



2020年7月期 (2019年7月16日～2020年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2020 (July 16, 2019 – July 15, 2020)

2020年8月26日
 August 26, 2020

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 サポートダイヤル 山中 淳 TEL 0120-753104

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: Jun Yamanaka, Head of Support Dial Team, Investment Trust Marketing Dept.

有価証券報告書提出予定日 2020年9月30日
 分配金支払開始日 2020年8月21日
 Scheduled date of submission of securities report: September 30, 2020
 Date of commencing dividend payment: August 21, 2020

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2020年7月期の運用状況 (2019年7月16日～2020年7月15日)

Management Status for Year ended July 2020 (from July 16, 2019 to July 15, 2020)

(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.	% %
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,001	(99.8)	4	(0.2)	2,006	(100.0)
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,072	(99.7)	5	(0.3)	2,077	(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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	110	0	0	110
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	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
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,048	41	2,006	182,186
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,117	39	2,077	188,659

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	3,180
2019年7月期 FY ended Jul. 2019	2,940

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 12 期 (2019 年 7 月 15 日現在) 12th Fiscal Year As of July 15, 2019	第 13 期 (2020 年 7 月 15 日現在) 13th Fiscal Year As of July 15, 2020
	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	8,852,014	8,331,221
株式 Stocks	2,072,300,690	2,001,787,200
未収入金 Accounts receivable - other	33,129,900	35,430,600
未収配当金 Accrued dividends receivable	2,849,280	2,535,750
流動資産合計 Total current assets	2,117,131,884	2,048,084,771
資産合計 Total assets	2,117,131,884	2,048,084,771
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	32,375,280	35,018,160
未払受託者報酬 Trustee fee payable	569,594	537,996
未払委託者報酬 Investment trust management fee payable	5,126,271	4,841,901
未払利息 Accrued interest expenses	74	4
その他未払費用 Other accrued expenses	1,545,904	1,459,901
流動負債合計 Total current liabilities	39,617,123	41,857,962
負債合計 Total liabilities	39,617,123	41,857,962
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	511,608,361	440,320,409
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	104,461	105,858
元本等合計 Total principal and other	2,077,514,761	2,006,226,809
純資産合計 Total net assets	2,077,514,761	2,006,226,809
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,117,131,884	2,048,084,771

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

(単位：円) (Unit: JPY)

	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	第13期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日 13th Fiscal Year From July 16, 2019 to July 15, 2020
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	45,991,391	47,820,831
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△329,313,694	△71,289,349
その他収益 Other revenue	26,765	20,924
営業収益合計 Total operating revenue	△283,295,538	△23,447,594
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	5,484	3,870
受託者報酬 Trustee fee	1,192,620	1,125,177
委託者報酬 Investment trust management fee	10,733,491	10,126,507
その他費用 Other expenses	1,647,409	1,566,644
営業費用合計 Total operating expenses	13,579,004	12,822,198
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△296,874,542	△36,269,792
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△296,874,542	△36,269,792
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△296,874,542	△36,269,792
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 (△)	840,858,183	511,608,361

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	32,375,280	35,018,160
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	511,608,361	440,320,409

(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、2019年7月16日から2020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12期 2019年7月15日現在	第13期 2020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 18,865.9 円 (10口当たり純資産額) (188,659 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 18,218.6 円 (10口当たり純資産額) (182,186 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自2018年7月16日 至2019年7月15日	第13期 自2019年7月16日 至2020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" style="width: 100%;"> <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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">46,012,672 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;">40,589 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;">46,053,261 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">13,573,520 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;">32,479,741 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">32,375,280 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;">104,461 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">110,120 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;">2,940 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	<table border="1" style="width: 100%;"> <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 style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">47,837,885 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;">104,461 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;">47,942,346 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">12,818,328 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;">35,124,018 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">35,018,160 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;">105,858 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">110,120 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;">3,180 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	47,837,885 円	分配準備積立金	B	104,461 円	配当等収益合計額	C=A+B	47,942,346 円	経費	D	12,818,328 円	収益分配可能額	E=C-D	35,124,018 円	収益分配金	F	35,018,160 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	105,858 円	口数	H	110,120 口	10口当たり分配金	I=F/H×10	3,180 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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	47,837,885 円																																																											
分配準備積立金	B	104,461 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	47,942,346 円																																																											
経費	D	12,818,328 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	35,124,018 円																																																											
収益分配金	F	35,018,160 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	105,858 円																																																											
口数	H	110,120 口																																																											
10口当たり分配金	I=F/H×10	3,180 円																																																											
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	2. その他費用 その他費用のうち1,349,518 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 12 期 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 年 7 月 15 日	第 13 期 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 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 12 期 2019 年 7 月 15 日現在	第 13 期 2020 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 12 期 自 2018 年 7 月 16 日 至 2019 年 7 月 15 日	第 13 期 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 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 12 期	第 13 期
--------	--------

