

平成23年7月期（平成22年7月16日～平成23年7月15日）決算短信

平成23年8月24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 CEO兼執行役会長 岩崎 俊博
 問合せ先責任者 投信ディスクロージャー部長 森保 一美 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成23年9月29日
 分配金支払開始予定日 平成23年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成23年7月期の運用状況（平成22年7月16日～平成23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23年7月期	2,802	(99.8)	6	(0.2)	2,809	(100)
平成22年7月期	2,688	(99.8)	6	(0.2)	2,695	(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23年7月期	309	0	0	309
平成22年7月期	308	99	99	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23年7月期	2,856	46	2,809	90,927
平成22年7月期	2,740	44	2,695	87,228

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成23年7月期	1,220.00
平成22年7月期	1,140.00

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3期 平成22年7月15日現在	第4期 平成23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	25,197,226	32,728,942
株式	2,688,785,660	2,802,947,270
未収入金	24,006,318	18,868,674
未収配当金	2,093,050	1,947,900
未収利息	71	78
流動資産合計	2,740,082,325	2,856,492,864
資産合計	2,740,082,325	2,856,492,864
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	35,226,684	37,698,732
未払受託者報酬	742,987	723,422
未払委託者報酬	6,686,830	6,510,739
その他未払費用	2,041,549	1,847,712
流動負債合計	44,698,050	46,780,605
負債合計	44,698,050	46,780,605
純資産の部		
元本等		
元本	4,394,065,320	4,394,065,320
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,698,681,045	1,584,353,061
(分配準備積立金)	2,281,174	2,082,440
元本等合計	2,695,384,275	2,809,712,259
純資産合計	2,695,384,275	2,809,712,259
負債純資産合計	2,740,082,325	2,856,492,864

(2)【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第3期	第4期
		自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		54,281,400	53,654,900
受取利息		15,061	9,783
有価証券売買等損益		102,860,373	114,526,718
その他収益		466	28,403
営業収益合計		48,563,446	168,219,804
営業費用			
受託者報酬		1,580,191	1,421,623
委託者報酬		14,221,584	12,794,512
その他費用		2,263,644	1,976,953
営業費用合計		18,065,419	16,193,088
営業利益		66,628,865	152,026,716
経常利益		66,628,865	152,026,716
当期純利益		66,628,865	152,026,716
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()		1,702,359,284	1,698,681,045
剰余金増加額又は欠損金減少額		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		556,683,540	
剰余金減少額又は欠損金増加額		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		451,149,752	
分配金		35,226,684	37,698,732
期末剰余金又は期末欠損金()		1,698,681,045	1,584,353,061

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第3期	第4期
	自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	自 平成22年7月16日 至 平成23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 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 約定日基準で計上しております。	(1) 受取配当金 同左 (2) 有価証券売買等損益 同左
3 その他	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。	当ファンドの計算期間は、平成22年7月16日から平成23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3期 平成22年7月15日現在	第4期 平成23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 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 1,698,681,045 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 1,584,353,061 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)	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 9,092.7 円 (10口当たり純資産額 90,927 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 39,781,172 円 (10口当たり1,287円)のうち、37,698,732円 (10口当たり1,220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: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">54,296,927円</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	A	54,296,927円	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	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">53,693,086円</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;">53,693,086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;">2,281,174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;">55,974,260円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">16,193,088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;">39,781,172円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">37,698,732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;">2,082,440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;">1,220円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	53,693,086円	当期配当等収益額	A	53,693,086円	分配準備積立金	B	2,281,174円	配当等収益合計額	C = A + B	55,974,260円	経費	D	16,193,088円	収益分配可能額	E = C - D	39,781,172円	収益分配金	F	37,698,732円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,082,440円	口数	H	309,006口	10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,220円
項目	A	54,296,927円																																																											
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	A	53,693,086円																																																											
当期配当等収益額	A	53,693,086円																																																											
分配準備積立金	B	2,281,174円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	55,974,260円																																																											
経費	D	16,193,088円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	39,781,172円																																																											
収益分配金	F	37,698,732円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,082,440円																																																											
口数	H	309,006口																																																											
10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,220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3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23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>	<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> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 平成22年7月15日現在	第4期 平成23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。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23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3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
期首元本額 4,386,742,020 円	期首元本額 4,394,065,320 円
期中追加設定元本額 1,421,715,600 円	期中追加設定元本額 円
期中一部交換元本額 1,414,392,300 円	期中一部交換元本額 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第3期 自 平成21年7月16日 至 平成22年7月15日	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日
種類	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	36,802,727	143,831,282
合計	36,802,727	143,831,282

