



2022年7月期 (2021年7月16日～2022年7月15日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2022 (July 16, 2021 - July 15, 2022)

2022年8月24日
 August 24, 2022

		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	長坂 智	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:	Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team		

有価証券報告書提出予定日 2022年9月28日
 分配金支払開始日 2022年8月23日
 Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2022
 Date of commencing dividend payment: August 23, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年7月期の運用状況 (2021年7月16日～2022年7月15日)

Management Status for Year ended July 2022 (from July 16, 2021 to July 15, 2022)

(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.	% %
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	997	(98.9)	10	(1.1)	1,008	(100.0)
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,393	(99.9)	1	(0.1)	2,395	(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
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	110	0	59	50
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	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
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	1,057	49	1,008	200,467
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,434	38	2,395	217,528

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	8,240
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	2,770

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14期 (2021年7月15日現在) 14th Fiscal Year As of July 15, 2021	第15期 (2022年7月15日現在) 15th Fiscal Year As of July 15, 2022
	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	16,410,340	11,110,691
株式 Stocks	2,393,653,500	997,178,400
未収入金 Accounts receivable - other	21,367,181	45,459,600
未収配当金 Accrued dividends receivable	2,653,134	3,323,088
流動資産合計 Total current assets	2,434,084,155	1,057,071,779
資産合計 Total assets	2,434,084,155	1,057,071,779
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
未払収益分配金 Unpaid dividends	30,503,240	41,434,016
未払受託者報酬 Trustee fees payable	653,724	596,711
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	5,883,463	5,370,333
未払利息 Accrued interest expenses	15	3
その他未払費用 Other accrued expenses	1,620,576	1,640,835
流動負債合計 Total current liabilities	38,661,018	49,041,898
負債合計 Total liabilities	38,661,018	49,041,898
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	1,565,906,400	715,038,480
剰余金 Surplus		

期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	829,516,737	292,991,401
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	30,558	36,459
元本等合計 Total principal and other	2,395,423,137	1,008,029,881
純資産合計 Total net assets	2,395,423,137	1,008,029,881
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	2,434,084,155	1,057,071,779

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

(単位：円) (Unit：JPY)

	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	第15期 自 2021年7月16日 至 2022年7月15日 15th Fiscal Year From July 16, 2021 to July 15, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	44,560,070	55,833,524
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	389,271,628	△155,641,457
その他収益 Other revenue	19,887	23,892
営業収益合計 Total operating revenue	433,851,585	△99,784,041
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	2,308	1,677
受託者報酬 Trustee fees	1,240,826	1,266,484
委託者報酬 Investment trust management fees	11,167,362	11,398,227
その他費用 Other expenses	1,741,521	1,751,111
営業費用合計 Total operating expenses	14,152,017	14,417,499
営業利益又は営業損失 (△) Operating profit (loss)	419,699,568	△114,201,540
経常利益又は経常損失 (△) Ordinary profit (loss)	419,699,568	△114,201,540
当期純利益又は当期純損失 (△) Profit (loss)	419,699,568	△114,201,540
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 (△)	440,320,409	829,516,737

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		380,889,780
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange		380,889,780
分配金 Dividends	30,503,240	41,434,016
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	829,516,737	292,991,401

(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、2021年7月16日から2022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 14 期 2021 年 7 月 15 日現在	第 15 期 2022 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 50,284 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 21,752.8 円 (10 口当たり純資産額) (217,528 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 20,046.7 円 (10 口当たり純資産額) (200,467 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日			第 15 期 自 2021 年 7 月 16 日 至 2022 年 7 月 15 日	
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程	
	項目		項目	
	当期配当等収益額	44,577,649 円	当期配当等収益額	55,855,739 円
	分配準備積立金	105,858 円	分配準備積立金	30,558 円
	配当等収益合計額	44,683,507 円	配当等収益合計額	55,886,297 円
	経費	14,149,709 円	経費	14,415,822 円
	収益分配可能額	30,533,798 円	収益分配可能額	41,470,475 円
	収益分配金	30,503,240 円	収益分配金	41,434,016 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	2,770 円

