

平成22年7月期（平成21年7月16日～平成22年7月15日）決算短信

平成22年8月19日

上場取引所

大証

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 執行役社長 吉川 淳
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部 新村 浩久 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成22年9月30日
 分配金支払開始予定日 平成22年8月20日

I ファンドの運用状況

1. 平成22年7月期の運用状況（平成21年7月16日～平成22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22年7月期	2,688	(99.8)	6	(0.2)	2,695	(100)
平成21年7月期	2,677	(99.8)	6	(0.2)	2,684	(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22年7月期	308	99	99	309
平成21年7月期	601	199	492	308

(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22年7月期	2,740	44	2,695	87,228
平成21年7月期	2,773	88	2,684	87,017

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成22年7月期	1,140.00
平成21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
 ② ①以外の変更

有・無
 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】

期別	第2期 平成21年7月15日現在	第3期 平成22年7月15日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,783,153	25,197,226
株式	2,677,703,690	2,688,785,660
未収入金	66,613,448	24,006,318
未収配当金	1,151,150	2,093,050
未収利息	83	71
流動資産合計	2,773,251,524	2,740,082,325
資産合計	2,773,251,524	2,740,082,325
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	78,973,696	35,226,684
未払受託者報酬	711,714	742,987
未払委託者報酬	6,405,382	6,686,830
その他未払費用	2,777,996	2,041,549
流動負債合計	88,868,788	44,698,050
負債合計	88,868,788	44,698,050
純資産の部		
元本等		
元本	4,386,742,020	4,394,065,320
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,702,359,284	1,698,681,045
(分配準備積立金)	1,276,350	2,281,174
元本等合計	2,684,382,736	2,695,384,275
純資産合計	2,684,382,736	2,695,384,275
負債純資産合計	2,773,251,524	2,740,082,325

(2)【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第2期	第3期
		自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		100,878,700	54,281,400
受取利息		53,903	15,061
有価証券売買等損益		1,833,644,863	102,860,373
その他収益		7,766	466
営業収益合計		1,732,704,494	48,563,446
営業費用			
受託者報酬		2,198,547	1,580,191
委託者報酬		19,786,818	14,221,584
その他費用		3,080,211	2,263,644
営業費用合計		25,065,576	18,065,419
営業利益		1,757,770,070	66,628,865
経常利益		1,757,770,070	66,628,865
当期純利益		1,757,770,070	66,628,865
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額			
期首剰余金又は期首欠損金()		1,955,922,592	1,702,359,284
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,039,437,880	556,683,540
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,039,437,880	556,683,540
剰余金減少額又は欠損金増加額		949,130,806	451,149,752
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		949,130,806	451,149,752
分配金		78,973,696	35,226,684
期末剰余金又は期末欠損金()		1,702,359,284	1,698,681,045

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第2期	第3期
	自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 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、市場価額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。	(1) 株式 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 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。 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金の計上基準 同左 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は、平成20年7月16日から平成21年7月15日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成21年7月16日から平成22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2期 平成21年7月15日現在	第3期 平成22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 308,491 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 309,006 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 1,702,359,284 円	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 1,698,681,045 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 8,701.7 円 (10口当たり純資産額 87,017 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 8,722.8 円 (10口当たり純資産額 87,228 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日																																																												
1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 80,250,046 円 (10口当たり2,601円)のうち、78,973,696 円 (10口当たり2,560円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 37,507,858 円 (10口当たり1,213円)のうち、35,226,684 円 (10口当たり1,140円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">項目</th> <th></th> <th style="text-align: right;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">100,940,369円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">4,375,253円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">105,315,622円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">25,065,576円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">80,250,046円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">78,973,696円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">1,276,350円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">308,491口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">2,560円</td> </tr> </tbody> </table>	項目		金額	当期配当等収益額	A	100,940,369円	分配準備積立金	B	4,375,253円	配当等収益合計額	C = A + B	105,315,622円	経費	D	25,065,576円	収益分配可能額	E = C - D	80,250,046円	収益分配金	F	78,973,696円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,276,350円	口数	H	308,491口	10口当たり分配金	I = F / H × 10	2,560円	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">項目</th> <th></th> <th style="text-align: right;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">54,296,927円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">1,276,350円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td style="text-align: center;">C = A + B</td> <td style="text-align: right;">55,573,277円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">18,065,419円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td style="text-align: center;">E = C - D</td> <td style="text-align: right;">37,507,858円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">35,226,684円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td style="text-align: center;">G = E - F</td> <td style="text-align: right;">2,281,174円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">309,006口</td> </tr> <tr> <td>10口当たり分配金</td> <td style="text-align: center;">I = F / H × 10</td> <td style="text-align: right;">1,140円</td> </tr> </tbody> </table>	項目		金額	当期配当等収益額	A	54,296,927円	分配準備積立金	B	1,276,350円	配当等収益合計額	C = A + B	55,573,277円	経費	D	18,065,419円	収益分配可能額	E = C - D	37,507,858円	収益分配金	F	35,226,684円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,281,174円	口数	H	309,006口	10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,140円
項目		金額																																																											
当期配当等収益額	A	100,940,369円																																																											
分配準備積立金	B	4,375,253円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	105,315,622円																																																											
経費	D	25,065,576円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	80,250,046円																																																											
収益分配金	F	78,973,696円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	1,276,350円																																																											
口数	H	308,491口																																																											
10口当たり分配金	I = F / H × 10	2,560円																																																											
項目		金額																																																											
当期配当等収益額	A	54,296,927円																																																											
分配準備積立金	B	1,276,350円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	55,573,277円																																																											
経費	D	18,065,419円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	37,507,858円																																																											
収益分配金	F	35,226,684円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,281,174円																																																											
口数	H	309,006口																																																											
10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,140円																																																											

