

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）
信託期間	原則として無期限です。
運用方針	①主としてわが国を含む世界各国の環境テクノロジー関連株式への投資を通じて、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 ②運用にあたっては、原則として委託会社が選定した複数の運用会社に運用指図にかかる権限を委託し、各運用会社の組み合わせにより、投資成果の向上を図ります。なお、委託会社の判断により、適宜、運用指図にかかる権限を委託する運用会社の追加、削除または入替え、ならびに各運用会社への委託割合の変更を行うことがあります。
主要運用対象	わが国を含む世界各国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式の投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の投資割合には制限を設けません。
分配方針	決算時（毎年3月10日および9月10日。休業日の場合は翌営業日。）に繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。

ラッセル世界環境 テクノロジー・ファンド

追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）

運用報告書

第2期

（決算日 2009年3月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、ご購入いただいております「ラッセル世界環境テクノロジー・ファンド」は去る2009年3月10日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

ラッセル・インベストメント株式会社
〒107-0052東京都港区赤坂7-3-37 プラース・カナダ
ホームページ <http://www.russell.com/jpin/>

〈運用報告書に関するお問い合わせ先〉
投信企画部 〈電話番号〉 03-5411-1515
受付時間は営業日の午前9時～午後5時
（半日営業日は午前9時～午前11時）

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額	税込 分配 金	期 騰 落 率	参 考 指 数	期 騰 落 率	株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	純資 産 額
				(MSCIワールド・ インデックス (円換算))				
(設定日) 2008年5月1日	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	百万円 38,513
1期(2008年9月10日)	8,535	0	△14.7	8,746	△12.5	91.7	8.1	37,888
2期(2009年3月10日)	4,464	0	△47.7	4,464	△49.0	88.7	9.4	18,135

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注3) 参考指数のMSCIワールド・インデックス(円換算)は、MSCIワールド・インデックス(米ドルベース、配当込み)の基準日前営業日の指数を基準日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値によりラッセル・インベストメント株式会社が円換算したうえで、設定時(2008年5月1日)を10,000として指数化したものです。

(注4) MSCIワールド・インデックスに関する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他、あらゆる形態を用い、インデックスの全部または一部を複製、配付、使用することは禁じられています。またこれらの情報は信頼のおける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCI Inc. は何ら保証するものではありません。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	(MSCIワールド・ インデックス (円換算))	騰 落 率			
(期 首) 2008年9月10日	円 8,535	% —	8,746	% —	% 91.7	% 8.1
9月末	7,570	△11.3	7,791	△10.9	94.5	5.1
10月末	5,493	△35.6	6,065	△30.7	93.1	5.7
11月末	5,136	△39.8	5,490	△37.2	93.0	6.0
12月末	5,117	△40.0	5,338	△39.0	92.6	6.9
2009年1月末	4,854	△43.1	5,006	△42.8	92.8	6.5
2月末	4,844	△43.2	4,884	△44.2	92.9	5.4
(期 末) 2009年3月10日	4,464	△47.7	4,464	△49.0	88.7	9.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

◎運用経過

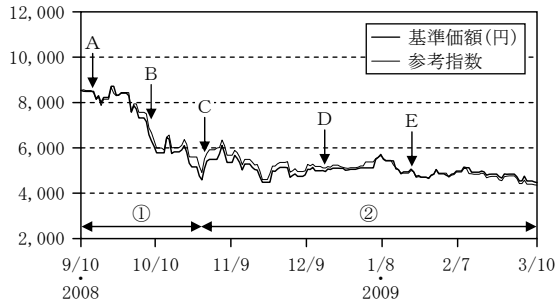
1. 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末の8,535円から47.7%下落して4,464円となりました。

<投資環境>

- ① 米大手投資銀行リーマン・ブラザーズの破綻を契機とした金融システム不安等を受けて急落
- ② 欧米の大手金融機関の追加損失懸念、金融危機の深刻化および実体経済への波及、更には世界経済の後退懸念等を受けて上昇のきっかけがないままほぼ横ばいで推移

基準価額の推移



(注) 参考指数は期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

<主な出来事>

- A : 米大手投資銀行の破綻、救済合併等
- B : 欧米主要各国の中央銀行が協調利下げ
- C : F R B (米連邦準備制度理事会) が政策金利である F F (フェデラル・ファンド) 金利の誘導目標を年1.0%に引き下げ
- D : F R B が F F 金利の誘導目標を年0.0~0.25%に引き下げ
- E : 米オバマ新大統領就任

<基準価額の主な変動要因>

●国別要因

韓国や台湾等が良好なパフォーマンスをあげましたが、メキシコや香港等がマイナス要因となりました。

●テーマ別要因

「クリーンエネルギー&エネルギー効率」、「水関連技術&環境汚染処理」、「廃棄物処理&環境マネジメント」の3つのテーマともにマイナス要因となりましたが、水質浄化への需要増期待を背景に、「水関連技術&環境汚染処理」の下落幅が比較的小さくなりました。「クリーンエネルギー&エネルギー効率」および「廃棄物処理&環境マネジメント」は景気後退観測を背景とした設備投資の後退懸念等を背景に、ほぼ同程度の下落幅となりました。