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。

次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	36,459 円
口数	H	50,284 口
10口当たり分配金	I=F/H×10	8,240 円

2. その他費用

その他費用のうち 1,520,364 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 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日	第 15 期 自 2021 年 7 月 16 日 至 2022 年 7 月 15 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>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。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 14 期 2021 年 7 月 15 日現在	第 15 期 2022 年 7 月 15 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>株式</p> <p>(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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 14 期 自 2020 年 7 月 16 日 至 2021 年 7 月 15 日	第 15 期 自 2021 年 7 月 16 日 至 2022 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14期 自 2020年7月16日 至 2021年7月15日		第15期 自 2021年7月16日 至 2022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	850,867,920円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第14期 自 2020年7月16日 至 2021年7月15日	第15期 自 2021年7月16日 至 2022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	335,620,784	△68,299,716
合計	335,620,784	△68,299,716

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(2022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	5,400	577.00	3,115,800	
		マルハニチロ	800	2,478.00	1,982,400	
		サカタのタネ	600	5,000.00	3,000,000	
		石油資源開発	700	3,115.00	2,180,500	
		ウエストホールディングス	400	4,185.00	1,674,000	
		ショーボンドホールディングス	700	5,670.00	3,969,000	
		ミライト・ワン	1,700	1,634.00	2,777,800	
		安藤・間	2,600	846.00	2,199,600	
		西松建設	800	3,940.00	3,152,000	
		三井住友建設	2,900	448.00	1,299,200	
		奥村組	600	2,913.00	1,747,800	
		戸田建設	4,100	697.00	2,857,700	
		熊谷組	700	2,714.00	1,899,800	
		五洋建設	5,200	689.00	3,582,800	

ライト工業	800	1,857.00	1,485,600
関電工	1,900	845.00	1,605,500
きんでん	2,500	1,580.00	3,950,000
エクシオグループ	1,800	2,111.00	3,799,800
九電工	800	2,663.00	2,130,400
日揮ホールディングス	4,400	1,610.00	7,084,000
高砂熱学工業	800	1,664.00	1,331,200
大気社	400	3,095.00	1,238,000
インフロニア・ホールディングス	3,500	922.00	3,227,000
ニッポン	800	1,646.00	1,316,800
森永製菓	700	4,360.00	3,052,000
江崎グリコ	800	4,020.00	3,216,000
山崎製パン	1,900	1,687.00	3,205,300
寿スピリッツ	400	5,900.00	2,360,000
カルビー	1,700	2,865.00	4,870,500
森永乳業	700	5,080.00	3,556,000
雪印メグミルク	800	1,873.00	1,498,400
プリマハム	500	2,276.00	1,138,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,500	682.00	1,705,000
サッポロホールディングス	1,100	2,885.00	3,173,500
宝ホールディングス	2,900	1,023.00	2,966,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	2,500	1,492.00	3,730,000
日清オイリオグループ	500	3,175.00	1,587,500
不二製油グループ本社	900	2,234.00	2,010,600
キューピー	1,900	2,264.00	4,301,600
ハウス食品グループ本社	1,100	2,922.00	3,214,200
カゴメ	1,500	3,370.00	5,055,000
アリアケジャパン	400	5,180.00	2,072,000
ニチレイ	1,900	2,341.00	4,447,900
ユーグレナ	1,800	898.00	1,616,400
東洋紡	1,500	996.00	1,494,000
帝人	3,500	1,402.00	4,907,000
セーレン	700	2,026.00	1,418,200
ワコールホールディングス	800	2,090.00	1,672,000
ホギメディカル	400	3,515.00	1,406,000

