

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書

**【提出先】** 関東財務局長 殿

**【提出日】** 2018年8月15日

**【発行者名】** 日立投資顧問株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 川手 健

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区神田練塀町3番地

**【事務連絡者氏名】** ファンド管理グループ 都地 雅夫

**【電話番号】** 03-4554-5121

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】** 日立バランスファンド（株式70）  
日立バランスファンド（株式50）  
日立バランスファンド（株式30）

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】** 継続募集額は以下のとおりです。  
日立バランスファンド（株式70）5,000億円を上限とします。  
日立バランスファンド（株式50）5,000億円を上限とします。  
日立バランスファンド（株式30）5,000億円を上限とします。  
合計15,000億円を上限とします。

**【縦覧に供する場所】** 該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

日立バランスファンド（株式70）

日立バランスファンド（株式50）

日立バランスファンド（株式30）

（以下、総称して、またはそれぞれを「当ファンド」もしくは「各ファンド」ということがあります。）

なお、当ファンドは、確定拠出年金向けファンドとしての取得の申込みのみ取扱います。当ファンドの取得申込みについては後記「(12) その他 受益権の取得申込者の制限」をご参照下さい。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権（以下「受益権」といいます。）

なお、当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後記の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者である日立投資顧問株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

日立バランスファンド（株式70） 5,000億円を上限とします。

日立バランスファンド（株式50） 5,000億円を上限とします。

日立バランスファンド（株式30） 5,000億円を上限とします。

合計 15,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

基準価額は、販売会社（後記「(8) 申込取扱場所」参照）または委託者にお問い合わせ下さい。

<お問い合わせ先（委託者）>

日立投資顧問株式会社 電話（03 - 4554 - 5100（代表））

（受付時間は、営業日の午前9時から午後5時までです。）

「基準価額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいい、便宜上1万口当たりをもって表示されることがあります。

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。(当初元本 1口 = 1円)

( 7 ) 【申込期間】

2018年8月16日(木)から2019年8月15日(木)までとします。

ただし、日本における委託者および販売会社（後記「(8) 申込取扱場所」参照）の営業日に限り、申込みの取扱いが行われます。

なお、申込期間は、当該期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

( 8 ) 【申込取扱場所】

以下の場所において申込みの取扱いを行います。なお、取扱店については、以下の販売会社にお問い合わせ下さい。

三菱UFJ信託銀行株式会社 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

(以下、申込みの取扱いを行う場所を「販売会社」といいます。)

( 9 ) 【払込期日】

ファンドの受益権の取得申込者は、お申込みの販売会社の指定した期日までに申込金額を当該販売会社に支払うものとします。

発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社より委託者の指定する口座を経由して、受託者の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は、前記「(8) 申込取扱場所」と同じです。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、次の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込みの方法

1. ファンドの受益権の取得申込みは、申込取扱場所において継続募集期間における毎営業日に販売会社所定の方法により受け付けます。

販売会社による申込みの受付は、原則として毎営業日の午後2時までとし、当該受付時間を過ぎてからの申込みは翌営業日の取扱いとなります。

委託者は、信託財産の効率的な運用が妨げられると委託者が合理的に判断する場合、わが国の証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）および外国の証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情がある場合は、委託者の判断により、受益権の取得申込みの受付を停止することおよび既に受け付けた取得申込みを取消することができます。

2. 受益権の取得申込者は、販売会社との間で、証券投資信託の取引に関する契約または規定に基づいて、取引口座の開設を申込む旨の申込書を提出します。

#### 受益権の取得申込者の制限

確定拠出年金向けファンドとして、確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく取得申込者(事業主と資産管理契約を締結した資産管理機関もしくは国民年金基金連合会(その事務の委託を受けた金融機関を含みます。以下「連合会」といいます。))による申込み(以下「確定拠出年金による取得申込み」といいます。)のみの取扱いとなります。

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)に移行しており、社振法の規定の適用を受け、前記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの償還金、換金代金は、社振法および前記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### (ご参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、親投資信託「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」、「日立国内債券インデックスマザーファンド」、「日立外国株式インデックスマザーファンド」および「日立外国債券インデックスマザーファンド」（以下、総称してまたはそれぞれを「マザーファンド」といいます。）の受益証券に主に投資を行うことを通じて、内外株式および内外債券を実質的な主要投資対象として中長期的に信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。

信託金の限度額は、各ファンドとも5,000億円（合計15,000億円）として信託金を追加することができます。ただし、この限度額は、委託者と受託者の合意のうえ変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において次に属します。

日立バランスファンド（株式70）：追加型投信／内外／資産複合／インデックス型（1）

日立バランスファンド（株式50）：追加型投信／内外／資産複合／インデックス型（1）

日立バランスファンド（株式30）：追加型投信／内外／資産複合／インデックス型（1）

1 当ファンドは、3ファンドとも同一の商品分類に属しており、属性区分においても同様です。そのため、以下の表示は、3ファンドに共通する内容となっております。

下表は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき記載をしており、当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型		不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
	内外	資産複合	

##### < 商品分類表の定義 >

追加型：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外：目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合：目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信（リート）及びその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225
	年2回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
年4回	北米				その他 (合成指数)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			
不動産投信	日々	中南米			
	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東) エマージング			
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券)、 資産配分固定型))					
資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型 資産配分変更型					

## &lt;属性区分表の定義&gt;

その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）、資産配分固定型））：目論見書又は投資信託約款において、投資信託証券を通じて実質的に複数資産（株式、債券）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（日本を含む）：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を含む）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

その他（合成指数）：目論見書又は投資信託約款において、インデックスファンドの対照インデックスが日経225あるいはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。合成指数とは、複数のインデックスを合成し、指数化したものです。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

当ファンドの運用にあたっては、TOPIX（東証株価指数、配当込み）（1）、NOMURA - BPI総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）（2）、MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）（3）ならびにFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（4）を基に、各ファンドに定められた基本資産配分（後記「2 投資方針（1）投資方針」参照）にしたがって委託者が計算する合成指数をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求します。

- 1 TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所（以下「東京証券取引所」といいます。）が算出している日本の株式市場の全体を表す指数です。同指数は、東京証券取引所の知的財産であり、関連するすべての権利は、東京証券取引所が有します。
- 2 NOMURA - BPI総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）は、野村證券株式会社（以下「野村證券」といいます。）が算出している国内債券市場の全体を表す指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利は、野村證券に帰属しています。
- 3 MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc. が算出している日本を除く世界の主要株式市場の動きを表す指数です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。
- 4 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

#### ファンドの特色

1. 当ファンドは、主たる投資対象であるマザーファンドを通して実質的な投資を行います。
2. マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社およびMU投資顧問株式会社に委託します。
3. マザーファンドの運用にあたっては、次表に示した主な投資対象に分散投資を行い、それぞれのベンチマークの動きに連動する投資成果を追求します。

マザーファンド名	ベンチマーク	主な投資対象
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	TOPIX（東証株価指数、配当込み）	国内株式
日立国内債券インデックスマザーファンド	NOMURA - BPI総合	国内債券
日立外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）	外国株式
日立外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	外国債券

## （2）【ファンドの沿革】

2001年12月5日 信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始

証券取引所への上場の予定はありません。

なお、主要投資対象であるマザーファンドは以下のとおりです。

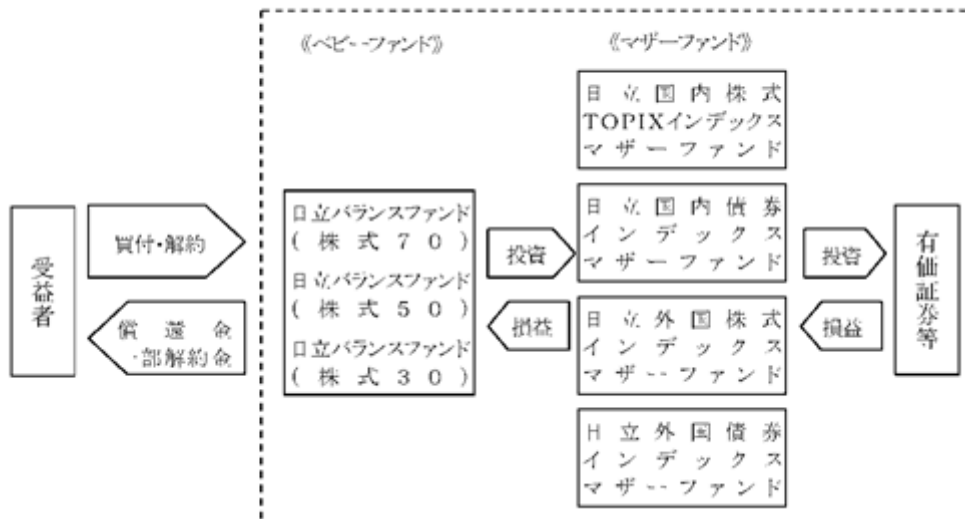
マザーファンド名	設定日
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	2001年 6月22日
日立国内債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立国内債券マザーファンドN」）	2000年 4月28日
日立外国株式インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国株式マザーファンドS」）	2000年 4月 3日
日立外国債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国債券マザーファンドU」）	2001年 3月29日

### （３）【ファンドの仕組み】

#### ファンドの仕組み

各ファンドはファミリーファンド方式により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者はベビーファンド（当ファンド）の受益権に投資し、さらにベビーファンドの資金でマザーファンドの受益証券に投資することにより、ベビーファンドの実質的な運用をマザーファンドにおいて行う仕組みです。

ただし、各ファンドから有価証券等に直接投資する場合があります。また、各ファンド以外のベビーファンドが、各ファンドの投資対象であるマザーファンドへ投資する場合があります。



#### ファンドの関係法人

各ファンドの関係法人の名称および関係業務ならびに契約等の概要は以下のとおりです。

##### 1. 委託者（委託会社）：日立投資顧問株式会社

各ファンドの委託者として、受益権の発行、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。

当社はマザーファンドの委託者でもありますが、マザーファンドの信託財産の運用の指図に関する権限を野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社およびMU投資顧問株式会社（以下、総称してまたはそれぞれを「運用再委託先」といいます。）に委託しております。

マザーファンド名	運用再委託先
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社
日立国内債券インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社
日立外国株式インデックスマザーファンド	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
日立外国債券インデックスマザーファンド	MU投資顧問株式会社

##### 2. 受託者（受託会社）：三菱UFJ信託銀行株式会社

委託者との投資信託契約に基づき、各ファンドの受託者として、信託財産の保管・管理業務などを行い、解約金および償還金の委託者への交付、信託財産に関する報告書を作成し委託者への交付を行います。また、受託者は、信託事務の処理の一部につき金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた金融機関に委託することがあります。

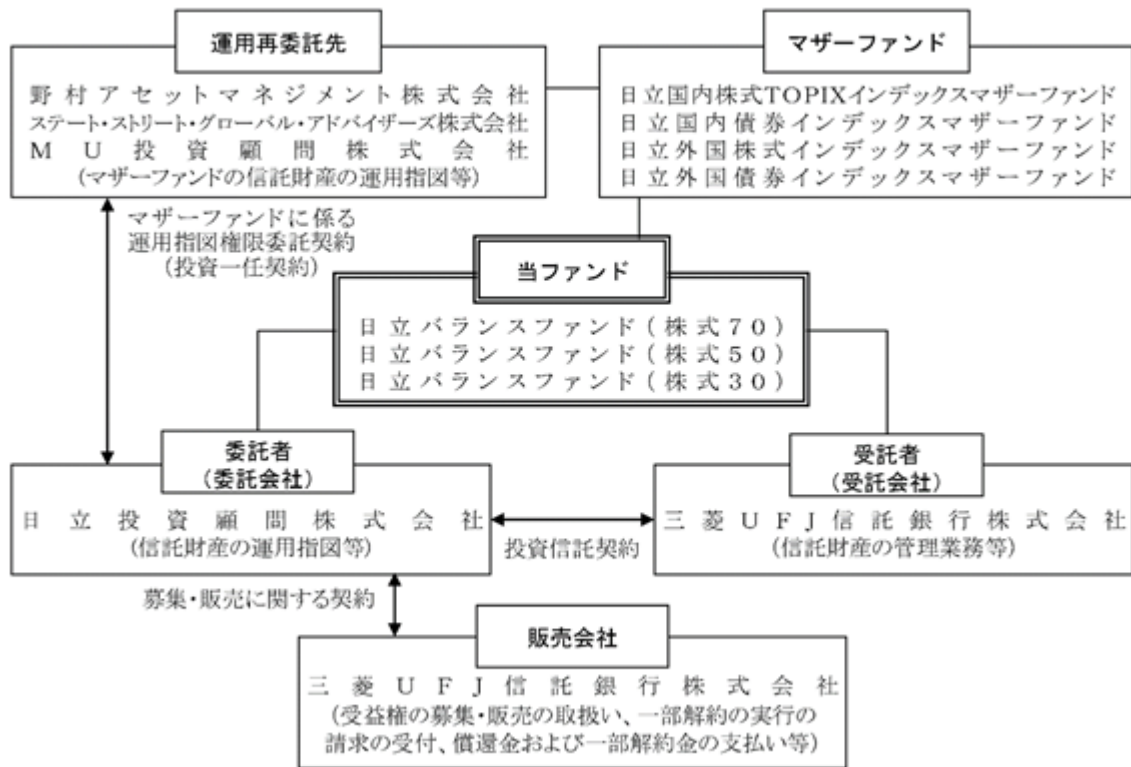
##### 3. 販売会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

委託者との募集・販売に関する契約に基づき、各ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い（確定拠出年金による取得申込みに限ります。）、一部解約の実行の請求の受付、償還金の支払い等を行います。



4. 運用再委託先：野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社、MU投資顧問株式会社  
 委託者との投資一任契約に基づき、当ファンドの主たる投資対象であるマザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

ファンドの関係法人図

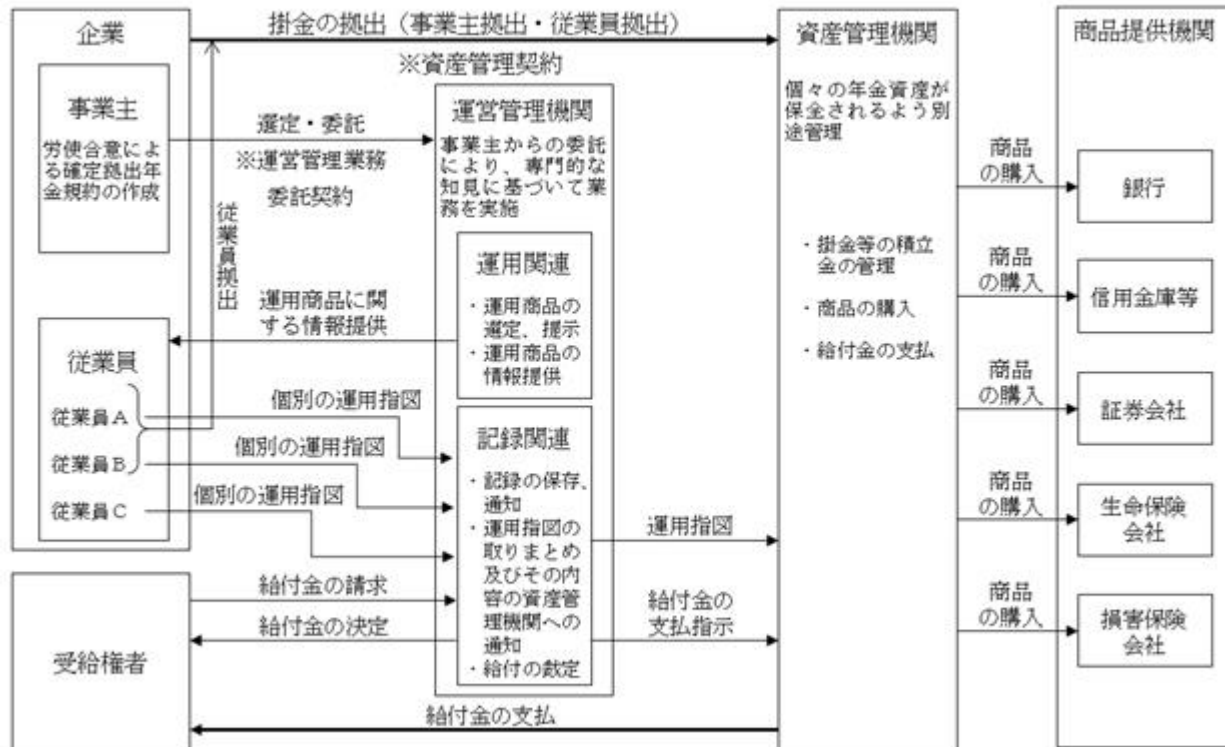


（ご参考）

当ファンドは、確定拠出年金向けのファンドです。以下は、確定拠出年金制度（企業型年金）の概要を図示したものです。（厚生労働省「確定拠出年金制度の概要」より抜粋）

制度の詳細は関係法令等によりご確認下さい。

確定拠出年金（企業型年金）制度のイメージ図



(注) 運営管理機関は、資産管理機関及び商品提供機関を兼ねることが可能。また、事業主は運営管理業務を行うことが可能。

各ファンドの販売会社は、図における「商品提供機関」に、また各ファンドの受益者は、図における「資産管理機関」に該当します。

確定拠出年金による取得申込みについては、各事業主が定める確定拠出年金に係る規約等にしたいがい、資産管理機関が行うこととなります。また、確定拠出年金の加入者等は、確定拠出年金に係る規約等にしたいがい、個別の運用商品の配分の指図を運営管理機関に対して行います。

#### 委託会社の概況（2018年8月15日現在）

1. 資本の額  
3億円
2. 委託会社の沿革
  - 1999年 8月 5日 会社設立
  - 1999年 8月31日 投資顧問業者登録
  - 2000年 1月27日 投資一任契約に係る業務の認可取得、証券投資信託委託業の認可取得
  - 2007年 9月30日 投資助言・代理業、投資運用業の登録
3. 大株主の状況
  - 株主名 株式会社 日立製作所
  - 住所 東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
  - 所有株数 6,000株
  - 所有割合 100%

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

次表の異なるベンチマークを持つ4本のマザーファンドに主として投資を行うことで、 に記載の複合ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求します。

マザーファンド名	ベンチマーク	主な投資対象
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	TOPIX（東証株価指数、配当込み）	国内株式
日立国内債券 インデックスマザーファンド	NOMURA - BPI総合	国内債券
日立外国株式 インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）	外国株式
日立外国債券 インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	外国債券

それぞれのマザーファンドの受益証券への信託財産の基本資産配分は、次のとおりとし、 に記載のそれぞれのマザーファンドのベンチマークを、この基本資産配分割合で加重平均したものを複合ベンチマークと呼びます。

マザーファンド名	ファンド名		
	日立 バランスファンド （株式70）	日立 バランスファンド （株式50）	日立 バランスファンド （株式30）
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	40%	30%	20%
日立国内債券 インデックスマザーファンド	20%	40%	60%
日立外国株式 インデックスマザーファンド	30%	20%	10%
日立外国債券 インデックスマザーファンド	10%	10%	10%

それぞれのマザーファンドの受益証券への実際の資産配分は、マザーファンド毎の基本資産配分に±5%の範囲で上限と下限を設け、その範囲内となるようにします。

マザーファンドの受益証券の組入比率はできるだけ高位を保ちます。

外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります。また、目的が達成されない場合があります。

有価証券の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引ならびに外国為替予約取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

複合ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、実質組入有価証券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドが投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### 運用の指図範囲

）委託者は、信託金を、主としてマザーファンドの受益証券に投資するほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
- ） 委託者は、信託金を、（ ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
- ）（ ）の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記（ ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ） デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、当該比率を超えることとなつた場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### （3）【運用体制】

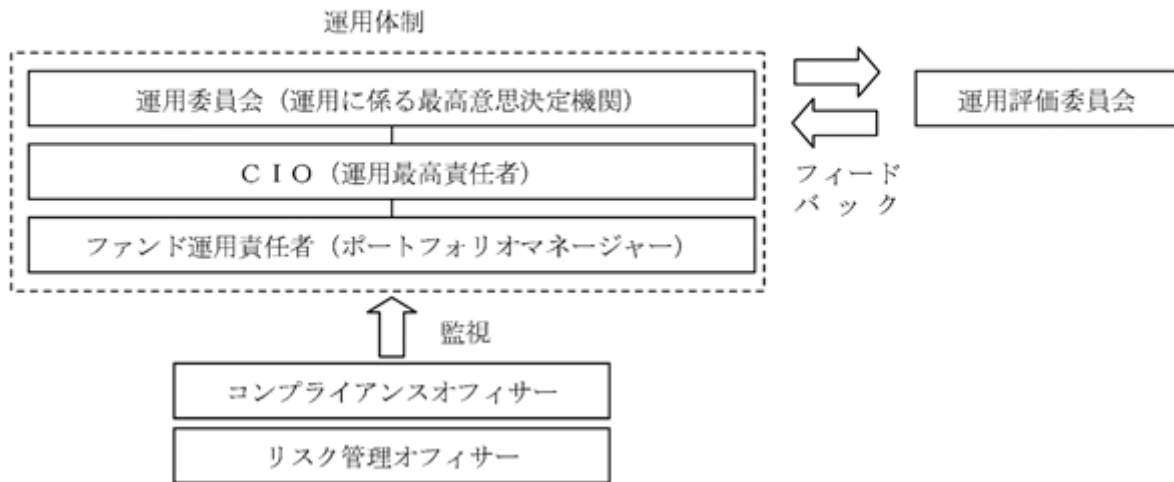
運用委員会は、当社の運用方針策定のための最高意思決定機関で、当ファンドに関する運用方針を策定します。2018年6月末現在10名程度出席。