●銘柄別要因

米国の廃棄物処理会社、日本の発電機器メーカー等がプラスに寄与しました。一方、米国の再生紙メーカー、米国の代替エネルギー開発会社等がマイナス要因となりました。

2. 外部委託先運用会社構成

当期、外部委託先運用会社の変更はございませんでした。当期末における外部委託先運用会社構成は下表の通りです。

外部委託先運用会社	運用スタイル	目標配分割合
ジェネレーション・インベストメント・マネジメント・エル・エル・ピー	グローバル株式を対象としたサステイナブル運用	20%
インボックス・アセット・マネジメント・リミテッド	グローバル株式を対象とした環境関連銘柄中心の運用	30%
アローストリート・キャピタル・リミテッド・パートナーシップ	ラッセル・グローバル環境テクノロジー基準に沿った株式を対象としたクオンツ型運用	25%
グローバル・カレンツ・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー	ラッセル・グローバル環境テクノロジー基準に沿った株式を対象としたバリュー型運用	25%

(注) 当ファンド全体の運用効率を高めるためのキャッシュ・エクイタイゼーションや、外部委託先運用会社の変更時における資産の移転管理および一時的な運用を行うこと等を目的として、上記の外部委託先運用会社の他に、委託会社の関連会社である「フランク・ラッセル・カンパニー」に対して運用の指図に係る権限を委託しています。

◎収益分配金および留保金の運用

基準価額の水準、分配金の原資の状況等に鑑み、当期は収益金の分配を行わないことといたしました。なお、収益分配金に充てなかった利益につきましては、信託財産内に留保し、その全額を当ファンドの運用方針に基づき引き続き運用させていただきます。

◎ファンドの性格および運用方針

当ファンドは世界経済の持続可能な成長に欠かせない環境テクノロジーに注目し、今後成長が見込まれる環境関連企業等に投資します。投資にあたっては、弊社が決定する投資アプローチ毎に複数の運用会社を選定、各運用会社には投資アプローチに沿うように運用の権限を再委託するとともに、弊社がファンド全体の取りまとめを行います。

具体的には、当期末現在、環境株式の専門家としてジェネレーション・インベストメント・マネジメント・エル・エル・ピーとインボックス・アセット・マネジメント・リミテッドの2社、グローバル株式の専門家としてアローストリート・キャピタル・リミテッド・パートナーシップとグローバル・カレンツ・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シーの2社の計4社が運用を行っています。

弊社は投資環境や各外部委託先運用会社の状況を継続的にモニタリングし、必要に応じて外部委託先運用会社の変更や追加等を行うことで、長期的により安定した運用成果を目指してまいります。引き続き宜しく願い申し上げます。

◆1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	54円 (29) (23) (2)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ ブ シ ョ ン)	6 (6) (0) (0)
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	1 (1)
(d) 保 管 費 用 等	4
(e) そ の 他 の 諸 費 用	0
合 計	65

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率

(b) 売買委託手数料、(c) 有価証券取引税、(d) 保管費用等、(e) その他の諸費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) (e) その他の諸費用には、投資信託財産に関する租税および信託事務の処理に要する諸費用等を含みます。また、①投資信託振替制度に係る手数料および費用、②目論見書の作成、印刷および交付に係る費用、③運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用、④ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用等が含まれます。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◆期中の売買状況(自 2008年9月11日 至 2009年3月10日)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 1,740	千円 1,687,673	千株 2,756	千円 2,326,598
	ア メ リ カ	百株 28,687 (△ 493)	千米ドル 45,979 (-)	百株 31,491 (-)	千米ドル 58,239 (0.00002)
外	カ ナ ダ	701	千カナダドル 368	2,218	千カナダドル 1,347
	メ キ シ コ	-	千メキシコペソ -	638	千メキシコペソ 1,726
	ブ ラ ジ ル	875	千ブラジルリアル 1,014	2,907	千ブラジルリアル 5,950
	ユ	ド イ ツ	960	千ユーロ 3,512	2,661
国 外	イ タ リ ア	5,353	1,563	5,460	2,058
	フ ラ ン ス	3,561 (359)	5,480 (500)	1,964 (758)	4,438 (306)
	オ ラ ン ダ	952	731	1,179	1,493
	ス ペ イ ン	4,795	2,576	6,034	2,939
	ベ ル ギ ー	409	936	134	450
	オ ー ス ト リ ア	1,351	1,778	407	1,445
	フ ィ ン ラ ン ド	483	902	1,652	1,360
	ア イ ル ラ ン ド	2,351	801	276	182
ギ リ シ ャ	277	109	-	-	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	イ ギ リ ス	百株 12,690 (326)	千ポンド 2,933 (132)	百株 13,606	千ポンド 3,660
	ス イ ス	84	千スイスフラン 1,162	957	千スイスフラン 6,279
	ス ウ ェ ー デ ン	662	千スウェーデンクローネ 3,651	4,086	千スウェーデンクローネ 21,742
	ノ ル ウ ェ ー	3,669	千ノルウェークローネ 12,950	4,374	千ノルウェークローネ 16,525
	デ ン マ ー ク	121	千デンマーククローネ 4,044	169	千デンマーククローネ 5,408
	オ ー ス ト ラ リ ア	13,429 (57)	千オーストラリアドル 2,828 (31)	1,536	千オーストラリアドル 1,082
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,128	千ニューージーランドドル 989	—	千ニューージーランドドル —
	香 港	21,422	千ホンコンドル 9,586	18,374	千ホンコンドル 27,947
	シ ン ガ ポ ー ル	69,172	千シンガポールドル 3,336	26,939	千シンガポールドル 1,289
	フ ィ リ ピ ン	36,397	千フィリピンペソ 43,871	—	千フィリピンペソ —
	韓 国	29	千韓国ウォン 295,755	195	千韓国ウォン 487,521
	台 湾	5,810	千新台湾ドル 31,744	—	千新台湾ドル —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) —印は取引なし。

