

平成24年7月期（平成23年7月16日～平成24年7月15日）決算短信

平成24年8月23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兼執行役会長兼社長 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24年9月27日
 分配金支払開始予定日 平成24年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成24年7月期の運用状況（平成23年7月16日～平成24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24年7月期	2,552	(99.5)	13	(0.5)	2,565	(100)
平成23年7月期	2,802	(99.8)	6	(0.2)	2,809	(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24年7月期	309	0	0	309
平成23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24年7月期	2,616	50	2,565	83,033
平成23年7月期	2,856	46	2,809	90,927

(4)分配金

	10口当り分配金
	円
平成24年7月期	1,360.00
平成23年7月期	1,220.00

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4期 平成23年7月15日現在	第5期 平成24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	32,728,942	32,329,306
株式	2,802,947,270	2,552,018,540
未収入金	18,868,674	30,252,218
未収配当金	1,947,900	2,027,050
未収利息	78	244
流動資産合計	2,856,492,864	2,616,627,358
資産合計	2,856,492,864	2,616,627,358
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,698,732	42,024,816
未払受託者報酬	723,422	702,310
未払委託者報酬	6,510,739	6,320,705
その他未払費用	1,847,712	1,797,641
流動負債合計	46,780,605	50,845,472
負債合計	46,780,605	50,845,472
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()	1,584,353,061	1,828,283,434
(分配準備積立金)	2,082,440	2,032,114
元本等合計	2,809,712,259	2,565,781,886
純資産合計	2,809,712,259	2,565,781,886
負債純資産合計	2,856,492,864	2,616,627,358

(2)【損益及び剰余金計算書】

科目	期別	第4期	第5期
		自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
受取配当金		53,654,900	57,708,750
受取利息		9,783	10,777
有価証券売買等損益		114,526,718	243,880,047
その他収益		28,403	18,963
営業収益合計		168,219,804	186,141,557
営業費用			
受託者報酬		1,421,623	1,384,242
委託者報酬		12,794,512	12,458,071
その他費用		1,976,953	1,921,687
営業費用合計		16,193,088	15,764,000
営業利益		152,026,716	201,905,557
経常利益		152,026,716	201,905,557
当期純利益		152,026,716	201,905,557
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()		1,698,681,045	1,584,353,061
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			
分配金		37,698,732	42,024,816
期末剰余金又は期末欠損金()		1,584,353,061	1,828,283,434

(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	(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	(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。
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、平成23年7月16日から平成24年7月15日までとなっております。

(追加情報)

第5期
自 平成23年7月16日 至 平成24年7月15日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 平成23年7月15日現在	第5期 平成24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 1,584,353,061 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 1,828,283,434 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)	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 8,303.3 円 (10口当たり純資産額 83,033 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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 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。	1 分配金の計算過程 計算期末における収益分配可能額 44,056,930 円 (10口当たり 1,425 円)のうち、42,024,816 円 (10口当たり 1,360 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;">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	<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;">57,738,490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;">57,738,490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;">2,082,440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;">59,820,930円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">15,764,000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;">44,056,930円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">42,024,816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;">2,032,114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;">1,360円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	57,738,490円	当期配当等収益額	A	57,738,490円	分配準備積立金	B	2,082,440円	配当等収益合計額	C = A + B	59,820,930円	経費	D	15,764,000円	収益分配可能額	E = C - D	44,056,930円	収益分配金	F	42,024,816円	次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,032,114円	口数	H	309,006口	10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,360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																																																											
項目	A	57,738,490円																																																											
当期配当等収益額	A	57,738,490円																																																											
分配準備積立金	B	2,082,440円																																																											
配当等収益合計額	C = A + B	59,820,930円																																																											
経費	D	15,764,000円																																																											
収益分配可能額	E = C - D	44,056,930円																																																											
収益分配金	F	42,024,816円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G = E - F	2,032,114円																																																											
口数	H	309,006口																																																											
10口当たり分配金	I = F / H × 10	1,360円																																																											
2 その他費用 その他費用のうち 1,705,823 円は、対象指数についての商標使用料であります。	2 その他費用 その他費用のうち 1,660,966 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4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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>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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 平成23年7月15日現在	第5期 平成24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4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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 円	期中追加設定元本額 円
期中一部交換元本額 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