(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2期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22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>4 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。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 平成21年7月15日現在	第3期 平成22年7月15日現在
	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。
	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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22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2期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日		第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	
期首元本額	8,547,727,320 円	期首元本額	4,386,742,020 円
期中追加設定元本額	2,835,752,400 円	期中追加設定元本額	1,421,715,600 円
期中一部交換元本額	6,996,737,700 円	期中一部交換元本額	1,414,392,300 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種類	第2期 自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日	
	貸借対照表計上額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,677,703,690	218,285,641
合計	2,677,703,690	218,285,641

売買目的有価証券

種類	第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式	36,802,727	
合計	36,802,727	

3 デリバティブ取引関係

第2期(自 平成20年7月16日 至 平成21年7月15日)

該当事項はございません。

第3期(自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(平成22年7月15日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日本水産	31,100	305.00	9,485,500	
	マルハニチロホールディングス	52,000	140.00	7,280,000	
	サカタのタネ	4,600	1,160.00	5,336,000	
	ホクト	2,900	1,712.00	4,964,800	
	日鉄鉱業	8,000	304.00	2,432,000	
	ショーボンドホールディングス	2,700	1,831.00	4,943,700	
	長谷工コーポレーション	169,500	68.00	11,526,000	
	西松建設	35,000	112.00	3,920,000	
	前田建設工業	16,000	242.00	3,872,000	
	奥村組	23,000	330.00	7,590,000	
	戸田建設	26,000	299.00	7,774,000	
	N I P P O	8,000	636.00	5,088,000	
	前田道路	9,000	719.00	6,471,000	
	住友林業	19,200	681.00	13,075,200	
	パナホーム	10,000	512.00	5,120,000	
	中電工	3,100	1,013.00	3,140,300	
	関電工	13,000	523.00	6,799,000	
	きんでん	19,000	789.00	14,991,000	
	協和エクシオ	10,200	792.00	8,078,400	
	三機工業	6,000	710.00	4,260,000	
	太平電業	4,000	661.00	2,644,000	
	高砂熱学工業	6,400	764.00	4,889,600	
	N E C ネットエスアイ	3,300	1,098.00	3,623,400	
	大気社	3,300	1,463.00	4,827,900	
	東芝プラントシステム	5,000	1,083.00	5,415,000	
	東洋エンジニアリング	16,000	283.00	4,528,000	
	新興ブランテック	5,400	832.00	4,492,800	
	日本製粉	14,000	448.00	6,272,000	
	三井製糖	12,000	303.00	3,636,000	
	森永製菓	24,000	202.00	4,848,000	
	江崎グリコ	10,000	1,037.00	10,370,000	
	森永乳業	24,000	328.00	7,872,000	
	雪印メグミルク	5,100	1,595.00	8,134,500	
	伊藤ハム	18,000	328.00	5,904,000	
	丸大食品	14,000	252.00	3,528,000	
	コカ・コーラウエスト	7,200	1,504.00	10,828,800	
	ダイドードリンコ	1,300	3,260.00	4,238,000	
	伊藤園	7,500	1,317.00	9,877,500	
