

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
1	7203	東1	輸送機	トヨタ自動車	3.15	919,445
2	9432	東1	情通	日本電信電話	3.15	735,243
3	9437	東1	情通	NTTドコモ	3.15	538,574
4	9433	東1	情通	KDDI	2.90	405,383
5	9501	東1	電力	東京電力	0.23	396,853
6	2914	東1	食料品	日本たばこ産業	2.83	346,946
7	6752	東1	電気	パナソニック	0.87	329,199
8	6758	東1	電気	ソニー	1.46	320,502
9	9022	東1	陸運	東海旅客鉄道	1.39	314,394
10	4568	東1	医薬品	第一三共	0.61	249,403
11	7270	東1	輸送機	富士重工業	1.11	248,926
12	5401	東1	鉄鋼	新日鐵住金	0.65	191,150
13	7751	東1	電気	キヤノン	1.38	174,470
14	5108	東1	ゴム	ブリヂストン	1.03	172,420
15	6902	東1	輸送機	デンソー	1.26	167,107
16	4502	東1	医薬品	武田薬品工業	1.28	164,508
17	8001	東1	卸売	伊藤忠商事	0.69	156,173
18	4503	東1	医薬品	アステラス製薬	1.30	153,019
19	4901	東1	化学	富士フイルムホールディングス	0.68	152,630
20	6201	東1	輸送機	豊田自動織機	0.54	151,254
21	6503	東1	電気	三菱電機	0.92	138,307
22	7261	東1	輸送機	マツダ	0.33	138,005
23	9020	東1	陸運	東日本旅客鉄道	1.31	130,384
24	4063	東1	化学	信越化学工業	1.07	128,487
25	6981	東1	電気	村田製作所	1.02	125,043
26	6954	東1	電気	ファナック	1.24	121,140
27	6367	東1	機械	ダイキン工業	0.93	116,677
28	6326	東1	機械	クボタ	0.66	113,563
29	3382	東1	小売	セブン&アイ・ホールディングス	1.34	105,905
30	6701	東1	電気	日本電気	0.26	101,313
31	9101	東1	海運	日本郵船	0.11	100,644
32	4689	東1	情通	ヤフー	0.91	100,070
33	7741	東1	精密	HOYA	0.52	99,648
34	8804	東1	不動産	東京建物	0.10	98,244
35	4452	東1	化学	花王	0.98	97,576
36	4005	東1	化学	住友化学	0.27	94,016
37	9983	東1	小売	ファーストリテイリング	1.25	90,573
38	6861	東1	電気	キーエンス	1.56	86,042
39	5411	東1	鉄鋼	ジェイ エフ イー ホールディングス	0.29	84,255
40	6971	東1	電気	京セラ	0.65	83,791
41	6301	東1	機械	小松製作所	0.69	80,733
42	8035	東1	電気	東京エレクトロン	0.52	80,691
43	6723	東1	電気	ルネサスエレクトロニクス	0.36	79,834
44	6273	東1	機械	SMC	0.64	79,544
45	4661	東1	サービス	オリエンタルランド	0.83	77,322
46	2503	東1	食料品	麒麟ホールディングス	0.57	74,879
47	7211	東1	輸送機	三菱自動車工業	0.17	74,418
48	7011	東1	機械	三菱重工業	0.53	74,312
49	2502	東1	食料品	アサヒグループホールディングス	0.59	72,781
50	7202	東1	輸送機	いすゞ自動車	0.40	72,335
51	5711	東1	非鉄金	三菱マテリアル	0.13	71,154
52	6594	東1	電気	日本電産	0.99	70,745
53	6724	東1	電気	セイコーエプソン	0.26	69,162
54	5802	東1	非鉄金	住友電気工業	0.40	68,948
55	4523	東1	医薬品	エーザイ	0.63	68,171

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
56	5406	東1	鉄鋼	神戸製鋼所	0.12	67,908
57	6702	東1	電気	富士通	0.32	61,778
58	6502	東1	電気	東芝	0.40	59,991