自 2018年7月16日 至 2019年7月15日	自 2019年7月16日 至 2020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12期 自 2018年7月16日 至 2019年7月15日	第13期 自 2019年7月16日 至 2020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	△291,982,689	△99,550,508
合計	△291,982,689	△99,550,508

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(2020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	14,200	474.00	6,730,800	
		マルハニチロ	2,000	2,155.00	4,310,000	
		サカタのタネ	1,500	3,135.00	4,702,500	
		石油資源開発	1,700	1,867.00	3,173,900	
		ショーボンドホールディングス	2,000	4,825.00	9,650,000	
		ミライト・ホールディングス	3,800	1,601.00	6,083,800	
		安藤・間	7,000	623.00	4,361,000	
		東急建設	3,600	553.00	1,990,800	
		西松建設	2,600	2,108.00	5,480,800	
		三井住友建設	8,100	466.00	3,774,600	
		前田建設工業	6,600	787.00	5,194,200	
		奥村組	1,600	2,572.00	4,115,200	
		東鉄工業	1,200	2,697.00	3,236,400	
		戸田建設	10,900	722.00	7,869,800	
		熊谷組	1,900	2,619.00	4,976,100	
		N I P P O	2,800	2,750.00	7,700,000	
		前田道路	2,200	2,002.00	4,404,400	
		五洋建設	14,000	593.00	8,302,000	

住友林業	6,300	1,372.00	8,643,600
ライト工業	2,100	1,498.00	3,145,800
中電工	1,300	2,229.00	2,897,700
関電工	4,800	901.00	4,324,800
日本電設工業	1,500	2,356.00	3,534,000
九電工	2,200	3,225.00	7,095,000
高砂熱学工業	2,300	1,544.00	3,551,200
大気社	1,100	3,155.00	3,470,500
日本製粉	2,300	1,692.00	3,891,600
森永製菓	1,800	4,070.00	7,326,000
江崎グリコ	2,200	5,020.00	11,044,000
山崎製パン	5,200	1,853.00	9,635,600
亀田製菓	600	5,420.00	3,252,000
寿スピリッツ	900	4,275.00	3,847,500
森永乳業	1,800	4,885.00	8,793,000
雪印メグミルク	2,000	2,605.00	5,210,000
プリマハム	1,500	2,852.00	4,278,000
伊藤ハム米久ホールディングス	6,400	652.00	4,172,800
サッポロホールディングス	2,900	2,015.00	5,843,500
宝ホールディングス	7,500	977.00	7,327,500
日清オイリオグループ	1,300	3,415.00	4,439,500
不二製油グループ本社	2,500	2,867.00	7,167,500
アリアケジャパン	900	6,850.00	6,165,000
ユーグレナ	3,600	767.00	2,761,200
グンゼ	700	4,205.00	2,943,500
東洋紡	3,900	1,548.00	6,037,200
ワコールホールディングス	2,000	1,955.00	3,910,000
ホギメディカル	1,200	3,130.00	3,756,000
ワールド	1,200	1,493.00	1,791,600
オンワードホールディングス	4,800	315.00	1,512,000
ゴールドウイン	1,200	6,600.00	7,920,000
日本製紙	4,100	1,468.00	6,018,800
北越コーポレーション	5,800	382.00	2,215,600
大王製紙	3,500	1,447.00	5,064,500
レンゴー	8,900	831.00	7,395,900

