



2021年7月期 (2020年7月16日～2021年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2021 (July 16, 2020 – July 15, 2021)

2021年8月25日
 August 25, 2021

		上場取引所	東証
		Listed Exchange	TSE
ファンド名	NEXT FUNDS ラッセル野村小型コア・インデックス連動型上場投信		
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	小池 広靖	
問合せ先責任者	サポートダイヤル	山中 淳	TEL 0120-753104

Fund name:	NEXT FUNDS Russell/Nomura Small Cap Core Index 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:	Hiroyasu Koike, 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 2021年9月29日
 分配金支払開始日 2021年8月23日
 Scheduled date of submission of securities report: September 29, 2021
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2021

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2021年7月期の運用状況 (2020年7月16日～2021年7月15日)

Management Status for Year ended July 2021 (from July 16, 2020 to July 15, 2021)

(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.	% %
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,393	(99.9)	1	(0.1)	2,395	(100.0)
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,001	(99.8)	4	(0.2)	2,006	(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
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	110	0	0	110
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	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
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,434	38	2,395	217,528
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	2,048	41	2,006	182,186

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,770
2020年7月期 FY ended Jul. 2020	3,180

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 13 期 (2020 年 7 月 15 日現在) 13th Fiscal Year As of July 15, 2020	第 14 期 (2021 年 7 月 15 日現在) 14th Fiscal Year As of July 15, 2021
	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	8,331,221	16,410,340
株式 Stocks	2,001,787,200	2,393,653,500
未収入金 Accounts receivable - other	35,430,600	21,367,181
未収配当金 Accrued dividends receivable	2,535,750	2,653,134
流動資産合計 Total current assets	2,048,084,771	2,434,084,155
資産合計 Total assets	2,048,084,771	2,434,084,155
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	35,018,160	30,503,240
未払受託者報酬 Trustee fees payable	537,996	653,724
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	4,841,901	5,883,463
未払利息 Accrued interest expenses	4	15
その他未払費用 Other accrued expenses	1,459,901	1,620,576
流動負債合計 Total current liabilities	41,857,962	38,661,018
負債合計 Total liabilities	41,857,962	38,661,018
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	440,320,409	829,516,737
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	105,858	30,558
元本等合計 Total principal and other	2,006,226,809	2,395,423,137
純資産合計 Total net assets	2,006,226,809	2,395,423,137
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,048,084,771	2,434,084,155

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	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	第 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日 14th Fiscal Year From July 16, 2020 to July 15, 2021
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	47,820,831	44,560,070
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	△71,289,349	389,271,628
その他収益 Other revenue	20,924	19,887
営業収益合計 Total operating revenue	△23,447,594	433,851,585
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	3,870	2,308
受託者報酬 Trustee fees	1,125,177	1,240,826
委託者報酬 Investment trust management fees	10,126,507	11,167,362
その他費用 Other expenses	1,566,644	1,741,521
営業費用合計 Total operating expenses	12,822,198	14,152,017
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	△36,269,792	419,699,568
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	△36,269,792	419,699,568
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	△36,269,792	419,699,568
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 (△)	511,608,361	440,320,409

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	35,018,160	30,503,240
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	440,320,409	829,516,737

(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、2020年7月16日から2021年7月15日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第13期 2020年7月15日現在	第14期 2021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 18,218.6 円 (10口当たり純資産額) (182,186 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 21,752.8 円 (10口当たり純資産額) (217,528 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年7月16日 至 2020年7月15日	第14期 自 2020年7月16日 至 2021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;">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> </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	<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;">44,577,649 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;">105,858 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;">44,683,507 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">14,149,709 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;">30,533,798 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">30,503,240 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;">30,558 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> </tbody> </table>			項目			当期配当等収益額	A	44,577,649 円	分配準備積立金	B	105,858 円	配当等収益合計額	C=A+B	44,683,507 円	経費	D	14,149,709 円	収益分配可能額	E=C-D	30,533,798 円	収益分配金	F	30,503,240 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,558 円	口数	H	110,120 口
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																																																							
項目																																																									
当期配当等収益額	A	44,577,649 円																																																							
分配準備積立金	B	105,858 円																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	44,683,507 円																																																							
経費	D	14,149,709 円																																																							
収益分配可能額	E=C-D	30,533,798 円																																																							
収益分配金	F	30,503,240 円																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,558 円																																																							
口数	H	110,120 口																																																							