59	4508	東1	医薬品	田辺三菱製薬	0.38	59,236
60	9201	東1	空運	日本航空	0.41	57,699
61	3863	東1	紙パ	日本製紙	0.08	57,119
62	8053	東1	卸売	住友商事	0.48	57,109
63	1812	東1	建設	鹿島建設	0.28	56,683
64	3659	東1	情通	ネクソン	0.24	54,590
65	3765	東1	情通	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.09	53,919
66	1801	東1	建設	大成建設	0.38	53,669
67	4911	東1	化学	資生堂	0.41	52,448
68	5233	東1	ガ土石	太平洋セメント	0.13	52,295
69	4519	東1	医薬品	中外製薬	0.76	52,067
70	4042	東1	化学	東ソー	0.12	51,822
71	4188	東1	化学	三菱ケミカルホールディングス	0.30	51,608
72	6988	東1	化学	日東電工	0.42	51,126
73	1878	東1	建設	大東建託	0.47	50,344
74	4507	東1	医薬品	塩野義製薬	0.66	49,861
75	3291	東1	不動産	飯田グループホールディングス	0.21	49,411
76	4204	東1	化学	積水化学工業	0.27	49,204
77	4543	東1	精密	テルモ	0.59	48,867
78	7269	東1	輸送機	スズキ	0.55	48,157
79	9531	東1	電力	東京瓦斯	0.37	48,108
80	4612	東1	化学	日本ペイントホールディングス	0.33	47,951
81	7205	東1	輸送機	日野自動車	0.22	47,298
82	7201	東1	輸送機	日産自動車	1.56	45,956
83	6504	東1	電気	富士電機	0.12	44,718
84	6098	東1	サービス	リクルートホールディングス	0.78	44,510
85	9613	東1	情通	エヌ・ティ・ティ・データ	0.50	44,062
86	7013	東1	機械	IHI	0.16	43,860
87	5713	東1	非鉄金	住友金属鉱山	0.25	43,158
88	9042	東1	陸運	阪急阪神ホールディングス	0.34	43,057
89	6305	東1	機械	日立建機	0.13	42,747
90	6586	東1	機械	マキタ	0.36	42,664
91	9064	東1	陸運	ヤマトホールディングス	0.37	41,967
92	7752	東1	電気	リコー	0.24	41,790
93	6471	東1	機械	日本精工	0.17	41,144
94	5110	東1	ゴム	住友ゴム工業	0.14	41,106
95	3407	東1	化学	旭化成	0.39	41,080
96	7309	東1	輸送機	シマノ	0.53	40,388
97	8802	東1	不動産	三菱地所	0.94	40,187
98	4506	東1	医薬品	大日本住友製薬	0.27	39,553
99	5201	東1	ガ土石	旭硝子	0.25	39,040
100	7832	東1	他製品	バンダイナムコホールディングス	0.21	38,594
101	5486	東1	鉄鋼	日立金属	0.17	37,710
102	1963	東1	建設	日揮	0.14	37,486
103	6645	東1	電気	オムロン	0.26	37,361
104	9107	東1	海運	川崎汽船	0.08	36,660
105	5333	東1	ガ土石	日本碍子	0.29	35,965
106	4631	東1	化学	DIC	0.08	35,106
107	7272	東1	輸送機	ヤマハ発動機	0.22	35,053
108	2131	東1	サービス	アコーディア・ゴルフ	0.04	34,701
109	3405	東1	化学	クラレ	0.16	34,327
110	9735	東1	サービス	セコム	0.64	34,136

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
111	4151	東1	医薬品	協和発酵キリン	0.37	34,032
112	8050	東1	精密	セイコーホールディングス	0.02	33,630
113	9024	東1	陸運	西武ホールディングス	0.22	33,595
114	6952	東1	電気	カシオ計算機	0.14	33,487
115	1808	東1	建設	長谷工コーポレーション	0.12	32,960
116	4680	東1	サービス	ラウンドワン	0.02	32,941
117	6473	東1	機械	ジェイテクト	0.18	32,528