(2) 公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 3,499	千米ドル 3,497 (3,500)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 外国投資証券

		買 付		売 付	
		単位数又は口数	金 額	単位数又は口数	金 額
外国	ア メ リ カ	口 14,800	千米ドル 436	口 -	千米ドル -

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) -印は取引なし。

(4) 先物取引等の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 746	百万円 751	百万円 -	百万円 -
外国	株 式 先 物 取 引	7,642	7,659	-	-

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) -印は取引なし。

◆株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合（自 2008年9月11日 至 2009年3月10日）

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	22,804,875千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	21,415,740千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.06

(注1) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

◆主要な売買銘柄（自 2008年9月11日 至 2009年3月10日）
株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株数	金 額	平均単価	銘 柄	株数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC(アメリカ)	64	227,594	3,526	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC(アメリカ)	71	236,333	3,297
関西電力	90	212,567	2,354	EMERSON ELECTRIC CO(アメリカ)	58	198,796	3,426
SIEMENS AG-REG(ユーロ・ドイツ)	21	175,634	8,291	WATTS WATER TECHNOLOGIES-A(アメリカ)	90	177,726	1,970
3M COMPANY(アメリカ)	33	170,960	5,133	HEADWATERS INC(アメリカ)	203	160,118	785
栗田工業	69	143,713	2,061	INTESA SANPAOLO(ユーロ・イタリア)	451	159,269	352
OWENS CORNING INC(アメリカ)	96	142,744	1,478	京セラ	23	151,790	6,599
デンソー	72	140,314	1,946	WATERS CORP(アメリカ)	37	150,372	4,028
LINDE AG(ユーロ・ドイツ)	20	137,700	6,684	関西電力	65	148,312	2,257
UNITED TECHNOLOGIES CORP(アメリカ)	28	136,486	4,828	ダイキン工業	44	147,897	3,331
AIR LIQUIDE(ユーロ・フランス)	18	136,192	7,353	LINDE AG(ユーロ・ドイツ)	17	147,376	8,277

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

◆利害関係人との取引状況等（自 2008年9月11日 至 2009年3月10日）

(1) 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	百万円 10,098	百万円 —	—	百万円 12,706	百万円 —	—
公 社 債	362	—	—	344	—	—
投 資 証 券	42	—	—	—	—	—
株 式 先 物 取 引	8,396	—	—	8,421	—	—
為 替	43,771	—	—	45,725	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) —印は取引なし。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	24,166千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	—千円
(B) / (A)	—%

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) —印は取引なし。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、「ラッセル・インプリメンテーション・サービシーズ・インク」を利害関係人に準ずるものとみなして開示します。

◆第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況（自 2008年9月11日 至 2009年3月10日）
期中における該当事項はありません。

◆自社による当ファンドの設定・解約状況（自 2008年9月11日 至 2009年3月10日）
期中における該当事項はありません。

◆組入有価証券明細表（2009年3月10日現在）

(1) 国内株式（上場株式）

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
建設業（4.0%）			
三機工業	—	10	4,900
日揮	104	63	72,261
中外炉工業	—	34	7,412
高砂熱学工業	—	17	8,636
繊維製品（2.4%）			
東レ	240	160	57,760
化学（5.8%）			
旭化成	171	93	29,016
日産化学工業	—	20	14,040
トクヤマ	11	51	27,081
積水化学工業	125	70	28,840
日東電工	—	21.3	37,530
医薬品（1.6%）			
中外製薬	60	23.9	37,092
ガラス・土石製品（5.4%）			
日本碍子	82	55	72,655
ニチアス	447	284	54,244
非鉄金属（3.9%）			
DOWAホールディングス	221	61	19,581
住友電気工業	133.6	—	—
アサヒブリテック	58.1	58	71,804
金属製品（—%）			
SUMCO	100.5	—	—
機械（20.0%）			
三浦工業	47.8	31.9	64,757
月島機械	19	—	—
荏原製作所	—	146	25,842
西島製作所	3.2	—	—
ダイキン工業	36.6	—	—
オルガノ	174	116	61,828
栗田工業	44.1	78.3	133,658
ダイフク	60.5	8	3,552
日本精工	244	291	103,014
前澤給装工業	—	21.3	30,033
日立造船	941.5	628	48,356
電気機器（33.2%）			
日本電産	1.4	—	—
ダイヘン	—	120	26,160
シャープ	181	136	94,384