	日清オイリオグループ	14,000	422.00	5,908,000	
	不二製油	7,200	1,272.00	9,158,400	
	ハウス食品	8,900	1,301.00	11,578,900	
	ニチレイ	30,000	372.00	11,160,000	
	グンゼ	20,000	282.00	5,640,000	
	東洋紡績	88,000	155.00	13,640,000	
	ユニチカ	57,000	76.00	4,332,000	
	倉敷紡績	26,000	138.00	3,588,000	
	日本毛織	9,000	687.00	6,183,000	
	ホギメディカル	1,300	4,275.00	5,557,500	
	三陽商会	14,000	335.00	4,690,000	
	オンワードホールディングス	16,000	664.00	10,624,000	
	東京スタイル	9,000	729.00	6,561,000	
	三菱製紙	38,000	102.00	3,876,000	
	北越紀州製紙	15,500	442.00	6,851,000	
	大王製紙	12,000	681.00	8,172,000	
	クレハ	17,000	453.00	7,701,000	
	日本曹達	18,000	319.00	5,742,000	
	セントラル硝子	24,000	344.00	8,256,000	
	東亜合成	27,000	400.00	10,800,000	
	関東電化工業	5,000	585.00	2,925,000	
	堺化学工業	11,000	353.00	3,883,000	
	日本パーカライジング	6,000	1,208.00	7,248,000	
	ステラ ケミファ	1,100	3,240.00	3,564,000	
	日本触媒	15,000	916.00	13,740,000	
	東京応化工業	4,900	1,544.00	7,565,600	
	日本合成化学工業	7,000	543.00	3,801,000	
	住友ベークライト	26,000	448.00	11,648,000	
	日本ゼオン	21,000	559.00	11,739,000	
	アイカ工業	7,000	979.00	6,853,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	A D E K A	10,700	861.00	9,212,700	
	日油	20,000	369.00	7,380,000	
	日本ペイント	24,000	528.00	12,672,000	
	中国塗料	7,000	640.00	4,480,000	
	太陽インキ製造	2,600	2,383.00	6,195,800	
	D I C	88,000	145.00	12,760,000	
	東洋インキ製造	25,000	344.00	8,600,000	
	ライオン	27,000	449.00	12,123,000	
	マンダム	2,600	2,383.00	6,195,800	
	ファンケル	4,800	1,291.00	6,196,800	
	コーセー	4,300	2,025.00	8,707,500	
	長谷川香料	2,900	1,408.00	4,083,200	
	上村工業	900	3,705.00	3,334,500	
	アース製薬	1,800	2,687.00	4,836,600	
	日本農薬	6,000	411.00	2,466,000	
	エフビコ	1,700	4,545.00	7,726,500	
	ニフコ	6,200	1,983.00	12,294,600	
	日本新薬	6,000	997.00	5,982,000	
	科研製薬	11,000	863.00	9,493,000	
	ロート製薬	11,000	1,049.00	11,539,000	
	持田製薬	10,000	861.00	8,610,000	
	日医工	3,000	2,945.00	8,835,000	
	キッセイ薬品工業	4,100	1,680.00	6,888,000	
	生化学工業	4,700	886.00	4,164,200	
	東和薬品	1,200	5,170.00	6,204,000	
	沢井製薬	1,800	7,540.00	13,572,000	
	キョーリン製薬ホールディングス	7,000	1,235.00	8,645,000	
	横浜ゴム	28,000	461.00	12,908,000	
	東洋ゴム工業	19,000	204.00	3,876,000	
	ニッタ	2,800	1,402.00	3,925,600	
	東海ゴム工業	5,100	1,060.00	5,406,000	
	日東紡績	27,000	204.00	5,508,000	
	住友大阪セメント	54,000	176.00	9,504,000	
	太平洋セメント	118,000	119.00	14,042,000	
	東海カーボン	26,000	468.00	12,168,000	
	日本カーボン	14,000	259.00	3,626,000	
	東洋炭素	1,500	4,260.00	6,390,000	
	ニチアス	12,000	366.00	4,392,000	
	日新製鋼	83,000	144.00	11,952,000	
	共英製鋼	2,000	1,474.00	2,948,000	
	淀川製鋼所	15,000	366.00	5,490,000	
	丸一鋼管	6,900	1,732.00	11,950,800	
	大同特殊鋼	34,000	380.00	12,920,000	
	日本冶金工業	15,500	286.00	4,433,000	
	山陽特殊製鋼	15,000	423.00	6,345,000	
	愛知製鋼	12,000	363.00	4,356,000	