ゴールドウイン	500	7,930.00	3,965,000
デサント	600	2,891.00	1,734,600
日本製紙	1,600	968.00	1,548,800
北越コーポレーション	2,500	704.00	1,760,000
大王製紙	1,500	1,437.00	2,155,500
レンゴー	3,400	752.00	2,556,800
クレハ	300	9,980.00	2,994,000
日本曹達	400	4,210.00	1,684,000
トクヤマ	1,200	1,723.00	2,067,600
東亜合成	1,900	1,023.00	1,943,700
エア・ウォーター	3,000	1,713.00	5,139,000
日本パーカライジング	1,500	941.00	1,411,500
日本触媒	500	5,290.00	2,645,000
カネカ	900	3,420.00	3,078,000
東京応化工業	600	6,610.00	3,966,000
KHネオケム	600	2,401.00	1,440,600
ダイセル	4,800	813.00	3,902,400
住友ベークライト	600	4,130.00	2,478,000
日本ゼオン	2,300	1,337.00	3,075,100
アイカ工業	900	2,966.00	2,669,400
UBE	1,900	2,008.00	3,815,200
日本化薬	2,700	1,099.00	2,967,300
扶桑化学工業	300	3,340.00	1,002,000
トリケミカル研究所	500	2,042.00	1,021,000
ADEKA	1,300	2,284.00	2,969,200
太陽ホールディングス	600	2,750.00	1,650,000
DIC	1,400	2,353.00	3,294,200
ミルボン	400	5,120.00	2,048,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,700	1,627.00	2,765,900
ノエビアホールディングス	300	5,930.00	1,779,000
長谷川香料	600	2,917.00	1,750,200
タカラバイオ	1,000	2,065.00	2,065,000
JCU	300	3,385.00	1,015,500
デクセリアルズ	1,100	3,570.00	3,927,000
アース製薬	300	5,500.00	1,650,000

藤森工業	300	3,465.00	1,039,500
エフピコ	800	3,045.00	2,436,000
ジーエヌアイグループ	800	1,416.00	1,132,800
住友ファーマ	2,700	1,069.00	2,886,300
科研製薬	600	3,945.00	2,367,000
久光製薬	1,000	3,435.00	3,435,000
持田製薬	400	3,305.00	1,322,000
ツムラ	1,200	3,200.00	3,840,000
JCRファーマ	1,200	2,699.00	3,238,800
東和薬品	500	2,555.00	1,277,500
アンジェス	3,000	373.00	1,119,000
そーせいグループ	1,400	1,244.00	1,741,600
キョーリン製薬ホールディングス	700	1,851.00	1,295,700
大正製薬ホールディングス	600	5,550.00	3,330,000
ペプチドリーム	1,900	1,529.00	2,905,100
サワイグループホールディングス	800	4,315.00	3,452,000
コスモエネルギーホールディングス	1,100	3,365.00	3,701,500
横浜ゴム	2,000	1,923.00	3,846,000
TOYO TIRE	2,000	1,780.00	3,560,000
住友ゴム工業	3,100	1,223.00	3,791,300
日東紡績	500	2,232.00	1,116,000
日本電気硝子	1,600	2,582.00	4,131,200
住友大阪セメント	700	3,470.00	2,429,000
太平洋セメント	2,300	1,986.00	4,567,800
三谷セキサン	200	4,090.00	818,000
東海カーボン	3,400	1,003.00	3,410,200
日本特殊陶業	2,800	2,519.00	7,053,200
MARUWA	200	14,950.00	2,990,000
フジミインコーポレーテッド	300	5,380.00	1,614,000
ニチアス	900	2,294.00	2,064,600
ニチハ	400	2,620.00	1,048,000
神戸製鋼所	6,400	615.00	3,936,000
東京製鐵	1,400	1,460.00	2,044,000
大和工業	700	4,290.00	3,003,000
丸一鋼管	1,000	2,850.00	2,850,000