銘柄	期首	当期	期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
TDK	—	1.7	5,321	
三洋電機	97	—	—	
横河電機	—	39.5	12,482	
山武	35	84.8	131,524	
堀場製作所	158.3	126.1	202,390	
スタンレー電気	110.3	119.8	111,773	
ファナック	19	12.7	70,866	
ローム	15.6	11	45,980	
京セラ	26.7	14.3	79,794	
村田製作所	29.6	—	—	
パナソニック電工	14	—	—	
輸送用機器（12.3%）				
デンソー	65.3	88.1	154,967	
アイシン精機	25.2	18.2	25,935	
豊田合成	17.3	31.9	40,066	
シマノ	32.5	21.7	68,355	
精密機器（8.3%）				
島津製作所	176	183	110,349	
HOYA	57.9	49.4	85,857	
電気・ガス業（2.2%）				
関西電力	—	24.6	52,890	
卸売業（—%）				
丸紅	59	—	—	
サービス業（0.9%）				
応用地質	15.1	19.9	20,457	
合計	株数・金額	株数	千株	千円
	銘柄数<比率>	4,460	3,444	2,353,446
		40	41	<13.0%>

(注1) 銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 評価額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(注4) —印は組入れなし。

(2) 外国株式（上場・登録株式）

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ……ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	303	—	—	—	保険
ACUITY BRANDS INC	—	58	119	11,814	資本財
AECOM TECHNOLOGY CORP	—	75	163	16,238	資本財
AMERICAN WATER WORKS CO INC	744	556	926	91,768	公益事業
AMERON INTERNATIONAL CORP	45	18	75	7,477	資本財
ARCH CHEMICALS INC	146	158	241	23,933	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	739	330	852	84,451	食品・飲料・タバコ
AVENTINE RENEWABLE ENERGY	577	—	—	—	エネルギー
BALDOR ELECTRIC	469	312	321	31,806	資本財
BECTON DICKINSON & CO	188	263	1,643	162,843	ヘルスクエア機器・サービス
BORGWARNER INC	45	374	571	56,578	自動車・自動車部品
CALIFORNIA WATER SERVICE GRP	460	225	853	84,526	公益事業
CIRCOR INTERNATIONAL INC	215	167	291	28,927	資本財
COMFORT SYSTEMS USA INC	—	35	29	2,879	商業・専門サービス
COMMERCIAL METALS CO	113	254	253	25,092	素材
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	374	568	1,036	102,644	公益事業
COVANTA HOLDING CORP	531	788	1,018	100,862	商業・専門サービス
DANAHER CORP	220	229	1,099	108,965	資本財
DARLING INTERNATIONAL INC	553	661	194	19,280	食品・飲料・タバコ
DOVER CORP	201	409	904	89,578	資本財
EDISON INTERNATIONAL	537	253	602	59,679	公益事業
INGERSOLL-RAND CO LTD-CL A	722	—	—	—	資本財
EMCOR GROUP INC	586	390	528	52,392	資本財
EMERSON ELECTRIC CO	1,006	425	1,059	104,919	資本財
ENERSIS S. A. -SPONS ADR	60	95	132	13,170	公益事業
FPL GROUP INC	—	136	568	56,292	公益事業
FAIRCHILD SEMICON INTL-CL A	—	111	32	3,175	半導体・半導体製造装置
FLUOR CORP	140	248	832	82,429	資本財
GRAFTECH INTERNATIONAL LTD	—	256	133	13,184	資本財
GREENHILL & CO INC	259	121	682	67,656	各種金融
HARSCO CORP	115	80	140	13,906	資本財
HEADWATERS INC	2,085	1,237	151	14,960	素材
HONEYWELL INTERNATIONL INC	—	60	141	14,024	資本財
ITT CORP	311	206	664	65,817	資本財
IDEX CORP	275	275	460	45,606	資本財
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	89	—	—	—	各種金融
INTL RECTIFIER CORP	79	520	609	60,421	半導体・半導体製造装置
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	54	236	782	77,499	資本財
JOHNSON CONTROLS INC	1,283	920	884	87,611	自動車・自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	167	245	416	41,237	不動産
LDK SOLAR CO LTD - ADR	326	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LINDSAY CORP	1	—	—	—	資本財
LOUISIANA-PACIFIC CORP	992	—	—	—	素材
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	71	250	330	32,788	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首	当		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千米ドル	千円		
MILLIPORE CORP	221	171	884	87,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MINDRAY MEDICAL INTL LTD-ADR	—	261	495	49,128	ヘルスケア機器・サービス	
MINERALS TECHNOLOGIES INC	180	10	28	2,862	素材	
MODINE MANUFACTURING CO	—	919	77	7,649	自動車・自動車部品	
MOHAWK INDUSTRIES INC	—	267	457	45,350	耐久消費財・アパレル	
MUELLER WATER PRODUCTS INC-A	109	918	186	18,467	資本財	
MUELLER WATER PRODUCTS INC-B	1,300	—	—	—	資本財	
NALCO HOLDING CO	760	377	367	36,378	素材	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	—	608	659	65,322	半導体・半導体製造装置	
OM GROUP INC	69	—	—	—	素材	
ORMAT TECHNOLOGIES INC	417	404	931	92,295	公益事業	
PALL CORP	498	458	971	96,238	資本財	
PARKER HANNIFIN CORP	160	147	411	40,772	資本財	
PENTAIR INC	931	763	1,342	133,039	資本財	
PERKINELMER INC	472	229	251	24,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POLYPORE INTERNATIONAL INC	713	766	183	18,146	資本財	
PRAXAIR INC	195	157	851	84,361	素材	
QUANTA SERVICES INC	—	222	418	41,435	資本財	
REGAL BELOIT CORP	687	548	1,414	140,172	資本財	
REPUBLIC SERVICES INC	—	665	1,071	106,187	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	83	—	—	—	資本財	
ROPER INDUSTRIES INC	254	230	850	84,217	資本財	
SPX CORP	250	138	588	58,292	資本財	
SHAW GROUP INC	—	561	1,262	125,044	資本財	
SUNTECH POWER HOLDINGS-ADR	200	—	—	—	資本財	
TENNECO INC	—	1,527	151	14,981	自動車・自動車部品	
TEREX CORP	241	—	—	—	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	738	666	2,191	217,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M COMPANY	—	271	1,144	113,337	資本財	
TRINITY INDUSTRIES INC	547	—	—	—	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	29	140	526	52,158	資本財	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	118	269	740	73,352	ヘルスケア機器・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	—	463	923	91,511	ソフトウェア・サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	550	470	1,046	103,643	商業・専門サービス	
WATERS CORP	476	269	854	84,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	1,184	318	507	50,280	資本財	
WEYERHAEUSER CO	296	—	—	—	素材	
TYCO INTERNATIONAL LTD	551	372	648	64,236	資本財	
COSAN LTD-CLASS A SHARES	1,166	777	194	19,244	食品・飲料・タバコ	
AMDOCS LTD	724	755	1,195	118,404	ソフトウェア・サービス	
COOPER INDUSTRIES LTD-CL A (アメリカ……アメリカン市場)	450	300	570	56,499	資本財	
GORMAN-RUPP CO (アメリカ……米国店頭市場)	16	—	—	—	資本財	
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES	1,040	1,106	607	60,181	半導体・半導体製造装置	