運用評価委員会は、運用再委託先を含む、運用成績、資産配分、リスクおよびポートフォリオの内容等運用状況についての分析および評価を行います。2018年6月末現在10名程度出席。

運用グループは、運用再委託先と連携して運用方針に基づく運用を行います。2018年6月末現在11名在籍。

コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーは、諸法令、投資信託約款等の遵守状況や運用リスクの状況などを定期的に監視しています。2018年6月末現在コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーは各1名在籍。

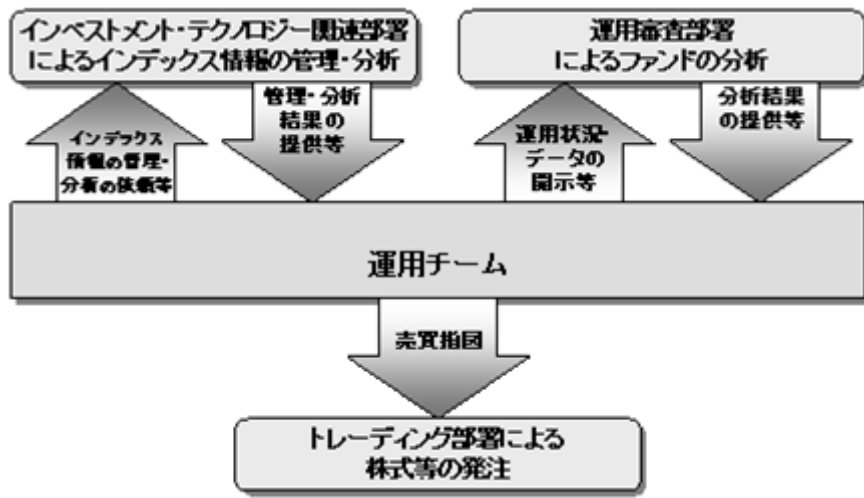
## 運用体制図



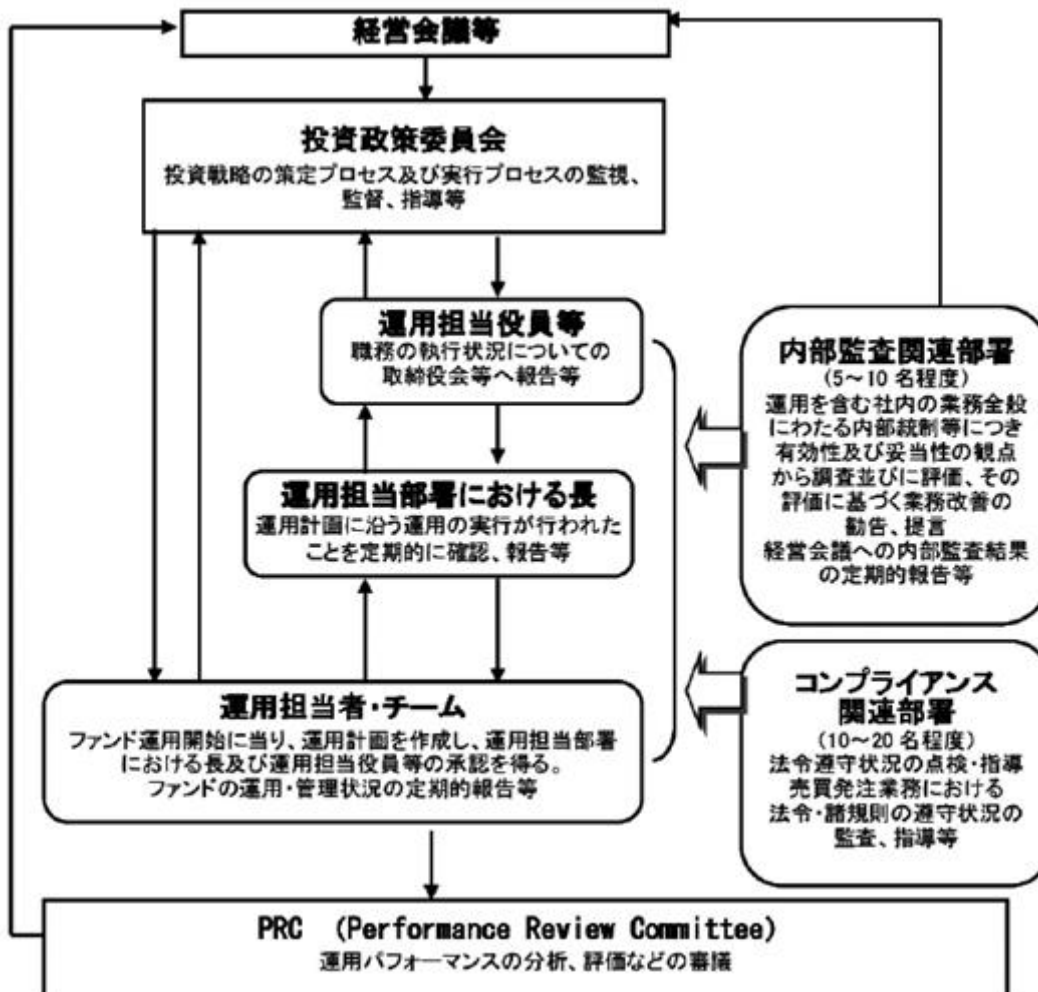
（ご参考）

「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」の運用体制

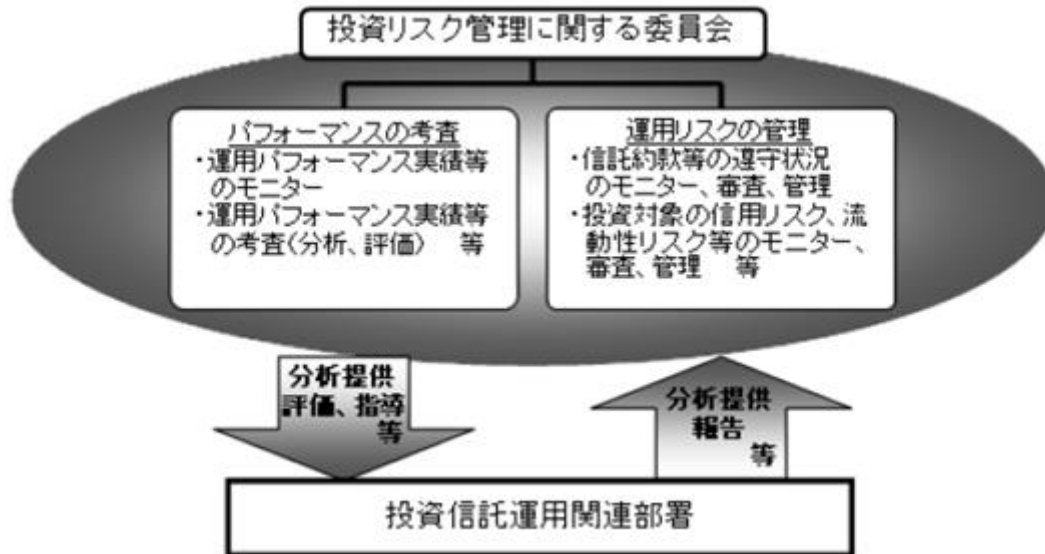
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。

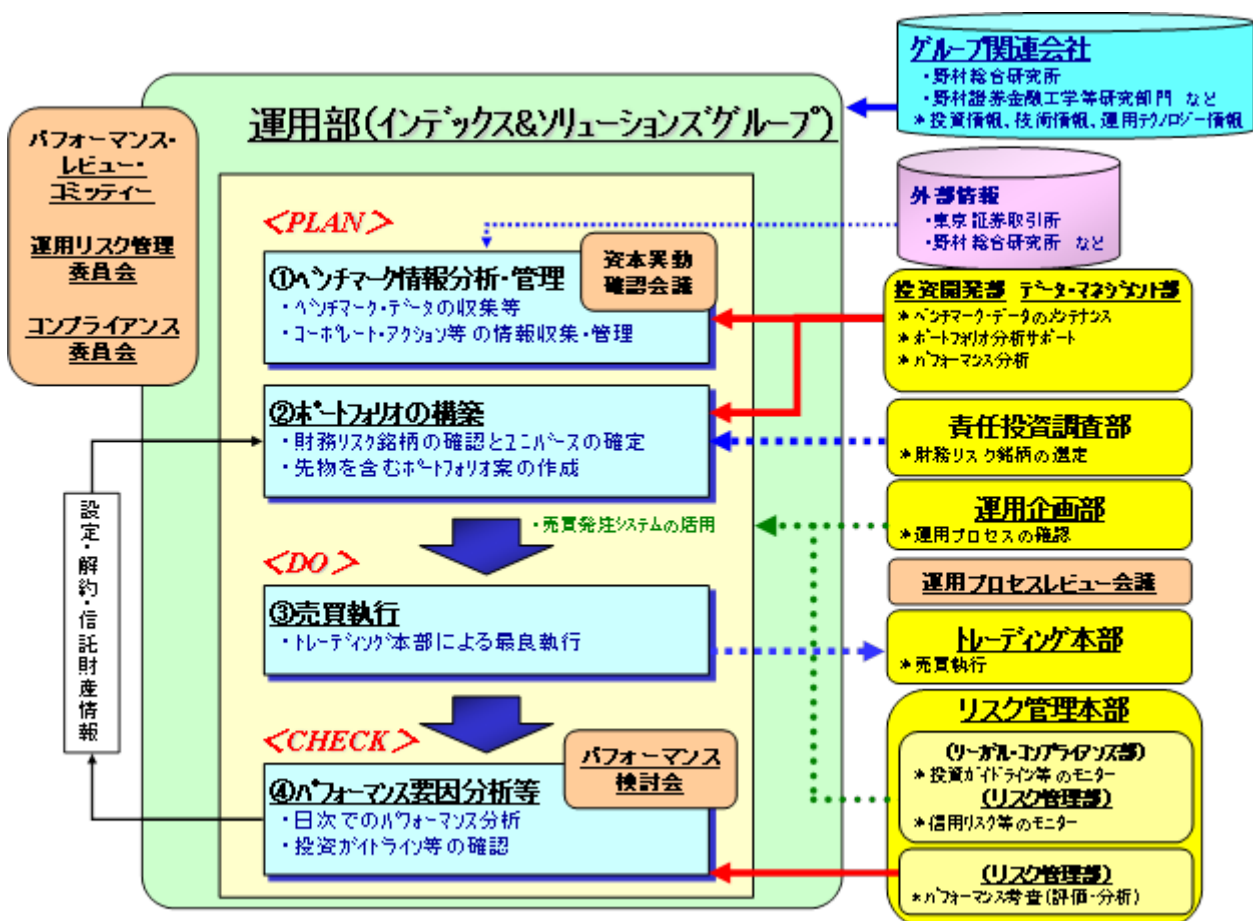


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

基本的には、東京証券取引所第1部の銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れますが、一部財務リスクの高い銘柄を除外しています。

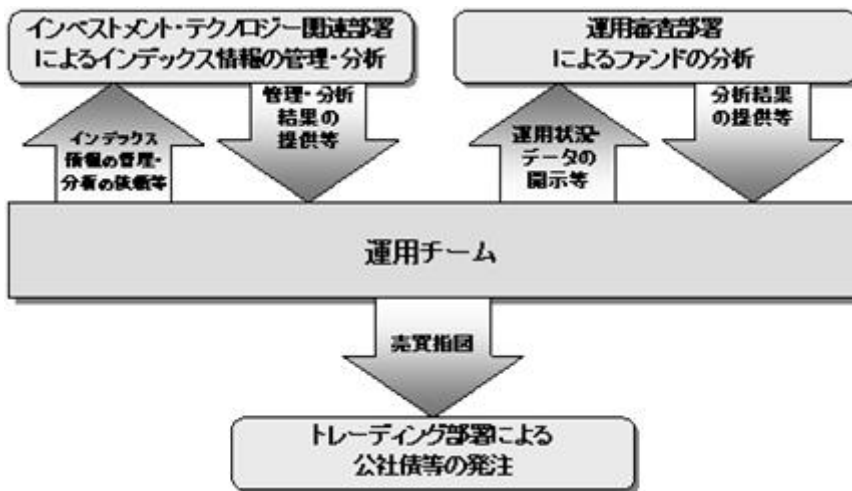




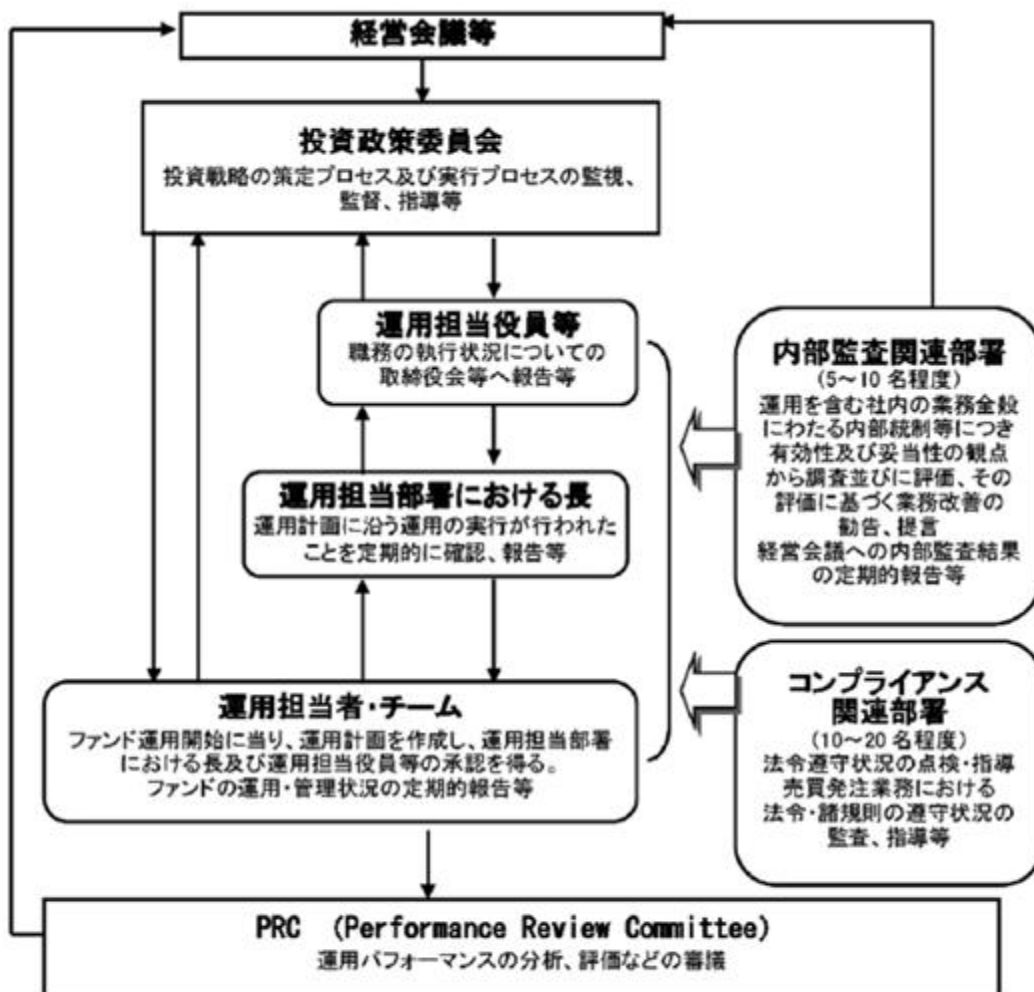
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

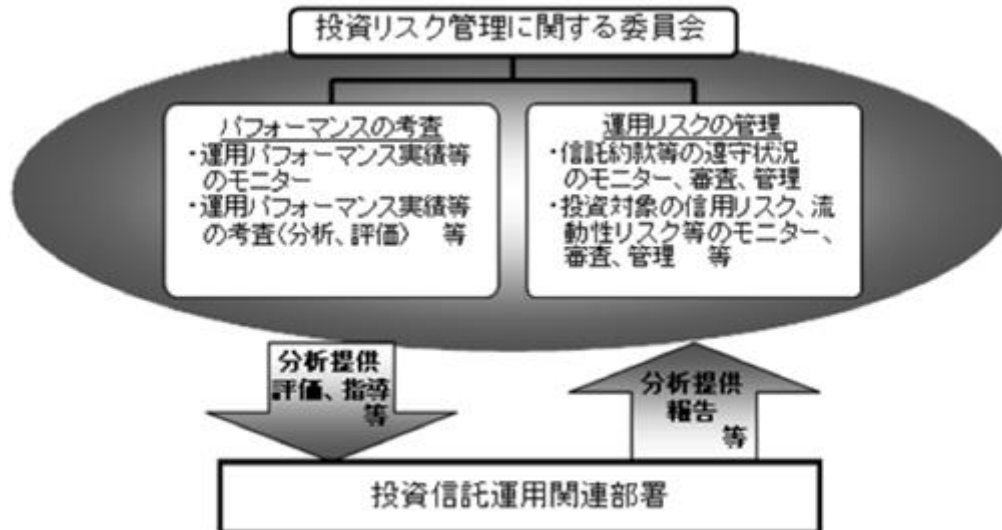
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。

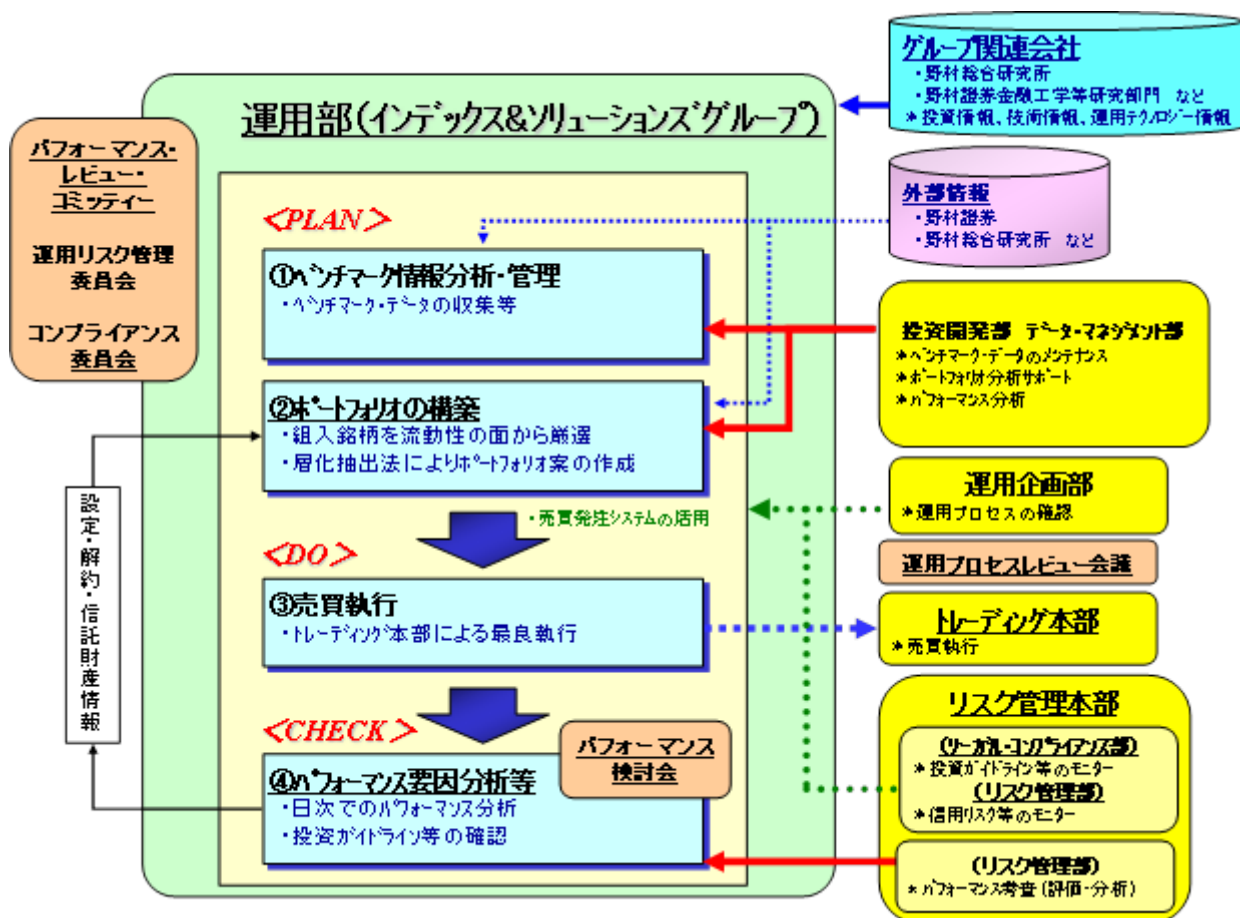


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

ベンチマーク・データ、信託財産情報、追加設定・解約等の資金流入出データ等を入手した後、層化抽出法の考え方に基づいてポートフォリオを構築します。





運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。運用担当者は、投資戦略別に毎月の投資行動を報告した上で、ガイドラインからの乖離やパフォーマンスの格差、発注取引先の集中等が生じている場合には、その理由及び顧客への説明状況について報告します。