大同特殊鋼	500	3,620.00	1,810,000
日本軽金属ホールディングス	1,100	1,515.00	1,666,500
三井金属鉱業	1,100	3,015.00	3,316,500
三菱マテリアル	2,300	1,907.00	4,386,100
DOWAホールディングス	1,000	4,545.00	4,545,000
UACJ	600	2,096.00	1,257,600
古河電気工業	1,300	2,224.00	2,891,200
フジクラ	4,600	769.00	3,537,400
アサヒホールディングス	1,400	2,017.00	2,823,800
トーカロ	1,100	1,222.00	1,344,200
東洋製罐グループホールディングス	2,500	1,461.00	3,652,500
横河ブリッジホールディングス	600	1,929.00	1,157,400
三和ホールディングス	3,600	1,296.00	4,665,600
日本発條	3,000	886.00	2,658,000
日本製鋼所	1,100	3,030.00	3,333,000
タクマ	1,100	1,315.00	1,446,500
オークマ	400	4,970.00	1,988,000
FUJII	1,300	1,928.00	2,506,400
牧野フライス製作所	400	4,340.00	1,736,000
オーエスジー	1,600	1,612.00	2,579,200
DMG森精機	2,300	1,600.00	3,680,000
ローツェ	200	7,770.00	1,554,000
ハーモニック・ドライブ・システムズ	700	4,635.00	3,244,500
椿本チエイン	500	3,020.00	1,510,000
タダノ	1,500	930.00	1,395,000
フジテック	1,200	2,986.00	3,583,200
CKD	900	1,696.00	1,526,400
平和	1,000	2,054.00	2,054,000
SANKYO	900	4,135.00	3,721,500
竹内製作所	700	2,407.00	1,684,900
アマノ	1,000	2,448.00	2,448,000
グローリー	1,000	2,117.00	2,117,000
NTN	7,500	244.00	1,830,000
ジェイテクト	3,700	1,003.00	3,711,100
日立造船	3,200	814.00	2,604,800

日清紡ホールディングス	2,700	1,030.00	2,781,000
コニカミノルタ	8,500	447.00	3,799,500
明電舎	600	2,105.00	1,263,000
東芝テック	500	4,225.00	2,112,500
マブチモーター	800	3,750.00	3,000,000
ダイヘン	300	3,940.00	1,182,000
MC J	1,300	916.00	1,190,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,200	2,215.00	2,658,000
沖電気工業	1,600	735.00	1,176,000
サンケン電気	400	4,685.00	1,874,000
ワコム	3,000	848.00	2,544,000
アルバック	800	4,640.00	3,712,000
エレコム	800	1,660.00	1,328,000
アンリツ	2,700	1,504.00	4,060,800
富士通ゼネラル	1,100	2,759.00	3,034,900
アルプスアルパイン	4,000	1,288.00	5,152,000
日本航空電子工業	900	2,138.00	1,924,200
日本光電工業	1,400	3,005.00	4,207,000
堀場製作所	600	6,100.00	3,660,000
日置電機	100	6,410.00	641,000
フェローテックホールディングス	800	2,387.00	1,909,600
イリソ電子工業	400	3,020.00	1,208,000
ウシオ電機	1,900	1,724.00	3,275,600
三井ハイテック	300	8,240.00	2,472,000
新光電気工業	1,300	3,370.00	4,381,000
トヨタ紡織	1,000	1,984.00	1,984,000
東海理化電機製作所	900	1,481.00	1,332,900
三菱自動車工業	13,200	437.00	5,768,400
武蔵精密工業	900	1,418.00	1,276,200
NOK	1,500	1,186.00	1,779,000
豊田合成	1,200	2,140.00	2,568,000
テイ・エス テック	1,600	1,460.00	2,336,000
ナカニシ	1,300	2,442.00	3,174,600
東京精密	800	4,405.00	3,524,000
マニー	1,200	1,551.00	1,861,200