銘 柄	期 首		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	百株	百株	千米ドル	千円		
APOGEE ENTERPRISES INC	—	519	437	43,340	資本財	
AUTODESK INC	524	521	614	60,855	ソフトウェア・サービス	
BLACKBAUD INC	513	536	491	48,653	ソフトウェア・サービス	
CISCO SYSTEMS INC	845	526	717	71,050	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CITRIX SYSTEMS INC	508	340	719	71,299	ソフトウェア・サービス	
CLEAN HARBORS INC	229	229	972	96,374	商業・専門サービス	
DIONEX CORP	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EBAY INC	478	564	579	57,420	ソフトウェア・サービス	
ENTEGRIS INC	1,414	1,523	86	8,602	半導体・半導体製造装置	
FIRST SOLAR INC	67	—	—	—	資本財	
IDEXX LABORATORIES INC	71	68	195	19,373	ヘルスケア機器・サービス	
INSITUFORM TECHNOLOGIES-CL A	895	477	569	56,424	資本財	
ITRON INC	268	172	703	69,710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LKQ CORP	1,042	996	1,234	122,256	小売	
MKS INSTRUMENTS INC	410	3	3	390	半導体・半導体製造装置	
NORTHERN TRUST CORP	166	237	1,138	112,766	各種金融	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	—	233	78	7,806	半導体・半導体製造装置	
PACIFIC ETHANOL INC	931	—	—	—	エネルギー	
T ROWE PRICE GROUP INC	182	178	378	37,504	各種金融	
SCHNITZER STEEL INDS INC-A	164	254	637	63,161	素材	
SMURFIT -STONE CONTAINER CORP	71	—	—	—	素材	
STERICYCLE INC	260	177	824	81,662	商業・専門サービス	
SUNPOWER CORP-CLASS B	—	300	612	60,690	資本財	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	—	311	377	37,368	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VCA ANTECH INC	—	237	426	42,239	ヘルスケア機器・サービス	
VARIAN INC	118	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEECO INSTRUMENTS INC	—	138	58	5,764	半導体・半導体製造装置	
WOODWARD GOVERNOR CO	37	—	—	—	資本財	
FOSTER WHEELER LTD	10	—	—	—	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	39,938	36,641	56,613	5,608,659	—
	銘 柄 数 <比 率>	93	94	—	<30.9%>	—
(カナダ……トロント市場)	百株	百株	千カナダドル	千円		
ATS AUTOMATION TOOLING SYS	—	668	201	15,343	資本財	
CAN HYDRO DEVELOPERS INC	2,984	1,163	305	23,340	公益事業	
METHANEX CORP	122	—	—	—	素材	
STANTEC INC	612	370	700	53,448	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,718	2,201	1,207	92,132	—
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.5%>	—
(メキシコ……メキシコ市場)	百株	百株	千メキシコペソ	千円		
URBI DESARROLLOS URBANOS SA	3,490	2,851	3,110	19,971	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,490	2,851	3,110	19,971	—
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.1%>	—
(ブラジル……サンパウロ市場)	百株	百株	千ブラジルリアル	千円		
AES TIETE SA-PREF	393	123	199	8,278	公益事業	
NATURA COSMETICOS SA	1,032	23	45	1,907	家庭用品・パーソナル用品	