118	7731	東1	精密	ニコン	0.21	32,396
119	6302	東1	機械	住友重機械工業	0.11	32,210
120	7733	東1	精密	オリンパス	0.43	31,973
121	6963	東1	電気	ローム	0.17	30,981
122	6479	東1	電気	ミネベア	0.12	30,086
123	9007	東1	陸運	小田急電鉄	0.32	29,873
124	9502	東1	電ガ	中部電力	0.40	28,947
125	4716	東1	情通	日本オラクル	0.28	28,605
126	4528	東1	医薬品	小野薬品工業	0.77	28,460
127	3401	東1	繊維	帝人	0.13	28,460
128	4902	東1	電気	コニカミノルタ	0.15	28,152
129	9041	東1	陸運	近鉄グループホールディングス	0.30	27,884
130	2121	東マ	サービス	ミクシィ	0.11	27,867
131	9831	東1	小売	ヤマダ電機	0.18	27,669
132	7951	東1	他製品	ヤマハ	0.20	27,456
133	9532	東1	電ガ	大阪瓦斯	0.31	26,745
134	6770	東1	電気	アルプス電気	0.16	26,743
135	4202	東1	化学	ダイセル	0.14	26,553
136	9533	東1	電ガ	東邦瓦斯	0.17	25,948
137	2651	東1	小売	ローソン	0.28	25,574
138	3436	東1	金属	SUMCO	0.08	25,502
139	9045	東1	陸運	京阪電気鉄道	0.15	25,028
140	7912	東1	他製品	大日本印刷	0.27	24,403
141	6417	東1	機械	SANKYO	0.12	24,304
142	5002	東1	石油	昭和シェル石油	0.12	24,054
143	8036	東1	卸売	日立ハイテクノロジーズ	0.17	23,999
144	2501	東1	食料品	サッポロホールディングス	0.08	23,915
145	5332	東1	ガ土石	TOTO	0.28	23,701
146	4217	東1	化学	日立化成	0.16	23,441
147	2670	東1	小売	エービーシー・マート	0.19	23,439
148	6412	東1	機械	平和	0.07	23,401
149	9678	東1	サービス	カナモト	0.03	23,351
150	2269	東1	食料品	明治ホールディングス	0.58	23,299
151	4768	東1	情通	大塚商会	0.18	23,174
152	5991	東1	金属	日本発條	0.08	22,398
153	6457	東1	機械	グローリー	0.07	22,242
154	7248	東1	輸送機	カルソニックカンセイ	0.08	21,996
155	3099	東1	小売	三越伊勢丹ホールディングス	0.14	21,849
156	9048	東1	陸運	名古屋鉄道	0.19	21,808
157	6841	東1	電気	横河電機	0.13	21,417
158	5714	東1	非鉄金	DOWAホールディングス	0.06	21,132
159	3116	東1	輸送機	トヨタ紡織	0.16	20,903
160	3880	東1	紙パ	大王製紙	0.06	20,699
161	2282	東1	食料品	日本ハム	0.18	20,499
162	9843	東1	小売	ニトリホールディングス	0.51	20,126
163	4307	東1	情通	野村総合研究所	0.31	19,967
164	4704	東1	情通	トレンドマイクロ	0.18	19,912
165	6762	東1	電気	TDK	0.29	19,879

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
166	9401	東1	情通	東京放送ホールディングス	0.10	19,783
167	9005	東1	陸運	東京急行電鉄	0.37	19,757
168	4021	東1	化学	日産化学工業	0.18	19,748
169	2768	東1	卸売	双日	0.11	19,726
170	2212	東1	食料品	山崎製パン	0.22	19,709
171	3861	東1	紙パ	王子ホールディングス	0.15	19,610
172	3632	東1	情通	グリー	0.04	19,470
173	4732	東1	サービス	ユー・エス・エス	0.19	19,402
174	9062	東1	陸運	日本通運	0.19	19,394
175	6465	東1	機械	ホシザキ電機	0.24	19,379
