

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式
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、信託財産の中長期的な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

追加型投信／内外／株式

---

## 運用報告書

第3期

（決算日 2009年9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9月10日に第3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〉

金融法人第二部 〈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	期中 騰落率	参考指数 (MSCIワールド・ インデックス (円換算))		株式 組入 率	株式 先物 比率	純資産 総額
				期 騰落率	期 騰落率			
(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
3期(2009年9月10日)	7,067	0	58.3	6,796	52.2	92.6	4.5	23,578

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の投資元本です。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 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5) 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 (MSCIワールド・ インデックス (円換算))		株式組入 率	株式先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2009年3月10日	円 4,464	% —	4,464	% —	% 88.7	% 9.4
3月末	5,011	12.3	5,109	14.4	88.7	9.2
4月末	5,816	30.3	5,704	27.8	90.4	8.6
5月末	6,263	40.3	6,100	36.6	93.4	5.5
6月末	6,424	43.9	6,183	38.5	95.1	3.8
7月末	6,804	52.4	6,587	47.5	95.0	3.8
8月末	6,915	54.9	6,756	51.3	95.0	4.1
(期末) 2009年9月10日	7,067	58.3	6,796	52.2	92.6	4.5

(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4,464円から58.3%上昇して7,067円となりました。

#### <投資環境>

- ① 米銀行大手の2009年の収益改善についての報道や主要各国の金融経済対策等を受けて、金融不安が後退し上昇基調
- ② 高値警戒感が高まる中、世界銀行による2009年世界経済の実質成長率見通しの下方修正等を受けて下落基調
- ③ 企業の好決算や明るい業績見通し、経済指標の改善等を受けて景気の底入れ観測が高まり、上昇基調

#### <主な出来事>

- A：米銀行大手の2009年の収益改善報道  
B：ガイトナー米財務長官が最大1兆ドルの官民投資プログラム（P P I P）を発表  
C：世界銀行が2009年世界経済の実質成長率見通しを3月時点の-1.7%から-2.9%へ下方修正

#### <基準価額の主な変動要因>

##### ●国別要因

オランダ、スペイン、シンガポール等において良好なパフォーマンスをあげました。

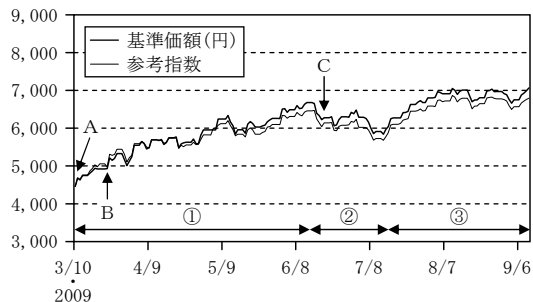
##### ●テーマ別要因

排出権規制強化を睨んだ需要増期待から「エネルギー効率」関連銘柄が最も高いリターンをあげた一方で、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「代替エネルギー」関連が最も低いリターンとなりました。当ファンドは、エネルギー効率関連銘柄の中でも特に上昇率の高かったハイブリッドカーの部品メーカー等を保有しており、良好なパフォーマンスに繋がりました。

##### ●銘柄別要因

米国の自動車部品メーカーや水処理技術メーカー等が大幅に上昇し、大きくプラスに貢献しました。一方、中国、ドイツ、米国等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。

### 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。

## 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)	62円 (33) (26) ( 3)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 証 券) (先物・オプション)	9 ( 9) ( 0) ( 0)
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 証 券)	2 ( 2) ( 0)
(d) 保 管 費 用 等	4
(e) そ の 他 の 諸 費 用	1
合 計	78

(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 2009年3月11日 至 2009年9月10日）

#### (1) 株 式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
国内	上 場	千株 1,326	千円 1,503,381	千株 1,998	千円 2,246,895	
外	ア メ リ カ	百株 34,767 ( 587)	千米ドル 80,810 ( 1,620)	百株 40,268 ( 587)	千米ドル 88,849 ( 1,620)	
	カ ナ ダ	257	千カナダドル 1,082	2,263	千カナダドル 1,840	
	メ キ シ コ	—	千メキシコペソ —	2,851	千メキシコペソ 5,094	
	ブ ラ ジ ル	1,373	千ブラジルリアル 3,156	1,292	千ブラジルリアル 1,970	
	ユ	ド イ ツ	1,952	千ユーロ 5,000	1,384	千ユーロ 5,944
		イ タ リ ア	9,243 ( 4,295)	3,247 ( —)	14,192	3,644
		フ ラ ン ス	4,565 ( 55)	8,701 ( 125)	6,641 ( 169)	11,633 ( 1)
		オ ラ ン ダ	5,317 (13,245)	2,798 ( 903)	9,989 ( 2,364)	3,365 ( 241)
		ス ベ イ ン	3,420 ( 26)	2,837 ( 12)	5,656 ( —)	4,447 ( 12)
	ロ	ベ ル ギ ー	222	456	704	2,432
オ ー ス ト リ ア		164	278	1,050	2,328	