トプコン	1,900	1,754.00	3,332,600
シチズン時計	4,800	538.00	2,582,400
メニコン	1,200	3,230.00	3,876,000
ニプロ	2,700	1,133.00	3,059,100
スノーピーク	600	2,504.00	1,502,400
パラマウントベッドホールディングス	700	2,369.00	1,658,300
SHOEI	400	5,430.00	2,172,000
パイロットコーポレーション	500	4,855.00	2,427,500
フジシールインターナショナル	800	1,479.00	1,183,200
タカラトミー	1,700	1,446.00	2,458,200
ローランド	300	3,915.00	1,174,500
リンテック	800	2,284.00	1,827,200
コクヨ	1,400	1,756.00	2,458,400
グローブライド	300	2,126.00	637,800
オカムラ	1,100	1,265.00	1,391,500
北陸電力	3,300	562.00	1,854,600
四国電力	3,200	826.00	2,643,200
北海道電力	3,500	525.00	1,837,500
電源開発	2,700	2,295.00	6,196,500
レノバ	600	2,588.00	1,552,800
東邦瓦斯	1,400	2,924.00	4,093,600
SBSホールディングス	400	2,678.00	1,071,200
相鉄ホールディングス	1,400	2,298.00	3,217,200
京浜急行電鉄	3,900	1,425.00	5,557,500
富士急行	400	3,875.00	1,550,000
西武ホールディングス	3,800	1,253.00	4,761,400
西日本鉄道	1,100	2,832.00	3,115,200
南海電気鉄道	2,000	2,554.00	5,108,000
京阪ホールディングス	1,800	3,225.00	5,805,000
山九	900	4,010.00	3,609,000
センコーグループホールディングス	1,800	899.00	1,618,200
ニッコンホールディングス	1,000	2,255.00	2,255,000
福山通運	400	3,150.00	1,260,000
セイノーホールディングス	2,200	1,100.00	2,420,000
日立物流	700	8,540.00	5,978,000

三菱倉庫	1,100	3,325.00	3,657,500
住友倉庫	1,000	2,006.00	2,006,000
上組	1,900	2,680.00	5,092,000
近鉄エクスプレス	100	4,170.00	417,000
NEC ネットエスアイ	1,400	1,904.00	2,665,600
システナ	5,400	442.00	2,386,800
デジタルアーツ	200	5,880.00	1,176,000
日鉄ソリューションズ	600	3,710.00	2,226,000
出前館	1,200	434.00	520,800
グリー	2,000	808.00	1,616,000
コーエーテクモホールディングス	1,100	4,755.00	5,230,500
テクマトリックス	800	1,756.00	1,404,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,000	2,475.00	2,475,000
インターネットイニシアティブ	1,000	5,020.00	5,020,000
コムチュア	400	2,782.00	1,112,800
ラクス	1,200	1,814.00	2,176,800
チェンジ	900	2,024.00	1,821,600
ラクスル	400	1,849.00	739,600
S a n s a n	1,300	1,210.00	1,573,000
B A S E	1,600	341.00	545,600
メドレー	400	2,747.00	1,098,800
J M D C	400	6,120.00	2,448,000
J T O W E R	200	6,490.00	1,298,000
フジ・メディア・ホールディングス	3,200	1,151.00	3,683,200
ジャストシステム	600	3,965.00	2,379,000
オービックビジネスコンサルタント	300	4,660.00	1,398,000
電通国際情報サービス	500	4,275.00	2,137,500
東映アニメーション	100	11,350.00	1,135,000
デジタルガレージ	700	3,795.00	2,656,500
B I P R O G Y	1,400	2,736.00	3,830,400
T B S ホールディングス	1,800	1,697.00	3,054,600
日本テレビホールディングス	3,100	1,251.00	3,878,100
テレビ朝日ホールディングス	900	1,522.00	1,369,800
GMOインターネット	1,300	2,500.00	3,250,000
松竹	200	12,140.00	2,428,000