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	百株 961	百株 1,837	千ブラジルレアル 1,506	千円 62,553	運輸	
TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	1,638	830	1,431	59,446	公益事業	
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	772	387	743	30,867	公益事業	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	436	—	—	—	公益事業	
小 計	5,232	3,200	3,927	163,053		
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6	5	—	< 0.9%>	———
(ユーロ……ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VOSSLOH AG	99	74	537	67,258	資本財	
SIEMENS AG-REG	240	390	1,514	189,559	資本財	
LINDE AG	178	206	1,058	132,410	素材	
SOLARWORLD AG	9	—	—	—	資本財	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,426	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	77	67	206	25,784	各種金融	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	346	259	509	63,760	資本財	
WACKER CHEMIE AG	3	30	141	17,671	素材	
ROTH & RAU AG	312	—	—	—	資本財	
CROPENERGIES AG	—	68	17	2,153	エネルギー	
SYMRISE AG	967	726	583	73,004	素材	
GERRESHEIMER AG	157	136	210	26,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	—	158	449	56,302	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,820	2,119	5,228	654,285	———
		11	10	—	< 3.6%>	
(ユーロ……イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INTESA SANPAOLO	4,513	—	—	—	銀行	
ACEA SPA	1,465	1,081	869	108,766	公益事業	
ENEL SPA	3,063	3,188	1,064	133,181	公益事業	
ACTELIOS SPA	—	47	12	1,523	公益事業	
HERA SPA	5,627	7,913	903	113,093	公益事業	
LANDI RENZO SPA	—	2,332	555	69,522	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	14,670	14,563	3,404	426,087	———
		4	5	—	< 2.3%>	
(ユーロ……フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	749	712	1,127	141,148	公益事業	
RECYLEX SA	—	36	9	1,142	素材	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	359	313	1,377	172,350	資本財	
NATUREX	169	169	334	41,811	食品・飲料・タバコ	
SECHE ENVIRONNEMENT	130	128	526	65,930	商業・専門サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	—	10	32	4,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEXANS SA	5	163	426	53,378	資本財	
JC DECAUX SA	287	—	—	—	メディア	
ESSILOR INTERNATIONAL	124	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SAFT GROUPE SA	461	306	521	65,237	資本財	
ALSTOM	257	148	543	68,077	資本財	
ARKEMA	—	204	217	27,282	素材	
LEGRAND SA	819	592	694	86,968	資本財	

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
EDF ENERGIES NOUVELLES SA	240	279	千ユーロ 754	千円 94,417	公益事業	
RHODIA SA - REGR	641	2,100	447	55,983	素材	
AIR LIQUIDE	—	185	1,086	135,968	素材	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	160	886	900	112,686	公益事業	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA-RTS	564	—	—	—	公益事業	
EDF ENERGIES NOUVELLES-RTS	240	—	—	—	公益事業	
NATUREX - RTS	—	169	1	127	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,211 15	6,408 16	9,001 —	1,126,548 < 6.2%>	—
(ユーロ……オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
QIAGEN N.V.	535	547	691	86,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIPS ELECTRONICS NV	831	265	300	37,643	資本財	
WAVIN NV	2,075	2,285	413	51,771	資本財	
BOSKALIS WESTMINSTER	—	175	241	30,171	資本財	
GRONTMIJ-CVA	355	297	407	51,010	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,798 4	3,572 5	2,054 —	257,155 < 1.4%>	—
(ユーロ……スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,556	1,644	769	96,318	銀行	
ABENGOA SA	631	616	542	67,950	資本財	
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	439	803	646	80,873	資本財	
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBI	2,009	—	—	—	資本財	
IBERDROLA SA	1,782	968	431	54,030	公益事業	
IBERDROLA RENOVABLES	2,335	3,416	949	118,858	公益事業	
EDP RENOVAVEIS SA	1,633	1,700	967	121,057	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	10,388 7	9,148 6	4,307 —	539,090 < 3.0%>	—
(ユーロ……ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UMICORE	465	664	802	100,435	素材	
SOLVAY SA	—	42	177	22,173	素材	
BEKAERT NV	160	194	745	93,286	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	626 2	901 3	1,725 —	215,896 < 1.2%>	—
(ユーロ……オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BWT AG	—	433	497	62,318	商業・専門サービス	
MAYR-MELNHOF KARTON AG	249	97	478	59,836	素材	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	389	283	674	84,450	公益事業	
ZUMTOBEL AG	170	600	336	42,084	資本財	
ANDRITZ AG	—	339	593	74,330	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	809 3	1,753 5	2,581 —	323,021 < 1.8%>	—
(ユーロ……フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KEMIRA OYJ	758	—	—	—	素材	
WARTSILA OYJ	10	221	397	49,720	資本財	
METSO OYJ	—	23	17	2,229	資本財	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
LASSILA & TIKANOJA OYJ	百株 550	百株 —	千ユーロ —	千円 —	商業・専門サービス
NESTE OIL OYJ	562	466	421	52,749	エネルギー
小計	株数・金額 1,881	712	836	104,700	——
	銘柄数<比率> 4	3	—	<0.6%>	
(ユーロ……アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KINGSPAN GROUP PLC (ロンドン市場取引)	1,683	2,183	482	60,336	資本財
KINGSPAN GROUP PLC (アイルランド市場取引)	1,992	3,568	785	98,250	資本財
小計	株数・金額 3,676	5,752	1,267	158,586	——
	銘柄数<比率> 2	2	—	<0.9%>	
(ユーロ……ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ELLAKTOR SA	—	277	110	13,831	資本財
小計	株数・金額 —	277	110	13,831	——
	銘柄数<比率> —	1	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 44,881	45,209	30,517	3,819,204	——
	銘柄数<比率> 52	56	—	<21.1%>	
(イギリス……ロンドン市場)	百株	百株	千ポンド	千円	
ARM HOLDINGS PLC	6,794	3,788	342	46,927	半導体・半導体製造装置
ATKINS (WS) PLC	104	104	44	6,033	商業・専門サービス
AGGREKO PLC	180	—	—	—	商業・専門サービス
SPECTRIS PLC	—	1,119	429	58,727	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	—	1,066	800	109,504	銀行
RICARDO PLC	911	1,633	257	35,264	商業・専門サービス
ROTORK PLC	—	95	75	10,377	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	620	386	408	55,926	公益事業
SIG PLC	507	1,318	141	19,396	資本財
SMITH (DAVID S) HOLDINGS PLC	9,342	7,099	465	63,651	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	515	515	399	54,654	資本財
BG GROUP PLC	1,053	917	902	123,567	エネルギー
WSP GROUP PLC	—	61	11	1,544	資本財
WEIR GROUP PLC/THE	173	—	—	—	資本財
WOLSELEY PLC	2,455	—	—	—	資本財
NORTHUMBRIAN WATER GROUP PLC	1,382	1,342	288	39,515	公益事業
RENESOLA LTD	1,756	1,961	149	20,477	半導体・半導体製造装置
PENNON GROUP PLC	1,269	1,266	482	65,989	公益事業
SEVERN TRENT PLC	776	639	620	84,951	公益事業
PV CRYSTALOX SOLAR PLC	—	4,763	336	46,126	資本財
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,408	2,580	1,196	163,793	公益事業
小計	株数・金額 31,249	30,659	7,352	1,006,428	——
	銘柄数<比率> 16	18	—	<5.5%>	
(スイス……チューリッヒ市場)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
ABB LTD-REG	436	—	—	—	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	150	99	1,319	112,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	29	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
(スイス……スイス電子市場)					
FISCHER (GEORG)-REG	0.56	23	276	23,620	資本財