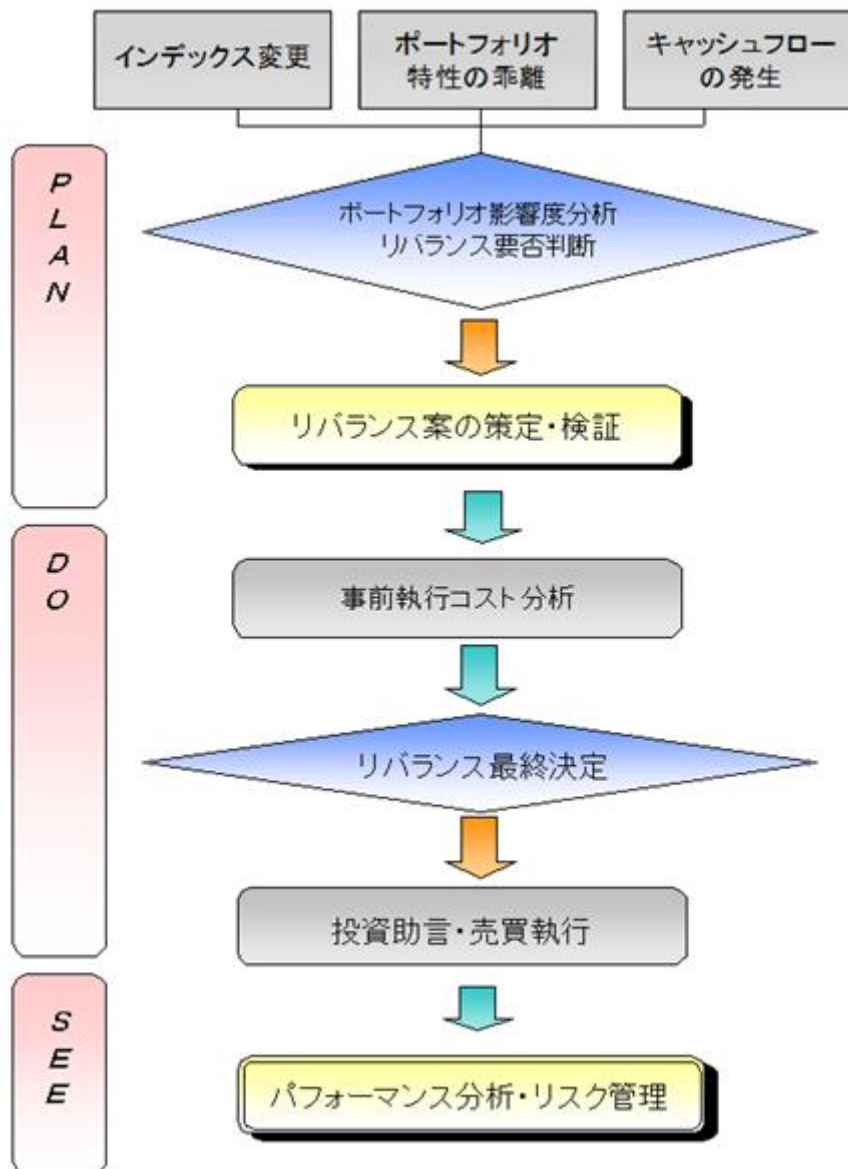
（ご参考）

「日立外国債券インデックスマザーファンド」の運用体制

当マザーファンドの運用は、MU投資顧問株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

債券運用部が、三菱UFJ信託銀行資産運用部インデックス戦略運用室の策定した投資助言案を確認し、トレーディング部が発注を行います。

層化抽出法における銘柄選択を行い、インデックスを構成する国別に、ポートフォリオとインデックスの特性が一致するよう最適化を行います。



#### A. コンプライアンス体制

当マザーファンドのコンプライアンスチェックについては、リスク管理部（法務コンプライアンス室）が行っています。ファンド運用に何らかの問題が発見された場合、発見部署より速やかに事実関係、当該問題の原因と影響、再発防止策等をリスク管理部（法務コンプライアンス室）に報告し、両部より各部門担当役員および社長に報告がなされます。また、リスク管理委員会（リスク管理全般に関する事項の報告・審議）および業務管理委員会（法令遵守状況および内部管理状況の報告・審議）にも報告されます。その後、リスク管理部より再発防止策の定着状況のフォローアップが行われます。

#### B. リスク管理における補完体制

当マザーファンドのリスク管理については、リスク管理部において、推定トラッキングエラーやファンド属性値のモニタリングが行われています。

投資助言を行う三菱UFJ信託銀行の資産運用部インデックス戦略運用室においては、日次で推定トラッキングエラー、デュレーション、残存年限別・国別・通貨別構成等をモニタリングしております。アセットマネジメント事業部および受託監理部においては、ガイドライン遵守状況のチェックおよびリスク管理・パフォーマンス測定を実施するほか、月次で開催される運用会議では、インデックスからの乖離やリバランス状況等が確認され、パフォーマンスの分析結果が定期的、継続的に評価・検討されています。

また、乖離の要因については、評価単価差異、各種コスト、キャッシュ、現物トラッキングエラー等に分けて把握されています。

## (4) 【分配方針】

運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

## (5) 【投資制限】

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当ファンドは、委託者による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

## 1. マザーファンドの受益証券への投資割合（運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限）

委託者は、マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

## 2. 株式への実質投資割合（運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限）

委託者は、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下同じ。）への実質投資割合については、信託財産の純資産総額に対して次の割合を上限とします。

ファンド名	日立 バランスファンド (株式70)	日立 バランスファンド (株式50)	日立 バランスファンド (株式30)
実質投資割合	80%	60%	40%

「株式への実質投資割合」とは、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の割合です。

「信託財産に属するとみなした額」とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

## 3. 信用取引の運用指図（投資信託約款第19条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

## 4. 先物取引等の運用指図（投資信託約款第20条）

イ. 委託者は、有価証券の実質組入比率を維持するためおよび信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## 5. スワップ取引の運用指図（投資信託約款第21条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ロ． スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとし、
  - ニ． 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、
- 6． 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（投資信託約款第22条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - ロ． 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとし、
  - ニ． 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、
- 7． 有価証券の貸付の指図（投資信託約款第23条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - ロ． 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、
- 8． 公社債の空売りの指図範囲（投資信託約款第24条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、
  - ロ． イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとし、
- 9． 公社債の借入れの指図範囲（投資信託約款第25条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとし、
  - ロ． イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとし、
  - ニ． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。



## 10. 外貨建資産への投資制限（投資信託約款第26条）

イ. 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額に対して次の割合を超えることとなる投資の指図をしません。

ファンド名	日立 バランスファンド (株式70)	日立 バランスファンド (株式50)	日立 バランスファンド (株式30)
割合	50%	40%	30%

ロ. イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

## 11. 外国為替予約の指図（投資信託約款第28条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

## 12. 資金の借入れ（投資信託約款第35条）

イ. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額、且つ借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の100分の10を限度とします。

ハ. 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

## 13. 受託者による資金の立替え（投資信託約款第37条）

イ. 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

ロ. 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ. イ.ロ.の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

その他法令上の投資制限

## 1. 同一の法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託者は、同一の法人の発行する株式について、委託者が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が、当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託者に指図してはなりません。

## 2. デリバティブ取引に係る投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託者は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合においては、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを内容とした運用を行ってはなりません。

（ご参考）

「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」の概要

### (1) 投資方針

主としてわが国の証券取引所上場株式（以下「国内株式」といいます。）に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。

国内株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

ベンチマーク採用銘柄の入替えおよびベンチマークの算出方法の変更ならびに資金動向、市況動向などによっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります、また、目的が達成されない場合があります。

株式の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引ならびに外国為替予約取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入国内株式の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

運用にあたっては、投資一任契約に基づき、運用の指図に関する権限を次の者に委託します。委託を受けた者が、法律に違反した場合、投資信託約款に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じせしめた場合等において、委託者は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

野村アセットマネジメント株式会社  
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

### (2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - イ. 有価証券
    - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）
    - ハ. 金銭債権
    - ニ. 約束手形
  2. 次に掲げる特定資産以外の資産
    - イ. 為替手形
- 運用の指図範囲

) 委託者(委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。)は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
17. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの  
なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

) 委託者は、信託金を、) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
  - ) )の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記 )に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
  - ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みません。）による当マザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

1. 株式への投資割合（マザーファンド投資信託約款第17条および運用の基本方針 2.運用方法 (3) 投資制限）

委託者は、株式への投資割合については、制限を設けません。

2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

3. 先物取引等の運用指図（マザーファンド投資信託約款第19条）

イ. 委託者は、株式の実質組入比率を維持するためおよび信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。

ロ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

4. スワップ取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第20条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の

条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ロ． スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5． 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - ロ． 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6． 有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - ロ． 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7． 公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - ロ． イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8． 公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
  - ロ． イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
  - ニ． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 9． 外貨建資産への投資制限（マザーファンド投資信託約款第25条および運用の基本方針 2.運用方法 (3) 投資制限）

委託者は、取得時において信託財産に属する外貨建資産の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

その他法令上の投資制限

委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2．投資方針（5）投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）

（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の概要

### (1) 投資方針

主としてわが国の公社債（以下「国内債券」といいます。）に分散投資を行い、NOMURA - B P I 総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。

国内債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

ベンチマーク採用銘柄の入替えおよびベンチマークの算出方法の変更ならびに資金動向、市況動向などによっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります、また、目的が達成されない場合があります。

公社債の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引ならびに外国為替予約取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入国内債券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

運用にあたっては、投資一任契約に基づき、運用の指図に関する権限を次の者に委託します。委託を受けた者が、法律に違反した場合、投資信託約款に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じせしめた場合等において、委託者は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

野村アセットマネジメント株式会社  
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

### (2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - イ. 有価証券
    - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限ります。）
    - ハ. 金銭債権
    - ニ. 約束手形
  2. 次に掲げる特定資産以外の資産
    - イ. 為替手形
- 運用の指図範囲

) 委託者(委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。)は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
17. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの  
なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

) 委託者は、信託金を、) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)



3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
  - ) )の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記 )に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
  - ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みません。）による当マザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

#### 1. 株式への投資割合（マザーファンド投資信託約款第17条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

委託者は、取得時において信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。

#### 3. 先物取引等の運用指図（マザーファンド投資信託約款第19条）

イ. 委託者は、株式の実質組入比率を維持するためおよび信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。  
ロ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### 4. スワップ取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第20条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の

条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ロ． スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5． 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - ロ． 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6． 有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - ロ． 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7． 公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - ロ． イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8． 公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
  - ロ． イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
  - ニ． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 9． 外貨建資産への投資制限（マザーファンド投資信託約款第25条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

委託者は、取得時において信託財産に属する外貨建資産の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

その他法令上の投資制限

委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2．投資方針（5）投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）

（ご参考）

「日立外国株式インデックスマザーファンド」の概要

### (1) 投資方針

主としてわが国を除く世界主要国・地域の株式（以下「外国株式」といいます。）に分散投資を行い、MSCIコクサイ指数（除く日本、円ベース）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。

外国株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。

ベンチマーク採用銘柄の入替えおよびベンチマークの算出方法の変更ならびに資金動向、市況動向などによっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります、また、目的が達成されない場合があります。

株式の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引ならびに外国為替予約取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入外国株式の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

運用にあたっては、投資一任契約に基づき、運用の指図に関する権限を次の者に委託します。委託を受けた者が、法律に違反した場合、投資信託約款に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じせしめた場合等において、委託者は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

### (2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

#### 運用の指図範囲

）委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

）委託者は、信託金を、）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
  - ) )の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記 )に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
  - ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みません。）による当マザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

1. 株式への投資割合（マザーファンド投資信託約款第17条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

委託者は、株式への投資割合については、制限を設けません。

2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

3. 先物取引等の運用指図（マザーファンド投資信託約款第19条）

イ. 委託者は、株式の実質組入比率を維持するためおよび信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。

ロ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

4. スワップ取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第20条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の

条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ロ． スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5． 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - ロ． 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ． 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
  - ニ． 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6． 有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - ロ． 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7． 公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - ロ． イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8． 公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
  - ロ． イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
  - ニ． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 9． 外貨建資産への投資制限（マザーファンド投資信託約款第25条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）
- 委託者は、外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。

## 10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

## 11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

その他法令上の投資制限

委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2．投資方針 (5) 投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）



（ご参考）

## 「日立外国債券インデックスマザーファンド」の概要

### (1) 投資方針

主として国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債（以下「外国債券」といいます。）に分散投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行います。

外国債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。

ベンチマーク採用銘柄の入替えおよびベンチマークの算出方法の変更ならびに資金動向、市況動向などによっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります、また、目的が達成されない場合があります。

公社債の実質組入比率を維持するため、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引ならびに外国為替予約取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指すため、資金動向によっては、組入外国債券の時価総額と有価証券先物取引等の買建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額を一時的に超えることができます。

運用にあたっては、投資一任契約に基づき、運用の指図に関する権限を次の者に委託します。委託を受けた者が、法律に違反した場合、投資信託約款に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じせしめた場合等において、委託者は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

MU投資顧問株式会社

東京都千代田区神田駿河台二丁目3番地11

### (2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ．為替手形

## 運用の指図範囲

) 委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの  
なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
- ) 委託者は、信託金を、) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
  - ） )の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記 )に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ） デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
  - ） 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みません。）による当マザーファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

1. 株式への投資割合（マザーファンド投資信託約款第17条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

委託者は、取得時において信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
3. 先物取引等の運用指図（マザーファンド投資信託約款第19条）
  - イ. 委託者は、株式の実質組入比率を維持するためおよび信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。
  - ロ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
  - ハ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
4. スワップ取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第20条）

- イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- ニ．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5．金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）
- イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- ニ．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6．有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）
- イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
- ロ．委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7．公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）
- イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8．公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）
- イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- ロ．イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

9. 外貨建資産への投資制限（マザーファンド投資信託約款第25条および運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

委託者は、外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。

10. 外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

11. 受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

イ. 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

ロ. 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ. イ.ロ.の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

その他法令上の投資制限

委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2.投資方針 (5) 投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）

### 3【投資リスク】

#### (1) 主なリスクおよび留意点

受益権の取得申込者は、当ファンドの投資目的、リスクおよび留意点を認識し、慎重に投資の判断を行うことが求められます。

投資信託である当ファンドは、投資元本および利回りのいずれも保証するものではなく、また当ファンドは、主としてマザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債などの値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。これらの運用によりファンドに生じた利益および損失（信託報酬等の費用控除後）は、全て当ファンドの受益者に帰属します。これを受けて、受益者は投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドに投資するにあたっては、あくまでも保有財産の分散投資手段の一部であることにご留意下さい。

当ファンドは主として以下に挙げるリスクが想定されます。

#### 有価証券に投資することによるリスク

有価証券には、次のリスクが単独でまたは同時にあるいは複合して存在するため、個々の有価証券の価格は、日常の企業活動、マクロ経済の状況、市場の需給、その他の予測出来ない要因により、日々刻々変化します。有価証券の価格変動により、当ファンドの基準価額は変動します。当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的に個々の有価証券に投資を行うため、個々の有価証券の性質に応じて以下のリスクが単独であるいは複合して基準価額等に影響を及ぼすことが想定されます。

#### 1. 株式の価格変動リスク

株式の価格変動リスクとは、株式市場が国内外の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、個々の株式が発行会社の日常の企業活動の影響を受け、株価が変動するリスクをいいます。株式の価格が下落した場合には、その影響を受けファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、投資する株式の発行企業が、業績悪化、経営不振あるいは倒産等に陥った場合には、その企業の株式の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることもあり、ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

#### 2. 債券の価格変動リスク

債券の価格変動リスクは、金利変動リスクと信用リスクに大別されます。

金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスクとは、債券の発行者（債務者）が元本償還金や利息の支払い（債務）を不履行あるいは遅延するリスクをいいます。この場合には、当該債券の価格は下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### 3. 為替変動リスク

為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外国通貨建資産の円貨換算の価格が変動するリスクをいいます。外国為替相場が対円で下落した（円高になった）場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。したがって、外国通貨建証券が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該証券の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動に影響を与える要因となります。

当ファンドでは、為替変動リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの基準価額に影響します。

#### 4. 政治・カントリーリスク

特定の国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて有価証券の価格が変動する可能性もあります。特に政治情勢によっては、当該国・地域の評価が変わったり市場の仕組みが変わることもあり、有価証券の価値が減少するか消滅したり、市場の閉鎖により売買が出来なくなったり、保管中の有価証券が凍結され売買機会を逸することもありません。

#### 5. 決済リスク

世界の市場では有価証券の決済のために様々なシステムや機関が相互に関連しあっており、天災、人災またはシステムダウンなどにより、そのどれかに支障が生じた場合に連鎖的な被害を受けることがあります。

#### 6. 流動性リスク

有価証券によってまたは市場によっては、流動性の低いものがあり、それらの有価証券は概して価格の変動率も大きく、期待する価格での取引ができなかったり、取引に時間が掛かることもあります。

##### 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動のリスク

当ファンドおよびマザーファンドは解約資金を手当するために保有する有価証券を大量に売却しなければならないことがあります。その場合には、ファンドの信託財産の純資産総額、市況動向や取引量等の状況によって基準価額が変動する可能性があります。

##### インデックス運用に係る留意点

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて複合ベンチマークの動きへの連動を目指します。つまり、複合ベンチマーク上昇時には同程度の上昇を、複合ベンチマーク下落時には同程度下落を目指して運用を行います。したがって、複合ベンチマークを相対的に上回る投資成果を目指す運用を行うものではありません。

各ベンチマーク採用銘柄の入れ替えおよび各ベンチマークの算出方法の変更ならびにファンドの資金動向、市況動向などによっては、複合ベンチマークの動きへの連動が困難となり、目的が達成されない場合があります。

##### 運用の再委託に係る留意点

委託者は、マザーファンドの運用の指図に関する権限を野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社およびMU投資顧問株式会社に委託しますので、コール・ローン取引を除き、マザーファンドの投資判断および投資の実行は運用再委託先が行います。

今後マザーファンドの投資信託約款の変更により運用再委託先が変更されることがあり、また、運用再委託先が、法律に違反した場合、投資信託約款または投資一任契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じせしめた場合等において、委託者は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

##### ファミリーファンド方式に係る留意点

当ファンドはファミリーファンド方式により運用を行っており、マザーファンドは日立投資顧問株式会社を委託者とする他のベビーファンドによっても投資されます。したがって他のベビーファンドの資金流入出に伴い、投資しているマザーファンドの運用が影響を受け、また基準価額を変動させることがあります。

2018年6月末現在、当ファンドを含めてマザーファンドに投資しているベビーファンドとその口数は、次のとおりです。なお、マザーファンドに投資するベビーファンドが新たに設定されたり、マザーファンドに投資しているベビーファンドが償還等の理由で今後投資しなくなったりすることがあります。

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	4,890,010,116
	日立バランスファンド（株式50）	3,681,270,429
	日立バランスファンド（株式30）	904,020,324
	日立国内株式インデックスファンド	10,752,183,892
	日立国内株式TOPIXインデックスファンド （非課税適格機関投資家専用）	7,010,007,830
	合計	27,237,492,591

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立国内債券 インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	3,113,625,684
	日立バランスファンド（株式50）	6,298,779,191
	日立バランスファンド（株式30）	3,492,132,466
	日立国内債券インデックスファンド	10,811,899,188
	日立国内債券特化型ファンドN （非課税適格機関投資家専用）	42,206,025,537
	合計	65,922,462,066