	日本電工	12,000	535.00	6,420,000	
	日本軽金属	63,000	123.00	7,749,000	
	東邦亜鉛	12,000	320.00	3,840,000	
	古河機械金属	40,000	95.00	3,800,000	
	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,700	3,735.00	10,084,500	
	東邦チタニウム	4,300	2,328.00	10,010,400	
	日立電線	23,000	232.00	5,336,000	
	アサヒホールディングス	2,900	1,900.00	5,510,000	
	三和ホールディングス	25,000	279.00	6,975,000	
	ノーリツ	3,800	1,522.00	5,783,600	
	長府製作所	2,600	1,812.00	4,711,200	
	東プレ	4,700	622.00	2,923,400	
	東京製綱	15,000	209.00	3,135,000	
	三浦工業	3,500	2,093.00	7,325,500	
	オークマ	17,000	568.00	9,656,000	
	東芝機械	16,000	336.00	5,376,000	
	富士機械製造	4,900	1,451.00	7,109,900	
	牧野フライス製作所	14,000	557.00	7,798,000	
	オーエスジー	10,100	1,015.00	10,251,500	
	旭ダイヤモンド工業	7,000	1,352.00	9,464,000	
	森精機製作所	13,600	924.00	12,566,400	
	島精機製作所	3,800	2,200.00	8,360,000	
	三井海洋開発	2,400	1,380.00	3,312,000	
	ユニオンツール	1,400	2,212.00	3,096,800	
	井関農機	20,000	219.00	4,380,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	新東工業	6,100	678.00	4,135,800	
	小森コーポレーション	8,600	863.00	7,421,800	
	橋本チエイン	16,000	387.00	6,192,000	
	ダイフク	11,500	533.00	6,129,500	
	タダノ	11,000	445.00	4,895,000	
	フジテック	9,000	454.00	4,086,000	
	シーケーディ	6,700	639.00	4,281,300	
	平和	5,300	960.00	5,088,000	
	ユニバーサルエンターテインメント	3,300	1,521.00	5,019,300	
	アマノ	7,300	728.00	5,314,400	
	マックス	4,000	1,007.00	4,028,000	
	ホシザキ電機	4,300	1,488.00	6,398,400	
	不二越	21,000	277.00	5,817,000	
	日本トムソン	9,000	577.00	5,193,000	
	キッツ	7,400	436.00	3,226,400	
	日立工機	4,900	803.00	3,934,700	
	日立造船	107,000	123.00	13,161,000	
	富士電機ホールディングス	75,000	252.00	18,900,000	
	東洋電機製造	5,000	400.00	2,000,000	
	明電舎	21,000	289.00	6,069,000	
	東芝テック	18,000	309.00	5,562,000	
	ダイヘン	13,000	373.00	4,849,000	
	JVC・ケンウッド・ホールディングス	92,000	33.00	3,036,000	
	メルコホールディングス	2,000	3,040.00	6,080,000	
	沖電気工業	95,000	73.00	6,935,000	
	サンケン電気	15,000	362.00	5,430,000	
	ルネサスエレクトロニクス	5,100	835.00	4,258,500	
	ワコム	54	135,600.00	7,322,400	
	アルバック	4,500	1,793.00	8,068,500	
	ナナオ	2,300	2,002.00	4,604,600	
	日本信号	5,600	658.00	3,684,800	
	アンリツ	13,000	475.00	6,175,000	
	日立国際電気	7,000	701.00	4,907,000	
	アルプス電気	23,500	751.00	17,648,500	
	バイオニア	32,700	317.00	10,365,900	
	日本電波工業	2,100	1,591.00	3,341,100	
	フォスター電機	2,500	2,377.00	5,942,500	
	SMK	7,000	417.00	2,919,000	
	ホシデン	7,500	982.00	7,365,000	
	日本航空電子工業	7,000	595.00	4,165,000	
	アルパイン	5,900	1,068.00	6,301,200	
	船井電機	2,700	3,040.00	8,208,000	
	日本光電工業	4,700	1,675.00	7,872,500	
	堀場製作所	4,900	2,384.00	11,681,600	
	メガチップス	2,200	1,412.00	3,106,400	
	双葉電子工業	3,700	1,578.00	5,838,600	
	ニチコン	7,800	1,112.00	8,673,600	
	日本ケミコン	15,000	421.00	6,315,000	
	スター精密	5,400	965.00	5,211,000	