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
CIBA HOLDING AG SYNTHES INC (スイス……V I R T - X市場)	百株 586 167	百株 374 116	千スイスフラン 1,773 1,501	千円 151,706 128,435	素材 ヘルスケア機器・サービス	
SGS SA-REG NESTLE SA-REG GEBERIT AG-REG	11 457 289	8 432 202	901 1,537 1,877	77,124 131,449 160,582	商業・専門サービス 食品・飲料・タバコ 資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,129 9	1,256 7	9,188 —	785,799 < 4.3%>	—
(スウェーデン……ストックホルム市場)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
HALDEX AB SKANSKA AB-B SHS ALFA LAVAL AB NIBE INDUSTRIER AB-B SHS SKF AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS MUNTERS AB	288 384 1,788 1,797 1,878 226 455	— 548 1,111 278 1,454 — —	— 3,524 7,059 1,544 10,398 — —	— 37,958 76,036 16,633 111,993 — —	資本財 資本財 資本財 資本財 資本財 資本財 資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,816 7	3,393 4	22,527 —	242,621 < 1.3%>	—
(ノルウェー……オスロ市場)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
TOMRA SYSTEMS ASA NORSK HYDRO A S ORKLA ASA	4,892 1,020 1,241	4,472 1,393 584	9,614 2,987 2,444	133,357 41,443 33,898	商業・専門サービス 素材 資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,154 3	6,449 3	15,046 —	208,699 < 1.2%>	—
(デンマーク……コペンハーゲン市場)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
NOVOZYMES A/S-B SHARES VESTAS WIND SYSTEMS A/S NOVO NORDISK A/S-B COLOPLAST-B	155 138 613 181	152 131 587 169	6,110 2,922 15,203 5,752	102,648 49,099 255,415 96,641	素材 資本財 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,089 4	1,040 4	29,988 —	503,804 < 2.8%>	—
(オーストラリア……オーストラリア市場)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
AMCOR LIMITED COFFEY INTERNATIONAL LTD COCHLEAR LIMITED TRANSFIELD SERVICES LIMITED TRANSPACIFIC INDUSTRIES GROUP SIMS METAL MANAGEMENT LTD	1,480 — 212 — 3,150 638	— 8,062 156 3,543 4,863 807	— 1,410 821 552 875 1,311	— 88,931 51,763 34,838 55,175 82,665	素材 商業・専門サービス ヘルスケア機器・サービス 商業・専門サービス 商業・専門サービス 素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,481 4	17,432 5	4,971 —	313,375 < 1.7%>	—
(ニュージーランド……ウエリントン市場)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
CONTACT ENERGY LTD	784	1,912	1,080	53,050	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	784 1	1,912 1	1,080 —	53,050 < 0.3%>	—