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立外国株式 インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	2,725,230,167
	日立バランスファンド（株式50）	1,821,150,297
	日立バランスファンド（株式30）	332,295,879
	日立外国株式インデックスファンド	11,240,728,214
	日立外国株式特化型ファンド （非課税適格機関投資家専用）	19,416,204,829
	合計	35,535,609,386

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立外国債券 インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	997,068,622
	日立バランスファンド（株式50）	1,011,527,645
	日立バランスファンド（株式30）	372,674,236
	日立外国債券インデックスファンド	6,606,736,534
	日立外国債券特化型ファンドU（為替ヘッジなし） （非課税適格機関投資家専用）	9,068,869,720
	合計	18,056,876,757

#### 販売会社を通じた取得申込みに係る留意点

委託者は、販売会社とは別法人であり、委託者はファンドの運用について、販売会社は販売（申込み金額の預り等を含みます。）についてそれぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。したがって、販売の申込み（申込み金額の預り等を含みます。）は全て販売会社を通じて行われますが、委託者および当ファンドは、販売会社により委託者の指定する口座を経由して、受託者の指定するファンド口座に申込み金額の払込みが現実になされるまでは、申込者の申込みについての責任を負いません。一部解約金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われますが、当ファンドは、それぞれの場合においてその金額を委託者の指定する口座を経由して販売会社に対して支払った後は、受益者への支払についての責任を負いません。また、受益権の口数の増加の記載または記録は全て販売会社を通じて行われますので、委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うこと以外の責任を負いません。

#### 収益分配方針に係る留意点

運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。したがって、運用による収益は、基準価額の変動として反映されるものの、受益者は直接分配金の取得はできません。

#### 法令・税制・会計等の変更可能性に係る留意点



当ファンドに適用される、あるいは関連する法令、税制、会計基準等に変更になる可能性があります、この場合、当ファンドの運用に影響を与え、または受益者に直接的な影響を与えることがあります。

#### その他のリスク

信託財産中の余裕資金は、コール・ローン取引等の短期金融商品で運用されており、運用先の債務不履行により損失が発生することがあります。

#### その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

#### （ご参考）確定拠出年金の加入者等に対するリスクおよび留意点

確定拠出年金の加入者等は、当ファンドの投資目的、リスクおよび留意点を認識し、慎重に運用指図の判断を行うことが求められます。特に、前記 から に記載したリスク等は確定拠出年金の加入者等が実質的に負うこととなります。

また、確定拠出年金の加入者等は当ファンドの受益者ではないため、受益者が有する権利（後記「第2 管理及び運営 4 受益者の権利等」参照）を直接保有しておりません。したがって、確定拠出年金の加入者等は、委託者に対して帳簿書類の閲覧・謄写の請求権ならびに信託契約の解約または投資信託約款の変更が行われる場合における異議申立権および反対者としての買取請求権を有しておらず、また、委託者は、確定拠出年金の加入者等へ運用報告書等の書面の交付を行わないことがあります。

#### (2) リスク管理体制

諸法令、約款等の遵守状況等については、運用グループで確認することはもとより、コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーが定期的に監視することにより、リスク管理の実効性を高めると共に、顧客との利益相反に対処しています。

具体的には、以下の事項を重点に、日々あるいは月次で諸法令ならびに投資信託約款に違背する事項がないかを確認し、事跡に留めています。

1. 資産配分比率の遵守状況
2. 適正な取引価格の確認
3. 投資制限銘柄の売買
4. ファンド間売買の有無
5. ブローカーへの発注状況

ポートフォリオのパフォーマンスやベンチマークとの乖離等、運用業務に関わるリスク特性については、運用評価委員会にて分析、評価、検討しています。また、運用再委託先の評価も担当しています。

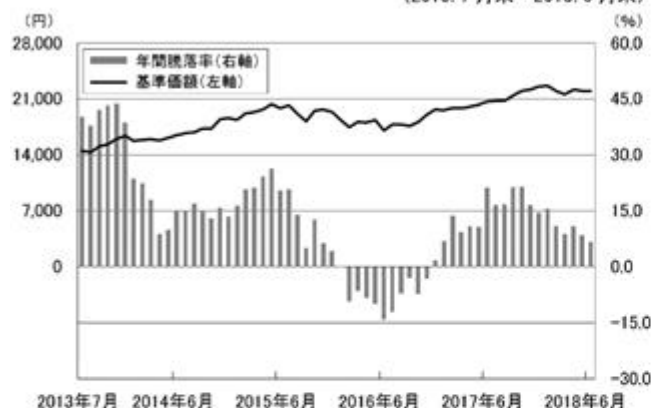
マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っています。そのリスク管理が適正に行われているかをコンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーが定期的に監視しています。

## <リスクの定量的比較>

### ○ファンドの年間騰落率及び基準価額の推移

日立バランスファンド（株式70）

(2013.7月末～2018.6月末)

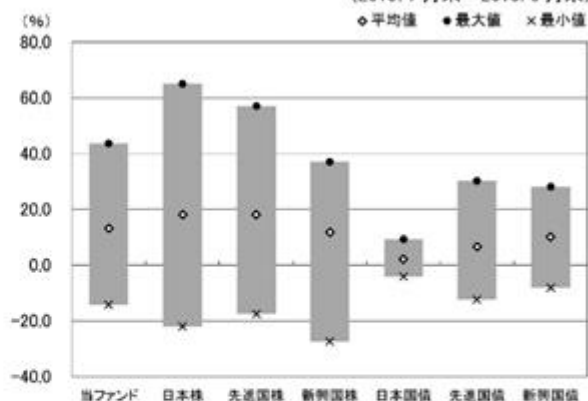


2013年7月 2014年6月 2015年6月 2016年6月 2017年6月 2018年6月

\*年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

### ○ 代表的な資産クラスと騰落率の比較

(2013.7月末～2018.6月末)



当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	13.1	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7
最大値(%)	43.8	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4
最小値(%)	△ 14.2	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3

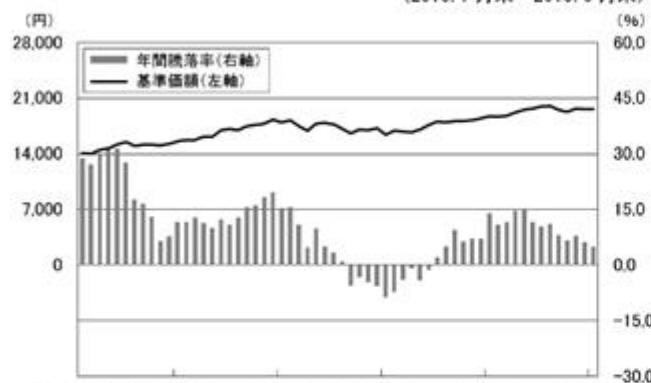
\*2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

日立バランスファンド（株式50）

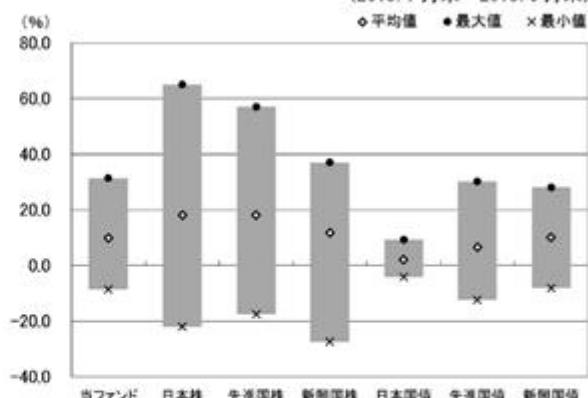
(2013.7月末～2018.6月末)



2013年7月 2014年6月 2015年6月 2016年6月 2017年6月 2018年6月

\*年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

(2013.7月末～2018.6月末)



当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	9.9	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7
最大値(%)	31.4	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4
最小値(%)	△ 8.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3

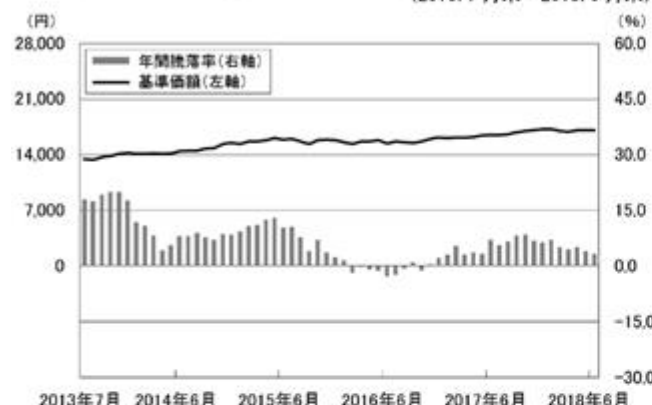
\*2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

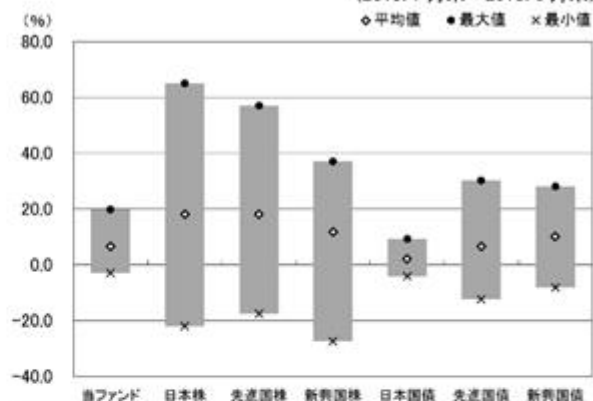
## 日立バランスファンド(株30)

(2013.7月末~2018.6月末)



\*年間騰落率は、2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

(2013.7月末~2018.6月末)



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	6.7	18.1	18.2	11.7	2.2	6.7	10.1
最大値(%)	20.0	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	28.1
最小値(%)	△ 2.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 8.0

\*2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

## \*各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株・・・MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

新興国株・・・MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI 国債

先進国債・・・FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債・・・JP モルガン GBI-EM グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

(注1) 海外の指数は、各指数を基に、日立投資顧問が計算したものです。また、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。

(注2) 各指数等に関する著作権等の知的財産権は、開発元もしくは公表元に帰属します(東証株価指数(TOPIX):株式会社東京証券取引所、MSCI コクサイ・インデックス及びMSCI エマージング・マーケット・インデックス:MSCI Inc.、NOMURA-BPI 国債:野村証券株式会社、FTSE 世界国債インデックス:FTSE Fixed Income LLC、JP モルガン GBI-EM グローバル・ディバーシファイド:J.P.Morgan Securities Inc.)。なお、各社は当ファンドの運用に関し一切責任を負いません。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

かかりません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

かかりません。

##### (3)【信託報酬等】

委託者および受託者の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次表の率を乗じて得た金額とし、その配分も次表のとおりです。

ファンド名	信託報酬率	信託報酬の配分（税抜）		役務の内容
		委託会社	年率	
日立バランスファンド （株式70）	年率0.2052% （税抜0.19%）	委託会社	年率0.09%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.06%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
日立バランスファンド （株式50）	年率0.1944% （税抜0.18%）	委託会社	年率0.08%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.06%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
日立バランスファンド （株式30）	年率0.1836% （税抜0.17%）	委託会社	年率0.07%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.06%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日（ただし、第1期計算期間を除きます。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産の中から支弁します。

信託報酬の表示は、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額を含めたものです。税法が改正された場合は、以上の内容が変更になることがあります。

信託報酬の販売会社への配分は、販売会社の行う業務に対する代行手数料であり、委託者が一旦信託財産から収受した後、取扱残高に応じて支払います。委託者は、信託報酬を収受したときは、販売会社に対して代行手数料を遅滞なく支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産の中から支弁します。この他に、売買委託手数料に係る消費税等相当額、先物取引やオプション取引およびコール・ローン取引等に要する費用ならびに外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産の中から支弁します。

これら売買委託手数料等の証券取引に伴う手数料や税金は、国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

信託財産に関する租税、受託者の立替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産の中から支弁します。

信託事務の処理に要する諸費用（信託財産に係る監査報酬、法律顧問・税務顧問への報酬、目論見書等の印刷費用、郵送費用、公告費用、格付費用等）ならびに当該費用に係る消費税等相当額は、委託者の負担とし、信託財産の中からは支弁しません。

上記、の費用は、運用の状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

（ご参考）マザーファンドにおける管理報酬等

マザーファンドについては信託報酬を収受しません。

運用再委託先に支払う報酬は、委託者の負担とします。報酬額は、毎日、この投資信託が保有するそれぞれの運用再委託先が運用するマザーファンドの純資産総額に次表の率を乗じて得た額とします。

マザーファンド	運用再委託先	報酬
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.027% (税抜0.025%)
日立国内債券 インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.027% (税抜0.025%)
日立外国株式 インデックスマザーファンド	ステート・ストリート・グローバル・アド バイザーズ株式会社	年0.0486% (税抜0.045%)
日立外国債券 インデックスマザーファンド	MU投資顧問株式会社	年0.0432% (税抜0.04%)

運用再委託先に支払う報酬は、毎年4月および10月ならびに信託契約終了のときに委託者が支弁します。

運用再委託先に支払う報酬の表示は、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額を含めたものです。税法が改正された場合は、以上の内容が変更になることがあります。

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等相当額、先物取引やオプション取引およびコール・ローン取引等に要する費用ならびに外国における資産の保管等に要する費用は、信託財産の中から支弁します。

信託財産に関する租税、受託者の立替えた立替金の利息および信託事務の処理に要する諸費用は、受益者の負担とし、信託財産の中から支弁します。

上記、の費用は、運用の状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。ただし、非課税扱いの受益者については、以下の課税対象について、課税されません。

個別元本について

- 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- 2.にかかわらず、受益者が同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

一部解約時および償還時の課税について

一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

個人、法人別の課税の取扱いについて

（注）所得税については、2013年1月1日から2037年12月31日までの間、別途、所得税の額に対し、2.1%の率で復興特別所得税が課されます。

- 個人の受益者に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける一部解約時および償還時の個別元本超過額については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収が行われ、申告分離課税が適用されます。

## 2. 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収され、法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。また、益金不算入制度の適用はありません。

確定拠出年金による取得に係る課税の取扱いについて  
確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

- \* 税制に関する記載は、2018年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。
- \* 税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下は2018年6月29日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 日立バランスファンド（株式70）

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,718,962,161	99.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		207,169,672	0.94
合計（純資産総額）		21,926,131,833	100.00

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ.上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	4,890,010,116	1.8553	9,072,758,177	1.7831	8,719,377,037	39.76
2	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	2,725,230,167	2.4198	6,594,511,959	2.3881	6,508,122,161	29.68
3	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,113,625,684	1.3932	4,337,903,303	1.3972	4,350,357,805	19.84
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	997,068,622	2.1600	2,153,700,944	2.1474	2,141,105,158	9.76

##### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

##### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

##### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## 日立バランスファンド（株式50）

## （1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,885,971,074	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		209,267,899	0.94
合計(純資産総額)		22,095,238,973	100.00

## （2）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	6,298,779,191	1.3933	8,776,163,008	1.3972	8,800,654,285	39.83
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	3,681,270,429	1.8562	6,833,233,708	1.7831	6,564,073,301	29.70
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	1,821,150,297	2.4199	4,407,127,453	2.3881	4,349,089,024	19.68
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	1,011,527,645	2.1596	2,184,535,077	2.1474	2,172,154,464	9.83

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。



## 日立バランスファンド（株式30）

## （1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,085,002,562	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		77,498,545	0.94
合計(純資産総額)		8,162,501,107	100.00

## （2）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,492,132,466	1.3932	4,865,238,952	1.3972	4,879,207,481	59.77
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	904,020,324	1.8548	1,676,850,518	1.7831	1,611,958,639	19.74
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	372,674,236	2.1597	804,869,564	2.1474	800,280,654	9.80
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	332,295,879	2.4195	804,014,853	2.3881	793,555,788	9.72

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考）

## 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	48,035,777,180	98.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		531,637,568	1.09
合計(純資産総額)		48,567,414,748	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	536,455,000	1.10

（注）先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	236,300	6,794.43	1,605,524,639	7,170.00	1,694,271,000	3.48
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,341,900	690.24	926,242,272	631.10	846,873,090	1.74
3	日本	株式	ソニー	電気機器	130,100	5,180.01	673,919,968	5,664.00	736,886,400	1.51
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	136,900	4,964.69	679,667,028	5,036.00	689,428,400	1.41
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	86,300	7,873.77	679,507,104	7,973.00	688,069,900	1.41
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	145,100	4,415.38	640,672,450	4,306.00	624,800,600	1.28
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	9,500	65,526.44	622,501,200	62,560.00	594,320,000	1.22
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	174,900	3,635.01	635,763,746	3,253.00	568,949,700	1.17
9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	168,100	2,705.85	454,853,980	3,031.00	509,511,100	1.04
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,604,600	190.27	495,587,758	186.50	485,757,900	1.00
11	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	143,300	2,657.66	380,843,478	3,066.00	439,357,800	0.90
12	日本	株式	任天堂	その他製品	12,000	47,404.05	568,848,700	36,200.00	434,400,000	0.89
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	134,300	2,842.01	381,682,105	3,078.00	413,375,400	0.85
14	日本	株式	ファナック	電気機器	18,500	26,539.47	490,980,239	22,005.00	407,092,500	0.83
15	日本	株式	花王	化学	47,800	8,064.44	385,480,532	8,450.00	403,910,000	0.83
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	17,400	20,069.20	349,204,138	22,960.00	399,504,000	0.82
17	日本	株式	日本電産	電気機器	23,400	16,426.83	384,388,040	16,625.00	389,025,000	0.80
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	80,200	4,553.72	365,208,602	4,831.00	387,446,200	0.79
19	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	136,900	2,738.10	374,846,605	2,822.50	386,400,250	0.79
20	日本	株式	村田製作所	電気機器	20,400	14,570.40	297,236,194	18,620.00	379,848,000	0.78
21	日本	株式	キャノン	電気機器	104,600	3,854.25	403,154,918	3,631.00	379,802,600	0.78
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	72,200	4,780.23	345,132,840	5,193.00	374,934,600	0.77
23	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	120,700	3,052.74	368,466,326	3,095.00	373,566,500	0.76
24	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	34,900	9,759.25	340,598,035	10,615.00	370,463,500	0.76
25	日本	株式	日立製作所	電気機器	467,000	770.22	359,692,760	781.60	365,007,200	0.75
26	日本	株式	ダイキン工業	機械	26,500	11,775.47	312,050,120	13,270.00	351,655,000	0.72
27	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	71,600	5,081.31	363,821,903	4,678.00	334,944,800	0.68
28	日本	株式	パナソニック	電気機器	222,000	1,514.36	336,188,856	1,493.50	331,557,000	0.68
29	日本	株式	信越化学工業	化学	33,500	10,963.79	367,286,965	9,873.00	330,745,500	0.68
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	191,100	1,594.68	304,743,348	1,689.00	322,767,900	0.66

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/ 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.28
		建設業	3.14
		食料品	4.45
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.33
		医薬品	4.69
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.01
		非鉄金属	0.84
		金属製品	0.61
		機械	5.09
		電気機器	13.47
		輸送用機器	8.51
		精密機器	1.71
		その他製品	2.06
		電気・ガス業	1.74
		陸運業	4.33
		海運業	0.18
		空運業	0.57
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	7.42
		卸売業	4.74
		小売業	4.98
		銀行業	6.58
		証券、商品先物取引業	0.91
		保険業	2.23
その他金融業	1.20		
不動産業	2.40		
サービス業	4.56		
合計			98.90

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(先物)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	31	日本円	540,940,066	536,455,000	1.10