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ	フィンランド	百株 225	千ユーロ 378	百株 937	千ユーロ 1,309
		アイルランド	249	80	1,948	988
		ギリシャ	72	28	349	182
		ポルトガル	3,353	1,052	84	26
		イ ギ リ ス	33,173 (2,952)	千ポンド (5,949 66)	29,858	千ポンド 6,707
		ス イ ス	681	千スイスフラン 2,460	900 (-)	千スイスフラン (6,795 21)
		ス ウ ェ ー デ ン	3,246	千スウェーデンクローネ 26,296	3,901	千スウェーデンクローネ 30,383
		ノ ル ウ ェ ー	1,385 (164)	千ノルウェークローネ (5,966 -)	6,613	千ノルウェークローネ 18,099
		デ ン マ ー ク	437	千デンマーククローネ 13,216	485	千デンマーククローネ 16,222
		オ ー ス ト ラ リ ア	10,068	千オーストラリアドル 2,759	5,086	千オーストラリアドル 3,161
		ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,346	千ニュージーランドドル 204	3,259	千ニュージーランドドル 1,358
		香 港	56,348	千香港ドル 43,787	62,750	千香港ドル 51,372
		シ ン ガ ポ ー ル	13,160	千シンガポールドル 2,360	46,593	千シンガポールドル 479
		フ ィ リ ピ ン	21,663	千フィリピンペソ 31,783	3,909	千フィリピンペソ 6,135
		韓 国	833	千韓国ウォン 4,767,712	507	千韓国ウォン 2,899,845
		台 湾	2,300 (162)	千新台湾ドル (15,310 918)	(-) (-)	千新台湾ドル (-) (918)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(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) 投資信託受益証券、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 29,141	千米ドル 857	口 7,158	千米ドル 218

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### (3) 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 1,022	百万円 1,214	百万円 -	百万円 -
外国	株 式 先 物 取 引	7,832	9,125	-	-

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) -印は取引なし。

(注3) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

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

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,661,744千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	21,435,616千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.66

(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 2009年3月11日 至 2009年9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
3M COMPANY(アメリカ)	65	397,476	6,033	SIEMENS AG-REG(ユーロ・ドイツ)	67	451,513	6,687
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD(香港)	4,361	329,406	75	WASTE MANAGEMENT INC(アメリカ)	118	318,903	2,680
ENEL SPA(ユーロ・イタリア)	535	298,920	557	PALL CORP(アメリカ)	95	248,873	2,617
SIEMENS AG-REG(ユーロ・ドイツ)	41	275,408	6,667	JOHNSON CONTROLS INC(アメリカ)	122	244,297	1,999
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN(ユーロ・フランス)	71	260,032	3,642	ALFA LAVAL AB(スウェーデン)	246	235,562	956
PHILIPS ELECTRONICS NV(ユーロ・オランダ)	132	248,196	1,870	REGAL BELOIT CORP(アメリカ)	57	234,101	4,048
WATERS CORP(アメリカ)	52	239,475	4,592	SCHNEIDER ELECTRIC SA(ユーロ・フランス)	28	220,124	7,632
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC(アメリカ)	57	228,182	3,954	AIR LIQUIDE(ユーロ・フランス)	24	213,392	8,561
EMERSON ELECTRIC CO(アメリカ)	69	225,407	3,229	ENEL SPA(ユーロ・イタリア)	407	200,508	492
WASTE MANAGEMENT INC(アメリカ)	85	225,185	2,625	UNITED TECHNOLOGIES CORP(アメリカ)	39	199,834	5,019

(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 2009年3月11日 至 2009年9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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株 式	15,992	—	—	19,669	—	—
投 資 証 券	82	—	—	20	—	—
株 式 先 物 取 引	8,864	—	—	10,350	—	—
為 替	35,725	—	—	39,873	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ー印は取引なし。

(注3) 単位未満は切捨て。

(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)	36,695千円
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) ー印は取引なし。

\*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委託会社の自己取引状況（自 2009年3月11日 至 2009年9月10日）  
期中における該当事項はありません。