3 デリバティブ取引関係

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。

第4期(自 平成22年7月16日 至 平成23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23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	27,300	271.00	7,398,300	
	マルハニチロホールディングス	47,000	130.00	6,110,000	
	サカタのタネ	3,900	1,187.00	4,629,300	
	ホクト	2,600	1,785.00	4,641,000	
	石油資源開発	3,800	3,890.00	14,782,000	
	ショーボンドホールディングス	2,400	1,908.00	4,579,200	
	コムシスホールディングス	13,000	786.00	10,218,000	
	長谷工コーポレーション	164,000	63.00	10,332,000	
	奥村組	22,000	292.00	6,424,000	
	戸田建設	25,000	292.00	7,300,000	
	N I P P O	7,000	643.00	4,501,000	
	前田道路	8,000	784.00	6,272,000	
	住友林業	16,900	749.00	12,658,100	
	パナホーム	9,000	533.00	4,797,000	
	関電工	12,000	381.00	4,572,000	
	きんでん	17,000	701.00	11,917,000	
	協和エクシオ	9,100	793.00	7,216,300	
	大気社	2,900	1,594.00	4,622,600	
	東芝プラントシステム	5,000	921.00	4,605,000	
	東洋エンジニアリング	15,000	304.00	4,560,000	
	千代田化工建設	19,000	925.00	17,575,000	
	新興プランテック	4,900	873.00	4,277,700	
	日本製粉	12,000	374.00	4,488,000	
	森永製菓	21,000	193.00	4,053,000	
	江崎グリコ	8,000	909.00	7,272,000	
	山崎製パン	11,000	1,083.00	11,913,000	
	森永乳業	22,000	360.00	7,920,000	
	雪印メグミルク	4,700	1,543.00	7,252,100	
	伊藤ハム	16,000	331.00	5,296,000	
	サッポロホールディングス	37,000	323.00	11,951,000	
	宝ホールディングス	22,000	421.00	9,262,000	
	コカ・コーラウエスト	7,400	1,539.00	11,388,600	
	伊藤園	7,200	1,425.00	10,260,000	
	日清オイリオグループ	12,000	384.00	4,608,000	
	不二製油	6,400	1,218.00	7,795,200	
	キュービー	12,900	1,048.00	13,519,200	
	ハウス食品	7,700	1,381.00	10,633,700	
	カゴメ	8,500	1,481.00	12,588,500	
	ニチレイ	26,000	352.00	9,152,000	
	グンゼ	19,000	283.00	5,377,000	
	東洋紡績	95,000	116.00	11,020,000	
	ユニチカ	51,000	60.00	3,060,000	
	日本毛織	8,000	681.00	5,448,000	
	ワコールホールディングス	12,000	1,001.00	12,012,000	
	ホギメディカル	1,200	3,590.00	4,308,000	
	T S Iホールディングス	9,400	534.00	5,019,600	
	三陽商会	12,000	235.00	2,820,000	
	オンワードホールディングス	14,000	676.00	9,464,000	
	北越紀州製紙	15,000	519.00	7,785,000	
	大王製紙	11,000	648.00	7,128,000	
	レンゴー	23,000	532.00	12,236,000	
	クレハ	15,000	388.00	5,820,000	
	日本曹達	16,000	351.00	5,616,000	
	東ソー	55,000	350.00	19,250,000	
	セントラル硝子	21,000	390.00	8,190,000	
	東亜合成	24,000	417.00	10,008,000	
	日本バーカライジング	5,000	1,185.00	5,925,000	
	日本触媒	15,000	1,048.00	15,720,000	
	東京応化工業	4,400	1,740.00	7,656,000	
	住友ベークライト	22,000	530.00	11,660,000	
	日本ゼオン	19,000	776.00	14,744,000	
	アイカ工業	6,000	1,102.00	6,612,000	
	A D E K A	9,400	837.00	7,867,800	
	日油	18,000	360.00	6,480,000	
	三洋化成工業	6,000	644.00	3,864,000	
	日本ペイント	22,000	641.00	14,102,000	
	中国塗料	6,000	627.00	3,762,000	
	太陽ホールディングス	2,200	2,377.00	5,229,400	