（ご参考）

日立国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	73,072,689,850	79.33
地方債証券	日本	6,289,624,690	6.82
特殊債券	日本	7,915,114,623	8.59
社債券	日本	4,453,331,000	4.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		374,000,081	0.40
合計(純資産総額)		92,104,760,244	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	900,000,000	104.10	936,936,000	103.87	934,911,000	0.8	2022/9/20	1.01
2	日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	900,000,000	103.59	932,319,000	103.28	929,520,000	1.2	2020/12/20	1.00
3	日本	国債証券	第124回利付国債 (5年)	850,000,000	100.49	854,165,000	100.44	853,765,500	0.1	2020/6/20	0.92
4	日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	800,000,000	100.71	805,732,800	100.80	806,424,000	0.1	2027/12/20	0.87
5	日本	国債証券	第125回利付国債 (5年)	800,000,000	100.54	804,344,000	100.50	804,000,000	0.1	2020/9/20	0.87
6	日本	国債証券	第382回利付国債 (2年)	800,000,000	100.38	803,104,000	100.32	802,584,000	0.1	2019/11/15	0.87
7	日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	730,000,000	102.77	750,221,000	102.50	748,271,900	1	2020/9/20	0.81
8	日本	国債証券	第315回利付国債 (10年)	700,000,000	104.27	729,897,000	103.94	727,622,000	1.2	2021/6/20	0.78
9	日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	680,000,000	102.45	696,687,200	102.10	694,300,400	1.3	2019/12/20	0.75
10	日本	国債証券	第308回利付国債 (10年)	660,000,000	103.17	680,922,000	102.81	678,546,000	1.3	2020/6/20	0.73
11	日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	670,000,000	101.07	677,215,900	101.16	677,778,700	0.1	2026/3/20	0.73
12	日本	国債証券	第317回利付国債 (10年)	630,000,000	104.24	656,724,600	103.94	654,834,600	1.1	2021/9/20	0.71
13	日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	600,000,000	103.51	621,084,000	103.36	620,190,000	0.6	2023/3/20	0.67
14	日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	600,000,000	103.29	619,764,000	103.25	619,524,000	0.4	2025/6/20	0.67
15	日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	590,000,000	104.68	617,670,400	104.51	616,656,200	0.8	2023/6/20	0.66
16	日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	600,000,000	101.02	606,168,000	101.11	606,708,000	0.1	2026/6/20	0.65
17	日本	国債証券	第129回利付国債 (5年)	600,000,000	100.76	604,590,000	100.71	604,260,000	0.1	2021/9/20	0.65
18	日本	国債証券	第148回利付国債 (20年)	500,000,000	118.36	591,825,000	118.36	591,820,000	1.5	2034/3/20	0.64
19	日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	570,000,000	102.25	582,825,000	101.86	580,647,600	1.4	2019/9/20	0.63
20	日本	国債証券	第35回利付国債 (30年)	420,000,000	130.13	546,554,400	130.39	547,646,400	2	2041/9/20	0.59
21	日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	510,000,000	104.15	531,195,600	103.90	529,890,000	1	2021/12/20	0.57
22	日本	国債証券	第131回利付国債 (5年)	520,000,000	100.87	524,524,000	100.82	524,264,000	0.1	2022/3/20	0.56
23	日本	国債証券	第332回利付国債 (10年)	500,000,000	103.96	519,800,000	103.82	519,100,000	0.6	2023/12/20	0.56
24	日本	国債証券	第306回利付国債 (10年)	500,000,000	103.00	515,020,000	102.62	513,145,000	1.4	2020/3/20	0.55
25	日本	国債証券	第72回利付国債 (20年)	450,000,000	114.08	513,396,000	113.62	511,312,500	2.1	2024/9/20	0.55

26	日本	国債証券	第126回利付国債 (5年)	500,000,000	100.59	502,990,000	100.55	502,785,000	0.1	2020/12/20	0.54
27	日本	国債証券	第37回利付国債 (30年)	380,000,000	128.69	489,029,600	128.85	489,637,600	1.9	2042/9/20	0.53
28	日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	480,000,000	100.75	483,600,000	100.87	484,200,000	0.1	2027/9/20	0.52
29	日本	国債証券	第149回利付国債 (20年)	400,000,000	118.36	473,468,000	118.46	473,860,000	1.5	2034/6/20	0.51
30	日本	国債証券	第123回利付国債 (5年)	470,000,000	100.44	472,072,700	100.38	471,814,200	0.1	2020/3/20	0.51

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.33
地方債証券	6.82
特殊債券	8.59
社債券	4.83
合計	99.59

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考）

日立外国株式インデックスマザーファンド  
投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	54,128,831,643	63.78
	カナダ	2,996,238,076	3.53
	ユーロ(ドイツ)	2,955,454,892	3.48
	ユーロ(イタリア)	619,935,464	0.73
	ユーロ(フランス)	3,181,031,973	3.74
	ユーロ(オランダ)	1,324,018,459	1.56
	ユーロ(スペイン)	961,482,149	1.13
	ユーロ(ベルギー)	337,136,446	0.39
	ユーロ(オーストリア)	77,761,307	0.09
	ユーロ(ルクセンブルク)	97,517,383	0.11
	ユーロ(フィンランド)	314,365,974	0.37
	ユーロ(アイルランド)	177,925,282	0.20
	ユーロ(ポルトガル)	49,996,258	0.05
	ユーロ(イギリス)	32,530,609	0.03
	ユーロ(マルタ共和国)	0	0
	イギリス	5,626,515,038	6.63
	スイス	2,430,484,652	2.86
	スウェーデン	786,759,434	0.92
	ノルウェー	237,314,603	0.27
	デンマーク	517,022,091	0.60
	オーストラリア	2,207,943,123	2.60
	ニュージーランド	68,440,211	0.08
	香港	1,046,960,246	1.23
シンガポール	399,686,538	0.47	
イスラエル	131,687,036	0.15	
	小計	80,707,038,887	95.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,156,680,301	4.89
合計(純資産総額)		84,863,719,188	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,780,675,151	3.27
	買建	カナダ	159,558,425	0.18
	買建	ドイツ	518,637,955	0.61
	買建	イギリス	327,539,723	0.38
	買建	スイス	140,423,975	0.16
	買建	オーストラリア	150,275,856	0.17

（注）先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。



## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび 機器	101,990	18,543.08	1,891,209,239	20,505.16	2,091,322,288	2.46
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	147,056	10,097.22	1,484,858,216	10,902.56	1,603,286,893	1.88
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	8,294	160,303.57	1,329,557,816	188,078.28	1,559,921,279	1.83
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・ サービス	48,200	17,704.44	853,354,485	21,691.26	1,045,518,934	1.23
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	69,018	12,156.08	838,988,592	11,598.96	800,537,173	0.94
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・ サービス	6,345	114,103.77	723,988,451	123,165.87	781,487,501	0.92
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	85,222	8,259.86	703,922,000	9,060.96	772,193,457	0.90
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・ サービス	6,030	114,702.16	691,654,025	124,554.26	751,062,195	0.88
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	54,007	14,157.19	764,587,416	13,485.87	728,331,921	0.85
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	197,236	3,315.09	653,855,999	3,169.18	625,076,742	0.73
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	93,538	5,793.40	541,903,181	5,928.26	554,517,603	0.65
12	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	38,403	12,622.91	484,757,708	13,890.45	533,435,197	0.62
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,750	22,025.77	567,163,661	20,680.92	532,533,911	0.62
14	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・ サービス	36,240	13,228.70	479,408,200	14,673.07	531,752,405	0.62
15	スイス	株式	NESTLE SA- REGISTERED	食品・飲料・タバ コ	62,690	8,385.58	525,692,452	8,460.14	530,366,427	0.62
16	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・ サービス	19,364	23,678.78	458,515,996	27,071.24	524,207,608	0.61
17	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	144,863	3,816.54	552,876,157	3,558.28	515,463,492	0.60
18	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製 造装置	94,157	5,758.47	542,200,890	5,444.09	512,599,653	0.60
19	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	23,358	19,701.82	460,195,338	21,578.51	504,030,916	0.59
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	118,956	3,924.40	466,831,664	4,019.23	478,112,047	0.56
21	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび 機器	98,039	4,741.06	464,808,840	4,746.58	465,350,702	0.54
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	82,325	5,287.83	435,320,835	5,622.06	462,836,452	0.54
23	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	50,636	8,752.64	443,199,084	8,627.64	436,869,533	0.51
24	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	403,310	963.82	388,721,282	1,026.29	413,916,980	0.48
25	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	11,176	36,243.85	405,061,326	36,992.21	413,424,950	0.48
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC- CLASS A	ソフトウェア・ サービス	18,900	19,362.18	365,945,323	21,787.43	411,782,503	0.48

27	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	81,628	4,799.03	391,735,332	4,805.17	392,236,727	0.46
28	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	52,305	7,461.45	390,271,143	7,392.91	386,686,430	0.45
29	アメリカ	株式	NETFLIX INC	小売	8,700	32,717.08	284,638,648	43,709.72	380,274,623	0.44
30	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	44,849	8,562.09	384,001,596	8,029.92	360,134,313	0.42

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.90
		素材	4.58
		資本財	6.71
		商業・専門サービス	1.04
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.36
		耐久消費財・アパレル	1.77
		消費者サービス	1.76
		メディア	1.92
		小売	4.74
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	4.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	4.47
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.42
		銀行	8.50
		各種金融	4.33
		保険	3.60
		不動産	2.76
		ソフトウェア・サービス	11.13
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.20		
電気通信サービス	2.24		
公益事業	2.92		
半導体・半導体製造装置	2.93		
合計			95.10

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
（先物）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価 指数 先物 取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	185	ドル	25,671,907.5	2,837,772,656	25,155,375	2,780,675,151	3.27
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE60 1809	買建	10	カナダ ドル	1,905,616	158,909,318	1,913,400	159,558,425	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 1809	買建	121	ユーロ	4,130,660	528,352,722	4,054,710	518,637,955	0.61
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 1809	買建	12	オース トラリ アドル	1,817,025	147,469,749	1,851,600	150,275,856	0.17
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1809	買建	30	ボンド	2,271,743.46	328,471,386	2,265,300	327,539,723	0.38
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI 1809	買建	15	スイス フラン	1,267,660	140,558,141	1,266,450	140,423,975	0.16

（ご参考）

日立外国債券インデックスマザーファンド  
投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	17,068,158,776	44.01
	カナダ	803,039,687	2.07
	メキシコ	302,452,039	0.78
	ユーロ(ドイツ)	2,722,992,974	7.02
	ユーロ(イタリア)	3,519,394,274	9.07
	ユーロ(フランス)	3,900,588,463	10.05
	ユーロ(オランダ)	832,223,010	2.14
	ユーロ(スペイン)	2,269,997,024	5.85
	ユーロ(ベルギー)	968,058,059	2.49
	ユーロ(オーストリア)	597,618,799	1.54
	ユーロ(フィンランド)	244,278,936	0.62
	ユーロ(アイルランド)	326,619,463	0.84
	イギリス	2,672,897,969	6.89
	スイス	43,822,104	0.11
	スウェーデン	143,767,649	0.37
	ノルウェー	87,406,587	0.22
	デンマーク	228,314,383	0.58
	ポーランド	234,622,827	0.60
	オーストラリア	809,775,009	2.08
	シンガポール	153,392,175	0.39
マレーシア	182,145,952	0.46	
南アフリカ	217,326,978	0.56	
	小計	38,328,893,137	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		445,648,335	1.14
合計(純資産総額)		38,774,541,472	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		683,760,072	1.76

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	ドイツ	国債 証券	3.250% DEUTSCHLAND REP	1,450,000	13,614.28	197,407,200	13,567.41	196,727,499	3.25	2020/1/4	0.50
2	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,830,000	10,513.21	192,391,894	10,511.66	192,363,433	2	2025/2/15	0.49
3	フランス	国債 証券	5.750% FRANCE GOV'T	890,000	21,088.04	187,683,622	21,075.73	187,574,003	5.75	2032/10/25	0.48
4	アメリカ	国債 証券	3.625% US TREASURY N/B	1,650,000	11,282.08	186,154,338	11,252.62	185,668,338	3.625	2020/2/15	0.47
5	アメリカ	国債 証券	3.625% US TREASURY N/B	1,460,000	11,400.84	166,452,296	11,340.71	165,574,411	3.625	2021/2/15	0.42
6	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,500,000	10,590.25	158,853,752	10,505.61	157,584,270	2.25	2027/11/15	0.40
7	アメリカ	国債 証券	1.750% US TREASURY N/B	1,450,000	10,723.51	155,490,987	10,728.42	155,562,165	1.75	2021/11/30	0.40
8	アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,430,000	10,772.17	154,042,136	10,775.92	154,095,695	2.125	2022/12/31	0.39
9	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,430,000	10,715.32	153,229,110	10,694.74	152,934,853	2.25	2024/11/15	0.39
10	アメリカ	国債 証券	2.625% US TREASURY N/B	1,320,000	11,100.65	146,528,646	11,066.95	146,083,792	2.625	2020/8/15	0.37
11	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,380,000	10,505.91	144,981,663	10,516.84	145,132,455	2.25	2027/8/15	0.37
12	アメリカ	国債 証券	2.500% US TREASURY N/B	1,330,000	10,960.73	145,777,734	10,881.28	144,721,041	2.5	2024/5/15	0.37
13	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,340,000	10,790.60	144,594,092	10,728.42	143,760,897	2	2022/11/30	0.37
14	フランス	国債 証券	4.250% FRANCE GOV'T	910,000	15,779.25	143,591,230	15,766.18	143,472,299	4.25	2023/10/25	0.37
15	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,350,000	10,542.39	142,322,284	10,545.34	142,362,134	2.25	2027/2/15	0.36
16	アメリカ	国債 証券	1.625% US TREASURY N/B	1,340,000	10,612.70	142,210,229	10,558.29	141,481,182	1.625	2022/11/15	0.36
17	アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,290,000	10,861.78	140,116,984	10,854.50	140,023,177	2.125	2021/12/31	0.36
18	アメリカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	1,260,000	11,118.21	140,089,553	11,050.54	139,236,875	2.75	2023/11/15	0.35
19	アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,300,000	10,607.01	137,891,151	10,576.43	137,493,625	2.125	2025/5/15	0.35
20	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,280,000	10,755.70	137,673,080	10,708.56	137,069,600	2	2023/2/15	0.35
21	アメリカ	国債 証券	3.000% US TREASURY N/B	1,220,000	10,694.62	130,474,383	11,096.31	135,375,055	3	2048/2/15	0.34
22	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,270,000	10,699.92	135,889,067	10,630.83	135,011,656	2.25	2025/11/15	0.34
23	アメリカ	国債 証券	2.375% US TREASURY N/B	1,240,000	10,717.17	132,892,967	10,643.79	131,983,033	2.375	2027/5/15	0.34
24	アメリカ	国債 証券	1.500% US TREASURY N/B	1,310,000	10,036.68	131,480,594	9,980.55	130,745,244	1.5	2026/8/15	0.33

25	アメリカ	国債証券	2.375% US TREASURY N/B	1,210,000	10,862.28	131,433,614	10,790.60	130,566,307	2.375	2024/8/15	0.33
26	アメリカ	国債証券	2.750% US TREASURY N/B	1,190,000	10,857.23	129,201,086	10,956.41	130,381,324	2.75	2028/2/15	0.33
27	アメリカ	国債証券	1.625% US TREASURY N/B	1,270,000	10,158.44	129,012,203	10,111.81	128,420,104	1.625	2026/5/15	0.33
28	フランス	国債証券	1.000% FRANCE GOV'T	950,000	13,418.61	127,476,820	13,480.43	128,064,132	1	2025/11/25	0.33
29	フランス	国債証券	4.500% FRANCE GOV'T	620,000	20,841.65	129,218,263	20,634.44	127,933,535	4.5	2041/4/25	0.32
30	アメリカ	国債証券	1.500% US TREASURY N/B	1,170,000	10,924.46	127,816,192	10,914.96	127,705,048	1.5	2019/10/31	0.32

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.85
合計	98.85

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

（為替予約）

資産の種類	通貨	買建/ 売建	数量	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
為替予約取引	ドル	買建	2,692,715.39	296,225,620	297,571,977	0.76
	カナダドル	買建	180,768.10	14,913,006	15,070,636	0.03
	メキシコペソ	買建	595,298.36	3,247,352	3,327,717	0.00
	ユーロ	買建	2,199,602.42	279,824,621	281,329,149	0.72
	ポンド	買建	347,994.25	50,212,090	50,309,528	0.12
	スウェーデンクローナ	買建	425,379.56	5,216,004	5,206,645	0.01
	デンマーククローネ	買建	174,652.29	2,982,187	2,997,033	0.00
	オーストラリアドル	買建	177,742.20	14,354,282	14,422,002	0.03
	シンガポールドル	買建	54,572.42	4,390,787	4,407,814	0.01
	マレーシアリンギット	買建	204,874.71	5,586,113	5,597,177	0.01
	ランド	買建	439,499.88	3,486,552	3,520,394	0.00

## (3) 【運用実績】

日立バランスファンド（株式70）

## 【純資産の推移】

2018年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
8期 (2009年 5月15日)	7,514,498,384	7,514,498,384	1.0030	1.0030
9期 (2010年 5月17日)	9,225,602,031	9,225,602,031	1.0903	1.0903
10期 (2011年 5月16日)	9,981,783,949	9,981,783,949	1.0860	1.0860
11期 (2012年 5月15日)	10,201,481,825	10,201,481,825	1.0393	1.0393
12期 (2013年 5月15日)	14,637,027,742	14,637,027,742	1.5314	1.5314
13期 (2014年 5月15日)	15,715,164,702	15,715,164,702	1.5943	1.5943
14期 (2015年 5月15日)	19,885,040,123	19,885,040,123	1.9820	1.9820
15期 (2016年 5月16日)	17,347,927,953	17,347,927,953	1.7758	1.7758
16期 (2017年 5月15日)	19,493,670,645	19,493,670,645	2.0454	2.0454
17期 (2018年 5月15日)	21,985,000,610	21,985,000,610	2.2493	2.2493
2017年 6月末日	19,377,291,976		2.0668	
7月末日	19,736,702,528		2.0744	
8月末日	19,809,548,216		2.0765	
9月末日	20,403,157,608		2.1417	
10月末日	20,924,508,817		2.2029	
11月末日	21,088,973,954		2.2219	
12月末日	21,486,650,409		2.2585	
2018年 1月末日	21,770,839,683		2.2696	
2月末日	21,107,209,970		2.2016	
3月末日	20,747,880,733		2.1577	
4月末日	21,474,328,435		2.2189	
5月末日	21,611,376,685		2.2030	
6月末日	21,926,131,833		2.2041	

## 【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
8期	
9期	
10期	
11期	
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	

## 【収益率の推移】

期	収益率（％）
8期	28.80
9期	8.70
10期	0.39
11期	4.30
12期	47.35
13期	4.11
14期	24.32
15期	10.40
16期	15.18
17期	9.97

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## （４）【設定及び解約の実績】

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
8期	2,020,273,468	772,480,399	7,491,914,546
9期	1,563,787,337	593,927,003	8,461,774,880
10期	1,463,693,183	733,900,007	9,191,568,056
11期	1,417,633,235	793,915,348	9,815,285,943
12期	1,944,918,343	2,202,403,757	9,557,800,529
13期	2,261,532,131	1,962,471,266	9,856,861,394
14期	1,763,150,742	1,586,985,879	10,033,026,257
15期	1,406,795,897	1,670,688,320	9,769,133,834
16期	1,117,467,696	1,355,884,843	9,530,716,687
17期	1,571,044,252	1,327,710,546	9,774,050,393

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。



## 日立バランスファンド（株式50）

## 純資産の推移

2018年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
8期 (2009年 5月15日)	9,992,837,733	9,992,837,733	1.0486	1.0486
9期 (2010年 5月17日)	11,843,460,727	11,843,460,727	1.1195	1.1195
10期 (2011年 5月16日)	12,815,240,356	12,815,240,356	1.1195	1.1195
11期 (2012年 5月15日)	13,374,729,464	13,374,729,464	1.0956	1.0956
12期 (2013年 5月15日)	17,117,193,057	17,117,193,057	1.4636	1.4636
13期 (2014年 5月15日)	18,190,497,087	18,190,497,087	1.5155	1.5155
14期 (2015年 5月15日)	21,534,819,583	21,534,819,583	1.7907	1.7907
15期 (2016年 5月16日)	19,488,077,758	19,488,077,758	1.6825	1.6825
16期 (2017年 5月15日)	20,776,203,481	20,776,203,481	1.8533	1.8533
17期 (2018年 5月15日)	22,260,170,947	22,260,170,947	1.9892	1.9892
2017年 6月末日	20,564,895,357		1.8676	
7月末日	20,810,576,841		1.8724	
8月末日	20,861,795,708		1.8771	
9月末日	21,294,641,641		1.9177	
10月末日	21,725,502,758		1.9575	
11月末日	21,827,969,794		1.9712	
12月末日	22,102,080,757		1.9948	
2018年 1月末日	22,220,481,994		1.9996	
2月末日	21,738,901,570		1.9575	
3月末日	21,465,240,499		1.9315	
4月末日	21,943,063,710		1.9704	
5月末日	21,916,081,618		1.9594	
6月末日	22,095,238,973		1.9607	

## 分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
8期	
9期	
10期	
11期	
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	

## 収益率の推移

期	収益率（％）
8期	20.45
9期	6.76
10期	0.00
11期	2.13
12期	33.59
13期	3.55
14期	18.16
15期	6.04
16期	10.15
17期	7.33