◆委託会社による自社が設定する投資信託の受益証券の自己取得及び処分の状況（自 2009年3月11日 至 2009年9月10日）

◎自社による当ファンドの設定・解約状況

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9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
<b>建設業（4.0%）</b>			
三機工業	10	—	—
日揮	63	63	111,132
中外炉工業	34	—	—
高砂熱学工業	17	—	—
<b>繊維製品（3.0%）</b>			
東レ	160	160	84,960
<b>化学（2.6%）</b>			
旭化成	93	156	73,788
日産化学工業	20	—	—
トクヤマ	51	—	—
積水化学工業	70	—	—
日東電工	21.3	—	—
<b>医薬品（—%）</b>			
中外製薬	23.9	—	—
<b>ガラス・土石製品（7.8%）</b>			
日本碍子	55	55	116,325
ニチアス	284	284	102,240
<b>非鉄金属（3.7%）</b>			
DOWAホールディングス	61	45	27,360
住友電気工業	—	4.4	5,486
アサヒブリテック	58	—	—
アサヒホールディングス	—	41.1	71,185
<b>機械（16.5%）</b>			
三浦工業	31.9	31.9	76,560
荏原製作所	146	44	19,272
オルガノ	116	116	83,404
栗田工業	78.3	48.9	153,057
ダイフク	8	32	18,784
日本精工	291	—	—
前澤給装工業	21.3	21.3	30,927
日立造船	628	628	76,616
<b>電気機器（38.9%）</b>			
イビデン	—	16.3	56,235
ダイヘン	120	120	50,520
シャープ	136	—	—
TDK	1.7	—	—
横河電機	39.5	—	—
山武	84.8	128	244,864
堀場製作所	126.1	118.8	275,616

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スタンレー電気	119.8	73.5	132,300
ファナック	12.7	12.7	97,155
ローム	11	—	—
京セラ	14.3	14.3	114,400
村田製作所	—	25.7	112,566
<b>輸送用機器（12.3%）</b>			
デンソー	88.1	95.9	258,450
アイシン精機	18.2	36.7	84,410
豊田合成	31.9	—	—
シマノ	21.7	—	—
<b>精密機器（8.2%）</b>			
島津製作所	183	239	157,023
HOYA	49.4	32.2	70,840
<b>電気・ガス業（—%）</b>			
関西電力	24.6	—	—
<b>卸売業（2.7%）</b>			
松田産業	—	12.6	20,500
丸紅	—	113	53,449
<b>サービス業（0.3%）</b>			
応用地質	19.9	—	—
ダイセキ	—	3.6	7,236
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	千株 3,444 41	千株 2,772 30 千円 2,786,662 <11.8%>