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(1312) 平成23年7月期 決算短信

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	D I C	80,000	183.00	14,640,000	
	東洋インキS Cホールディングス	23,000	373.00	8,579,000	
	ライオン	24,000	451.00	10,824,000	
	マンダム	2,300	2,342.00	5,386,600	
	ファンケル	4,300	1,116.00	4,798,800	
	コーセー	3,900	2,112.00	8,236,800	
	ドクターシーラボ	16	433,000.00	6,928,000	
	小林製薬	3,500	4,100.00	14,350,000	
	アース製薬	1,600	2,804.00	4,486,400	
	エフビコ	1,600	4,965.00	7,944,000	
	ニフコ	5,600	2,137.00	11,967,200	
	大日本住友製薬	16,000	791.00	12,656,000	
	日本新薬	5,000	1,079.00	5,395,000	
	科研製薬	10,000	1,106.00	11,060,000	
	ロート製薬	10,000	926.00	9,260,000	
	持田製薬	8,000	860.00	6,880,000	
	日医工	3,300	2,198.00	7,253,400	
	キッセイ薬品工業	3,700	1,554.00	5,749,800	
	生化学工業	4,100	937.00	3,841,700	
	東和薬品	1,100	4,580.00	5,038,000	
	沢井製薬	1,800	8,240.00	14,832,000	
	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,644.00	9,864,000	
	コスモ石油	60,000	236.00	14,160,000	
	横浜ゴム	25,000	483.00	12,075,000	
	東海ゴム工業	4,500	1,067.00	4,801,500	
	日東紡績	22,000	203.00	4,466,000	
	住友大阪セメント	48,000	223.00	10,704,000	
	太平洋セメント	106,000	159.00	16,854,000	
	東海カーボン	22,000	438.00	9,636,000	
	東洋炭素	1,400	3,825.00	5,355,000	
	日新製鋼	73,000	155.00	11,315,000	
	東京製鐵	12,800	835.00	10,688,000	
	大和工業	5,000	2,453.00	12,265,000	
	淀川製鋼所	14,000	342.00	4,788,000	
	丸一鋼管	6,000	2,065.00	12,390,000	
	大同特殊鋼	29,000	539.00	15,631,000	
	日本冶金工業	14,000	218.00	3,052,000	
	山陽特殊製鋼	13,000	512.00	6,656,000	
	愛知製鋼	11,000	558.00	6,138,000	
	日立金属	13,000	1,074.00	13,962,000	
	大平洋金属	18,000	599.00	10,782,000	
	日本電工	10,000	512.00	5,120,000	
	日本軽金属	56,000	164.00	9,184,000	
	東邦亜鉛	12,000	393.00	4,716,000	
	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	5,350.00	12,840,000	
	東邦チタニウム	3,800	2,279.00	8,660,200	
	日立電線	21,000	198.00	4,158,000	
	アサヒホールディングス	2,500	1,744.00	4,360,000	
	三和ホールディングス	23,000	283.00	6,509,000	
	ノーリツ	3,500	1,654.00	5,789,000	
	長府製作所	2,300	2,029.00	4,666,700	
	日本発條	19,000	834.00	15,846,000	
	三浦工業	3,100	2,305.00	7,145,500	
	オークマ	15,000	839.00	12,585,000	
	東芝機械	14,000	478.00	6,692,000	
	富士機械製造	4,300	1,581.00	6,798,300	
	牧野フライス製作所	12,000	754.00	9,048,000	
	オーエスジー	9,000	1,210.00	10,890,000	
	旭ダイヤモンド工業	6,800	1,836.00	12,484,800	
	森精機製作所	12,600	1,036.00	13,053,600	
	ディスコ	2,700	4,690.00	12,663,000	
	島精機製作所	3,300	2,026.00	6,685,800	
	井関農機	18,000	200.00	3,600,000	
	小森コーポレーション	7,500	701.00	5,257,500	
	椿本チエイン	14,000	499.00	6,986,000	
	ダイフク	10,000	525.00	5,250,000	
	平和	4,800	1,333.00	6,398,400	
	ユニバーサルエンターテインメント	3,000	2,340.00	7,020,000	
	アマノ	6,200	770.00	4,774,000	
	サンデン	12,000	391.00	4,692,000	