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## （４）設定及び解約の実績

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
8期	2,272,911,587	866,677,336	9,529,317,574
9期	1,596,166,519	546,052,192	10,579,431,901
10期	1,516,114,802	647,746,736	11,447,799,967
11期	1,501,118,637	741,217,518	12,207,701,086
12期	1,621,195,930	2,133,455,878	11,695,441,138
13期	1,779,180,272	1,471,292,153	12,003,329,257
14期	1,243,555,682	1,220,654,621	12,026,230,318
15期	1,015,439,687	1,459,033,617	11,582,636,388
16期	909,333,996	1,281,826,035	11,210,144,349
17期	1,126,087,244	1,145,889,203	11,190,342,390

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

## 日立バランスファンド（株式30）

## 純資産の推移

2018年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
8期 (2009年 5月15日)	3,974,772,532	3,974,772,532	1.0839	1.0839
9期 (2010年 5月17日)	4,585,652,650	4,585,652,650	1.1345	1.1345
10期 (2011年 5月16日)	5,018,619,209	5,018,619,209	1.1371	1.1371
11期 (2012年 5月15日)	5,288,769,335	5,288,769,335	1.1350	1.1350
12期 (2013年 5月15日)	6,017,104,914	6,017,104,914	1.3722	1.3722
13期 (2014年 5月15日)	6,629,586,999	6,629,586,999	1.4126	1.4126
14期 (2015年 5月15日)	7,528,771,603	7,528,771,603	1.5847	1.5847
15期 (2016年 5月16日)	7,217,040,101	7,217,040,101	1.5596	1.5596
16期 (2017年 5月15日)	7,612,669,650	7,612,669,650	1.6414	1.6414
17期 (2018年 5月15日)	8,093,462,907	8,093,462,907	1.7187	1.7187
2017年 6月末日	7,480,682,130		1.6494	
7月末日	7,619,139,276		1.6519	
8月末日	7,650,832,830		1.6585	
9月末日	7,718,739,645		1.6782	
10月末日	7,837,387,970		1.6999	
11月末日	7,895,739,920		1.7089	
12月末日	7,935,463,406		1.7216	
2018年 1月末日	7,928,246,224		1.7213	
2月末日	7,854,961,895		1.7008	
3月末日	7,827,788,849		1.6894	
4月末日	8,002,828,764		1.7097	
5月末日	8,024,374,577		1.7029	
6月末日	8,162,501,107		1.7042	

## 分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
8期	
9期	
10期	
11期	
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	

## 収益率の推移

期	収益率（％）
8期	11.60
9期	4.67
10期	0.23
11期	0.18
12期	20.90
13期	2.94
14期	12.18
15期	1.58
16期	5.24
17期	4.71

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## （４）設定及び解約の実績

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
8期	909,020,668	441,068,053	3,667,135,866
9期	652,963,008	278,235,272	4,041,863,602
10期	656,838,408	285,301,181	4,413,400,829
11期	674,454,849	428,086,598	4,659,769,080
12期	826,723,933	1,101,491,747	4,385,001,266
13期	1,005,765,009	697,676,389	4,693,089,886
14期	732,598,184	674,751,204	4,750,936,866
15期	625,743,362	749,224,751	4,627,455,477
16期	626,093,297	615,672,733	4,637,876,041
17期	801,659,364	730,398,178	4,709,137,227

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

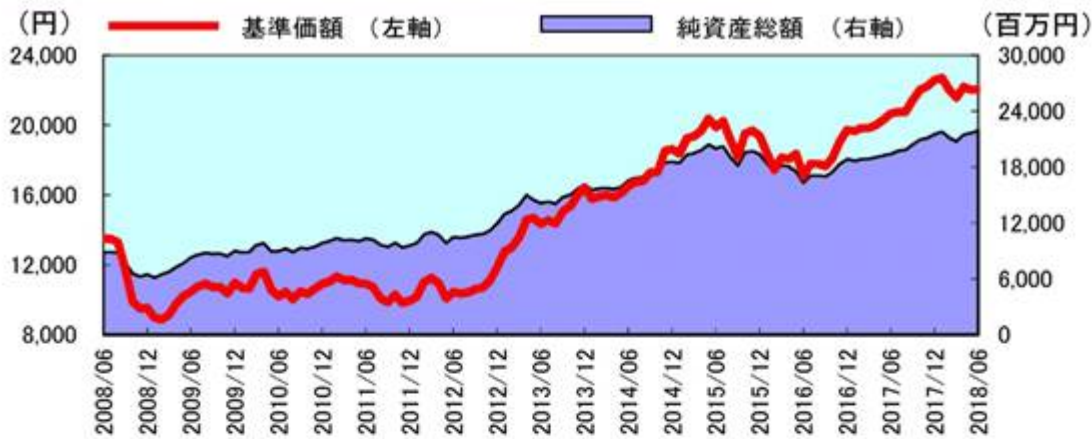
（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

## &lt; 参考情報 &gt;

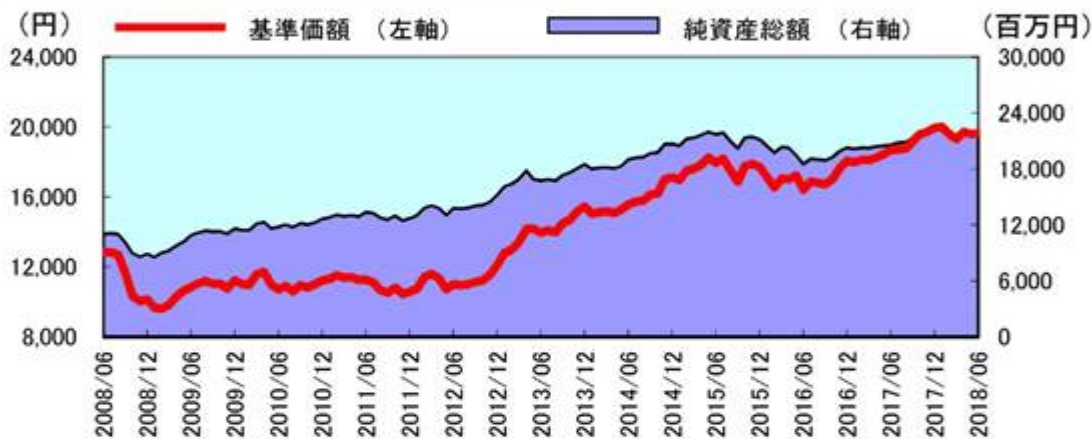
## 運用実績（2018年6月末現在）

## ◆ 基準価額・純資産の推移（2008年6月末～2018年6月末）

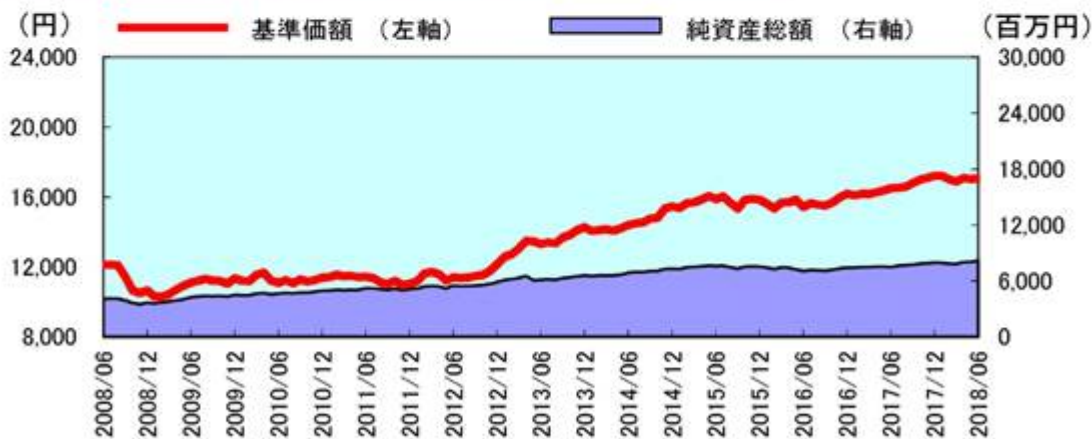
## 日立バランスファンド(株式70)



## 日立バランスファンド(株式50)



## 日立バランスファンド(株式30)



## ◆ 分配の推移

期中には分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保します。  
そのため、これまでに分配金を支払ったことはありません。

ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## ◆ 主要な資産の状況（組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対するものです。）

## 国内株式（日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド）

## ○組入上位10銘柄

銘柄名	業種	組入比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.7%
ソニー	電気機器	1.5%
日本電信電話	情報・通信業	1.4%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.3%
キーエンス	電気機器	1.2%
本田技研工業	輸送用機器	1.2%
KDDI	情報・通信業	1.0%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.0%
合計		15.2%

## ○組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	13.5%
輸送用機器	8.5%
情報・通信業	7.4%
化学	7.3%
銀行業	6.6%
機械	5.1%
小売業	5.0%
卸売業	4.7%
医薬品	4.7%
サービス業	4.6%
合計	67.4%

## 外国株式（日立外国株式インデックスマザーファンド）

## ○組入上位10銘柄

銘柄名	国/地域	組入比率
APPLE INC	アメリカ	2.5%
MICROSOFT CORP	アメリカ	1.9%
AMAZON COM INC	アメリカ	1.8%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.2%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.9%
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	0.9%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	0.7%
合計		12.6%

## ○組入上位10ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	63.8%
イギリス	6.7%
フランス	3.7%
カナダ	3.5%
ドイツ	3.5%
スイス	2.9%
オーストラリア	2.6%
オランダ	1.6%
香港	1.2%
スペイン	1.1%
合計	90.6%

## 国内債券（日立国内債券インデックスマザーファンド）

## ○組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
第325回利付国債（10年）	2022/9/20	1.0%
第312回利付国債（10年）	2020/12/20	1.0%
第124回利付国債（5年）	2020/6/20	0.9%
第349回利付国債（10年）	2027/12/20	0.9%
第125回利付国債（5年）	2020/9/20	0.9%
第382回利付国債（2年）	2019/11/15	0.9%
第310回利付国債（10年）	2020/9/20	0.8%
第315回利付国債（10年）	2021/6/20	0.8%
第305回利付国債（10年）	2019/12/20	0.8%
第308回利付国債（10年）	2020/6/20	0.7%
合計		8.7%

## ○債券種別構成比

債券種別	組入比率
国債証券	79.3%
特殊債券	8.6%
地方債証券	6.8%
社債券	4.8%
合計	99.5%

## 外国債券（日立外国債券インデックスマザーファンド）

## ○組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
独国債 3.250%	2020/1/4	0.5%
米国債 2.000%	2025/2/15	0.5%
仏国債 5.750%	2032/10/25	0.5%
米国債 3.625%	2020/2/15	0.5%
米国債 3.625%	2021/2/15	0.4%
米国債 2.250%	2027/11/15	0.4%
米国債 1.750%	2021/11/30	0.4%
米国債 2.125%	2022/12/31	0.4%
米国債 2.250%	2024/11/15	0.4%
米国債 2.625%	2020/8/15	0.4%
合計		4.4%

## ○組入上位5ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	44.0%
フランス	10.1%
イタリア	9.1%
ドイツ	7.0%
イギリス	6.9%
合計	77.1%

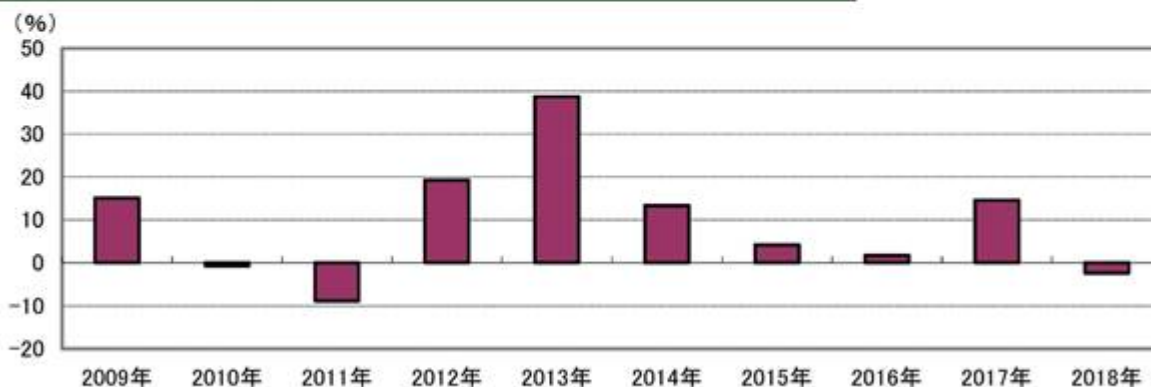
ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## ◆ 資産の構成（資産別マザーファンドの保有時価比率を表示しています。）

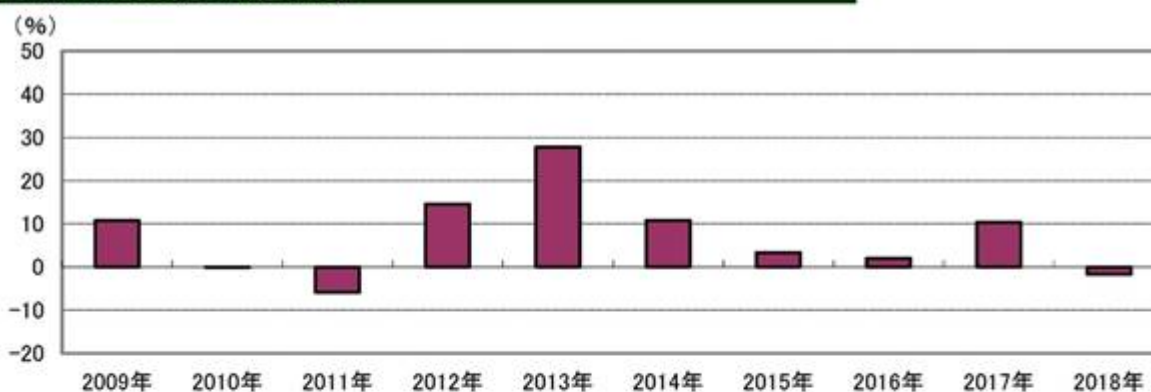
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド 株式(70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	39.7%	29.6%	19.8%	9.7%	1.2%
日立バランスファンド 株式(50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	29.7%	19.6%	39.8%	9.8%	1.1%
日立バランスファンド 株式(30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	19.7%	9.7%	59.7%	9.8%	1.1%

## ◆ 年間収益率の推移

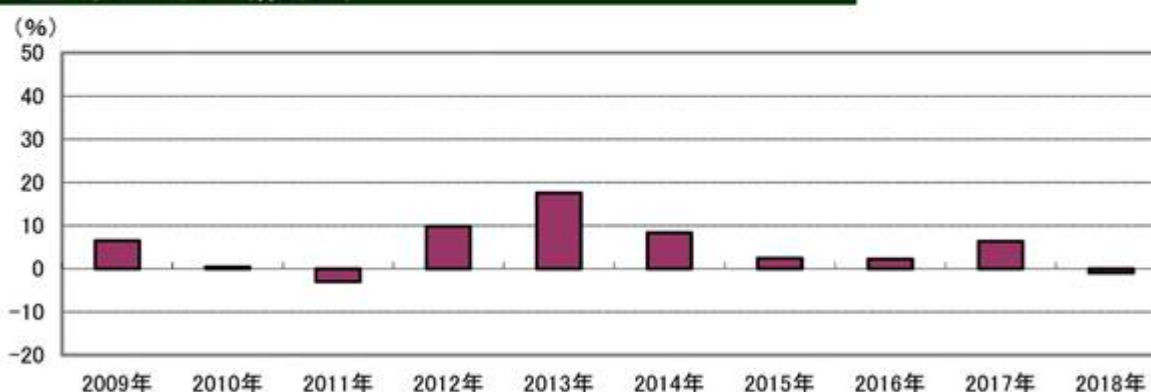
## 日立バランスファンド(株式70)



## 日立バランスファンド(株式50)



## 日立バランスファンド(株式30)



※2018年は、1月から6月末までの騰落率を表示しています。

ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- (1) 継続募集期間中の毎営業日に、受益権の募集が行われます。申込みの受付は午後2時までとし、これら受付時間を過ぎてからの申込みは翌営業日の取扱いとします。
- (2) 継続募集期間における取得の申込みは、確定拠出年金による取得申込みのみを対象としています。
- (3) 受益権の販売価額は、継続募集期間においては取得申込日の翌営業日の基準価額とします。申込みには申込手数料を要しません。受益権の申込単位は1円の整数倍です。なお、継続募集期間における基準価額は、毎営業日に計算されます。
- (4) 委託者は、信託財産の効率的な運用が妨げられると委託者が合理的に判断する場合、わが国および外国の証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情がある場合は、委託者の判断により、受益権の取得申込みの受付を停止することおよび既に受付けた取得申込みを取消することができます。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

### 2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権について委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます（買取請求による換金はいりません。）。解約請求は、原則として毎営業日請求を受け付けます。一部解約の受付は午後2時までとし、これらの受付時間を過ぎてからの一部解約の請求は翌営業日の取扱いとします。
- (2) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。解約代金の支払いは原則として解約の実行の請求を受け付けた日から起算して5営業日目から販売会社において支払われます。解約にかかる手数料はありません。
- (3) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。



- (4) 委託者は、証券取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することがあります。その場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして取扱うこととします。

換金の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額は、原則として毎営業日に委託者が計算します。

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいい、便宜上1万口当たりをもって表示されることがあります。

なお、信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

基準価額は、販売会社または委託者にお問い合わせ下さい。

<お問い合わせ先（委託者）>

日立投資顧問株式会社 電話（03 - 4554 - 5100（代表））

（受付時間は、営業日の午前9時から午後5時までです。）

（ご参考）確定拠出年金の加入者等による基準価額の入手方法

確定拠出年金の加入者等は、運営管理機関を通じて基準価額を知ることができます。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

当ファンドの信託の期間は、信託契約締結日（2001年12月5日）から無期限とします。ただし、信託契約の解約、委託者の登録取消等（他の投資信託委託会社に引き継ぐことが出来ない場合）および受託者の辞任等（新受託者を選任出来ない場合）の場合は信託を終了することがあります。

（４）【計算期間】

当ファンドの信託の計算期間は、原則として毎年5月16日から翌年5月15日までとします。この原則にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとし、ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

信託契約の解約

1. 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
2. 委託者は、1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 3.の一定の期間内に異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 3.から5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託契約に関する監督官庁の命令

委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

委託者の登録取消等に伴う取扱い

委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は当該投資信託約款変更について異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超える場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

受託者の辞任および解任に伴う取扱い

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、後記「投資信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託者を選任します。委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 投資信託約款の変更

1. 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託者は、1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、1. の投資信託約款の変更をしません。
5. 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、1. から5. までの規定にしたがいます。

#### 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告によります。

#### 運用報告書

委託者は、決算時および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は交付運用報告書）を作成し、かつ知られたる受益者に交付します。

#### その他の契約の変更

委託者と販売会社との間の募集・販売に関する契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。また、同契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 4【受益者の権利等】

当ファンドの受益権は、その取得口数に応じて、受益者に帰属します。この受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。なお、投資信託約款には受益者集会に関する規定はありません。また、ファンド資産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

### (1) 一部解約（換金）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求する権利を有します。一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。解約代金の支払いは原則として解約の実行の請求を受けた日から起算して5営業日目から販売会社において支払われます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

(2) 償還金請求権

受益者は、償還金を持分に応じて委託者に請求する権利を有します。償還金は、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに販売会社において受益者への支払いが開始されます。

償還金の請求権は、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、その金銭は委託者に帰属します。

(3) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は委託者に対し、当該受益者に係る信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

(4) 反対者の買取請求権

信託契約の解約または変更を行う場合において、受益者は一定の期間内に委託者に対して異議を申し立てることができ、異議を申し立てた受益者は、法令に基づき、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

（ご参考）確定拠出年金の加入者等の権利

確定拠出年金の加入者等は、当ファンドの受益者ではないため、前記の権利を直接有しておりません。

ただし、加入者等は、運営管理機関に対して行う配分の指図（一部解約の指図）を通じて解約でき、また、ファンドの償還金は資産管理機関または連合会に支払われます。なお、これらは各事業主または連合会により定められた確定拠出年金に係る規約等にしがたって行われるため、一部解約代金または償還金の支払い時期などは前記と異なる場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」といいます。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」といいます。）に基づいて作成しております。
2. 財務諸表に記載している金額については、円単位で表示しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2017年5月16日から2018年5月15日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【日立バランスファンド（株式70）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	244,290,299	247,253,624
親投資信託受益証券	19,300,463,347	21,767,865,492
流動資産合計	19,544,753,646	22,015,119,116
資産合計	19,544,753,646	22,015,119,116
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,011,411	8,482,073
未払受託者報酬	4,014,945	4,554,911
未払委託者報酬	15,055,976	17,080,845
未払利息	669	677
流動負債合計	51,083,001	30,118,506
負債合計	51,083,001	30,118,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,530,716,687	9,774,050,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,962,953,958	12,210,950,217
元本等合計	19,493,670,645	21,985,000,610
純資産合計	19,493,670,645	21,985,000,610
負債純資産合計	19,544,753,646	22,015,119,116