クレハ	900	4,675.00	4,207,500
日本曹達	1,200	2,864.00	3,436,800
トクヤマ	3,100	2,526.00	7,830,600
セントラル硝子	1,800	2,000.00	3,600,000
東亜合成	5,100	1,096.00	5,589,600
日本パーカライズニング	3,900	1,125.00	4,387,500
日本触媒	1,400	5,600.00	7,840,000
カネカ	2,400	2,694.00	6,465,600
東京応化工業	1,600	5,970.00	9,552,000
KHネオケム	1,700	2,138.00	3,634,600
住友ベークライト	1,700	2,946.00	5,008,200
日本ゼオン	6,200	1,019.00	6,317,800
アイカ工業	2,500	3,615.00	9,037,500
積水樹脂	1,400	2,286.00	3,200,400
日本化薬	7,000	1,096.00	7,672,000
ADEKA	3,600	1,499.00	5,396,400
三洋化成工業	600	4,790.00	2,874,000
太陽ホールディングス	800	5,120.00	4,096,000
東洋インキSCホールディングス	1,700	2,108.00	3,583,600
マンダム	2,000	1,911.00	3,822,000
ミルボン	1,100	4,960.00	5,456,000
ノエビアホールディングス	800	4,565.00	3,652,000
長谷川香料	1,400	2,345.00	3,283,000
タカラバイオ	2,500	3,035.00	7,587,500
アース製薬	700	7,170.00	5,019,000
クミアイ化学工業	3,700	1,018.00	3,766,600
藤森工業	800	3,625.00	2,900,000
エフピコ	1,100	8,780.00	9,658,000
ジーエヌアイグループ	2,200	1,591.00	3,500,200
科研製薬	1,500	5,190.00	7,785,000
持田製薬	1,200	3,970.00	4,764,000
ツムラ	3,200	2,782.00	8,902,400
日医工	2,400	1,257.00	3,016,800
キッセイ薬品工業	1,300	2,402.00	3,122,600
JCRファーマ	800	10,460.00	8,368,000

東和薬品	1,200	2,010.00	2,412,000
アンジェス	5,500	1,667.00	9,168,500
そーせいグループ	3,400	1,562.00	5,310,800
キョーリン製薬ホールディングス	2,100	2,089.00	4,386,900
サンバイオ	1,400	1,555.00	2,177,000
コスモエネルギーホールディングス	2,900	1,610.00	4,669,000
TOYO TIRE	5,600	1,520.00	8,512,000
日東紡績	1,200	5,030.00	6,036,000
日本板硝子	4,600	389.00	1,789,400
日本電気硝子	4,100	1,708.00	7,002,800
住友大阪セメント	1,800	3,825.00	6,885,000
東海カーボン	9,100	984.00	8,954,400
MARUWA	400	8,280.00	3,312,000
ニチアス	2,500	2,380.00	5,950,000
ニチハ	1,200	2,377.00	2,852,400
神戸製鋼所	16,200	386.00	6,253,200
東京製鐵	4,700	638.00	2,998,600
大和工業	1,800	2,201.00	3,961,800
丸一鋼管	2,600	2,754.00	7,160,400
大同特殊鋼	1,300	3,540.00	4,602,000
日本軽金属ホールディングス	28,600	190.00	5,434,000
三井金属鉱業	3,000	2,402.00	7,206,000
DOWAホールディングス	2,500	3,365.00	8,412,500
UACJ	1,500	1,954.00	2,931,000
古河電気工業	3,300	2,628.00	8,672,400
フジクラ	12,400	325.00	4,030,000
アサヒホールディングス	1,700	2,858.00	4,858,600
トーカロ	3,000	1,174.00	3,522,000
東プレ	1,700	1,187.00	2,017,900
パイオラックス	1,500	1,674.00	2,511,000
日本発條	8,500	687.00	5,839,500
日本製鋼所	3,000	1,626.00	4,878,000
タクマ	3,100	1,553.00	4,814,300
オークマ	1,200	4,730.00	5,676,000
FUJI	3,200	1,947.00	6,230,400