種類	第4期 自 平成22年7月16日 至 平成23年7月15日	第5期 自 平成23年7月16日 至 平成24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	143,831,282	185,710,416
合計	143,831,282	185,710,416

3 デリバティブ取引関係

第4期(平成23年7月15日現在)

該当事項はございません。

第5期(平成24年7月15日現在)

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24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	33,600	200.00	6,720,000	
	マルハニチロホールディングス	59,000	123.00	7,257,000	
	サカタのタネ	4,700	1,051.00	4,939,700	
	ホクト	3,200	1,547.00	4,950,400	
	ショーボンドホールディングス	3,000	2,346.00	7,038,000	
	ミライト・ホールディングス	8,500	565.00	4,802,500	
	コムシスホールディングス	16,200	974.00	15,778,800	
	長谷工コーポレーション	224,000	56.00	12,544,000	
	西松建設	40,000	141.00	5,640,000	
	前田建設工業	18,000	373.00	6,714,000	
	奥村組	26,000	270.00	7,020,000	
	戸田建設	31,000	243.00	7,533,000	
	N I P P O	8,000	906.00	7,248,000	
	前田道路	9,000	1,055.00	9,495,000	
	五洋建設	41,500	208.00	8,632,000	
	パナホーム	11,000	491.00	5,401,000	
	関電工	14,000	372.00	5,208,000	
	きんでん	21,000	525.00	11,025,000	
	協和エクシオ	11,800	820.00	9,676,000	
	高砂熱学工業	6,900	605.00	4,174,500	
	大気社	3,700	1,734.00	6,415,800	
	東芝プラントシステム	6,000	920.00	5,520,000	
	東洋エンジニアリング	18,000	348.00	6,264,000	
	新興プランテック	6,100	698.00	4,257,800	

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24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	日本製粉	15,000	352.00	5,280,000	
	三井製糖	13,000	248.00	3,224,000	
	森永製菓	26,000	187.00	4,862,000	
	江崎グリコ	9,000	905.00	8,145,000	
	カルビー	2,300	5,230.00	12,029,000	
	森永乳業	27,000	307.00	8,289,000	
	雪印メグミルク	6,000	1,395.00	8,370,000	
	伊藤ハム	20,000	332.00	6,640,000	
	サッポロホールディングス	46,000	260.00	11,960,000	
	宝ホールディングス	27,000	510.00	13,770,000	
	ダイドードリンコ	1,400	3,555.00	4,977,000	
	伊藤園	9,000	1,491.00	13,419,000	
	日清オイリオグループ	16,000	324.00	5,184,000	
	不二製油	8,300	1,016.00	8,432,800	
	ハウス食品	9,200	1,353.00	12,447,600	
	ニチレイ	33,000	389.00	12,837,000	
	グンゼ	24,000	203.00	4,872,000	
	東洋紡績	123,000	104.00	12,792,000	
	倉敷紡績	28,000	136.00	3,808,000	
	日本毛織	9,000	542.00	4,878,000	
	ワコールホールディングス	15,000	898.00	13,470,000	
	ホギメディカル	1,700	3,675.00	6,247,500	
	T S Iホールディングス	13,500	386.00	5,211,000	
	オンワードホールディングス	17,000	587.00	9,979,000	
	北越紀州製紙	19,500	398.00	7,761,000	
	大王製紙	14,000	465.00	6,510,000	
	クレハ	19,000	322.00	6,118,000	
	石原産業	51,000	67.00	3,417,000	
	日本曹達	19,000	303.00	5,757,000	
	トクヤマ	48,000	190.00	9,120,000	
	セントラル硝子	26,000	303.00	7,878,000	
	東亜合成	30,000	294.00	8,820,000	
	日本バーカライジング	6,000	1,182.00	7,092,000	
	東京応化工業	5,500	1,687.00	9,278,500	
	住友ベークライト	27,000	332.00	8,964,000	
	アイカ工業	7,100	1,211.00	8,598,100	
	A D E K A	11,600	674.00	7,818,400	
	日油	22,000	403.00	8,866,000	
	三洋化成工業	8,000	479.00	3,832,000	
	中国塗料	8,000	418.00	3,344,000	
	太陽ホールディングス	2,700	1,967.00	5,310,900	
	東洋インキS Cホールディングス	28,000	281.00	7,868,000	
	マンダム	2,800	1,975.00	5,530,000	
	ファンケル	5,300	983.00	5,209,900	
	コーセー	4,800	1,871.00	8,980,800	
	ドクターシーラボ	20	287,300.00	5,746,000	
	ポーラ・オルビスホールディングス	3,300	2,514.00	8,296,200	
	長谷川香料	3,300	988.00	3,260,400	
	アース製薬	2,000	2,885.00	5,770,000	
	エフピコ	2,000	5,440.00	10,880,000	
	日本新薬	7,000	942.00	6,594,000	
	科研製薬	12,000	1,129.00	13,548,000	
	ロート製薬	13,000	1,092.00	14,196,000	
	持田製薬	10,000	905.00	9,050,000	
	日医工	4,400	1,799.00	7,915,600	
	キッセイ薬品工業	4,600	1,427.00	6,564,200	
	生化学工業	5,200	799.00	4,154,800	
	東和薬品	1,400	4,560.00	6,384,000	
	キョーリン製薬ホールディングス	7,400	1,729.00	12,794,600	
	東洋ゴム工業	26,000	235.00	6,110,000	
	ニッタ	3,100	1,212.00	3,757,200	
	東海ゴム工業	5,600	843.00	4,720,800	
	日東紡績	27,000	242.00	6,534,000	
	東海カーボン	28,000	332.00	9,296,000	
	東洋炭素	1,700	2,427.00	4,125,900	
	ニチアス	13,000	442.00	5,746,000	
	日新製鋼	90,000	96.00	8,640,000	
	東京製鐵	16,100	418.00	6,729,800	
	大和工業	6,000	2,226.00	13,356,000	
	淀川製鋼所	17,000	300.00	5,100,000	
	丸一鋼管	7,300	1,635.00	11,935,500	