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期		第17期	
	自	2016年5月17日 至 2017年5月15日	自	2017年5月16日 至 2018年5月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,627,768,404		1,982,102,145
<b>営業収益合計</b>		<b>2,627,768,404</b>		<b>1,982,102,145</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		171,278		210,959
受託者報酬		7,720,565		8,904,471
委託者報酬		28,951,996		33,391,627
その他費用		4,667		-
<b>営業費用合計</b>		<b>36,848,506</b>		<b>42,507,057</b>
営業利益又は営業損失( )		2,590,919,898		1,939,595,088
経常利益又は経常損失( )		2,590,919,898		1,939,595,088
当期純利益又は当期純損失( )		2,590,919,898		1,939,595,088
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		134,694,360		127,119,402
期首剰余金又は期首欠損金( )		7,578,794,119		9,962,953,958
剰余金増加額又は欠損金減少額		983,107,048		1,830,289,835
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		983,107,048		1,830,289,835
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,055,172,747		1,394,769,262
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,055,172,747		1,394,769,262
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		9,962,953,958		12,210,950,217

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,530,716,687口	9,774,050,393口
1口当たり純資産額	2.0454円	2.2493円
(1万口当たり純資産額)	(20,454円)	(22,493円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1.運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
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。
2. 金融商品の内容及びリスク	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、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## 金融商品の時価に関する事項

項目	第17期 2018年5月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 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、時価は帳簿価額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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,492,022,221	1,922,829,896
合計	2,492,022,221	1,922,829,896

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,769,133,834円	9,530,716,687円
期中追加設定元本額	1,117,467,696円	1,571,044,252円
期中一部解約元本額	1,355,884,843円	1,327,710,546円

（４）【附属明細表】

（2018年5月15日現在）

第１ 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,070,129,700	4,277,611,711	
		日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	4,725,024,470	8,774,842,943	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	979,726,414	2,116,600,944	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	2,726,780,948	6,598,809,894	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	11,501,661,532	21,767,865,492 100.0%	
合計				21,767,865,492	

（注1）組入時価比率（列項目：銘柄）は、組入時価の純資産に対する比率であります。

（注2）組入時価比率（列項目：評価額）は、各評価額小計欄の合計金額に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【日立バランスファンド（株式50）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	212,188,973	239,178,271
親投資信託受益証券	20,585,977,653	22,046,915,405
未収入金	11,500,000	-
流動資産合計	20,809,666,626	22,286,093,676
資産合計	20,809,666,626	22,286,093,676
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,022,030	4,833,569
未払受託者報酬	4,320,133	4,686,352
未払委託者報酬	15,120,401	16,402,153
未払利息	581	655
流動負債合計	33,463,145	25,922,729
負債合計	33,463,145	25,922,729
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,210,144,349	11,190,342,390
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,566,059,132	11,069,828,557
元本等合計	20,776,203,481	22,260,170,947
純資産合計	20,776,203,481	22,260,170,947
負債純資産合計	20,809,666,626	22,286,093,676

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	2016年5月17日 至 2017年5月15日	自	2017年5月16日 至 2018年5月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,966,420,010		1,547,637,752
営業収益合計		1,966,420,010		1,547,637,752
<b>営業費用</b>				
支払利息		181,414		210,714
受託者報酬		8,458,369		9,262,174
委託者報酬		29,604,161		32,417,446
その他費用		5,284		-
営業費用合計		38,249,228		41,890,334
営業利益又は営業損失（ ）		1,928,170,782		1,505,747,418
経常利益又は経常損失（ ）		1,928,170,782		1,505,747,418
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,928,170,782		1,505,747,418
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		68,266,021		65,508,830
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,905,441,370		9,566,059,132
剰余金増加額又は欠損金減少額		676,618,223		1,043,543,036
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		676,618,223		1,043,543,036
剰余金減少額又は欠損金増加額		875,905,222		980,012,199
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		875,905,222		980,012,199
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,566,059,132		11,069,828,557

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,210,144,349口	11,190,342,390口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8533円 (18,533円)	1.9892円 (19,892円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1.運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
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。
2. 金融商品の内容及びリスク	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、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## 金融商品の時価に関する事項

項目	第17期 2018年5月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 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、時価は帳簿価額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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,817,497,159	1,471,671,770
合計	1,817,497,159	1,471,671,770

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,582,636,388円	11,210,144,349円
期中追加設定元本額	909,333,996円	1,126,087,244円
期中一部解約元本額	1,281,826,035円	1,145,889,203円

(4)【附属明細表】

(2018年5月15日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	6,258,060,854	8,719,356,187	
		日立国内株式T O P I X インデックスマザーファンド	3,622,301,532	6,726,976,175	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	975,391,167	2,107,235,077	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	1,856,755,358	4,493,347,966	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	12,712,508,911	22,046,915,405 100.0%	
合計				22,046,915,405	

(注1)組入時価比率(列項目：銘柄)は、組入時価の純資産に対する比率であります。

(注2)組入時価比率(列項目：評価額)は、各評価額小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【日立バランスファンド（株式30）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	80,217,547	91,233,662
親投資信託受益証券	7,542,440,453	8,015,346,530
未収入金	5,400,000	3,400,000
流動資産合計	7,628,058,000	8,109,980,192
資産合計	7,628,058,000	8,109,980,192
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,643,384	9,321,427
未払受託者報酬	1,587,012	1,693,100
未払委託者報酬	5,157,735	5,502,509
未払利息	219	249
流動負債合計	15,388,350	16,517,285
負債合計	15,388,350	16,517,285
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,637,876,041	4,709,137,227
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,974,793,609	3,384,325,680
元本等合計	7,612,669,650	8,093,462,907
純資産合計	7,612,669,650	8,093,462,907
負債純資産合計	7,628,058,000	8,109,980,192



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	2016年5月17日 至 2017年5月15日	自	2017年5月16日 至 2018年5月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		389,870,945		371,506,077
<b>営業収益合計</b>		<b>389,870,945</b>		<b>371,506,077</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		69,621		78,812
受託者報酬		3,138,838		3,362,511
委託者報酬		10,201,111		10,928,034
その他費用		2,399		-
<b>営業費用合計</b>		<b>13,411,969</b>		<b>14,369,357</b>
営業利益又は営業損失（ ）		376,458,976		357,136,720
経常利益又は経常損失（ ）		376,458,976		357,136,720
当期純利益又は当期純損失（ ）		376,458,976		357,136,720
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		15,632,429		25,157,966
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,589,584,624		2,974,793,609
剰余金増加額又は欠損金減少額		369,442,298		547,307,785
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		369,442,298		547,307,785
剰余金減少額又は欠損金増加額		345,059,860		469,754,468
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		345,059,860		469,754,468
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,974,793,609		3,384,325,680

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,637,876,041口	4,709,137,227口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6414円 (16,414円)	1.7187円 (17,187円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1.運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
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。
2. 金融商品の内容及びリスク	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、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## 金融商品の時価に関する事項

項目	第17期 2018年5月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 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、時価は帳簿価額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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第16期 2017年5月15日現在	第17期 2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	348,060,281	343,118,087
合計	348,060,281	343,118,087

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第16期計算期間 自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	第17期計算期間 自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,627,455,477円	4,637,876,041円
期中追加設定元本額	626,093,297円	801,659,364円
期中一部解約元本額	615,672,733円	730,398,178円

（４）【附属明細表】

（2018年5月15日現在）

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,442,666,241	4,796,666,873	
		日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	877,003,709	1,628,683,587	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	362,048,493	782,169,564	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	333,812,606	807,826,506	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	5,015,531,049	8,015,346,530 100.0%	
合計				8,015,346,530	

（注1）組入時価比率（列項目：銘柄）は、組入時価の純資産に対する比率であります。

（注2）組入時価比率（列項目：評価額）は、各評価額小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （ご参考）

当ファンドは「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」、「日立国内債券インデックスマザーファンド」、「日立外国株式インデックスマザーファンド」、「日立外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は、次のとおりです。

## 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## 貸借対照表

（単位：円）

	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	314,398,245	502,436,310
株式	43,466,710,747	48,842,327,960
派生商品評価勘定	16,964,102	55,573,014
未収入金	80,415,700	4,894,660
未収配当金	409,215,755	457,645,026
差入委託証拠金	7,525,000	23,715,000
流動資産合計	44,295,229,549	49,886,591,970
資産合計	44,295,229,549	49,886,591,970
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	-	55,342,800
未払金	7,124,400	55,910,100
未払解約金	52,300,000	8,400,000
未払利息	861	1,376
流動負債合計	59,425,261	119,654,276
負債合計	59,425,261	119,654,276
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	27,783,227,776	26,797,955,004
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,452,576,512	22,968,982,690
元本等合計	44,235,804,288	49,766,937,694
純資産合計	44,235,804,288	49,766,937,694
負債純資産合計	44,295,229,549	49,886,591,970

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、日本証券業協会が発表する基準値、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>国内先物の評価においては、原則として取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	27,783,227,776口	26,797,955,004口
1口当たり純資産額	1.5922円	1.8571円
(1万口当たり純資産額)	(15,922円)	(18,571円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
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。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

## 金融商品の時価に関する事項

項目	2018年5月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2. 時価の算定方法	有価証券等 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、時価は帳簿価額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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,864,753,804	2,591,160,328
合計	1,864,753,804	2,591,160,328

（注）当計算期間とは、当親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間としております。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額等の変動によるリスクを回避する目的で行いません。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 取引の時価等に関する事項

## （株式関連）

（2017年5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	663,490,000	-	680,475,000	30,100,000
	東証株価指数先物	663,490,000	-	680,475,000	30,100,000
合計		663,490,000	-	680,475,000	30,100,000

（2018年5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	865,207,200	-	920,805,000	47,940,000
	東証株価指数先物	865,207,200	-	920,805,000	47,940,000
合計		865,207,200	-	920,805,000	47,940,000



時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	29,390,791,906円	27,783,227,776円
期中追加設定元本額	2,134,781,458円	2,004,111,830円
期中一部解約元本額	3,742,345,588円	2,989,384,602円
期末元本額	27,783,227,776円	26,797,955,004円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	4,892,135,153円	4,725,024,470円
日立バランスファンド（株式50）	3,932,822,682円	3,622,301,532円
日立バランスファンド（株式30）	959,626,490円	877,003,709円
日立国内株式TOPIXインデックスファンド （非課税適格機関投資家専用）	7,781,921,716円	7,019,844,265円
日立国内株式インデックスファンド	10,216,721,735円	10,553,781,028円

（注）\*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

(2018年5月15日現在)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	極洋	800	3,845.00	3,076,000	
	日本水産	23,900	569.00	13,599,100	
	マルハニチロ	4,000	4,080.00	16,320,000	
	カネコ種苗	700	1,683.00	1,178,100	
	サカタのタネ	3,100	4,105.00	12,725,500	
	ホクト	2,200	2,092.00	4,602,400	
	ホクリヨウ	300	994.00	298,200	
	住石ホールディングス	5,500	173.00	951,500	
	日鉄鉱業	600	6,260.00	3,756,000	
	三井松島産業	1,100	1,605.00	1,765,500	
	国際石油開発帝石	103,100	1,366.50	140,886,150	
	日本海洋掘削	700	1,941.00	1,358,700	
	石油資源開発	3,400	3,090.00	10,506,000	
	K&Oエナジーグループ	1,200	1,862.00	2,234,400	
	ヒノキヤグループ	500	3,090.00	1,545,000	
	ショーボンドホールディングス	2,000	8,100.00	16,200,000	
	ミライト・ホールディングス	6,500	1,840.00	11,960,000	
	タマホーム	1,600	1,254.00	2,006,400	
	サンヨーホームズ	400	1,190.00	476,000	
	日本アクア	600	452.00	271,200	
	ファーストコーポレーション	700	1,299.00	909,300	
	ベステラ	400	1,607.00	642,800	
	TATERU	2,000	1,907.00	3,814,000	
	ダイセキ環境ソリューション	500	1,096.00	548,000	
	第一カッター興業	300	2,540.00	762,000	
	安藤・間	16,500	913.00	15,064,500	
	東急建設	8,200	1,195.00	9,799,000	
	コムシスホールディングス	7,500	3,025.00	22,687,500	
	ミサワホーム	1,800	999.00	1,798,200	
	ピーアールホールディングス	2,100	420.00	882,000	
高松コンストラクショングループ	1,400	3,095.00	4,333,000		
東建コーポレーション	800	10,820.00	8,656,000		

ソネック	300	851.00	255,300	
ヤマウラ	1,000	894.00	894,000	
大成建設	21,100	6,150.00	129,765,000	
大林組	63,600	1,231.00	78,291,600	
清水建設	64,900	1,126.00	73,077,400	
飛島建設	19,300	184.00	3,551,200	
長谷工コーポレーション	24,700	1,696.00	41,891,200	
松井建設	2,300	935.00	2,150,500	
銭高組	300	5,500.00	1,650,000	
鹿島建設	93,000	1,013.00	94,209,000	
不動テトラ	16,000	182.00	2,912,000	
大末建設	700	1,235.00	864,500	
鉄建建設	1,300	3,315.00	4,309,500	
西松建設	4,900	3,150.00	15,435,000	
三井住友建設	15,300	670.00	10,251,000	
大豊建設	8,000	602.00	4,816,000	
前田建設工業	15,100	1,302.00	19,660,200	
佐田建設	1,400	471.00	659,400	
ナカノフドー建設	1,600	704.00	1,126,400	
奥村組	3,500	3,925.00	13,737,500	
東鉄工業	2,500	3,495.00	8,737,500	
イチケン	400	2,548.00	1,019,200	
淺沼組	7,000	370.00	2,590,000	
戸田建設	25,000	964.00	24,100,000	
熊谷組	3,300	3,860.00	12,738,000	
青木あすなる建設	1,400	996.00	1,394,400	
北野建設	4,000	368.00	1,472,000	
植木組	300	2,668.00	800,400	
三井ホーム	3,000	734.00	2,202,000	
矢作建設工業	2,900	886.00	2,569,400	
ピーエス三菱	2,500	615.00	1,537,500	
日本ハウスホールディングス	4,100	590.00	2,419,000	
大東建託	7,600	18,425.00	140,030,000	
新日本建設	2,500	1,368.00	3,420,000	
N I P P O	4,900	2,387.00	11,696,300	
東亜道路工業	400	4,145.00	1,658,000	
前田道路	6,600	2,422.00	15,985,200	
日本道路	600	6,020.00	3,612,000	
東亜建設工業	1,700	2,833.00	4,816,100	

若築建設	1,100	1,764.00	1,940,400
東洋建設	6,700	512.00	3,430,400
五洋建設	25,200	756.00	19,051,200
世紀東急工業	2,800	756.00	2,116,800
福田組	700	6,790.00	4,753,000
住友林業	13,600	1,852.00	25,187,200
日本基礎技術	2,400	408.00	979,200
日成ビルド工業	3,100	1,218.00	3,775,800
ヤマダ・エスバイエルホーム	10,000	70.00	700,000
巴コーポレーション	2,600	528.00	1,372,800
大和ハウス工業	62,600	4,230.00	264,798,000
ライト工業	4,100	1,134.00	4,649,400
積水ハウス	69,000	2,014.50	139,000,500
日特建設	1,800	633.00	1,139,400
北陸電気工事	1,200	1,266.00	1,519,200
ユアテック	3,000	966.00	2,898,000
西部電気工業	400	3,715.00	1,486,000
四電工	300	2,828.00	848,400
中電工	2,700	2,959.00	7,989,300
関電工	8,400	1,262.00	10,600,800
きんでん	14,100	1,870.00	26,367,000
東京エネシス	2,400	1,257.00	3,016,800
トーエネック	600	3,375.00	2,025,000
住友電設	1,700	2,042.00	3,471,400
日本電設工業	3,300	2,494.00	8,230,200
協和エクシオ	7,600	2,915.00	22,154,000
新日本空調	1,600	1,806.00	2,889,600
N D S	300	6,180.00	1,854,000
九電工	4,200	5,420.00	22,764,000
三機工業	4,500	1,191.00	5,359,500
日揮	18,300	2,526.00	46,225,800
中外炉工業	600	3,255.00	1,953,000
ヤマト	1,700	758.00	1,288,600
太平電業	1,400	3,095.00	4,333,000
高砂熱学工業	5,800	2,139.00	12,406,200
三晃金属工業	200	3,625.00	725,000
朝日工業社	400	3,420.00	1,368,000
明星工業	3,800	858.00	3,260,400
大気社	2,700	3,910.00	10,557,000

ダイダン	1,400	2,559.00	3,582,600	
日比谷総合設備	2,400	2,345.00	5,628,000	
東芝プラントシステム	4,600	2,322.00	10,681,200	
OSJ Bホールディングス	9,400	298.00	2,801,200	
東洋エンジニアリング	2,500	967.00	2,417,500	
千代田化工建設	13,800	1,024.00	14,131,200	
新興プランテック	4,100	1,042.00	4,272,200	
日本製粉	6,300	1,827.00	11,510,100	
日清製粉グループ本社	23,200	2,299.00	53,336,800	
日東富士製粉	100	5,400.00	540,000	
昭和産業	1,700	2,941.00	4,999,700	
鳥越製粉	1,700	980.00	1,666,000	
中部飼料	2,300	2,133.00	4,905,900	
フィード・ワン	12,800	282.00	3,609,600	
東洋精糖	300	1,227.00	368,100	
日本甜菜製糖	1,100	2,353.00	2,588,300	
三井製糖	1,500	3,900.00	5,850,000	
塩水港精糖	2,300	268.00	616,400	
日新製糖	900	2,135.00	1,921,500	
森永製菓	4,500	5,790.00	26,055,000	
中村屋	500	4,895.00	2,447,500	
江崎グリコ	5,300	5,410.00	28,673,000	
名糖産業	900	1,709.00	1,538,100	
井村屋グループ	700	3,610.00	2,527,000	
不二家	1,200	2,735.00	3,282,000	
山崎製パン	15,500	2,337.00	36,223,500	
第一屋製パン	300	1,182.00	354,600	
モロゾフ	300	6,720.00	2,016,000	
亀田製菓	1,200	5,790.00	6,948,000	
寿スピリッツ	1,800	5,750.00	10,350,000	
カルビー	8,700	4,025.00	35,017,500	
森永乳業	3,800	4,490.00	17,062,000	
六甲バター	1,300	2,490.00	3,237,000	
ヤクルト本社	11,100	7,820.00	86,802,000	
明治ホールディングス	12,600	9,140.00	115,164,000	
雪印メグミルク	4,600	3,020.00	13,892,000	
プリマハム	13,000	690.00	8,970,000	
日本ハム	8,200	4,665.00	38,253,000	
林兼産業	700	842.00	589,400	

丸大食品	10,000	516.00	5,160,000	
S Foods	1,300	4,430.00	5,759,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	12,200	1,039.00	12,675,800	
サッポロホールディングス	6,900	2,982.00	20,575,800	
アサヒグループホールディングス	39,800	5,813.00	231,357,400	
キリンホールディングス	91,300	2,917.00	266,322,100	
宝ホールディングス	14,200	1,431.00	20,320,200	
オエノンホールディングス	5,400	488.00	2,635,200	
養命酒製造	600	2,461.00	1,476,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホール デ	13,300	4,415.00	58,719,500	
サントリー食品インターナショナル	14,500	5,030.00	72,935,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	6,470.00	6,470,000	
伊藤園	6,300	4,405.00	27,751,500	
キーコーヒー	1,900	2,161.00	4,105,900	
ユニカフェ	600	1,124.00	674,400	
ジャパンフーズ	300	1,490.00	447,000	
日清オイリオグループ	2,200	3,335.00	7,337,000	
不二製油グループ本社	5,100	3,710.00	18,921,000	
かどや製油	200	6,210.00	1,242,000	
J - オイルミルズ	1,000	3,955.00	3,955,000	
キッコーマン	14,800	5,070.00	75,036,000	
味の素	43,700	2,097.00	91,638,900	
キューピー	10,600	2,666.00	28,259,600	
ハウス食品グループ本社	7,200	3,985.00	28,692,000	
カゴメ	7,600	3,820.00	29,032,000	
焼津水産化学工業	900	1,256.00	1,130,400	
アリアケジャパン	1,700	9,590.00	16,303,000	
ピエトロ	200	1,645.00	329,000	
エバラ食品工業	400	2,147.00	858,800	
ニチレイ	9,000	3,050.00	27,450,000	
東洋水産	10,400	3,990.00	41,496,000	
イートアンド	500	2,160.00	1,080,000	
大冷	200	1,993.00	398,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	938.00	375,200	
日清食品ホールディングス	8,300	8,240.00	68,392,000	
永谷園ホールディングス	2,000	1,498.00	2,996,000	
一正蒲鉾	700	1,378.00	964,600	
フジッコ	2,100	2,795.00	5,869,500	