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(1312) 平成23年7月期 決算短信

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	グローリー	6,700	1,780.00	11,926,000	
	ホシザキ電機	4,000	1,790.00	7,160,000	
	不二越	18,000	543.00	9,774,000	
	日本トムソン	8,000	646.00	5,168,000	
	日立造船	95,500	128.00	12,224,000	
	富士電機	67,000	246.00	16,482,000	
	明電舎	19,000	339.00	6,441,000	
	東芝テック	16,000	343.00	5,488,000	
	マブチモーター	3,100	4,120.00	12,772,000	
	ダイヘン	12,000	306.00	3,672,000	
	沖電気工業	84,000	81.00	6,804,000	
	サンケン電気	14,000	447.00	6,258,000	
	ワコム	47	91,200.00	4,286,400	
	アルバック	4,100	1,864.00	7,642,400	
	アンリツ	12,000	732.00	8,784,000	
	日立国際電気	6,000	627.00	3,762,000	
	バイオニア	31,900	387.00	12,345,300	
	フォスター電機	2,100	1,496.00	3,141,600	
	ホシデン	6,700	700.00	4,690,000	
	日本航空電子工業	6,000	599.00	3,594,000	
	アルバイン	5,200	1,158.00	6,021,600	
	船井電機	2,400	2,096.00	5,030,400	
	日本光電工業	4,300	2,085.00	8,965,500	
	堀場製作所	4,500	2,683.00	12,073,500	
	新光電気工業	8,500	697.00	5,924,500	
	太陽誘電	13,000	984.00	12,792,000	
	双葉電子工業	3,200	1,440.00	4,608,000	
	ニチコン	6,700	1,354.00	9,071,800	
	日本ケミコン	14,000	496.00	6,944,000	
	小糸製作所	10,000	1,370.00	13,700,000	
	大日本スクリーン製造	26,000	656.00	17,056,000	
	キャノン電子	2,400	2,176.00	5,222,400	
	トヨタ紡織	6,200	1,329.00	8,239,800	
	ユニプレス	3,600	2,277.00	8,197,200	
	東海理化電機製作所	5,800	1,553.00	9,007,400	
	日野自動車	30,000	477.00	14,310,000	
	武蔵精密工業	2,600	2,158.00	5,610,800	
	日産車体	8,000	639.00	5,112,000	
	日信工業	4,500	1,478.00	6,651,000	
	曙ブレーキ工業	8,800	434.00	3,819,200	
	カヤバ工業	16,000	603.00	9,648,000	
	カルソニックカンセイ	16,000	528.00	8,448,000	
	ケーヒン	5,300	1,749.00	9,269,700	
	エクセディ	2,100	2,858.00	6,001,800	
	豊田合成	7,300	1,762.00	12,862,600	
	日本精機	4,000	993.00	3,972,000	
	エフ・シー・シー	4,100	1,929.00	7,908,900	
	タカタ	4,200	2,387.00	10,025,400	
	テイ・エス テック	4,900	1,528.00	7,487,200	
	日機装	6,000	727.00	4,362,000	
	ナカニシ	500	7,980.00	3,990,000	
	東京精密	4,600	1,455.00	6,693,000	
	ニプロ	5,600	1,483.00	8,304,800	
	トッパン・フォームズ	5,400	666.00	3,596,400	
	フジシールインターナショナル	2,400	1,776.00	4,262,400	
	タカラトミー	7,400	732.00	5,416,800	
	日本写真印刷	3,500	1,495.00	5,232,500	
	ビジョン	2,200	2,771.00	6,096,200	
	パラマウントベッド	1,800	2,232.00	4,017,600	
	リンテック	6,000	2,222.00	13,332,000	
	タカラスタンダード	11,000	613.00	6,743,000	
	コクヨ	9,700	601.00	5,829,700	
	沖縄電力	1,700	3,710.00	6,307,000	
	西部瓦斯	25,000	209.00	5,225,000	
	相鉄ホールディングス	43,000	228.00	9,804,000	
	西日本鉄道	34,000	351.00	11,934,000	
	山九	31,000	373.00	11,563,000	
	日本梱包運輸倉庫	4,300	902.00	3,878,600	
	福山通運	13,000	469.00	6,097,000	
	セイノーホールディングス	17,000	601.00	10,217,000	