(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	—	345	1,379	127,196	保険
ACUITY BRANDS INC	58	—	—	—	資本財
AECOM TECHNOLOGY CORP	75	—	—	—	資本財
AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	—	123	566	52,254	電気通信サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	556	1,090	2,169	199,991	公益事業
AMERON INTERNATIONAL CORP	18	56	411	37,949	資本財
ARCH CHEMICALS INC	158	158	460	42,435	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	330	829	2,381	219,571	食品・飲料・タバコ
BALDOR ELECTRIC	312	698	1,985	183,027	資本財
BARD (C. R. ) INC	—	105	849	78,366	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	263	287	2,022	186,499	ヘルスケア機器・サービス
BORGWARNER INC	374	204	679	62,689	自動車・自動車部品
CALIFORNIA WATER SERVICE GRP	225	—	—	—	公益事業
CARLISLE COS INC	—	69	225	20,780	資本財
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	213	503	46,445	エネルギー
CIRCOR INTERNATIONAL INC	167	—	—	—	資本財
COMFORT SYSTEMS USA INC	35	367	413	38,134	資本財
COMMERCIAL METALS CO	254	132	245	22,601	素材
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	568	416	1,537	141,725	公益事業
COVANTA HOLDING CORP	788	1,119	2,005	184,883	商業・専門サービス
DANAHER CORP	229	315	2,096	193,339	資本財
DARLING INTERNATIONAL INC	661	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DEERE & CO	—	166	716	66,025	資本財
DOVER CORP	409	—	—	—	資本財
ECOLAB INC	—	22	100	9,228	素材
EDISON INTERNATIONAL	253	—	—	—	公益事業
EMCOR GROUP INC	390	—	—	—	資本財
EMERSON ELECTRIC CO	425	750	2,908	268,167	資本財
ENERSIS S. A. -SPONS ADR	95	885	1,564	144,291	公益事業
FPL GROUP INC	136	278	1,502	138,564	公益事業
FAIRCHILD SEMICON INTL-CL A	111	—	—	—	半導体・半導体製造装置
FLUOR CORP	248	—	—	—	資本財
GRAFTECH INTERNATIONAL LTD	256	—	—	—	資本財
GREENHILL & CO INC	121	106	812	74,903	各種金融
HARSCO CORP	80	83	280	25,824	資本財
HEADWATERS INC	1,237	—	—	—	素材
HONYWELL INTERNATION INC	60	—	—	—	資本財
HUBBELL INC -CL B	—	356	1,421	131,072	資本財
ITT CORP	206	—	—	—	資本財
IDEX CORP	275	—	—	—	資本財
IHS INC-CLASS A	—	21	105	9,690	商業・専門サービス
INTL RECTIFIER CORP	520	—	—	—	半導体・半導体製造装置
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	236	—	—	—	資本財
JOHNSON CONTROLS INC	920	559	1,452	133,912	自動車・自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	245	197	946	87,301	不動産
LDK SOLAR CO LTD - ADR	—	541	523	48,284	半導体・半導体製造装置
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	250	273	450	41,531	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		
MASTEC INC	—	1,411	1,557	143,623	資本財	
MILLIPORE CORP	171	120	836	77,110	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	195	617	56,908	ヘルスケア機器・サービス	
MINERALS TECHNOLOGIES INC	10	—	—	—	素材	
MODINE MANUFACTURING CO	919	302	254	23,446	自動車・自動車部品	
MOHAWK INDUSTRIES INC	267	95	478	44,105	耐久消費財・アパレル	
MUELLER WATER PRODUCTS INC-A	918	—	—	—	資本財	
NALCO HOLDING CO	377	283	506	46,666	素材	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	608	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ORMAT TECHNOLOGIES INC	404	344	1,285	118,557	公益事業	
PALL CORP	458	—	—	—	資本財	
PARKER HANNIFIN CORP	147	—	—	—	資本財	
PENTAIR INC	763	521	1,522	140,361	資本財	
PERKINELMER INC	229	229	425	39,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POLYPORE INTERNATIONAL INC	766	—	—	—	資本財	
PRAXAIR INC	157	195	1,506	138,917	素材	
QUANTA SERVICES INC	222	—	—	—	資本財	
REGAL BELOIT CORP	548	—	—	—	資本財	
REPUBLIC SERVICES INC	665	744	1,976	182,236	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	—	397	1,676	154,550	資本財	
ROPER INDUSTRIES INC	230	371	1,806	166,549	資本財	
SPX CORP	138	—	—	—	資本財	
SHAW GROUP INC	561	146	456	42,066	資本財	
SUNTECH POWER HOLDINGS-ADR	—	187	294	27,137	資本財	
TENNECO INC	1,527	105	162	14,937	自動車・自動車部品	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	666	738	3,385	312,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M COMPANY	271	630	4,613	425,322	資本財	
TRINITY INDUSTRIES INC	—	3	5	503	資本財	
URS CORP	—	168	743	68,587	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	140	147	906	83,554	資本財	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	269	241	1,054	97,235	ヘルスケア機器・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	463	211	805	74,260	ソフトウェア・サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	470	138	414	38,194	商業・専門サービス	
WATERS CORP	269	514	2,746	253,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	318	460	1,374	126,684	資本財	
YINGLI GREEN ENERGY HOLD-ADR	—	742	976	90,030	資本財	
TYCO INTERNATIONAL LTD	372	—	—	—	資本財	
COSAN LTD-CLASS A SHARES	777	777	620	57,168	食品・飲料・タバコ	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	—	536	1,906	175,742	資本財	
INGERSOLL-RAND PLC	—	183	581	53,621	資本財	
TYCO INTERNATIONAL LTD	—	416	1,359	125,384	資本財	
AMDOCS LTD	755	686	1,771	163,323	ソフトウェア・サービス	
COOPER INDUSTRIES LTD-CL A (アメリカ……米国店頭市場)	300	—	—	—	資本財	
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES	1,106	693	823	75,970	半導体・半導体製造装置	
APOGEE ENTERPRISES INC	519	520	709	65,408	資本財	
APPLIED MATERIAL INC	—	201	279	25,780	半導体・半導体製造装置	
AUTODESK INC	521	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
BLACKBAUD INC	536	412	830	76,553	ソフトウェア・サービス	