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24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	山陽特殊製鋼	17,000	329.00	5,593,000	
	愛知製鋼	14,000	305.00	4,270,000	
	大太平洋金属	23,000	297.00	6,831,000	
	日本電工	13,000	269.00	3,497,000	
	日本軽金属	70,000	89.00	6,230,000	
	東邦亜鉛	18,000	285.00	5,130,000	
	大阪チタニウムテクノロジーズ	3,000	2,499.00	7,497,000	
	東邦チタニウム	4,800	995.00	4,776,000	
	住友軽金属工業	62,000	81.00	5,022,000	
	フジクラ	50,000	217.00	10,850,000	
	日立電線	26,000	164.00	4,264,000	
	リョービ	15,000	216.00	3,240,000	
	アサヒホールディングス	3,200	1,622.00	5,190,400	
	SUMCO	18,400	649.00	11,941,600	
	三和ホールディングス	29,000	323.00	9,367,000	
	ノーリツ	4,200	1,425.00	5,985,000	
	長府製作所	2,900	1,816.00	5,266,400	
	三浦工業	3,900	2,049.00	7,991,100	
	オークマ	19,000	469.00	8,911,000	
	東芝機械	17,000	343.00	5,831,000	
	富士機械製造	5,200	1,309.00	6,806,800	
	牧野フライス製作所	15,000	420.00	6,300,000	
	オーエスジー	11,100	1,108.00	12,298,800	
	旭ダイヤモンド工業	7,900	891.00	7,038,900	
	森精機製作所	15,800	634.00	10,017,200	
	島精機製作所	4,000	1,161.00	4,644,000	
	井関農機	23,000	196.00	4,508,000	
	新東工業	6,600	763.00	5,035,800	
	小森コーポレーション	9,200	551.00	5,069,200	
	椿本チエイン	18,000	465.00	8,370,000	
	ダイフク	12,500	468.00	5,850,000	
	タダノ	12,000	588.00	7,056,000	
	平和	6,200	1,510.00	9,362,000	
	ユニバーサルエンターテインメント	3,800	1,790.00	6,802,000	
	アマノ	7,900	656.00	5,182,400	
	サンデン	15,000	256.00	3,840,000	
	マックス	5,000	912.00	4,560,000	
	ホシザキ電機	5,500	2,042.00	11,231,000	
	不二越	22,000	269.00	5,918,000	
	日本トムソン	10,000	339.00	3,390,000	
	日立造船	119,500	100.00	11,950,000	
	明電舎	23,000	285.00	6,555,000	
	東芝テック	20,000	274.00	5,480,000	
	マブチモーター	3,800	3,150.00	11,970,000	
	ダイヘン	14,000	264.00	3,696,000	
	JVCケンウッド	15,800	256.00	4,044,800	
	沖電気工業	108,000	127.00	13,716,000	
	サンケン電気	17,000	303.00	5,151,000	
	ワコム	58	172,000.00	9,976,000	
	アルバック	5,600	649.00	3,634,400	
	富士通ゼネラル	8,000	636.00	5,088,000	
	日立国際電気	8,000	559.00	4,472,000	
	ミツミ電機	13,300	485.00	6,450,500	
	ホシデン	8,400	475.00	3,990,000	
	日本航空電子工業	8,000	690.00	5,520,000	
	アルパイン	6,300	845.00	5,323,500	
	船井電機	3,000	1,082.00	3,246,000	
	日本光電工業	5,400	2,542.00	13,726,800	
	フェローテック	4,300	415.00	1,784,500	
	新光電気工業	10,600	573.00	6,073,800	
	太陽誘電	15,900	721.00	11,463,900	
	双葉電子工業	4,100	1,208.00	4,952,800	
	ニチコン	7,900	697.00	5,506,300	
	日本ケミコン	19,000	196.00	3,724,000	
	スター精密	5,600	756.00	4,233,600	
	キャノン電子	3,100	1,610.00	4,991,000	