10口当たり分配金	I=F/H×10	3,180円	10口当たり分配金	I=F/H×10	2,770円
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。			2. その他費用 その他費用のうち1,488,811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13期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	第14期 自 2020年 7月 16日 至 2021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13期 2020年 7月 15日現在	第14期 2021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13期 自 2019年 7月 16日 至 2020年 7月 15日	第14期 自 2020年 7月 16日 至 2021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 13 期 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 年 7 月 15 日	第 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日
期首元本額	1,565,906,400 円	1,565,906,400 円
期中追加設定元本額	0 円	0 円
期中一部交換元本額	0 円	0 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 13 期 自 2019 年 7 月 16 日 至 2020 年 7 月 15 日	第 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 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	△99,550,508	335,620,784
合計	△99,550,508	335,620,784

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(2021 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	14,600	549.00	8,015,400	
		マルハニチロ	2,000	2,407.00	4,814,000	
		サカタのタネ	1,500	3,830.00	5,745,000	
		石油資源開発	1,800	1,926.00	3,466,800	
		ミライト・ホールディングス	4,300	2,082.00	8,952,600	
		安藤・間	7,300	865.00	6,314,500	
		東建コーポレーション	400	10,160.00	4,064,000	
		西松建設	2,600	3,535.00	9,191,000	
		三井住友建設	8,100	502.00	4,066,200	
		前田建設工業	6,500	964.00	6,266,000	
		奥村組	1,500	2,985.00	4,477,500	
		東鉄工業	1,200	2,391.00	2,869,200	
		戸田建設	11,500	778.00	8,947,000	
		熊谷組	1,900	2,914.00	5,536,600	
		NIPPPO	2,800	3,120.00	8,736,000	
		前田道路	1,700	2,183.00	3,711,100	

五洋建設	14,100	763.00	10,758,300
ライト工業	2,200	1,944.00	4,276,800
中電工	1,300	2,326.00	3,023,800
関電工	4,900	918.00	4,498,200
日本電設工業	1,500	1,974.00	2,961,000
九電工	2,200	3,730.00	8,206,000
高砂熱学工業	2,200	1,941.00	4,270,200
大気社	1,200	3,455.00	4,146,000
ニッポン	2,200	1,600.00	3,520,000
森永製菓	1,900	3,645.00	6,925,500
山崎製パン	5,200	1,566.00	8,143,200
亀田製菓	600	4,645.00	2,787,000
寿スピリッツ	900	7,470.00	6,723,000
森永乳業	1,800	6,100.00	10,980,000
雪印メグミルク	2,000	2,127.00	4,254,000
プリマハム	1,500	3,045.00	4,567,500
S F o o d s	900	3,420.00	3,078,000
伊藤ハム米久ホールディングス	6,500	729.00	4,738,500
サッポロホールディングス	2,900	2,334.00	6,768,600
宝ホールディングス	7,700	1,351.00	10,402,700
日清オイリオグループ	1,300	3,120.00	4,056,000
不二製油グループ本社	2,600	2,567.00	6,674,200
アリアケジャパン	900	7,060.00	6,354,000
ユーグレナ	4,400	1,032.00	4,540,800
グンゼ	700	4,675.00	3,272,500
東洋紡	4,100	1,340.00	5,494,000
セーレン	2,100	2,186.00	4,590,600
ワコールホールディングス	2,000	2,523.00	5,046,000
ホギメディカル	1,200	3,535.00	4,242,000
日本製紙	4,100	1,268.00	5,198,800
大王製紙	3,700	1,790.00	6,623,000
レンゴー	9,000	936.00	8,424,000
クレハ	900	6,640.00	5,976,000
日本曹達	1,200	3,260.00	3,912,000
トクヤマ	3,300	2,271.00	7,494,300