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		
CISCO SYSTEMS INC	526	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CITRIX SYSTEMS INC	340	263	945	87,213	ソフトウェア・サービス	
CLEAN HARBORS INC	229	319	1,900	175,206	商業・専門サービス	
CLEAN ENERGY FUELS CORP	—	409	525	48,419	エネルギー	
CREE INC	—	118	446	41,173	半導体・半導体製造装置	
EBAY INC	564	317	721	66,494	ソフトウェア・サービス	
ENERGY CONVERSION DEVICES	—	290	357	32,994	資本財	
ENTEGRIS INC	1,523	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
GT SOLAR INTERNATIONAL INC	—	442	240	22,173	資本財	
IDEXX LABORATORIES INC	68	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
INSITUFORM TECHNOLOGIES-CL A	477	—	—	—	資本財	
INNOSPEC INC	—	53	73	6,743	素材	
ITRON INC	172	227	1,365	125,890	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JA SOLAR HOLDINGS CO LTD-ADR	—	886	341	31,532	資本財	
LKQ CORP	996	794	1,373	126,647	小売	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	—	250	690	63,638	半導体・半導体製造装置	
MKS INSTRUMENTS INC	3	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
NORTHERN TRUST CORP	237	184	1,083	99,938	各種金融	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	233	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
T ROWE PRICE GROUP INC	178	—	—	—	各種金融	
SCHNITZER STEEL INDS INC-A	254	81	462	42,684	素材	
STAPLES INC	—	256	576	53,189	小売	
STERICYCLE INC	177	206	1,009	93,066	商業・専門サービス	
SUNPOWER CORP-CLASS B	300	291	697	64,338	資本財	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	311	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VCA ANTECH INC	237	182	455	41,979	ヘルスケア機器・サービス	
VEECO INSTRUMENTS INC	138	718	1,595	147,129	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	36,641 94	31,139 85	88,853 —	8,192,272 <34.7%>	—
(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	—	—	—	—	資本財
CAN HYDRO DEVELOPERS INC	1,163	—	—	—	—	公益事業
SHOPPERS DRUG MART CORP	—	195	847	72,431	—	食品・生活必需品小売り
STANTEC INC	370	—	—	—	—	商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,201 3	195 1	847 —	72,431 <0.3%>	—
(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	2,851	—	—	—	—	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,851 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	123	693	1,426	71,772	—	公益事業
NATURA COSMETICOS SA	23	—	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	1,837	956	1,238	62,303	—	運輸
TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	830	830	1,681	84,583	—	公益事業
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	387	405	1,203	60,544	—	公益事業
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	—	396	1,099	55,314	—	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,200 5	3,280 5	6,650 —	334,517 <1.4%>	—

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		
(ユーロ……ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GEA GROUP AG	—	596	798	107,193	資本財	
SGL CARBON AG	—	139	352	47,331	資本財	
VOSSLOH AG	74	48	393	52,791	資本財	
SIEMENS AG-REG	390	128	811	108,858	資本財	
LINDE AG	206	132	942	126,535	素材	
DEUTSCHE BOERSE AG	67	—	—	—	各種金融	
REPOWER SYSTEMS AG-REG'D	—	18	195	26,246	資本財	
PHOENIX SOLAR AG	—	46	165	22,171	資本財	
NORDEX AG	—	119	150	20,188	資本財	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	259	259	807	108,357	資本財	
Q-CELLS SE	—	94	114	15,430	資本財	
WACKER CHEMIE AG	30	37	342	45,915	素材	
CROPENERGIES AG	68	—	—	—	エネルギー	
SYMRISE AG	726	726	904	121,392	素材	
GERRESHEIMER AG	136	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHONGDE WASTE TECHNOLOGY AG	—	266	320	42,985	資本財	
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	158	76	453	60,839	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,119	2,688	6,751	906,238	
	銘 柄 数 <比 率>	10	14	—	< 3.8%>	—
(ユーロ……イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ACEA SPA	1,081	213	188	25,338	公益事業	
ENEL SPA	3,188	4,472	1,845	247,690	公益事業	
ACTELIOS SPA	47	—	—	—	公益事業	
HERA SPA	7,913	6,892	1,192	160,071	公益事業	
LANDI RENZO SPA	2,332	2,332	703	94,435	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,563	13,910	3,930	527,536	
	銘 柄 数 <比 率>	5	4	—	< 2.2%>	—
(ユーロ……フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	712	843	2,099	281,730	公益事業	
RECYLEX SA	36	—	—	—	素材	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	313	263	1,810	242,964	資本財	
NATUREX	169	169	526	70,634	食品・飲料・タバコ	
SECHE ENVIRONNEMENT	128	106	564	75,831	商業・専門サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEXANS SA	163	262	1,477	198,259	資本財	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	—	386	1,284	172,396	資本財	
SAFT GROUPE SA	306	306	1,068	143,428	資本財	
ALSTOM	148	—	—	—	資本財	
ARKEMA	204	76	181	24,298	素材	
LEGRAND SA	592	459	826	110,881	資本財	
EDF ENERGIES NOUVELLES SA	279	—	—	—	公益事業	
VINCI SA	—	235	926	124,311	資本財	
RHODIA SA - REGR	2,100	741	657	88,270	素材	
AIR LIQUIDE	185	—	—	—	素材	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	886	367	542	72,789	公益事業	
NATUREX - RTS	169	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,408	4,218	11,963	1,605,796	
	銘 柄 数 <比 率>	16	12	—	< 6.8%>	—