	トヨタ紡織	7,700	909.00	6,999,300	
	ユニプレス	5,000	1,938.00	9,690,000	
	東海理化電機製作所	7,100	1,214.00	8,619,400	
	三井造船	105,000	105.00	11,025,000	
	武蔵精密工業	3,200	1,388.00	4,441,600	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日産車体	9,000	826.00	7,434,000	
	日信工業	5,400	1,003.00	5,416,200	
	曙ブレーキ工業	12,500	347.00	4,337,500	
	タチエス	3,100	1,349.00	4,181,900	
	フタバ産業	7,300	389.00	2,839,700	
	カヤバ工業	20,000	313.00	6,260,000	
	プレス工業	14,000	354.00	4,956,000	
	カルソニックカンセイ	21,000	398.00	8,358,000	
	ケーヒン	6,400	1,042.00	6,668,800	
	エクセディ	2,700	1,618.00	4,368,600	
	豊田合成	9,000	1,658.00	14,922,000	
	日本精機	6,000	859.00	5,154,000	
	エフ・シー・シー	5,100	1,223.00	6,237,300	
	タカタ	5,300	1,554.00	8,236,200	
	テイ・エス テック	5,900	1,314.00	7,752,600	
	日機装	9,000	905.00	8,145,000	
	ナカニシ	600	8,290.00	4,974,000	
	東京精密	5,800	1,273.00	7,383,400	
	タムロン	2,400	2,566.00	6,158,400	
	ニプロ	17,500	468.00	8,190,000	
	パラマウントベッドホールディングス	2,200	2,429.00	5,343,800	
	トッパン・フォームズ	6,700	669.00	4,482,300	
	フジシールインターナショナル	3,000	1,518.00	4,554,000	
	タカラトミー	9,500	502.00	4,769,000	
	日本写真印刷	4,300	859.00	3,693,700	
	ビジョン	2,700	3,505.00	9,463,500	
	リンテック	7,300	1,331.00	9,716,300	
	タカラスタンダード	14,000	617.00	8,638,000	
	コクヨ	11,800	592.00	6,985,600	
	岡村製作所	8,000	590.00	4,720,000	
	美津濃	11,000	411.00	4,521,000	
	沖縄電力	2,200	2,509.00	5,519,800	
	西部瓦斯	30,000	211.00	6,330,000	
	静岡瓦斯	8,000	559.00	4,472,000	
	山九	39,000	296.00	11,544,000	
	日本梱包運輸倉庫	5,700	973.00	5,546,100	
	福山通運	16,000	434.00	6,944,000	
	セイノーホールディングス	21,000	531.00	11,151,000	
	日立物流	7,200	1,437.00	10,346,400	
	飯野海運	12,000	345.00	4,140,000	
	スカイマーク	4,900	442.00	2,165,800	
	三井倉庫	15,000	280.00	4,200,000	
	住友倉庫	19,000	367.00	6,973,000	
	近鉄エクスプレス	2,700	2,486.00	6,712,200	
	N E C ネットエスアイ	3,700	1,286.00	4,758,200	
	新日鉄ソリューションズ	2,700	1,370.00	3,699,000	
	I T ホールディングス	11,700	892.00	10,436,400	
	インターネットイニシアティブ	17	364,000.00	6,188,000	
	ソネットエンタテインメント	18	337,500.00	6,075,000	
	オービック	810	15,720.00	12,733,200	
	大塚商会	2,500	6,840.00	17,100,000	
	デジタルガレージ	20	156,000.00	3,120,000	
	エイベックス・グループ・ホールディングス	5,300	1,213.00	6,428,900	
	日本ユニシス	8,800	561.00	4,936,800	
	東京放送ホールディングス	13,300	950.00	12,635,000	
	テレビ朝日	68	126,400.00	8,595,200	
	スカパーJ S A Tホールディングス	209	35,000.00	7,315,000	
	イー・アクセス	260	15,490.00	4,027,400	
	光通信	3,300	3,600.00	11,880,000	
	角川グループホールディングス	2,400	2,124.00	5,097,600	