セントラル硝子	1,700	2,163.00	3,677,100
東亜合成	5,200	1,147.00	5,964,400
日本パーカライジング	4,100	1,138.00	4,665,800
日本触媒	1,400	5,300.00	7,420,000
カネカ	2,400	4,425.00	10,620,000
KHネオケム	1,700	2,613.00	4,442,100
住友ベークライト	1,700	4,660.00	7,922,000
日本ゼオン	6,200	1,442.00	8,940,400
アイカ工業	2,500	3,930.00	9,825,000
宇部興産	5,100	2,209.00	11,265,900
日本化薬	7,300	1,088.00	7,942,400
扶桑化学工業	900	3,960.00	3,564,000
トリケミカル研究所	1,400	3,025.00	4,235,000
ADEKA	3,600	2,187.00	7,873,200
三洋化成工業	600	5,670.00	3,402,000
太陽ホールディングス	800	5,090.00	4,072,000
D I C	3,600	2,826.00	10,173,600
東洋インキSCホールディングス	1,700	2,038.00	3,464,600
マンダム	2,000	1,927.00	3,854,000
ミルボン	1,100	6,220.00	6,842,000
ポーラ・オルビスホールディングス	4,600	2,918.00	13,422,800
ノエビアホールディングス	900	5,500.00	4,950,000
長谷川香料	1,700	2,513.00	4,272,100
タカラバイオ	2,600	2,847.00	7,402,200
JCU	900	3,675.00	3,307,500
デクセリアルズ	2,900	2,375.00	6,887,500
アース製薬	700	6,680.00	4,676,000
クミアイ化学工業	3,800	861.00	3,271,800
藤森工業	800	4,215.00	3,372,000
エフピコ	2,200	4,130.00	9,086,000
ジーエヌアイグループ	2,100	1,980.00	4,158,000
大日本住友製薬	7,200	2,255.00	16,236,000
科研製薬	1,600	4,860.00	7,776,000
持田製薬	1,200	3,680.00	4,416,000
日医工	2,600	861.00	2,238,600

キッセイ薬品工業	1,300	2,264.00	2,943,200
栄研化学	1,600	2,125.00	3,400,000
JCRファーマ	3,300	3,310.00	10,923,000
アンジェス	6,400	777.00	4,972,800
そーせいグループ	3,600	1,731.00	6,231,600
キョーリン製薬ホールディングス	2,000	1,813.00	3,626,000
大幸薬品	1,800	984.00	1,771,200
コスモエネルギーホールディングス	2,900	2,597.00	7,531,300
横浜ゴム	5,200	2,163.00	11,247,600
TOYO TIRE	5,300	2,103.00	11,145,900
住友ゴム工業	8,300	1,442.00	11,968,600
日東紡績	1,300	3,375.00	4,387,500
日本電気硝子	4,100	2,496.00	10,233,600
住友大阪セメント	1,800	3,060.00	5,508,000
三谷セキサン	500	4,390.00	2,195,000
MARUWA	400	11,010.00	4,404,000
フジミインコーポレーテッド	800	4,870.00	3,896,000
ニチアス	2,600	2,841.00	7,386,600
ニチハ	1,200	2,932.00	3,518,400
神戸製鋼所	16,800	710.00	11,928,000
東京製鐵	4,400	1,042.00	4,584,800
大和工業	1,900	3,540.00	6,726,000
丸一鋼管	2,600	2,677.00	6,960,200
大同特殊鋼	1,300	5,250.00	6,825,000
日本軽金属ホールディングス	2,900	1,883.00	5,460,700
三井金属鉱業	3,000	3,065.00	9,195,000
DOWAホールディングス	2,600	4,265.00	11,089,000
古河電気工業	3,300	2,788.00	9,200,400
フジクラ	12,500	554.00	6,925,000
アサヒホールディングス	3,600	2,278.00	8,200,800
トーカロ	3,000	1,394.00	4,182,000
東洋製罐グループホールディングス	6,900	1,412.00	9,742,800
横河ブリッジホールディングス	1,500	2,081.00	3,121,500
日本発條	8,400	852.00	7,156,800
日本製鋼所	3,000	2,798.00	8,394,000