銘柄	株数	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	
(ユーロ……オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
QIAGEN N.V.	547	367	524	70,429	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCADIS NV	—	68	84	11,315	資本財	
PHILIPS ELECTRONICS NV	265	960	1,633	219,216	資本財	
WAVIN NV	2,285	8,384	1,278	171,626	資本財	
BOSKALIS WESTMINSTER	175	—	—	—	資本財	
GRONTMIJ-CVA	297	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,572 5	9,780 4	3,521 —	472,589 < 2.0%>	———
(ユーロ……スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,644	1,094	1,360	182,599	銀行	
VALLEHERMOSO SA	—	456	509	68,358	資本財	
ABENGOA SA	616	—	—	—	資本財	
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	803	1,068	1,706	229,014	資本財	
IBERDROLA SA	968	968	626	84,126	公益事業	
IBERDROLA RENOVABLES	3,416	2,224	742	99,714	公益事業	
EDP RENOVAVEIS SA	1,700	1,127	789	105,961	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,148 6	6,939 6	5,735 —	769,774 < 3.3%>	———
(ユーロ……ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UMICORE	664	273	522	70,193	素材	
SOLVAY SA	42	—	—	—	素材	
HAMON SA	—	146	410	55,065	資本財	
BEKAERT NV	194	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	901 3	419 2	933 —	125,258 < 0.5%>	———
(ユーロ……オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BWT AG	433	433	791	106,180	商業・専門サービス	
MAYR-MELNHOF KARTON AG	97	6	43	5,810	素材	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	283	222	796	106,917	公益事業	
ZUMTOBEL AG	600	170	199	26,762	資本財	
A-TEC INDUSTRIES AG	—	34	41	5,507	資本財	
ANDRITZ AG	339	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,753 5	866 5	1,871 —	251,178 < 1.1%>	———
(ユーロ……フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
WARTSILA OYJ	221	—	—	—	資本財	
METSO OYJ	23	—	—	—	資本財	
NESTE OIL OYJ	466	—	—	—	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	712 3	— —	— —	— < -%>	———
(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)	2,183	1,305	801	107,538	資本財	
KINGSPAN GROUP PLC (アイルランド市場取引)	3,568	2,748	1,703	228,688	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,752 2	4,054 2	2,505 —	336,227 < 1.4%>	———
(ユーロ……ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ELLAKTOR SA	277	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	277 1	— —	— —	— < -%>	———

銘 柄	株 数	期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ……ポルトガル) MOTA ENGLI SGPS SA	百株 —	百株 3,268	千ユーロ 1,120	千円 150,354	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	3,268 1	1,120 —	150,354 < 0.6%>	—
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	45,209 56	46,146 50	38,332 —	5,144,952 <21.8%>	—
(イギリス……ロンドン市場) ARM HOLDINGS PLC	百株 3,788	百株 —	千ポンド —	千円 —	半導体・半導体製造装置	
ATKINS(W S) PLC	104	149	99	15,125	商業・専門サービス	
SPECTRIS PLC	1,119	637	454	69,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC	1,066	565	802	122,420	銀行	
IMI PLC	—	1,041	473	72,207	資本財	
KELLER GROUP PLC	—	90	64	9,854	資本財	
RICARDO PLC	1,633	—	—	—	商業・専門サービス	
ROTORK PLC	95	453	454	69,369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	386	—	—	—	公益事業	
SHANKS GROUP PLC	—	3,724	365	55,768	商業・専門サービス	
SIG PLC	1,318	—	—	—	資本財	
SMITH (DAVID S) HOLDINGS PLC	7,099	6,060	566	86,316	素材	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	515	502	504	76,976	資本財	
BG GROUP PLC	917	791	867	132,235	エネルギー	
WSP GROUP PLC	61	—	—	—	資本財	
NORTHUMBRIAN WATER GROUP PLC	1,342	—	—	—	公益事業	
RENESOLA LTD	1,961	3,474	660	100,687	半導体・半導体製造装置	
VODAFONE GROUP PLC	—	8,899	1,231	187,759	電気通信サービス	
PENNON GROUP PLC	1,266	2,509	1,183	180,451	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	639	—	—	—	公益事業	
PV CRYSTALOX SOLAR PLC	4,763	883	69	10,638	資本財	
HANSEN TRANSMISSIONS INT'L	—	5,362	674	102,836	資本財	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,580	1,781	826	126,084	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	30,659 18	36,927 16	9,298 —	1,417,993 < 6.0%>	—
(スイス……チューリッヒ市場) ABB LTD-REG	百株 —	百株 393	千スイスフラン 829	千円 73,443	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	99	76	1,265	112,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
(スイス……スイス電子市場) FISCHER (GEORG)-REG	23	—	—	—	資本財	
CIBA HOLDING AG	374	—	—	—	素材	
SYNTHESE INC	116	132	1,674	148,247	ヘルスケア機器・サービス	
(スイス……V I R T - X 市場) SGS SA-REG	8	5	711	62,960	商業・専門サービス	
NESTLE SA-REG	432	388	1,683	149,115	食品・飲料・タバコ	
GEBERIT AG-REG	202	40	644	57,110	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,256 7	1,037 6	6,809 —	602,962 < 2.6%>	—
(スウェーデン……ストックホルム市場) CARDO AB	百株 —	百株 385	千スウェーデンクローネ 7,075	千円 93,109	資本財	
SKANSKA AB-B SHS	548	635	6,605	86,929	資本財	
ALFA LAVAL AB	1,111	394	3,268	43,010	資本財	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	278	584	3,912	51,492	資本財	