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港……香港市場)	百株	百株	千ホンコンドル	千円		
CLP HOLDINGS LIMITED	5,274	3,949	21,719	277,358	公益事業	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	—	1,257	3,412	43,582	家庭用品・パーソナル用品	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	4,374	1,529	6,888	87,961	公益事業	
CHINA WATER AFFAIRS GROUP	5,880	24,320	2,529	32,298	公益事業	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING	12,356	12,356	4,547	58,065	素材	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	11,580	—	—	—	素材	
CHINA HIGH SPEED TRANSMISSION	5,750	4,851	4,608	58,849	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	45,214 6	48,262 6	43,705 —	558,116 <3.1%>	———
(シンガポール……シンガポール市場)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
HYFLUX LIMITED	—	3,699	510	32,664	公益事業	
BIO-TREAT TECHNOLOGY LTD	33,790	33,790	118	7,567	商業・専門サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	5,130	4,301	881	56,420	資本財	
SINO-ENVIRONMENT TECH GROUP	—	11,693	344	22,072	公益事業	
EPURE INTERNATIONAL LIMITED	—	27,670	719	46,035	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	38,920 2	81,153 5	2,574 —	164,761 <0.9%>	———
(フィリピン……フィリピン証券市場)	百株	百株	千フィリピンペソ	千円		
MANILA WATER COMPANY	—	36,397	39,126	79,818	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	36,397 1	39,126 —	79,818 <0.4%>	———
(韓国……韓国市場)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	—	4	85,668	5,491	資本財	
HYUNDAI STEEL CO	6	—	—	—	素材	
(韓国……韓国店頭市場)						
TAEWOONG CO LTD	—	24	231,240	14,822	資本財	
PYEONG SAN CO LTD	189	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	195 2	29 2	316,908 —	20,313 <0.1%>	———
(台湾……台湾市場)	百株	百株	千新台湾ドル	千円		
DELTA ELECTRONICS INC	—	5,810	31,548	89,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	5,810 1	31,548 —	89,912 <0.5%>	———
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	236,296 209	323,899 216	— —	13,729,724 <75.7%>	———

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) —印は組入れなし。

(3) 外国投資証券

銘 柄		期 首	当 期		末
		単位数又は口数	単位数又は口数	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) PLUM CREEK TIMBER CO		口 —	口 14,800	千米ドル 352	千円 34,881
合 計	口 数 ・ 金 額	—	14,800	352	34,881
	銘 柄 数 <比 率>	—	1	—	<0.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 単位未満は切捨て。

(注4) —印は組入れなし。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国 内		百万円		百万円
株 式 先 物 取 引				
日経平均		239		—
外 国				
株 式 先 物 取 引				
CAC40 10 EUR		277		—
S&P500 EMINI		385		—
E-MINI MSCI EMERGING		235		—
MDAX INDEX		335		—
S&P 500		83		—
FTSE 100 INDEX		154		—

(注1) 金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) —印は組入れなし。

◆投資信託財産の構成 (2009年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 16,083,171	% 84.7
投 資 証 券	34,881	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,871,369	15.1
投 資 信 託 財 産 総 額	18,989,421	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建て純資産 (15,599,561千円) の投資信託財産総額 (18,989,421千円) に対する比率は82.1%です。

(注3) 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買取場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2009年3月10日における邦貨換算レートは1米ドル=99.07円、1カナダドル=76.31円、1メキシコペソ=6.42円、1ブラジルリアル=41.52円、1ユーロ=125.15円、1ポンド=136.88円、1スイスフラン=85.52円、1スウェーデンクローネ=10.77円、1ノルウェークローネ=13.87円、1デンマーククローネ=16.80円、1オーストラリアドル=63.03円、1ニュージーランドドル=49.09円、1香港ドル=12.77円、1シンガポールドル=63.99円、1フィリピンペソ=2.04円、100韓国ウォン=6.41円、1新台幣ドル=2.85円です。

◆資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2009年3月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	33,433,516,424円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,451,937,315
株 式(評価額)	16,083,171,216
投 資 証 券(評価額)	34,881,754
未 収 入 金	15,308,237,799
未 収 配 当 金	27,566,051
未 収 利 息	1,465
そ の 他 未 収 収 益	141,453
差 入 委 託 証 拠 金	527,579,371
(B) 負 債	15,297,925,109
未 払 金	15,052,640,114
未 払 解 約 金	8,343,076
未 払 信 託 報 酬	230,928,025
そ の 他 未 払 費 用	6,013,894
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	18,135,591,315
元 本	40,627,652,456
次 期 繰 越 損 益 金	△22,492,061,141
(D) 受 益 権 総 口 数	40,627,652,456口
1万口当たり基準価額(C/D)	4,464円

<注記事項>

期首元本額	44,392,869,801円
期中追加設定元本額	781,653,369円
期中解約元本額	4,546,870,714円
計算口数当りの純資産額	4,464円

◆損益の状況

当期 (自2008年9月11日 至2009年3月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	162,678,630円
受 取 配 当 金	155,682,520
受 取 利 息	3,920,583
そ の 他 収 益 金	3,075,527
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△15,242,516,172
売 買 益 損	2,329,854,205
売 買 損 益	△17,572,370,377
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 981,693,610
取 引 益 損	72,091,144
取 引 損 益	△ 1,053,784,754
(D) 信 託 報 酬 等	△ 249,023,396
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△16,310,554,548
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 5,721,555,346
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 459,951,247
(配 当 等 相 当 額)	(13,270,196)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 473,221,443)
(H) 計 (E+F+G)	△22,492,061,141
(I) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(H+I)	△22,492,061,141
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 459,951,247
(配 当 等 相 当 額)	(13,270,196)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 473,221,443)
繰 越 損 益 金	△22,032,109,894

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