176	2784	東1	卸売	アルフレッサ ホールディングス	0.19	19,261
177	9987	東1	卸売	スズケン	0.12	19,208
178	2681	東1	小売	ゼオホールディングス	0.03	19,127
179	2593	東1	食料品	伊藤園	0.12	19,105
180	6361	東1	機械	荏原製作所	0.09	18,974
181	3231	東1	不動産	野村不動産ホールディングス	0.12	18,869
182	7276	東1	電気	小糸製作所	0.29	18,639
183	8113	東1	化学	ユニ・チャーム	0.46	18,103
184	2801	東1	食料品	キッコーマン	0.27	17,902
185	9719	東1	情通	SCSK	0.16	17,742
186	1803	東1	建設	清水建設	0.29	17,571
187	4684	東1	情通	オービック	0.21	17,534
188	1881	東1	建設	NIPPO	0.08	17,471
189	6395	東1	機械	タダノ	0.05	17,337
190	6869	東1	電気	シスメックス	0.53	17,318
191	3088	東1	小売	マツモトキヨシホールディングス	0.09	17,229
192	7911	東1	他製品	凸版印刷	0.22	17,166
193	1944	東1	建設	きんでん	0.10	17,025
194	9435	東1	情通	光通信	0.14	16,891
195	9009	東1	陸運	京成電鉄	0.16	16,813
196	6923	東1	電気	スタンレー電気	0.16	16,745
197	4530	東1	医薬品	久光製薬	0.19	16,669
198	4613	東1	化学	関西ペイント	0.21	16,584
199	4114	東1	化学	日本触媒	0.09	16,567
200	3626	東1	情通	ITホールディングス	0.08	16,503
201	8129	東1	卸売	東邦ホールディングス	0.06	16,456
202	8227	東1	小売	しまむら	0.20	16,415
203	5101	東1	ゴム	横浜ゴム	0.08	16,245
204	6755	東1	電気	富士通ゼネラル	0.09	16,196
205	1883	東1	建設	前田道路	0.06	16,062
206	8252	東1	小売	丸井グループ	0.15	15,860
207	4739	東1	情通	伊藤忠テクノソリューションズ	0.10	15,859
208	9684	東1	情通	スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.14	15,723
209	7259	東1	輸送機	アイシン精機	0.49	15,636
210	9021	東1	陸運	西日本旅客鉄道	0.44	15,602
211	9989	東1	小売	サンドラッグ	0.21	15,547
212	4062	東1	電気	イビデン	0.07	15,372
213	6703	東1	電気	沖電気工業	0.04	15,252
214	2579	東1	食料品	コカ・コーラウエスト	0.11	15,207
215	4521	東1	医薬品	科研製薬	0.12	15,160
216	6146	東1	機械	ディスコ	0.13	14,988
217	5929	東1	金属	三和ホールディングス	0.09	14,954
218	3668	東1	情通	コロプラ	0.07	14,941
219	1719	東1	建設	安藤・間	0.04	14,886
220	8060	東1	卸売	キヤノンマーケティングジャパン	0.09	14,859

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
221	8282	東1	小売	ケーズホールディングス	0.08	14,798
222	5803	東1	非鉄金	フジクラ	0.06	14,783
223	3086	東1	小売	J. フロント リテイリング	0.11	14,733
224	5232	東1	ガ土石	住友大阪セメント	0.07	14,687
225	6370	東1	機械	栗田工業	0.10	14,643
226	6592	東1	電気	マブチモーター	0.12	14,617
227	9962	東1	卸売	ミスミグループ本社	0.18	14,427
228	5631	東1	機械	日本製鋼所	0.06	14,411
229	1721	東1	建設	コムシスホールディングス	0.09	14,378
230	8840	東1	不動産	大京	0.05	14,284
231	7701	東1	精密	島津製作所	0.16	14,144
232	4185	東1	化学	JSR	0.11	13,874