銘柄	株数	株数	期末		業種等		
			株数	株数		評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
SKF AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS	百株 1,454 —	百株 465 274	千円 5,352 2,554	千円 70,441 33,617	資本財 資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,393 4	2,738 6	28,769 —	378,600 <1.6%>	—	
(ノルウェー……オスロ市場)	百株	百株	千ノルウェークロネ	千円			
TOMRA SYSTEMS ASA	4,472	—	—	—	商業・専門サービス		
RENEWABLE ENERGY CORP AS	—	476	2,099	32,809	資本財		
NORSK HYDRO A S	1,393	909	3,412	53,334	素材		
ORKLA ASA	584	—	—	—	資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,449 3	1,385 2	5,511 —	86,144 <0.4%>	—	
(デンマーク……コペンハーゲン市場)	百株	百株	千デンマーククロネ	千円			
DANISCO A/S	—	129	3,412	61,536	食品・飲料・タバコ		
NOVOZYMES A/S-B SHARES	152	109	5,081	91,618	素材		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	131	274	10,929	197,051	資本財		
NOVO NORDISK A/S-B	587	404	12,976	233,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
COLOPLAST-B	169	75	3,104	55,971	ヘルスケア機器・サービス		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,040 4	993 5	35,504 —	640,142 <2.7%>	—	
(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			
COFFEY INTERNATIONAL LTD	8,062	8,620	1,844	146,892	商業・専門サービス		
COCHLEAR LIMITED	156	120	729	58,081	ヘルスケア機器・サービス		
TRANSFIELD SERVICES LIMITED	3,543	—	—	—	商業・専門サービス		
TRANSPACIFIC INDUSTRIES GROUP	4,863	12,971	2,023	161,132	商業・専門サービス		
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	807	703	1,667	132,801	素材		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,432 5	22,415 4	6,265 —	498,906 <2.1%>	—	
(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	1,912	—	—	—	公益事業		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,912 1	— —	— —	— <-%>	—	
(香港……香港市場)	百株	百株	千香港ドル	千円			
CLP HOLDINGS LIMITED	3,949	3,394	17,733	211,030	公益事業		
HENGAN INTL GROUP CO LTD	1,257	417	1,860	22,134	家庭用品・パーソナル用品		
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	—	1,762	7,356	87,540	資本財		
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	1,529	754	3,208	38,178	公益事業		
CHINA WATER AFFAIRS GROUP	24,320	—	—	—	公益事業		
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING	12,356	—	—	—	素材		
GUANGDONG INVESTMENT LTD	—	6,100	2,385	28,382	公益事業		
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	—	29,433	16,276	193,689	自動車・自動車部品		
CHINA HIGH SPEED TRANSMISSION	4,851	—	—	—	資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	48,262 6	41,860 6	48,819 —	580,956 <2.5%>	—	
(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	3,699	1,113	72,103	公益事業		
BIO-TREAT TECHNOLOGY LTD	33,790	—	—	—	商業・専門サービス		
NOBLE GROUP LTD	—	7,840	1,756	113,728	資本財		
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,301	8,511	2,868	185,745	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	
SINO-ENVIRONMENT TECH GROUP EPURE INTERNATIONAL LIMITED	百株 11,693 27,670	百株 — 27,670	千シンガポールドル — 1,757	千円 — 113,786	公益事業 公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 47,720	外貨建金額 7,494	邦貨換算金額 485,363 < 2.1%>	—
(フィリピン……フィリピン証券市場) MANILA WATER COMPANY	百株 36,397	百株 54,151	千フィリピンペソ 87,995	千円 168,071	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 54,151	外貨建金額 87,995	邦貨換算金額 168,071 < 0.7%>	—
(韓国……韓国市場) HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HYUNDAI STEEL CO HYOSUNG CORPORATION (韓国……韓国店頭市場) WOONGJIN COWAY CO LTD TAEWOONG CO LTD SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	百株 4 — — — — 24 —	百株 9 82 15 50 88 108	千韓国ウォン 184,943 651,592 135,597 188,330 686,400 1,029,040	千円 13,926 49,064 10,210 14,181 51,685 77,486	資本財 素材 素材 耐久消費財・アパレル 資本財 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>	株数 354 6	外貨建金額 2,875,902	邦貨換算金額 216,555 < 0.9%>	—
(台湾……台湾市場) DELTA ELECTRONICS INC	百株 5,810	百株 8,272	千新台幣ドル 76,517	千円 216,545	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>	株数 8,272 1	外貨建金額 76,517	邦貨換算金額 216,545 < 0.9%>	—
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 298,899 216	外貨建金額 —	邦貨換算金額 19,036,418 < 80.7%>	—