タクマ	3,000	1,718.00	5,154,000
ツガミ	2,100	1,749.00	3,672,900
オークマ	1,200	5,480.00	6,576,000
F U J I	3,300	2,567.00	8,471,100
牧野フライス製作所	1,200	4,280.00	5,136,000
オーエスジー	4,200	2,082.00	8,744,400
DMG 森精機	6,100	1,814.00	11,065,400
オプトラン	1,300	2,457.00	3,194,100
サトーホールディングス	1,300	2,718.00	3,533,400
技研製作所	700	4,565.00	3,195,500
椿本チエイン	1,200	3,335.00	4,002,000
タダノ	4,000	1,109.00	4,436,000
フジテック	3,200	2,425.00	7,760,000
CKD	2,300	2,222.00	5,110,600
平和	2,800	2,008.00	5,622,400
SANKYO	2,200	2,857.00	6,285,400
竹内製作所	1,700	2,839.00	4,826,300
アマノ	2,800	2,871.00	8,038,800
グローリー	2,500	2,411.00	6,027,500
NTN	20,300	291.00	5,907,300
ジェイテクト	9,900	1,137.00	11,256,300
日立造船	8,600	828.00	7,120,800
I H I	6,900	2,533.00	17,477,700
日清紡ホールディングス	7,000	948.00	6,636,000
コニカミノルタ	22,600	602.00	13,605,200
東芝テック	1,300	4,620.00	6,006,000
マブチモーター	2,300	4,230.00	9,729,000
ダイヘン	900	4,920.00	4,428,000
MC J	3,400	1,355.00	4,607,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,400	2,865.00	9,741,000
沖電気工業	4,400	1,025.00	4,510,000
サンケン電気	1,200	5,220.00	6,264,000
ワコム	8,000	688.00	5,504,000
アルバック	1,900	5,580.00	10,602,000
E I Z O	800	4,865.00	3,892,000

エレコム	2,000	2,052.00	4,104,000
富士通ゼネラル	2,900	2,931.00	8,499,900
日本航空電子工業	2,500	1,836.00	4,590,000
堀場製作所	1,700	7,150.00	12,155,000
イリソ電子工業	1,000	5,230.00	5,230,000
ウシオ電機	5,100	2,000.00	10,200,000
日本電子	1,900	6,920.00	13,148,000
新光電気工業	3,600	3,820.00	13,752,000
象印マホービン	1,900	1,591.00	3,022,900
トヨタ紡織	2,500	2,262.00	5,655,000
モリタホールディングス	1,500	1,619.00	2,428,500
東海理化電機製作所	2,600	1,752.00	4,555,200
川崎重工業	7,300	2,261.00	16,505,300
三菱自動車工業	35,700	295.00	10,531,500
日産車体	3,400	728.00	2,475,200
NOK	4,200	1,418.00	5,955,600
豊田合成	3,300	2,648.00	8,738,400
エフ・シー・シー	1,600	1,568.00	2,508,800
テイ・エス テック	4,300	1,678.00	7,215,400
ナカニシ	3,500	2,385.00	8,347,500
東京精密	2,000	4,690.00	9,380,000
マニー	3,200	2,476.00	7,923,200
トプコン	5,200	1,584.00	8,236,800
シチズン時計	12,900	415.00	5,353,500
CYBERDYNE	5,600	471.00	2,637,600
ニプロ	7,100	1,374.00	9,755,400
パラマウントベッドホールディングス	2,000	2,018.00	4,036,000
SHOEI	1,100	4,265.00	4,691,500
パイロットコーポレーション	1,400	3,810.00	5,334,000
フジシールインターナショナル	2,100	2,246.00	4,716,600
タカラトミー	4,700	977.00	4,591,900
リンテック	2,300	2,407.00	5,536,100
コクヨ	3,800	1,794.00	6,817,200
北陸電力	9,000	612.00	5,508,000
四国電力	8,500	768.00	6,528,000