	大日本スクリーン製造	30,000	447.00	13,410,000	
	キャノン電子	2,700	2,168.00	5,853,600	
	日本電産サンキョー	6,000	721.00	4,326,000	
	トヨタ紡織	7,100	1,351.00	9,592,100	
	ユニプレス	3,400	1,493.00	5,076,200	
	東海理化電機製作所	6,700	1,641.00	10,994,700	
	日本車輛製造	8,000	373.00	2,984,000	
	日野自動車	34,000	437.00	14,858,000	
	武蔵精密工業	2,900	1,812.00	5,254,800	
	トヨタ車体	3,400	1,244.00	4,229,600	
	日産車体	10,000	598.00	5,980,000	
	新明和工業	12,000	329.00	3,948,000	
	日信工業	5,200	1,282.00	6,666,400	
	曙ブレーキ工業	7,600	399.00	3,032,400	
	カヤバ工業	19,000	344.00	6,536,000	
	カルソニックカンセイ	17,000	261.00	4,437,000	
	ケーヒン	5,700	1,702.00	9,701,400	
	エクセディ	2,400	2,498.00	5,995,200	
	日本精機	5,000	965.00	4,825,000	
	エフ・シー・シー	4,700	1,721.00	8,088,700	
	タカタ	4,700	1,695.00	7,966,500	
	テイ・エス テック	5,500	1,421.00	7,815,500	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日機装	6,000	711.00	4,266,000	
	ナカニシ	600	7,980.00	4,788,000	
	東京精密	5,100	1,271.00	6,482,100	
	ニプロ	5,600	1,708.00	9,564,800	
	トッパン・フォームズ	6,000	869.00	5,214,000	
	フジシールインターナショナル	2,700	1,930.00	5,211,000	
	タカラトミー	8,400	690.00	5,796,000	
	ビジョン	2,300	3,220.00	7,406,000	
	パラマウントベッド	1,900	2,122.00	4,031,800	
	リンテック	6,600	1,699.00	11,213,400	
	タカラスタンダード	11,000	578.00	6,358,000	
	コクヨ	10,600	754.00	7,992,400	
	美津濃	10,000	391.00	3,910,000	
	沖縄電力	1,900	4,495.00	8,540,500	
	西部瓦斯	28,000	243.00	6,804,000	
	静岡瓦斯	7,000	561.00	3,927,000	
	山九	35,000	362.00	12,670,000	
	日本梱包運輸倉庫	5,000	1,002.00	5,010,000	
	福山通運	15,000	421.00	6,315,000	
	セイノーホールディングス	18,000	593.00	10,674,000	
	日立物流	6,400	1,284.00	8,217,600	
	飯野海運	11,200	429.00	4,804,800	
	三井倉庫	15,000	310.00	4,650,000	
	住友倉庫	19,000	407.00	7,733,000	
	近鉄エクスプレス	2,400	2,184.00	5,241,600	
	新日鉄ソリューションズ	2,500	1,690.00	4,225,000	
	I Tホールディングス	11,100	1,021.00	11,333,100	
	グリー	1,400	6,400.00	8,960,000	
	コーエーテックモホールディングス	5,200	577.00	3,000,400	
	ティーガイア	24	151,600.00	3,638,400	
	オービック	720	16,990.00	12,232,800	
	伊藤忠テクノソリューションズ	4,200	3,300.00	13,860,000	
	大塚商会	2,300	5,900.00	13,570,000	
	A C C E S S	29	119,900.00	3,477,100	
	ネットワンシステムズ	57	106,900.00	6,093,300	
	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,900	1,055.00	5,169,500	
	日本ユニシス	8,400	652.00	5,476,800	
	テレビ朝日	57	126,800.00	7,227,600	
	スカパー J S A Tホールディングス	201	30,700.00	6,170,700	
	イー・アクセス	187	57,600.00	10,771,200	
	光通信	3,600	1,598.00	5,752,800	
	ゼンリン	2,900	941.00	2,728,900	
	角川グループホールディングス	2,300	1,853.00	4,261,900	
	松竹	11,000	629.00	6,919,000	
	東映	10,000	380.00	3,800,000	
	カブコン	7,200	1,398.00	10,065,600	
	住商情報システム	2,900	1,320.00	3,828,000	
	C S Kホールディングス	10,300	370.00	3,811,000	
	富士ソフト	3,100	1,494.00	4,631,400	
	日本システムディベロップメント	5,400	990.00	5,346,000	