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(1312) 平成23年7月期 決算短信

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日立物流	5,700	1,391.00	7,928,700	
	飯野海運	10,000	393.00	3,930,000	
	三井倉庫	13,000	323.00	4,199,000	
	住友倉庫	16,000	385.00	6,160,000	
	近鉄エクスプレス	2,200	2,743.00	6,034,600	
	I Tホールディングス	9,600	765.00	7,344,000	
	グリー	9,200	1,860.00	17,112,000	
	オービック	670	15,820.00	10,599,400	
	伊藤忠テクノソリューションズ	3,700	2,957.00	10,940,900	
	大塚商会	2,000	5,240.00	10,480,000	
	ネットワンシステムズ	54	165,500.00	8,937,000	
	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,300	1,103.00	4,742,900	
	日本ユニシス	7,400	469.00	3,470,600	
	東京放送ホールディングス	10,900	1,009.00	10,998,100	
	テレビ朝日	55	122,400.00	6,732,000	
	スカパーJ S A Tホールディングス	168	34,700.00	5,829,600	
	イー・アクセス	167	37,450.00	6,254,150	
	光通信	3,000	1,996.00	5,988,000	
	角川グループホールディングス	2,000	2,816.00	5,632,000	
	松竹	10,000	670.00	6,700,000	
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,100	1,583.00	12,822,300	
	カブコン	6,200	1,896.00	11,755,200	
	N S D	4,400	697.00	3,066,800	
	ダイワボウホールディングス	22,000	182.00	4,004,000	
	J F E 商事ホールディングス	13,000	396.00	5,148,000	
	第一興商	5,300	1,389.00	7,361,700	
	長瀬産業	12,800	992.00	12,697,600	
	日立ハイテクノロジーズ	8,600	1,750.00	15,050,000	
	キャノンマーケティングジャパン	7,500	950.00	7,125,000	
	阪和興業	23,000	358.00	8,234,000	
	岩谷産業	24,000	292.00	7,008,000	
	東邦ホールディングス	5,100	825.00	4,207,500	
	サンゲツ	3,500	2,029.00	7,101,500	
	サンリオ	4,500	2,949.00	13,270,500	
	リョーサン	3,900	1,738.00	6,778,200	
	モスフードサービス	2,900	1,542.00	4,471,800	
	オートバックスセブン	3,500	3,480.00	12,180,000	
	因幡電機産業	2,000	2,180.00	4,360,000	
	ミスミグループ本社	7,900	2,128.00	16,811,200	
	エーピーシー・マート	3,200	3,055.00	9,776,000	
	ポイント	2,130	3,445.00	7,337,850	
	エディオン	6,700	850.00	5,695,000	
	D C Mホールディングス	10,000	649.00	6,490,000	
	ドトール・日レスホールディングス	3,800	1,076.00	4,088,800	
	マツモトキヨシホールディングス	4,100	1,749.00	7,170,900	
	スタートトゥデイ	4,600	1,895.00	8,717,000	
	サークルKサンクス	4,200	1,326.00	5,569,200	
	ツルハホールディングス	1,800	3,960.00	7,128,000	
	良品計画	2,900	4,185.00	12,136,500	
	ドン・キホーテ	6,400	2,733.00	17,491,200	
	ゼンショー	8,400	1,042.00	8,752,800	
	サイゼリヤ	3,100	1,631.00	5,056,100	
	スギホールディングス	4,700	2,186.00	10,274,200	
	木曽路	2,100	1,466.00	3,078,600	
	島忠	5,900	2,061.00	12,159,900	
	コメリ	4,000	2,359.00	9,436,000	
	青山商事	7,400	1,496.00	11,070,400	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	13,000	609.00	7,917,000	
	イズミ	5,400	1,223.00	6,604,200	
	ゼビオ	3,000	1,880.00	5,640,000	
	ケースホールディングス	5,600	3,975.00	22,260,000	
	吉野家ホールディングス	57	101,000.00	5,757,000	
	アークス	3,300	1,382.00	4,560,600	
	サンドラッグ	4,300	2,521.00	10,840,300	
	新生銀行	184,000	86.00	15,824,000	
	あおぞら銀行	86,000	175.00	15,050,000	
	第四銀行	31,000	247.00	7,657,000	
	札幌北洋ホールディングス	32,600	350.00	11,410,000	
	武蔵野銀行	3,700	2,787.00	10,311,900	
	七十七銀行	36,000	365.00	13,140,000	