北海道電力	9,300	526.00	4,891,800
沖縄電力	2,300	1,435.00	3,300,500
メタウォーター	1,400	2,039.00	2,854,600
富士急行	1,000	5,110.00	5,110,000
西日本鉄道	3,000	2,677.00	8,031,000
センコーグループホールディングス	4,900	1,076.00	5,272,400
ニッコンホールディングス	2,700	2,438.00	6,582,600
福山通運	1,000	4,185.00	4,185,000
セイノーホールディングス	6,600	1,416.00	9,345,600
日立物流	2,200	4,370.00	9,614,000
丸和運輸機関	1,600	1,524.00	2,438,400
川崎汽船	4,400	3,460.00	15,224,000
三菱倉庫	3,000	3,295.00	9,885,000
住友倉庫	2,800	1,592.00	4,457,600
上組	5,200	2,331.00	12,121,200
近鉄エクスプレス	1,800	2,601.00	4,681,800
NEC ネットエスアイ	3,700	1,812.00	6,704,400
システナ	3,600	2,181.00	7,851,600
デジタルアーツ	600	8,110.00	4,866,000
日鉄ソリューションズ	1,700	3,540.00	6,018,000
出前館	1,900	1,413.00	2,684,700
グリー	6,000	608.00	3,648,000
コロプラ	3,500	832.00	2,912,000
メディアドゥ	400	4,410.00	1,764,000
SHIFT	600	19,840.00	11,904,000
テクマトリックス	2,000	1,855.00	3,710,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,500	2,093.00	5,232,500
インターネットイニシアティブ	2,600	3,565.00	9,269,000
GMO グローバルサイン・ホールディングス	200	4,615.00	923,000
コムチュア	1,200	2,350.00	2,820,000
メディカル・データ・ビジョン	1,200	2,032.00	2,438,400
ラクス	2,900	3,055.00	8,859,500
ユーザベース	1,000	2,467.00	2,467,000
マネーフォワード	1,600	6,900.00	11,040,000

インフォコム	1,200	2,890.00	3,468,000
ラクスル	1,000	5,490.00	5,490,000
S a n s a n	400	8,220.00	3,288,000
マクアケ	300	6,360.00	1,908,000
メドレー	1,200	4,410.00	5,292,000
J M D C	700	5,680.00	3,976,000
J T O W E R	400	6,330.00	2,532,000
A I i n s i d e	100	11,800.00	1,180,000
フジ・メディア・ホールディングス	8,800	1,240.00	10,912,000
オービックビジネスコンサルタント	1,000	6,590.00	6,590,000
サイボウズ	1,200	2,422.00	2,906,400
電通国際情報サービス	1,300	4,600.00	5,980,000
デジタルガレージ	1,800	4,815.00	8,667,000
T B S ホールディングス	4,900	1,733.00	8,491,700
日本テレビホールディングス	8,100	1,274.00	10,319,400
テレビ朝日ホールディングス	2,400	1,736.00	4,166,400
スカパー J S A T ホールディングス	6,300	413.00	2,601,900
K A D O K A W A	2,700	4,230.00	11,421,000
松竹	400	11,970.00	4,788,000
東映	300	20,130.00	6,039,000
D T S	2,100	2,746.00	5,766,600
T K C	1,400	3,240.00	4,536,000
富士ソフト	1,200	5,590.00	6,708,000
N S D	2,800	1,850.00	5,180,000
あらた	700	4,155.00	2,908,500
あい ホールディングス	1,900	2,165.00	4,113,500
ダイワボウホールディングス	4,300	2,167.00	9,318,100
マクニカ・富士エレホールディングス	2,600	2,664.00	6,926,400
T O K A I ホールディングス	4,400	899.00	3,955,600
コメダホールディングス	2,400	2,121.00	5,090,400
ナガイレーベン	1,100	2,562.00	2,818,200
第一興商	1,900	4,230.00	8,037,000
日本ライフライン	3,000	1,368.00	4,104,000
長瀬産業	5,100	1,687.00	8,603,700
兼松	4,100	1,498.00	6,141,800