牧野フライス製作所	1,200	3,420.00	4,104,000
オーエスジー	4,200	1,726.00	7,249,200
DMG 森精機	5,900	1,314.00	7,752,600
島精機製作所	1,400	1,390.00	1,946,000
オプトラン	1,200	2,608.00	3,129,600
三井海洋開発	1,100	1,607.00	1,767,700
サトーホールディングス	1,300	2,456.00	3,192,800
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1,500	6,070.00	9,105,000
小森コーポレーション	2,300	713.00	1,639,900
椿本チエイン	1,200	2,736.00	3,283,200
タダノ	3,800	919.00	3,492,200
フジテック	3,200	1,971.00	6,307,200
CKD	2,300	2,138.00	4,917,400
平和	2,800	1,829.00	5,121,200
SANKYO	2,400	2,709.00	6,501,600
ユニバーサルエンターテインメント	1,200	2,046.00	2,455,200
竹内製作所	1,700	1,910.00	3,247,000
アマノ	2,800	2,298.00	6,434,400
グローリー	2,500	2,476.00	6,190,000
ツバキ・ナカシマ	2,000	854.00	1,708,000
NTN	19,800	217.00	4,296,600
不二越	600	3,430.00	2,058,000
日立造船	8,400	385.00	3,234,000
スター精密	1,700	1,312.00	2,230,400
日清紡ホールディングス	6,900	781.00	5,388,900
明電舎	1,600	1,694.00	2,710,400
東芝テック	1,300	4,295.00	5,583,500
マブチモーター	2,300	3,400.00	7,820,000
ダイヘン	900	4,155.00	3,739,500
日新電機	2,100	1,057.00	2,219,700
I D E C	1,400	1,681.00	2,353,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,300	1,846.00	6,091,800
沖電気工業	4,300	1,080.00	4,644,000
サンケン電気	1,200	2,140.00	2,568,000

ワコム	7,700	583.00	4,489,100
アルバック	1,900	3,375.00	6,412,500
E I Z O	800	4,205.00	3,364,000
エレコム	900	5,400.00	4,860,000
シャープ	8,700	1,178.00	10,248,600
富士通ゼネラル	2,900	2,481.00	7,194,900
日本航空電子工業	2,400	1,555.00	3,732,000
イリソ電子工業	1,000	3,380.00	3,380,000
ウシオ電機	5,100	1,379.00	7,032,900
日本セラミック	1,000	2,224.00	2,224,000
日本電子	1,900	3,125.00	5,937,500
新光電気工業	3,500	1,691.00	5,918,500
象印マホービン	1,900	1,384.00	2,629,600
トヨタ紡織	2,500	1,464.00	3,660,000
ユニプレス	1,900	950.00	1,805,000
東海理化電機製作所	2,500	1,546.00	3,865,000
三井E&Sホールディングス	3,500	444.00	1,554,000
武蔵精密工業	2,400	897.00	2,152,800
日産車体	3,400	914.00	3,107,600
新明和工業	3,300	1,034.00	3,412,200
日信工業	1,900	2,202.00	4,183,800
NOK	4,200	1,352.00	5,678,400
K Y B	900	2,018.00	1,816,200
太平洋工業	1,900	960.00	1,824,000
ケーヒン	2,200	2,541.00	5,590,200
ショーワ	2,600	2,250.00	5,850,000
豊田合成	3,300	2,207.00	7,283,100
日本精機	2,000	1,305.00	2,610,000
エフ・シー・シー	1,600	1,844.00	2,950,400
テイ・エス テック	2,100	2,995.00	6,289,500
ナカニシ	3,500	1,507.00	5,274,500
東京精密	2,000	3,490.00	6,980,000
マニー	3,000	2,911.00	8,733,000
トプコン	5,200	851.00	4,425,200
シチズン時計	12,500	337.00	4,212,500