233	7240	東1	輸送機	NOK	0.12	13,794
234	2875	東1	食料品	東洋水産	0.18	13,792
235	9008	東1	陸運	京王電鉄	0.22	13,738
236	6268	東1	機械	ナブテスコ	0.12	13,675
237	7762	東1	精密	シチズンホールディングス	0.06	13,664
238	7974	東1	他製品	任天堂	1.07	13,637
239	4544	東1	サービス	みらかホールディングス	0.10	13,581
240	9602	東1	情通	東宝	0.20	13,536
241	7313	東1	輸送機	テイ・エス テック	0.06	13,424
242	3105	東1	電気	日清紡ホールディングス	0.06	13,421
243	5463	東1	鉄鋼	丸一鋼管	0.13	13,395
244	4208	東1	化学	宇部興産	0.07	13,250
245	2206	東1	食料品	江崎グリコ	0.15	13,245
246	9086	東1	陸運	日立物流	0.08	13,227
247	1860	東1	建設	戸田建設	0.06	13,076
248	7735	東1	電気	SCREENホールディングス	0.11	12,853
249	2580	東1	食料品	コカ・コーライーストジャパン	0.09	12,761
250	2730	東1	小売	エディオン	0.03	12,703
251	8086	東1	精密	ニプロ	0.08	12,532
252	9449	東1	情通	GMOインターネット	0.05	12,437
253	9766	東1	情通	コナミ	0.20	12,356
254	3197	東1	小売	すかいらーく	0.09	12,347
255	5423	東1	鉄鋼	東京製鐵	0.04	12,149
256	8028	東1	小売	ファミリーマート	0.21	12,136
257	7936	東1	他製品	アシックス	0.13	12,075
258	4205	東1	化学	日本ゼオン	0.07	12,049
259	7459	東1	卸売	メディパルホールディングス	0.15	12,041
260	4967	東1	化学	小林製薬	0.15	11,998
261	3391	東1	小売	ツルハホールディングス	0.20	11,989
262	7230	東1	輸送機	日信工業	0.04	11,958
263	7966	東1	他製品	リンテック	0.06	11,901
264	7649	東1	小売	スギホールディングス	0.12	11,840
265	4061	東1	化学	電気化学工業	0.07	11,831
266	6103	東1	機械	オークマ	0.05	11,754
267	4666	東1	不動産	パーク24	0.18	11,741
268	2002	東1	食料品	日清製粉グループ本社	0.18	11,698
269	4581	東1	医薬品	大正製薬ホールディングス	0.36	11,681
270	6810	東1	電気	日立マクセル	0.03	11,597
271	6756	東1	電気	日立国際電気	0.06	11,585
272	5105	東1	ゴム	東洋ゴム工業	0.05	11,528
273	5413	東1	鉄鋼	日新製鋼	0.05	11,519
274	1824	東1	建設	前田建設工業	0.06	11,423
275	4536	東1	医薬品	参天製薬	0.25	11,333

CVAポートフォリオ  
2016年8月リバランス後の保有銘柄

#	ID	主市場	業種	銘柄名	ウェイト(%)	3期平均CVA(百万円)
276	6506	東1	電気	安川電機	0.13	11,332
277	4569	東1	医薬品	キョーリン製薬ホールディングス	0.06	11,269
278	1911	東1	建設	住友林業	0.09	11,241
279	4272	東1	化学	日本化薬	0.07	11,223
280	5703	東1	非鉄金	日本軽金属ホールディングス	0.04	11,159
281	4043	東1	化学	トクヤマ	0.04	11,148
282	5901	東1	金属	東洋製罐グループホールディングス	0.15	11,134
283	9706	東1	不動産	日本空港ビルデング	0.14	11,077
284	5214	東1	ガ土石	日本電気硝子	0.08	10,872
285	1983	東1	建設	東芝プラントシステム	0.06	10,856
286	4403	東1	化学	日油	0.06	10,821
287	2327	東1	情通	新日鉄住金ソリューションズ	0.07	10,803
288	7984	東1	他製品	コクヨ	0.07	10,763
289	4540	東1	医薬品	ツムラ	0.07	10,761