東映	100	19,170.00	1,917,000
D T S	800	3,250.00	2,600,000
T K C	500	3,395.00	1,697,500
富士ソフト	400	7,980.00	3,192,000
N S D	1,000	2,497.00	2,497,000
あい ホールディングス	700	1,598.00	1,118,600
ダイワボウホールディングス	1,600	1,820.00	2,912,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	2,632.00	2,632,000
T O K A I ホールディングス	1,600	885.00	1,416,000
シップヘルスケアホールディングス	1,500	2,543.00	3,814,500
コメダホールディングス	900	2,285.00	2,056,500
第一興商	700	3,675.00	2,572,500
アズワン	600	6,310.00	3,786,000
日本ライフライン	1,100	949.00	1,043,900
長瀬産業	1,900	1,913.00	3,634,700
兼松	1,500	1,353.00	2,029,500
キヤノンマーケティングジャパン	900	2,792.00	2,512,800
阪和興業	700	2,789.00	1,952,300
岩谷産業	800	5,390.00	4,312,000
東邦ホールディングス	900	2,129.00	1,916,100
サンリオ	900	2,910.00	2,619,000
モスフードサービス	400	3,340.00	1,336,000
P A L T A C	600	4,365.00	2,619,000
日鉄物産	300	4,955.00	1,486,500
トラスコ中山	800	1,889.00	1,511,200
オートバックスセブン	1,200	1,407.00	1,688,400
因幡電機産業	900	2,719.00	2,447,100
スズケン	1,300	3,825.00	4,972,500
ローソン	900	4,705.00	4,234,500
エービーシー・マート	600	5,730.00	3,438,000
くら寿司	400	3,260.00	1,304,000
エディオン	1,400	1,285.00	1,799,000
セリア	800	2,598.00	2,078,400
ジーンズホールディングス	200	3,580.00	716,000
ビックカメラ	1,800	1,174.00	2,113,200

DCMホールディングス	2,100	1,027.00	2,156,700
J. フロント リテイリング	4,600	1,027.00	4,724,200
物語コーポレーション	200	5,440.00	1,088,000
三越伊勢丹ホールディングス	6,500	1,014.00	6,591,000
クリエイトSDホールディングス	500	3,070.00	1,535,000
オイシックス・ラ・大地	500	1,783.00	891,500
ネクステージ	800	2,575.00	2,060,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,900	959.00	1,822,100
トリドールホールディングス	1,000	2,552.00	2,552,000
クスリのアオキホールディングス	300	5,480.00	1,644,000
アトム	2,100	800.00	1,680,000
ノジマ	500	2,937.00	1,468,500
コーナン商事	500	3,855.00	1,927,500
ゼンショーホールディングス	1,800	3,500.00	6,300,000
ワークマン	300	6,020.00	1,806,000
サイゼリヤ	500	2,729.00	1,364,500
コロワイド	1,400	1,906.00	2,668,400
日本瓦斯	2,000	1,941.00	3,882,000
コメリ	600	2,650.00	1,590,000
しまむら	500	12,660.00	6,330,000
高島屋	2,700	1,360.00	3,672,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,700	976.00	1,659,200
イズミ	600	3,235.00	1,941,000
ヤオコー	400	6,470.00	2,588,000
ケーズホールディングス	3,200	1,418.00	4,537,600
アインホールディングス	500	7,450.00	3,725,000
吉野家ホールディングス	1,000	2,586.00	2,586,000
玉将フードサービス	200	6,930.00	1,386,000
アークス	800	2,104.00	1,683,200
バローホールディングス	700	1,902.00	1,331,400
サンドラッグ	1,400	3,040.00	4,256,000
めぶきフィナンシャルグループ	16,600	257.00	4,266,200
九州フィナンシャルグループ	6,100	378.00	2,305,800
西日本フィナンシャルホールディングス	2,200	722.00	1,588,400