CYBERDYNE	5,500	467.00	2,568,500
メニコン	1,200	5,290.00	6,348,000
セイコーホールディングス	1,400	1,658.00	2,321,200
ニプロ	7,000	1,166.00	8,162,000
パラマウントベッドホールディングス	1,000	4,540.00	4,540,000
パイロットコーポレーション	1,400	3,450.00	4,830,000
フジシールインターナショナル	2,100	2,023.00	4,248,300
タカラトミー	4,600	858.00	3,946,800
リンテック	2,300	2,570.00	5,911,000
タカラスタンダード	1,800	1,543.00	2,777,400
コクヨ	3,700	1,275.00	4,717,500
オカムラ	2,900	788.00	2,285,200
北陸電力	8,900	677.00	6,025,300
四国電力	8,400	801.00	6,728,400
北海道電力	9,200	415.00	3,818,000
沖縄電力	2,300	1,764.00	4,057,200
相鉄ホールディングス	3,700	2,797.00	10,348,900
富士急行	1,000	3,255.00	3,255,000
西日本鉄道	3,000	2,818.00	8,454,000
ハマキョウレックス	800	3,295.00	2,636,000
サカイ引越センター	400	5,180.00	2,072,000
センコーグループホールディングス	5,000	822.00	4,110,000
ニッコンホールディングス	2,700	2,130.00	5,751,000
福山通運	1,000	3,840.00	3,840,000
セイノーホールディングス	6,600	1,402.00	9,253,200
日立物流	2,200	2,950.00	6,490,000
川崎汽船	4,300	1,071.00	4,605,300
三菱倉庫	3,000	2,786.00	8,358,000
住友倉庫	2,900	1,277.00	3,703,300
近鉄エクスプレス	1,800	1,903.00	3,425,400
NECネットエスアイ	3,600	2,203.00	7,930,800
システナ	3,500	1,424.00	4,984,000
デジタルアーツ	600	9,020.00	5,412,000
日鉄ソリューションズ	1,700	2,865.00	4,870,500
グリー	6,100	466.00	2,842,600

コーエーテクモホールディングス	2,200	3,510.00	7,722,000
コロプラ	3,400	1,055.00	3,587,000
SHIFT	500	11,390.00	5,695,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,400	2,008.00	4,819,200
インターネットイニシアティブ	1,400	3,715.00	5,201,000
インフォコム	1,200	3,115.00	3,738,000
メルカリ	4,200	4,215.00	17,703,000
ジャストシステム	1,600	7,700.00	12,320,000
オービックビジネスコンサルタント	1,000	5,970.00	5,970,000
デジタルガレージ	1,800	3,710.00	6,678,000
東京放送ホールディングス	4,800	1,667.00	8,001,600
テレビ朝日ホールディングス	2,400	1,540.00	3,696,000
GMOインターネット	3,500	3,045.00	10,657,500
KADOKAWA	2,700	2,348.00	6,339,600
ゼンリン	1,800	1,243.00	2,237,400
松竹	400	13,760.00	5,504,000
東映	300	14,710.00	4,413,000
D T S	2,000	2,293.00	4,586,000
TKC	700	5,980.00	4,186,000
富士ソフト	1,200	4,490.00	5,388,000
NSD	2,700	1,941.00	5,240,700
あらた	700	4,710.00	3,297,000
神戸物産	2,700	6,680.00	18,036,000
あいホールディングス	1,800	1,540.00	2,772,000
ダイワボウホールディングス	900	7,250.00	6,525,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,600	1,608.00	4,180,800
TOKAIホールディングス	4,300	1,006.00	4,325,800
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,615.00	10,153,000
コメダホールディングス	2,400	1,836.00	4,406,400
第一興商	1,900	3,185.00	6,051,500
アズワン	600	11,560.00	6,936,000
日本ライフライン	2,800	1,397.00	3,911,600
長瀬産業	5,100	1,343.00	6,849,300
兼松	4,000	1,300.00	5,200,000