(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) 外国投資信託受益証券、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 14,800	口 36,783	千米ドル 1,095	千円 101,029
合 計	口 数 ・ 金 額	14,800	36,783	1,095	101,029
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.4%>

(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。

## (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
国 内		百万円	
株 式 先 物 取 引			
日経平均		146	—
外 国			
株 式 先 物 取 引			
CAC40 10 EUR		179	—
S&P500 EMINI		223	—
E-MINI MSCI EMERGING		138	—
MDAX INDEX		198	—
S&P 500		71	—
FTSE 100 INDEX		99	—

(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) 一印は組入れなし。

◆投資信託財産の構成 (2009年9月10日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 21,823,080	% 89.2
投 資 証 券	101,029	0.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,535,166	10.4
投 資 信 託 財 産 総 額	24,459,275	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 (20,854,885千円) の投資信託財産総額 (24,459,275千円) に対する比率は85.3%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相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2009年9月10日における邦貨換算レートは1米ドル=92.20円、1カナダドル=85.49円、1ブラジルレアル=50.30円、1ユーロ=134.22円、1ポンド=152.50円、1スイスフラン=88.55円、1スウェーデンクローネ=13.16円、1ノルウェークローネ=15.63円、1デンマーククローネ=18.03円、1オーストラリアドル=79.63円、1ニュージーランドドル=64.48円、1香港ドル=11.90円、1シンガポールドル=64.76円、1フィリピンペソ=1.91円、100韓国ウォン=7.53円、1新台幣ドル=2.83円です。

◆資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2009年9月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	45,769,336,675円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	810,472,522
株 式 (評価額)	21,823,080,614
投 資 証 券 (評価額)	101,029,585
未 収 入 金	22,885,426,046
未 収 配 当 金	34,420,306
未 収 利 息	973
差 入 委 託 証 拠 金	114,906,629
(B) 負 債	22,190,604,707
未 払 金	21,860,161,448
未 払 解 約 金	93,561,946
未 払 信 託 報 酬	230,290,601
そ の 他 未 払 費 用	6,590,712
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	23,578,731,968
元 本	33,363,844,752
次 期 繰 越 損 益 金	△ 9,785,112,784
(D) 受 益 権 総 口 数	33,363,844,752口
1万口当たり基準価額 (C / D)	7,067円

<注記事項>

期首元本額	40,627,652,456円
期中追加設定元本額	254,119,547円
期中解約元本額	7,517,927,251円
計算口数当りの純資産額	7,067円

◆損益の状況

当期 (自2009年3月11日 至2009年9月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	306,797,494円
受 取 配 当 金	301,359,498
受 取 利 息	172,803
そ の 他 収 益 金	5,265,193
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,884,497,336
売 買 損 益	10,243,977,029
売 買 損 益	△ 2,359,479,693
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	723,053,900
取 引 損 益	783,081,603
取 引 損 益	△ 60,027,703
(D) 信 託 報 酬 等	△ 248,166,375
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	8,666,182,355
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 17,977,475,383
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 473,819,756
(配 当 等 相 当 額)	( 11,339,648)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 485,159,404)
(H) 計 (E + F + G)	△ 9,785,112,784
(I) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (H + I)	△ 9,785,112,784
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 473,819,756
(配 当 等 相 当 額)	( 11,339,648)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 485,159,404)
分 配 準 備 積 立 金	298,260,571
繰 越 損 益 金	△ 9,609,553,599

(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。