	日本風力開発	15	74,800.00	1,122,000	
	ダイワボウホールディングス	23,000	184.00	4,232,000	
	J F E 商事ホールディングス	14,000	358.00	5,012,000	
	第一興商	6,100	1,270.00	7,747,000	
	黒田電気	3,400	1,171.00	3,981,400	
	ガリバーインターナショナル	600	4,020.00	2,412,000	
	長瀬産業	13,000	941.00	12,233,000	
	兼松	52,000	70.00	3,640,000	
	キャノンマーケティングジャパン	8,200	1,329.00	10,897,800	
	阪和興業	27,000	356.00	9,612,000	
	岩谷産業	27,000	250.00	6,750,000	
	東邦ホールディングス	4,700	1,331.00	6,255,700	
	サンゲツ	3,700	1,816.00	6,719,200	
	サンリオ	4,900	1,063.00	5,208,700	
	リョーサン	4,300	2,182.00	9,382,600	
	モスフードサービス	3,400	1,493.00	5,076,200	
	オートバックスセブン	4,100	3,145.00	12,894,500	
	加藤産業	2,600	1,364.00	3,546,400	
	因幡電機産業	2,200	2,052.00	4,514,400	
	カワチ薬品	2,100	1,626.00	3,414,600	
	エービーシー・マート	3,600	2,961.00	10,659,600	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	ゲオ	50	108,700.00	5,435,000	
	エディオン	7,300	657.00	4,796,100	
	D C Mホールディングス	10,000	431.00	4,310,000	
	ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,113.00	4,785,900	
	マツモトキヨシホールディングス	4,500	1,926.00	8,667,000	
	ココカラファイン ホールディングス	1,600	1,731.00	2,769,600	
	サークルKサンクス	5,000	1,172.00	5,860,000	
	ツルハホールディングス	1,900	3,240.00	6,156,000	
	ワタミ	2,500	1,659.00	4,147,500	
	メガネトップ	2,400	581.00	1,394,400	
	西松屋チェーン	4,300	810.00	3,483,000	
	ゼンショー	9,200	793.00	7,295,600	
	サイゼリヤ	3,600	1,615.00	5,814,000	
	スギホールディングス	5,000	1,936.00	9,680,000	
	木曽路	2,400	1,854.00	4,449,600	
	日本瓦斯	3,300	1,362.00	4,494,600	
	コメリ	4,300	1,943.00	8,354,900	
	青山商事	8,200	1,478.00	12,119,600	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	16,000	578.00	9,248,000	
	パルコ	6,500	653.00	4,244,500	
	イズミヤ	9,000	406.00	3,654,000	
	イズミ	5,900	1,173.00	6,920,700	
	平和堂	3,400	1,080.00	3,672,000	
	フジ	2,200	1,667.00	3,667,400	
	ゼビオ	3,400	1,640.00	5,576,000	
	吉野家ホールディングス	62	98,000.00	6,076,000	
	ブレナス	2,900	1,327.00	3,848,300	
	アークス	3,700	1,194.00	4,417,800	
	サンドラッグ	4,300	2,247.00	9,662,100	
	あおぞら銀行	94,000	109.00	10,246,000	
	第四銀行	35,000	296.00	10,360,000	
	北越銀行	23,000	143.00	3,289,000	
	札幌北洋ホールディングス	37,200	405.00	15,066,000	
	武蔵野銀行	4,100	2,440.00	10,004,000	
	東京都民銀行	3,800	974.00	3,701,200	
	青森銀行	22,000	211.00	4,642,000	
	秋田銀行	20,000	304.00	6,080,000	
	山形銀行	16,000	405.00	6,480,000	
	岩手銀行	1,800	4,855.00	8,739,000	
	東邦銀行	24,000	259.00	6,216,000	
	十六銀行	38,000	310.00	11,780,000	
	山梨中央銀行	17,000	350.00	5,950,000	
	大垣共立銀行	38,000	272.00	10,336,000	
	福井銀行	27,000	284.00	7,668,000	
	北國銀行	29,000	329.00	9,541,000	
	南都銀行	28,000	458.00	12,824,000	
	百五銀行	31,000	374.00	11,594,000	
三重銀行	14,000	247.00	3,458,000		
百十四銀行	28,000	325.00	9,100,000		
四国銀行	22,000	276.00	6,072,000		
阿波銀行	27,000	531.00	14,337,000		