キヤノンマーケティングジャパン	2,400	2,205.00	5,292,000
阪和興業	1,700	2,132.00	3,624,400
岩谷産業	1,800	3,775.00	6,795,000
東邦ホールディングス	2,300	1,947.00	4,478,100
サンゲツ	2,200	1,533.00	3,372,600
サンリオ	2,300	1,646.00	3,785,800
リョーサン	1,000	2,183.00	2,183,000
モスフードサービス	1,100	2,829.00	3,111,900
PAL TAC	1,500	5,140.00	7,710,000
日鉄物産	700	3,495.00	2,446,500
トラスコ中山	1,900	2,684.00	5,099,600
オートバックスセブン	3,200	1,350.00	4,320,000
加藤産業	1,000	3,475.00	3,475,000
因幡電機産業	2,400	2,535.00	6,084,000
サンエー	800	4,105.00	3,284,000
アスクル	1,100	3,540.00	3,894,000
アダストリア	1,400	1,574.00	2,203,600
エディオン	4,100	1,065.00	4,366,500
セリア	2,000	4,265.00	8,530,000
ジーンズホールディングス	600	7,330.00	4,398,000
ビックカメラ	4,700	1,181.00	5,550,700
DCMホールディングス	4,500	1,314.00	5,913,000
ドトール・日レスホールディングス	1,500	1,554.00	2,331,000
ココカラファイン	800	6,240.00	4,992,000
クリエイトSDホールディングス	1,300	3,745.00	4,868,500
コスモス薬品	1,000	18,700.00	18,700,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	4,400	540.00	2,376,000
クスリのアオキホールディングス	800	10,050.00	8,040,000
スシローグローバルホールディングス	4,500	2,469.00	11,110,500
アトム	4,800	795.00	3,816,000
コーナン商事	1,300	3,860.00	5,018,000
ワークマン	700	9,970.00	6,979,000
サイゼリヤ	1,500	1,849.00	2,773,500
ユナイテッドアローズ	1,100	1,645.00	1,809,500

コロワイド	3,000	1,371.00	4,113,000
壱番屋	700	4,960.00	3,472,000
木曽路	1,000	2,350.00	2,350,000
日本瓦斯	1,500	4,750.00	7,125,000
ロイヤルホールディングス	1,300	1,743.00	2,265,900
島忠	2,100	2,950.00	6,195,000
コメリ	1,600	2,880.00	4,608,000
青山商事	2,100	652.00	1,369,200
しまむら	1,100	7,540.00	8,294,000
高島屋	7,700	817.00	6,290,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,500	699.00	3,145,500
アクシアル リテイリング	700	4,650.00	3,255,000
イズミ	1,600	4,055.00	6,488,000
ヤオコー	800	8,430.00	6,744,000
アインホールディングス	1,200	7,160.00	8,592,000
吉野家ホールディングス	2,800	2,061.00	5,770,800
王将フードサービス	600	5,800.00	3,480,000
アークス	1,800	2,649.00	4,768,200
バローホールディングス	1,700	2,262.00	3,845,400
九州フィナンシャルグループ	16,300	444.00	7,237,200
西日本フィナンシャルホールディングス	6,000	724.00	4,344,000
関西みらいフィナンシャルグループ	4,500	416.00	1,872,000
第四北越フィナンシャルグループ	1,800	2,079.00	3,742,200
群馬銀行	17,000	343.00	5,831,000
七十七銀行	2,800	1,560.00	4,368,000
十六銀行	1,400	1,973.00	2,762,200
スルガ銀行	7,900	377.00	2,978,300
八十二銀行	17,900	412.00	7,374,800
大垣共立銀行	1,700	2,234.00	3,797,800
北國銀行	1,000	2,909.00	2,909,000
滋賀銀行	2,100	2,435.00	5,113,500
南都銀行	1,300	2,072.00	2,693,600
百五銀行	10,200	325.00	3,315,000
京都銀行	2,600	3,950.00	10,270,000
紀陽銀行	3,200	1,595.00	5,104,000

