	741.00	3,334,500
第四北越フィナンシャルグループ	1,800	2,846.00	5,122,800
群馬銀行	16,300	389.00	6,340,700
武蔵野銀行	1,400	2,152.00	3,012,800
七十七銀行	2,700	1,617.00	4,365,900
青森銀行	800	2,744.00	2,195,200
山形銀行	1,100	1,719.00	1,890,900
岩手銀行	700	2,899.00	2,029,300
東邦銀行	8,400	271.00	2,276,400
十六銀行	1,400	2,388.00	3,343,200
スルガ銀行	7,700	413.00	3,180,100
八十二銀行	17,000	451.00	7,667,000
大垣共立銀行	1,700	2,462.00	4,185,400
北國銀行	1,000	3,035.00	3,035,000

滋賀銀行	2,000	2,523.00	5,046,000
南都銀行	1,200	2,380.00	2,856,000
百五銀行	9,900	337.00	3,336,300
紀陽銀行	3,100	1,473.00	4,566,300
ほくほくフィナンシャルグループ	5,500	1,160.00	6,380,000
広島銀行	11,500	539.00	6,198,500
山陰合同銀行	6,100	702.00	4,282,200
中国銀行	6,900	997.00	6,879,300
伊予銀行	7,400	570.00	4,218,000
百十四銀行	1,000	2,297.00	2,297,000
阿波銀行	1,600	2,612.00	4,179,200
大分銀行	700	3,150.00	2,205,000
沖縄銀行	900	3,495.00	3,145,500
セブン銀行	28,100	293.00	8,233,300
山口フィナンシャルグループ	8,400	780.00	6,552,000
北洋銀行	13,200	259.00	3,418,800
京葉銀行	4,900	666.00	3,263,400
トモニホールディングス	7,100	375.00	2,662,500
池田泉州ホールディングス	12,200	207.00	2,525,400
F P G	3,200	937.00	2,998,400
ジャフコ	1,400	4,115.00	5,761,000
岡三証券グループ	6,500	405.00	2,632,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,900	323.00	3,197,700
松井証券	5,500	1,016.00	5,588,000
マネックスグループ	8,100	344.00	2,786,400
かんぽ生命保険	3,300	1,791.00	5,910,300
アニコム ホールディングス	800	3,855.00	3,084,000
全国保証	2,400	4,335.00	10,404,000
芙蓉総合リース	800	6,290.00	5,032,000
興銀リース	1,100	2,709.00	2,979,900
日本証券金融	4,300	570.00	2,451,000
アイフル	14,600	228.00	3,328,800
アコム	16,600	389.00	6,457,400
オリエントコーポレーション	26,500	124.00	3,286,000
日立キャピタル	2,300	2,327.00	5,352,100

いちご	12,000	379.00	4,548,000
オープンハウス	1,500	4,550.00	6,825,000
平和不動産	1,600	2,365.00	3,784,000
ダイビル	2,300	1,061.00	2,440,300
レオパレス21	12,000	244.00	2,928,000
スターツコーポレーション	1,300	2,656.00	3,452,800
イオンモール	5,000	1,751.00	8,755,000
カチタス	1,200	4,210.00	5,052,000
日本空港ビルデング	1,800	4,240.00	7,632,000
ミクシィ	2,100	2,155.00	4,525,500
UTグループ	1,200	2,625.00	3,150,000
エス・エム・エス	3,200	2,539.00	8,124,800
ディップ	1,600	1,997.00	3,195,200
ベネフィット・ワン	2,600	1,882.00	4,893,200
アウトソーシング	4,900	1,328.00	6,507,200
ディー・エヌ・エー	5,400	2,218.00	11,977,200
インフォマート	4,500	1,596.00	7,182,000
RIZAPグループ	7,700	300.00	2,310,000
EPSホールディングス	1,600	1,711.00	2,737,600
プレステージ・インターナショナル	2,300	1,681.00	3,866,300
ケネディクス	11,400	566.00	6,452,400
みらかホールディングス	2,600	2,522.00	6,557,200
ダスキン	2,100	2,972.00	6,241,200
ラウンドワン	3,200	1,568.00	5,017,600
リゾートトラスト	3,700	1,619.00	5,990,300
ビー・エム・エル	1,000	3,075.00	3,075,000
エン・ジャパン	1,200	4,565.00	5,478,000
ジャパンマテリアル	2,700	1,535.00	4,144,500
ベクトル	1,300	1,045.00	1,358,500
ベルシステム24ホールディングス	1,700	1,654.00	2,811,800
ソラスト	2,200	1,107.00	2,435,400
東祥	700	2,679.00	1,875,300
エイチ・アイ・エス	1,600	2,624.00	4,198,400
共立メンテナンス	1,400	4,770.00	6,678,000
東京都競馬	700	3,250.00	2,275,000

	カナモト	1,400	2,814.00	3,939,600	
	東京ドーム	3,800	1,017.00	3,864,600	
	西尾レントオール	800	3,070.00	2,456,000	
	トランス・コスモス	1,100	2,391.00	2,630,100	
	乃村工藝社	3,300	1,413.00	4,662,900	
	メイテック	1,200	5,620.00	6,744,000	
	船井総研ホールディングス	1,600	2,528.00	4,044,800	
	イオンディライト	1,100	3,245.00	3,569,500	
	ダイセキ	1,600	2,673.00	4,276,800	
	小計 銘柄数：446			2,072,300,690	
	組入時価比率：99.7%			100.0%	
	合計			2,072,300,690	

(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(2019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。