	松竹	13,000	774.00	10,062,000	
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,200	1,245.00	12,699,000	
	S C S K	5,900	1,121.00	6,613,900	
	ダイワボウホールディングス	28,000	151.00	4,228,000	
	シップヘルスケアホールディングス	4,600	2,085.00	9,591,000	
	第一興商	6,200	1,693.00	10,496,600	
	山善	7,500	571.00	4,282,500	
	キヤノンマーケティングジャパン	9,100	992.00	9,027,200	
	阪和興業	28,000	292.00	8,176,000	
	岩谷産業	29,000	312.00	9,048,000	
	J F E 商事	15,900	310.00	4,929,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	東邦ホールディングス	6,400	1,602.00	10,252,800	
	サンゲツ	4,400	1,956.00	8,606,400	
	リョーサン	4,800	1,496.00	7,180,800	
	モスフードサービス	3,500	1,569.00	5,491,500	
	オートバックスセブン	3,100	3,930.00	12,183,000	
	加藤産業	2,900	1,552.00	4,500,800	
	因幡電機産業	2,500	2,331.00	5,827,500	
	エービーシー・マート	3,900	3,170.00	12,363,000	
	ゲオホールディングス	53	89,200.00	4,727,600	
	ポイント	2,600	2,851.00	7,412,600	
	エディオン	9,600	362.00	3,475,200	
	D C Mホールディングス	12,200	531.00	6,478,200	
	ドトール・日レスホールディングス	4,700	1,038.00	4,878,600	
	マツモトキヨシホールディングス	5,100	1,777.00	9,062,700	
	スタートトゥデイ	7,100	1,119.00	7,944,900	
	ココカラファイン	2,300	2,673.00	6,147,900	
	コスモス薬品	1,300	5,340.00	6,942,000	
	ツルハホールディングス	2,300	5,040.00	11,592,000	
	良品計画	3,500	4,430.00	15,505,000	
	コーナン商事	4,200	996.00	4,183,200	
	ワタミ	2,800	1,703.00	4,768,400	
	ゼンショーホールディングス	10,500	1,008.00	10,584,000	
	サイゼリヤ	4,000	1,176.00	4,704,000	
	コロナイド	8,500	630.00	5,355,000	
	スギホールディングス	5,600	2,622.00	14,683,200	
	上新電機	5,000	857.00	4,285,000	
	島忠	7,200	1,691.00	12,175,200	
	チヨダ	3,100	1,948.00	6,038,800	
	コメリ	4,800	2,038.00	9,782,400	
	青山商事	9,000	1,628.00	14,652,000	
	エイチ・ツー・オー リテイリング	16,000	771.00	12,336,000	
	イズミ	6,700	1,676.00	11,229,200	
	フジ	2,600	1,818.00	4,726,800	
	ゼビオ	3,800	1,847.00	7,018,600	
	アインファーマシーズ	1,200	4,880.00	5,856,000	
	吉野家ホールディングス	73	103,400.00	7,548,200	
	アークス	4,100	1,780.00	7,298,000	
	ハロー	4,800	1,358.00	6,518,400	
	サンドラッグ	5,300	2,705.00	14,336,500	
	第四銀行	43,000	233.00	10,019,000	
	北越銀行	28,000	156.00	4,368,000	
	札幌北洋ホールディングス	40,100	231.00	9,263,100	
	武蔵野銀行	4,500	2,299.00	10,345,500	
	七十七銀行	44,000	315.00	13,860,000	
	青森銀行	27,000	246.00	6,642,000	
	秋田銀行	22,000	220.00	4,840,000	
	山形銀行	18,000	341.00	6,138,000	
	岩手銀行	2,100	3,330.00	6,993,000	
	東邦銀行	29,000	243.00	7,047,000	
	十六銀行	44,000	261.00	11,484,000	
	山梨中央銀行	23,000	320.00	7,360,000	
	大垣共立銀行	46,000	274.00	12,604,000	