ほくほくフィナンシャルグループ	5,900	924.00	5,451,600
広島銀行	12,300	508.00	6,248,400
山陰合同銀行	6,600	530.00	3,498,000
中国銀行	7,200	958.00	6,897,600
伊予銀行	7,400	647.00	4,787,800
阿波銀行	1,700	2,394.00	4,069,800
沖縄銀行	1,000	3,155.00	3,155,000
セブン銀行	29,700	282.00	8,375,400
山口フィナンシャルグループ	9,100	654.00	5,951,400
北洋銀行	13,900	214.00	2,974,600
京葉銀行	5,200	527.00	2,740,400
F P G	3,400	554.00	1,883,600
ジャフコ	1,700	3,820.00	6,494,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,200	245.00	2,499,000
松井証券	5,800	859.00	4,982,200
アニコム ホールディングス	900	4,495.00	4,045,500
全国保証	2,600	3,990.00	10,374,000
アルヒ	1,400	1,654.00	2,315,600
芙蓉総合リース	800	5,930.00	4,744,000
みずほリース	1,200	2,385.00	2,862,000
東京センチュリー	2,000	5,680.00	11,360,000
アイフル	15,600	220.00	3,432,000
イオンフィナンシャルサービス	5,500	898.00	4,939,000
アコム	17,600	385.00	6,776,000
オリエン트コーポレーション	29,000	110.00	3,190,000
日立キャピタル	2,500	2,428.00	6,070,000
いちご	13,100	264.00	3,458,400
プレサンスコーポレーション	1,700	1,287.00	2,187,900
オープンハウス	3,200	3,325.00	10,640,000
平和不動産	1,600	2,970.00	4,752,000
ダイビル	2,400	1,056.00	2,534,400
レオパレス21	12,000	184.00	2,208,000
スターツコーポレーション	1,400	2,270.00	3,178,000
イオンモール	5,000	1,350.00	6,750,000
カチタス	2,700	2,579.00	6,963,300

日本空港ビルデング	1,900	4,355.00	8,274,500
ミクシィ	2,200	2,172.00	4,778,400
UTグループ	1,300	2,653.00	3,448,900
コンダカホールディングス	2,200	420.00	924,000
エス・エム・エス	3,500	2,396.00	8,386,000
ディップ	1,600	2,233.00	3,572,800
ベネフィット・ワン	3,000	2,159.00	6,477,000
アウトソーシング	5,700	640.00	3,648,000
インフォマート	9,400	728.00	6,843,200
プレステージ・インターナショナル	4,900	886.00	4,341,400
ケネディクス	10,100	487.00	4,918,700
H. U. グループホールディングス	2,700	2,515.00	6,790,500
ダスキン	2,200	2,746.00	6,041,200
ラウンドワン	3,400	749.00	2,546,600
リゾートトラスト	4,000	1,348.00	5,392,000
ビー・エム・エル	1,000	2,753.00	2,753,000
エン・ジャパン	1,500	2,661.00	3,991,500
ジャパンマテリアル	3,000	1,713.00	5,139,000
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,656.00	2,980,800
ソラスト	2,700	1,065.00	2,875,500
ベイクレント・コンサルティング	700	9,480.00	6,636,000
カーブスホールディングス	2,300	560.00	1,288,000
エイチ・アイ・エス	1,600	1,640.00	2,624,000
共立メンテナンス	1,500	3,625.00	5,437,500
カナモト	1,600	2,383.00	3,812,800
東京ドーム	4,000	731.00	2,924,000
西尾レントオール	1,000	2,293.00	2,293,000
トランス・コスモス	1,200	2,615.00	3,138,000
乃村工藝社	3,600	853.00	3,070,800
メイテック	1,300	5,270.00	6,851,000
船井総研ホールディングス	1,700	2,344.00	3,984,800
イオンディライト	1,100	3,290.00	3,619,000
ニチイ学館	1,700	1,567.00	2,663,900
ダイセキ	1,800	2,555.00	4,599,000
小計 銘柄数：399			2,001,787,200

	組入時価比率：99.8%			100.0%
合計				2,001,787,200

(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(2020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。