第四北越フィナンシャルグループ	700	2,469.00	1,728,300
ひろぎんホールディングス	4,700	602.00	2,829,400
群馬銀行	6,700	363.00	2,432,100
七十七銀行	1,100	1,688.00	1,856,800
八十二銀行	6,700	483.00	3,236,100
滋賀銀行	700	2,547.00	1,782,900
京都銀行	1,000	5,430.00	5,430,000
紀陽銀行	1,200	1,367.00	1,640,400
ほくほくフィナンシャルグループ	2,300	815.00	1,874,500
山陰合同銀行	2,500	636.00	1,590,000
中国銀行	2,800	938.00	2,626,400
伊予銀行	2,800	613.00	1,716,400
阿波銀行	600	1,996.00	1,197,600
セブン銀行	11,200	256.00	2,867,200
山口フィナンシャルグループ	3,700	720.00	2,664,000
ウェルスナビ	600	1,919.00	1,151,400
ジャフコ グループ	1,500	1,759.00	2,638,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,600	372.00	1,339,200
松井証券	2,200	798.00	1,755,600
マネックスグループ	3,000	423.00	1,269,000
全国保証	900	4,335.00	3,901,500
クレディセゾン	2,800	1,571.00	4,398,800
芙蓉総合リース	300	7,890.00	2,367,000
みずほリース	400	3,170.00	1,268,000
東京センチュリー	700	4,440.00	3,108,000
アイフル	5,800	363.00	2,105,400
イオンフィナンシャルサービス	2,000	1,310.00	2,620,000
アコム	7,200	319.00	2,296,800
オリエン트コーポレーション	11,400	127.00	1,447,800
イー・ギャランティ	600	2,269.00	1,361,400
いちご	4,900	296.00	1,450,400
パーク24	2,400	1,737.00	4,168,800
平和不動産	600	3,910.00	2,346,000
スターツコーポレーション	500	2,744.00	1,372,000
イオンモール	1,800	1,637.00	2,946,600

カチタス	1,000	3,085.00	3,085,000
日本空港ビルディング	1,000	5,020.00	5,020,000
ミクシィ	800	2,184.00	1,747,200
UTグループ	500	2,472.00	1,236,000
夢真ビーネックスグループ	1,000	1,559.00	1,559,000
パソナグループ	400	1,955.00	782,000
ディップ	600	3,480.00	2,088,000
アウトソーシング	2,300	1,086.00	2,497,800
ディー・エヌ・エー	1,800	1,863.00	3,353,400
エスプール	1,200	1,013.00	1,215,600
バリューコマース	300	2,997.00	899,100
インフォマート	3,600	367.00	1,321,200
プレステージ・インターナショナル	1,800	657.00	1,182,600
H. U. グループホールディングス	1,000	3,120.00	3,120,000
ダスキン	800	2,964.00	2,371,200
ラウンドワン	1,200	1,306.00	1,567,200
リゾートトラスト	1,500	2,023.00	3,034,500
ビー・エム・エル	400	3,745.00	1,498,000
エン・ジャパン	600	1,908.00	1,144,800
アイ・アールジャパンホールディングス	200	2,107.00	421,400
ジャパンマテリアル	1,200	1,733.00	2,079,600
M&Aキャピタルパートナーズ	300	3,350.00	1,005,000
ソラスト	1,000	765.00	765,000
ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,100	1,560.00	1,716,000
リログループ	2,300	1,982.00	4,558,600
エイチ・アイ・エス	800	1,916.00	1,532,800
共立メンテナンス	600	4,760.00	2,856,000
ナガワ	100	8,230.00	823,000
カナモト	600	1,974.00	1,184,400
トランス・コスモス	500	3,545.00	1,772,500
乃村工藝社	1,400	872.00	1,220,800
メイテック	1,400	2,328.00	3,259,200
船井総研ホールディングス	600	2,281.00	1,368,600
ベネッセホールディングス	1,400	2,272.00	3,180,800

	イオンデイト	400	2,830.00	1,132,000	
	ダイセキ	800	3,670.00	2,936,000	
	小計 銘柄数：399			997,178,400	
	組入時価比率：98.9%			100.0%	
	合計			997,178,400	

(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(2022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。