	福井銀行	30,000	185.00	5,550,000	
	北國銀行	33,000	307.00	10,131,000	
	南都銀行	31,000	335.00	10,385,000	
	百五銀行	33,000	331.00	10,923,000	
	山陰合同銀行	21,000	544.00	11,424,000	
	百十四銀行	32,000	306.00	9,792,000	
	四国銀行	25,000	199.00	4,975,000	
	鹿児島銀行	20,000	487.00	9,740,000	
	大分銀行	21,000	251.00	5,271,000	
	肥後銀行	23,000	410.00	9,430,000	
	十八銀行	20,000	205.00	4,100,000	
	沖縄銀行	2,600	3,630.00	9,438,000	
	琉球銀行	5,700	1,007.00	5,739,900	
	セブン銀行	82,400	201.00	16,562,400	
	紀陽ホールディングス	105,000	116.00	12,180,000	
	名古屋銀行	20,000	244.00	4,880,000	
	愛媛銀行	20,000	218.00	4,360,000	
	京葉銀行	29,000	357.00	10,353,000	
	関西アーバン銀行	41,000	102.00	4,182,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	栃木銀行	14,000	249.00	3,486,000	
	トモニホールディングス	22,000	326.00	7,172,000	
	フィデアホールディングス	21,800	152.00	3,313,600	
	ジャフコ	3,900	1,408.00	5,491,200	
	岡三証券グループ	23,000	286.00	6,578,000	
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	34,000	264.00	8,976,000	
	松井証券	17,300	445.00	7,698,500	
	芙蓉総合リース	2,400	2,493.00	5,983,200	
	東京センチュリーリース	7,200	1,378.00	9,921,600	
	日本証券金融	12,500	379.00	4,737,500	
	アコム	5,360	1,600.00	8,576,000	
	ジャックス	15,000	252.00	3,780,000	
	日立キャピタル	4,600	1,295.00	5,957,000	
	ヒューリック	19,300	376.00	7,256,800	
	パーク24	13,800	1,192.00	16,449,600	
	平和不動産	28,000	179.00	5,012,000	
	ダイビル	7,300	596.00	4,350,800	
	大京	46,000	195.00	8,970,000	
	レオパレス21	20,900	249.00	5,204,100	
	住友不動産販売	1,210	3,960.00	4,791,600	
	アーネストワン	6,000	1,040.00	6,240,000	
	エヌ・ティ・ティ都市開発	178	62,800.00	11,178,400	
	日本空港ビルデング	5,900	940.00	5,546,000	
	アコーディア・ゴルフ	129	51,900.00	6,695,100	
	総合警備保障	7,500	1,105.00	8,287,500	
	メッセージ	21	271,100.00	5,693,100	
	エムスリー	29	382,500.00	11,092,500	
	ケネディクス	361	10,640.00	3,841,040	
	ダスキン	7,900	1,563.00	12,347,700	
	ラウンドワン	9,800	407.00	3,988,600	
	リゾートトラスト	4,500	1,349.00	6,070,500	
	もしもしホットライン	5,700	822.00	4,685,400	
	エイチ・アイ・エス	2,800	2,872.00	8,041,600	
	歌舞伎座	1,000	4,020.00	4,020,000	
	東京ドーム	24,000	234.00	5,616,000	
	メイテック	4,500	1,689.00	7,600,500	
	アサツー ディ・ケイ	4,900	2,217.00	10,863,300	
	イオンディライト	2,900	1,854.00	5,376,600	
	ニチイ学館	5,600	786.00	4,401,600	
	ダイセキ	5,500	1,363.00	7,496,500	
計	銘柄数：348			2,552,018,540	
	組入時価比率：99.5%			100.0%	
合計				2,552,018,540	

(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24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。