鹿児島銀行	18,000	551.00	9,918,000		
大分銀行	17,000	280.00	4,760,000		
宮崎銀行	17,000	231.00	3,927,000		
肥後銀行	21,000	480.00	10,080,000		
佐賀銀行	14,000	248.00	3,472,000		
十八銀行	19,000	238.00	4,522,000		
沖縄銀行	2,300	2,930.00	6,739,000		
琉球銀行	5,000	980.00	4,900,000		
八千代銀行	1,700	1,750.00	2,975,000		
セブン銀行	65	166,700.00	10,835,500		
紀陽ホールディングス	96,000	118.00	11,328,000		
名古屋銀行	18,000	301.00	5,418,000		
愛知銀行	800	5,600.00	4,480,000		
第三銀行	18,000	254.00	4,572,000		
中京銀行	14,000	264.00	3,696,000		
愛媛銀行	19,000	237.00	4,503,000		
京葉銀行	25,000	439.00	10,975,000		
栃木銀行	12,000	367.00	4,404,000		
ジャフコ	3,500	2,156.00	7,546,000		
みずほインベスターズ証券	49,000	83.00	4,067,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	岡三証券グループ	21,000	337.00	7,077,000	
	丸三証券	8,000	508.00	4,064,000	
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,000	310.00	9,610,000	
	松井証券	16,800	546.00	9,172,800	
	マネックスグループ	162	35,850.00	5,807,700	
	カブドットコム証券	10,300	412.00	4,243,600	
	芙蓉総合リース	2,200	2,010.00	4,422,000	
	東京センチュリーリース	6,800	1,123.00	7,636,400	
	日本証券金融	10,900	504.00	5,493,600	
	武富士	15,330	265.00	4,062,450	
	リコーリース	2,000	2,015.00	4,030,000	
	イオンクレジットサービス	11,300	864.00	9,763,200	
	アコム	4,930	1,413.00	6,966,090	
	プロミス	11,450	666.00	7,625,700	
	日立キャピタル	4,300	1,181.00	5,078,300	
	パーク24	12,200	926.00	11,297,200	
	平和不動産	21,500	211.00	4,536,500	
	ダイビル	6,600	646.00	4,263,600	
	大京	34,000	149.00	5,066,000	
	テーオーシー	10,600	324.00	3,434,400	
	レオパレス21	18,700	231.00	4,319,700	
	住友不動産販売	1,080	3,965.00	4,282,200	
	ゴールドクレスト	2,260	1,665.00	3,762,900	
	アーネストワン	5,300	909.00	4,817,700	
	エヌ・ティ・ティ都市開発	161	69,000.00	11,109,000	
	日本空港ビルデング	5,100	1,333.00	6,798,300	
	ミクシィ	8	433,000.00	3,464,000	
	アコーディア・ゴルフ	84	84,200.00	7,072,800	
	総合警備保障	7,100	919.00	6,524,900	
	カカクコム	25	390,000.00	9,750,000	
	エムスリー	12	377,500.00	4,530,000	
	ディー・エヌ・エー	12,800	2,207.00	28,249,600	
	PGMホールディングス	64	54,500.00	3,488,000	
	ケネディクス	169	14,780.00	2,497,820	
	ダスキン	7,400	1,534.00	11,351,600	
	ラウンドワン	6,600	419.00	2,765,400	
	リゾートトラスト	4,500	1,256.00	5,652,000	
	もしもしホットライン	2,500	1,847.00	4,617,500	
	サイバーエージェント	70	128,000.00	8,960,000	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	14,400	382.00	5,500,800		
エイチ・アイ・エス	2,500	1,822.00	4,555,000		
東京ドーム	21,000	236.00	4,956,000		
メイテック	4,100	1,520.00	6,232,000		
アサツー ディ・ケイ	4,200	2,163.00	9,084,600		
ニチイ学館	5,300	800.00	4,240,000		
ダイセキ	4,600	1,819.00	8,367,400		
計	銘柄数：398			2,688,785,660	
	組入時価比率：99.8%			100%	
合計				2,688,785,660	

(注) 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22年7月15日現在)

該当事項はございません。

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

該当事項はございません。