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(1312) 平成23年7月期 決算短信

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	青森銀行	21,000	271.00	5,691,000	
	秋田銀行	18,000	245.00	4,410,000	
	山形銀行	14,000	388.00	5,432,000	
	岩手銀行	1,600	3,190.00	5,104,000	
	東邦銀行	22,000	187.00	4,114,000	
	十六銀行	35,000	249.00	8,715,000	
	山梨中央銀行	19,000	347.00	6,593,000	
	大垣共立銀行	36,000	252.00	9,072,000	
	福井銀行	24,000	235.00	5,640,000	
	北國銀行	26,000	278.00	7,228,000	
	滋賀銀行	23,000	461.00	10,603,000	
	南都銀行	25,000	419.00	10,475,000	
	百五銀行	28,000	326.00	9,128,000	
	山陰合同銀行	17,000	607.00	10,319,000	
	百十四銀行	26,000	295.00	7,670,000	
	四国銀行	20,000	262.00	5,240,000	
	阿波銀行	24,000	516.00	12,384,000	
	鹿児島銀行	16,000	536.00	8,576,000	
	大分銀行	16,000	242.00	3,872,000	
	宮崎銀行	16,000	187.00	2,992,000	
	肥後銀行	18,000	457.00	8,226,000	
	沖縄銀行	2,100	3,710.00	7,791,000	
	琉球銀行	4,500	1,032.00	4,644,000	
	みずほ信託銀行	170,000	70.00	11,900,000	
	セブン銀行	67	160,500.00	10,753,500	
	紀陽ホールディングス	85,000	109.00	9,265,000	
	名古屋銀行	16,000	259.00	4,144,000	
	第三銀行	16,000	194.00	3,104,000	
	京葉銀行	23,000	427.00	9,821,000	
	関西アーバン銀行	33,000	147.00	4,851,000	
	栃木銀行	11,000	309.00	3,399,000	
	トモニホールディングス	17,400	317.00	5,515,800	
	池田泉州ホールディングス	92,700	120.00	11,124,000	
	ジャフコ	3,100	2,030.00	6,293,000	
	みずほ証券	57,000	191.00	10,887,000	
	岡三証券グループ	19,000	294.00	5,586,000	
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,000	239.00	6,692,000	
	松井証券	14,100	399.00	5,625,900	
	芙蓉総合リース	1,900	2,698.00	5,126,200	
	東京センチュリーリース	6,400	1,515.00	9,696,000	
	日本証券金融	9,800	496.00	4,860,800	
	イオンクレジットサービス	10,200	1,107.00	11,291,400	
	アコム	4,360	1,271.00	5,541,560	
	プロミス	10,650	677.00	7,210,050	
	日立キャピタル	3,800	1,105.00	4,199,000	
	三菱UFJリース	4,690	3,185.00	14,937,650	
	野村不動産ホールディングス	10,200	1,369.00	13,963,800	
	パーク24	12,000	898.00	10,776,000	
	平和不動産	22,500	183.00	4,117,500	
	ダイビル	5,900	603.00	3,557,700	
	大京	34,000	146.00	4,964,000	
	住友不動産販売	960	3,665.00	3,518,400	
	ゴールドクレスト	2,020	1,668.00	3,369,360	
	アーネストワン	4,700	874.00	4,107,800	
	エヌ・ティ・ティ都市開発	144	69,000.00	9,936,000	
	日本空港ビルデング	4,600	977.00	4,494,200	
	アコーディア・ゴルフ	75	56,700.00	4,252,500	
	総合警備保障	6,200	923.00	5,722,600	
	カカコム	23	547,000.00	12,581,000	
	エムスリー	11	608,000.00	6,688,000	
	博報堂DYホールディングス	2,850	4,380.00	12,483,000	
	ケネディクス	295	15,500.00	4,572,500	
	ダスキン	6,500	1,574.00	10,231,000	
	リゾートトラスト	3,500	1,091.00	3,818,500	
	もしもしホットライン	2,250	1,353.00	3,044,250	
	サイバーエージェント	64	296,800.00	18,995,200	
	エイチ・アイ・エス	2,300	2,135.00	4,910,500	
	東京ドーム	19,000	159.00	3,021,000	
	メイテック	3,600	1,700.00	6,120,000	
	アサツー ディ・ケイ	4,000	2,215.00	8,860,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	ダイセキ	4,300	1,593.00	6,849,900	
計	銘柄数：349			2,802,947,270	
	組入時価比率：99.8%			100%	
合計				2,802,947,270	

(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23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。