山善	2,600	1,035.00	2,691,000
キヤノンマーケティングジャパン	2,400	2,592.00	6,220,800
三谷商事	500	7,500.00	3,750,000
阪和興業	1,800	3,150.00	5,670,000
岩谷産業	2,100	6,390.00	13,419,000
東邦ホールディングス	2,400	1,918.00	4,603,200
サンゲツ	2,300	1,614.00	3,712,200
サンリオ	2,300	1,944.00	4,471,200
モスフードサービス	1,200	3,130.00	3,756,000
PALTAC	1,500	5,110.00	7,665,000
トラスコ中山	2,000	2,950.00	5,900,000
オートバックスセブン	3,200	1,561.00	4,995,200
加藤産業	1,000	3,355.00	3,355,000
イエローハット	1,700	2,051.00	3,486,700
因幡電機産業	2,400	2,674.00	6,417,600
サンエー	800	4,185.00	3,348,000
エービーシー・マート	1,600	6,290.00	10,064,000
アスクル	2,200	1,693.00	3,724,600
くら寿司	1,000	4,105.00	4,105,000
エディオン	4,000	1,104.00	4,416,000
セリア	2,000	3,985.00	7,970,000
ジンズホールディングス	600	7,550.00	4,530,000
ビックカメラ	4,800	1,125.00	5,400,000
DCMホールディングス	5,500	1,094.00	6,017,000
物語コーポレーション	500	7,380.00	3,690,000
ココカラファイン	900	8,460.00	7,614,000
三越伊勢丹ホールディングス	17,800	791.00	14,079,800
クリエイトSDホールディングス	1,300	3,485.00	4,530,500
オイシックス・ラ・大地	1,200	4,055.00	4,866,000
ネクステージ	2,000	2,215.00	4,430,000
ジョイフル本田	1,900	1,383.00	2,627,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	2,500	1,026.00	2,565,000
トリドールホールディングス	2,900	1,910.00	5,539,000
クスリのアオキホールディングス	900	7,350.00	6,615,000
アトム	4,900	775.00	3,797,500

ノジマ	1,400	2,784.00	3,897,600
コーナン商事	1,400	4,215.00	5,901,000
ワークマン	700	7,160.00	5,012,000
サイゼリヤ	1,500	2,795.00	4,192,500
コロワイド	3,200	1,993.00	6,377,600
壱番屋	700	4,900.00	3,430,000
日本瓦斯	5,500	1,877.00	10,323,500
コメリ	1,600	2,665.00	4,264,000
高島屋	7,600	1,205.00	9,158,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,600	903.00	4,153,800
アクシアル リテイリング	700	3,830.00	2,681,000
イズミ	1,600	3,985.00	6,376,000
平和堂	1,300	2,086.00	2,711,800
ヤオコー	900	6,410.00	5,769,000
アインホールディングス	1,200	6,570.00	7,884,000
アークランドサカモト	1,500	1,502.00	2,253,000
吉野家ホールディングス	2,800	2,083.00	5,832,400
王将フードサービス	600	5,760.00	3,456,000
アークス	2,100	2,219.00	4,659,900
バローホールディングス	1,700	2,277.00	3,870,900
ベルク	500	5,090.00	2,545,000
めぶきフィナンシャルグループ	44,500	237.00	10,546,500
九州フィナンシャルグループ	16,700	391.00	6,529,700
西日本フィナンシャルホールディングス	6,000	629.00	3,774,000
第四北越フィナンシャルグループ	1,900	2,466.00	4,685,400
ひろぎんホールディングス	12,800	585.00	7,488,000
群馬銀行	17,600	348.00	6,124,800
七十七銀行	2,900	1,170.00	3,393,000
十六銀行	1,500	1,954.00	2,931,000
スルガ銀行	8,200	329.00	2,697,800
八十二銀行	18,100	358.00	6,479,800
大垣共立銀行	1,700	1,889.00	3,211,300
北國銀行	1,000	2,123.00	2,123,000
滋賀銀行	2,000	1,969.00	3,938,000
百五銀行	10,200	306.00	3,121,200

紀陽銀行	3,200	1,517.00	4,854,400
ほくほくフィナンシャルグループ	6,100	813.00	4,959,300
山陰合同銀行	6,700	555.00	3,718,500
中国銀行	7,400	857.00	6,341,800
伊予銀行	7,500	542.00	4,065,000
阿波銀行	1,700	2,036.00	3,461,200
沖縄銀行	1,000	2,520.00	2,520,000
セブン銀行	30,600	241.00	7,374,600
山口フィナンシャルグループ	9,800	614.00	6,017,200
北洋銀行	14,000	242.00	3,388,000
ジャフコ グループ	1,600	6,350.00	10,160,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,200	388.00	3,957,600
松井証券	5,800	812.00	4,709,600
ライフネット生命保険	1,700	1,142.00	1,941,400
アニコム ホールディングス	3,700	857.00	3,170,900
アルヒ	1,900	1,444.00	2,743,600
クレディセゾン	7,900	1,346.00	10,633,400
芙蓉総合リース	800	7,190.00	5,752,000
みずほリース	1,100	3,650.00	4,015,000
アイフル	15,800	362.00	5,719,600
イオンフィナンシャルサービス	5,500	1,377.00	7,573,500
アコム	18,000	471.00	8,478,000
オリエントコーポレーション	30,200	145.00	4,379,000
三菱HCキャピタル	33,400	607.00	20,273,800
イー・ギャランティ	1,500	2,336.00	3,504,000
いちご	13,500	350.00	4,725,000
プレサンスコーポレーション	1,300	1,548.00	2,012,400
パーク24	5,800	2,079.00	12,058,200
平和不動産	1,700	3,870.00	6,579,000
ダイビル	2,400	1,400.00	3,360,000
スターツコーポレーション	1,500	2,826.00	4,239,000
イオンモール	5,000	1,732.00	8,660,000
カチタス	2,700	3,225.00	8,707,500
日本空港ビルデング	2,300	4,985.00	11,465,500
ミクシィ	2,200	2,732.00	6,010,400

UTグループ	1,500	3,365.00	5,047,500	
ディップ	1,600	3,345.00	5,352,000	
ベネフィット・ワン	3,500	3,490.00	12,215,000	
アウトソーシング	6,100	2,145.00	13,084,500	
ディー・エヌ・エー	5,000	2,189.00	10,945,000	
バリューコマース	900	3,315.00	2,983,500	
インフォマート	9,600	928.00	8,908,800	
プレステージ・インターナショナル	5,000	705.00	3,525,000	
H. U. グループホールディングス	2,800	2,828.00	7,918,400	
ダスキン	2,200	2,574.00	5,662,800	
ラウンドワン	3,500	1,223.00	4,280,500	
リゾートトラスト	4,100	1,838.00	7,535,800	
ビー・エム・エル	1,100	3,945.00	4,339,500	
エン・ジャパン	1,700	3,885.00	6,604,500	
弁護士ドットコム	400	8,750.00	3,500,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	500	13,940.00	6,970,000	
ジャパンマテリアル	3,100	1,369.00	4,243,900	
M&Aキャピタルパートナーズ	800	5,660.00	4,528,000	
メドピア	500	4,410.00	2,205,000	
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,765.00	3,177,000	
ソラスト	2,700	1,367.00	3,690,900	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	2,600	2,444.00	6,354,400	
エイチ・アイ・エス	1,800	2,435.00	4,383,000	
共立メンテナンス	1,500	3,630.00	5,445,000	
東京都競馬	700	4,560.00	3,192,000	
カナモト	1,600	2,585.00	4,136,000	
トランス・コスモス	1,200	3,100.00	3,720,000	
メイテック	1,300	6,190.00	8,047,000	
船井総研ホールディングス	1,700	2,451.00	4,166,700	
ベネッセホールディングス	3,800	2,713.00	10,309,400	
イオンディライト	1,100	3,695.00	4,064,500	
ダイセキ	1,800	4,945.00	8,901,000	
小計	銘柄数：397		2,393,653,500	
	組入時価比率：99.9%		100.0%	

合計			2,393,653,500	
----	--	--	---------------	--

(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 (2021 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。