ロック・フィールド	2,000	2,052.00	4,104,000	
日本たばこ産業	117,500	3,053.00	358,727,500	
ケンコーマヨネーズ	1,300	3,870.00	5,031,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	2,804.00	3,364,800	
なとり	1,100	2,002.00	2,202,200	
イフジ産業	300	796.00	238,800	
ピクルスコーポレーション	400	2,134.00	853,600	
北の達人コーポレーション	5,800	804.00	4,663,200	
ユーグレナ	7,600	919.00	6,984,400	
ミヨシ油脂	700	1,404.00	982,800	
理研ビタミン	700	4,160.00	2,912,000	
片倉工業	2,300	1,392.00	3,201,600	
グンゼ	1,500	7,250.00	10,875,000	
東洋紡	7,300	1,987.00	14,505,100	
ユニチカ	5,800	672.00	3,897,600	
富士紡ホールディングス	1,100	3,940.00	4,334,000	
倉敷紡績	20,000	375.00	7,500,000	
シキボウ	1,000	1,352.00	1,352,000	
日本毛織	5,600	1,141.00	6,389,600	
ダイトウボウ	3,000	100.00	300,000	
トーア紡コーポレーション	800	583.00	466,400	
ダイドーリミテッド	2,200	456.00	1,003,200	
帝国繊維	2,100	2,422.00	5,086,200	
帝人	16,300	2,190.00	35,697,000	
東レ	143,800	948.80	136,437,440	
サカイオーベックス	500	2,660.00	1,330,000	
住江織物	500	2,919.00	1,459,500	
日本フェルト	1,000	525.00	525,000	
イチカワ	1,000	369.00	369,000	
日東製網	200	1,758.00	351,600	
アツギ	1,300	1,210.00	1,573,000	
ダイニック	700	1,018.00	712,600	
セーレン	4,600	1,912.00	8,795,200	
ソトー	700	1,047.00	732,900	
東海染工	300	1,467.00	440,100	
小松精練	3,000	1,033.00	3,099,000	
ワコールホールディングス	5,500	3,305.00	18,177,500	
ホギメディカル	2,500	4,650.00	11,625,000	
レナウン	5,400	162.00	874,800	

クラウドシアホールディングス	500	585.00	292,500	
T S Iホールディングス	6,800	853.00	5,800,400	
マツオカコーポレーション	500	3,590.00	1,795,000	
三陽商会	1,000	2,451.00	2,451,000	
ナイガイ	700	575.00	402,500	
オンワードホールディングス	11,800	917.00	10,820,600	
ルックホールディングス	3,000	316.00	948,000	
キムラタン	9,100	39.00	354,900	
ゴールドウイン	1,100	7,650.00	8,415,000	
デサント	4,500	2,182.00	9,819,000	
キング	1,000	571.00	571,000	
ヤマトインターナショナル	1,200	649.00	778,800	
特種東海製紙	1,100	4,585.00	5,043,500	
王子ホールディングス	83,000	741.00	61,503,000	
日本製紙	8,900	2,027.00	18,040,300	
三菱製紙	2,800	693.00	1,940,400	
北越紀州製紙	11,100	628.00	6,970,800	
中越パルプ工業	800	1,956.00	1,564,800	
巴川製紙所	3,000	265.00	795,000	
大王製紙	7,900	1,576.00	12,450,400	
阿波製紙	500	676.00	338,000	
レンゴー	19,100	953.00	18,202,300	
トーモク	1,100	2,179.00	2,396,900	
ザ・パック	1,400	3,860.00	5,404,000	
クラレ	33,400	1,897.00	63,359,800	
旭化成	123,600	1,468.00	181,444,800	
共和レザー	1,200	1,024.00	1,228,800	
昭和電工	13,200	4,205.00	55,506,000	
住友化学	146,000	653.00	95,338,000	
住友精化	800	5,260.00	4,208,000	
日産化学工業	11,500	4,930.00	56,695,000	
ラサ工業	700	2,581.00	1,806,700	
クレハ	1,700	7,190.00	12,223,000	
多木化学	300	4,680.00	1,404,000	
テイカ	1,500	2,858.00	4,287,000	
石原産業	3,600	1,260.00	4,536,000	
片倉コープアグリ	500	1,251.00	625,500	
日東エフシー	1,200	742.00	890,400	
日本曹達	14,000	596.00	8,344,000	



東ソー	28,700	1,984.00	56,940,800	
トクヤマ	5,800	3,900.00	22,620,000	
セントラル硝子	4,000	2,543.00	10,172,000	
東亜合成	11,600	1,302.00	15,103,200	
大阪ソーダ	1,900	3,050.00	5,795,000	
関東電化工業	4,700	1,082.00	5,085,400	
デンカ	7,300	4,365.00	31,864,500	
信越化学工業	33,000	11,410.00	376,530,000	
日本カーバイド工業	600	2,232.00	1,339,200	
堺化学工業	1,400	3,130.00	4,382,000	
エア・ウォーター	16,300	2,232.00	36,381,600	
大陽日酸	15,300	1,648.00	25,214,400	
日本化学工業	700	3,880.00	2,716,000	
東邦アセチレン	300	1,559.00	467,700	
日本パーカライジング	10,100	1,634.00	16,503,400	
高压ガス工業	2,900	1,030.00	2,987,000	
チタン工業	200	2,770.00	554,000	
四国化成工業	2,900	1,629.00	4,724,100	
戸田工業	400	3,125.00	1,250,000	
ステラ ケミファ	1,000	3,870.00	3,870,000	
保土谷化学工業	600	4,110.00	2,466,000	
日本触媒	3,100	7,640.00	23,684,000	
大日精化工業	1,500	4,540.00	6,810,000	
カネカ	27,000	1,140.00	30,780,000	
三菱瓦斯化学	16,300	2,852.00	46,487,600	
三井化学	18,000	3,290.00	59,220,000	
J S R	19,900	2,126.00	42,307,400	
東京応化工業	3,400	4,235.00	14,399,000	
大阪有機化学工業	1,700	1,471.00	2,500,700	
三菱ケミカルホールディングス	132,800	1,011.50	134,327,200	
K Hネオケム	3,000	3,120.00	9,360,000	
ダイセル	26,700	1,263.00	33,722,100	
住友ベークライト	16,000	1,073.00	17,168,000	
積水化学工業	41,200	1,842.00	75,890,400	
日本ゼオン	16,700	1,402.00	23,413,400	
アイカ工業	5,600	4,115.00	23,044,000	
宇部興産	10,000	3,375.00	33,750,000	
積水樹脂	3,100	2,399.00	7,436,900	
タキロンシーアイ	4,000	704.00	2,816,000	

旭有機材	1,200	1,877.00	2,252,400	
日立化成	9,800	2,490.00	24,402,000	
ニチバン	1,000	2,976.00	2,976,000	
リケンテクノス	4,300	566.00	2,433,800	
大倉工業	5,000	607.00	3,035,000	
積水化成成品工業	2,500	1,336.00	3,340,000	
群栄化学工業	500	3,755.00	1,877,500	
タイガースポリマー	1,000	827.00	827,000	
ミライアル	700	1,649.00	1,154,300	
ダイキアクシス	700	1,431.00	1,001,700	
ダイキョーニシカワ	3,900	1,866.00	7,277,400	
竹本容器	300	3,310.00	993,000	
森六ホールディングス	1,000	3,125.00	3,125,000	
日本化薬	12,900	1,302.00	16,795,800	
カーリットホールディングス	1,800	1,123.00	2,021,400	
日本精化	1,600	1,232.00	1,971,200	
扶桑化学工業	1,900	2,888.00	5,487,200	
トリケミカル研究所	500	4,640.00	2,320,000	
A D E K A	8,500	2,067.00	17,569,500	
日油	7,700	3,310.00	25,487,000	
新日本理化	3,100	269.00	833,900	
ハリマ化成グループ	1,500	937.00	1,405,500	
花王	46,500	7,780.00	361,770,000	
第一工業製薬	4,000	768.00	3,072,000	
石原ケミカル	500	2,097.00	1,048,500	
日華化学	600	1,245.00	747,000	
ニイタカ	300	1,839.00	551,700	
三洋化成工業	1,200	5,450.00	6,540,000	
有機合成薬品工業	1,300	304.00	395,200	
大日本塗料	2,300	1,597.00	3,673,100	
日本ペイントホールディングス	15,300	4,710.00	72,063,000	
関西ペイント	20,800	2,371.00	49,316,800	
神東塗料	1,500	231.00	346,500	
中国塗料	5,700	1,118.00	6,372,600	
日本特殊塗料	1,200	2,152.00	2,582,400	
藤倉化成	2,500	682.00	1,705,000	
太陽ホールディングス	1,500	4,670.00	7,005,000	
D I C	7,800	3,760.00	29,328,000	
サカタインクス	4,000	1,600.00	6,400,000	

東洋インキＳＣホールディングス	20,000	642.00	12,840,000	
T & K T O K A	1,300	1,257.00	1,634,100	
富士フイルムホールディングス	39,300	4,252.00	167,103,600	
資生堂	35,300	8,100.00	285,930,000	
ライオン	26,400	2,114.00	55,809,600	
高砂香料工業	1,200	3,495.00	4,194,000	
マンダム	3,700	3,620.00	13,394,000	
ミルボン	2,500	5,260.00	13,150,000	
ファンケル	4,600	4,625.00	21,275,000	
コーセー	3,200	21,720.00	69,504,000	
コタ	900	1,597.00	1,437,300	
シーズ・ホールディングス	2,300	5,790.00	13,317,000	
シーボン	200	3,225.00	645,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,100	5,040.00	40,824,000	
ノエビアホールディングス	1,200	7,690.00	9,228,000	
アジュバンコスメジャパン	400	977.00	390,800	
エステー	1,400	2,638.00	3,693,200	
アグロ カネショウ	800	2,614.00	2,091,200	
コニシ	3,100	1,891.00	5,862,100	
長谷川香料	2,300	2,237.00	5,145,100	
星光P M C	1,100	1,179.00	1,296,900	
小林製薬	5,300	9,420.00	49,926,000	
荒川化学工業	1,700	1,964.00	3,338,800	
メック	1,300	1,914.00	2,488,200	
日本高純度化学	500	2,546.00	1,273,000	
タカラバイオ	5,000	2,488.00	12,440,000	
J C U	2,300	2,690.00	6,187,000	
新田ゼラチン	1,300	869.00	1,129,700	
O A T アグリオ	300	3,560.00	1,068,000	
デクセリアルズ	4,900	1,127.00	5,522,300	
アース製薬	1,400	5,550.00	7,770,000	
北興化学工業	1,900	690.00	1,311,000	
大成ラミック	600	3,115.00	1,869,000	
クミアイ化学工業	8,600	698.00	6,002,800	
日本農薬	4,500	668.00	3,006,000	
アキレス	1,400	2,275.00	3,185,000	
有沢製作所	3,200	1,243.00	3,977,600	
日東電工	14,300	8,531.00	121,993,300	
レック	1,100	4,040.00	4,444,000	

きもと	3,200	317.00	1,014,400	
藤森工業	1,600	4,060.00	6,496,000	
前澤化成工業	1,300	1,273.00	1,654,900	
J S P	1,100	3,510.00	3,861,000	
エフピコ	1,600	6,520.00	10,432,000	
天馬	1,500	1,927.00	2,890,500	
信越ポリマー	3,900	1,137.00	4,434,300	
東リ	4,700	375.00	1,762,500	
ニフコ	6,900	3,980.00	27,462,000	
日本バルカー工業	1,500	3,410.00	5,115,000	
ユニ・チャーム	40,100	3,231.00	129,563,100	
協和発酵キリン	23,700	2,211.00	52,400,700	
武田薬品工業	69,700	4,695.00	327,241,500	
アステラス製薬	194,500	1,670.00	324,815,000	
大日本住友製薬	14,000	1,824.00	25,536,000	
塩野義製薬	26,700	5,723.00	152,804,100	
田辺三菱製薬	23,100	1,952.00	45,091,200	
わかもと製薬	2,300	295.00	678,500	
あすか製薬	2,200	1,435.00	3,157,000	
日本新薬	5,000	7,770.00	38,850,000	
バイオフェルミン製薬	300	2,974.00	892,200	
中外製薬	19,700	5,860.00	115,442,000	
科研製薬	3,400	6,380.00	21,692,000	
エーザイ	22,700	7,320.00	166,164,000	
ロート製薬	10,400	3,520.00	36,608,000	
小野薬品工業	44,700	2,682.50	119,907,750	
久光製薬	5,600	8,800.00	49,280,000	
持田製薬	1,300	7,960.00	10,348,000	
参天製薬	35,900	1,897.00	68,102,300	
扶桑薬品工業	700	2,998.00	2,098,600	
日本ケミファ	300	4,405.00	1,321,500	
ツムラ	6,800	3,940.00	26,792,000	
日医工	5,000	1,658.00	8,290,000	
キッセイ薬品工業	3,300	3,120.00	10,296,000	
生化学工業	3,700	1,773.00	6,560,100	
栄研化学	3,100	2,378.00	7,371,800	
日水製薬	800	1,418.00	1,134,400	
鳥居薬品	1,200	3,000.00	3,600,000	
J C R ファーマ	1,300	5,810.00	7,553,000	

東和薬品	900	6,730.00	6,057,000	
富士製薬工業	600	4,450.00	2,670,000	
沢井製薬	3,800	4,635.00	17,613,000	
ゼリア新薬工業	4,100	2,349.00	9,630,900	
第一三共	54,200	3,890.00	210,838,000	
キョーリン製薬ホールディングス	5,300	2,322.00	12,306,600	
大幸薬品	1,000	2,061.00	2,061,000	
ダイト	1,100	3,685.00	4,053,500	
大塚ホールディングス	39,300	5,269.00	207,071,700	
大正製薬ホールディングス	4,200	11,560.00	48,552,000	
ペプチドリーム	8,700	4,530.00	39,411,000	
日本コークス工業	16,000	120.00	1,920,000	
昭和シェル石油	17,700	1,623.00	28,727,100	
ニチレキ	2,400	1,254.00	3,009,600	
ユシロ化学工業	1,100	1,756.00	1,931,600	
ビービー・カストロール	800	1,704.00	1,363,200	
富士石油	4,600	426.00	1,959,600	
MORESCO	700	1,951.00	1,365,700	
出光興産	15,900	4,100.00	65,190,000	
JXTGホールディングス	302,100	719.90	217,481,790	
コスモエネルギーホールディングス	5,500	4,025.00	22,137,500	
横浜ゴム	11,000	2,575.00	28,325,000	
東洋ゴム工業	11,200	1,757.00	19,678,400	
ブリヂストン	62,600	4,473.00	280,009,800	
住友ゴム工業	19,500	1,945.00	37,927,500	
藤倉ゴム工業	1,700	733.00	1,246,100	
オカモト	7,000	1,134.00	7,938,000	
フコク	800	1,001.00	800,800	
ニッタ	2,000	4,575.00	9,150,000	
住友理工	3,700	1,265.00	4,680,500	
三ツ星ベルト	5,000	1,198.00	5,990,000	
バンドー化学	3,600	1,299.00	4,676,400	
日東紡績	2,800	2,354.00	6,591,200	
旭硝子	19,100	4,785.00	91,393,500	
日本板硝子	9,600	1,166.00	11,193,600	
石塚硝子	300	2,573.00	771,900	
日本山村硝子	8,000	182.00	1,456,000	
日本電気硝子	8,200	3,165.00	25,953,000	
オハラ	700	2,428.00	1,699,600	

住友大阪セメント	37,000	492.00	18,204,000	
太平洋セメント	12,000	4,030.00	48,360,000	
日本ヒューム	1,900	853.00	1,620,700	
日本コンクリート工業	4,100	419.00	1,717,900	
三谷セキサン	1,000	2,588.00	2,588,000	
アジアパイルホールディングス	2,400	718.00	1,723,200	
東海カーボン	17,200	1,705.00	29,326,000	
日本カーボン	1,000	5,550.00	5,550,000	
東洋炭素	1,200	3,955.00	4,746,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	5,230.00	5,230,000	
TOTO	14,600	5,940.00	86,724,000	
日本碍子	23,100	2,074.00	47,909,400	
日本特殊陶業	16,200	3,015.00	48,843,000	
ダントーホールディングス	1,400	141.00	197,400	
MARUWA	700	9,390.00	6,573,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,500.00	1,750,000	
黒崎播磨	400	5,140.00	2,056,000	
ヨータイ	1,500	636.00	954,000	
イソライト工業	1,000	845.00	845,000	
東京窯業	2,400	461.00	1,106,400	
ニッカトー	900	1,056.00	950,400	
フジインコーポレーテッド	1,700	2,641.00	4,489,700	
クニミネ工業	500	1,038.00	519,000	
エーアンドエーマテリアル	400	1,354.00	541,600	
ニチアス	10,000	1,505.00	15,050,000	
ニチハ	2,900	4,475.00	12,977,500	
新日鐵住金	83,800	2,507.00	210,086,600	
神戸製鋼所	34,300	1,184.00	40,611,200	
中山製鋼所	2,600	765.00	1,989,000	
合同製鐵	1,000	2,432.00	2,432,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	50,500	2,437.00	123,068,500	
日新製鋼	5,200	1,495.00	7,774,000	
東京製鐵	10,000	908.00	9,080,000	
共英製鋼	2,100	2,242.00	4,708,200	
大和工業	4,000	3,635.00	14,540,000	
東京鐵鋼	800	1,752.00	1,401,600	
大阪製鐵	1,200	2,402.00	2,882,400	
淀川製鋼所	2,700	3,175.00	8,572,500	
東洋鋼鈑	4,700	718.00	3,374,600	

丸一鋼管	6,600	3,960.00	26,136,000
モリ工業	600	3,440.00	2,064,000
大同特殊鋼	3,300	6,020.00	19,866,000
日本高周波鋼業	700	843.00	590,100
日本冶金工業	15,500	363.00	5,626,500
山陽特殊製鋼	2,200	2,802.00	6,164,400
愛知製鋼	1,100	4,725.00	5,197,500
日立金属	20,200	1,364.00	27,552,800
日本金属	500	2,154.00	1,077,000
大平洋金属	1,200	3,665.00	4,398,000
新日本電工	11,200	344.00	3,852,800
栗本鐵工所	900	1,998.00	1,798,200
虹技	300	2,121.00	636,300
日本鑄鉄管	2,000	169.00	338,000
三菱製鋼	1,400	2,614.00	3,659,600
日亜鋼業	2,700	359.00	969,300
日本精線	300	4,760.00	1,428,000
シンニッタン	2,900	485.00	1,406,500
新家工業	400	2,284.00	913,600
大紀アルミニウム工業所	3,100	829.00	2,569,900
日本軽金属ホールディングス	54,600	296.00	16,161,600
三井金属鉱業	5,100	5,080.00	25,908,000
東邦亜鉛	1,000	4,685.00	4,685,000
三菱マテリアル	12,400	3,170.00	39,308,000
住友金属鉱山	23,900	4,588.00	109,653,200
DOWAホールディングス	4,700	3,845.00	18,071,500
古河機械金属	3,100	1,811.00	5,614,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,900	2,079.00	3,950,100
東邦チタニウム	3,400	1,271.00	4,321,400
UACJ	2,800	2,723.00	7,624,400
CKサンエツ	400	4,320.00	1,728,000
古河電気工業	6,200	4,970.00	30,814,000
住友電気工業	70,000	1,774.50	124,215,000
フジクラ	22,600	790.00	17,854,000
昭和電線ホールディングス	2,400	851.00	2,042,400
東京特殊電線	200	3,045.00	609,000
タツタ電線	3,700	628.00	2,323,600
カナレ電気	300	2,409.00	722,700
平河ヒューテック	900	1,453.00	1,307,700

リョービ	2,300	3,190.00	7,337,000	
アーレスティ	2,300	1,131.00	2,601,300	
アサヒホールディングス	3,200	2,005.00	6,416,000	
稲葉製作所	1,100	1,423.00	1,565,300	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,199.00	1,099,500	
トーカロ	5,200	1,401.00	7,285,200	
アルファC o	700	1,824.00	1,276,800	
SUMCO	17,200	2,844.00	48,916,800	
川田テクノロジーズ	400	6,900.00	2,760,000	
RS Technologies	300	6,720.00	2,016,000	
東洋製罐グループホールディングス	12,800	1,688.00	21,606,400	
ホッカホールディングス	5,000	400.00	2,000,000	
コロナ	1,000	1,264.00	1,264,000	
横河ブリッジホールディングス	3,500	2,534.00	8,869,000	
駒井ハルテック	400	2,383.00	953,200	
高田機工	200	3,260.00	652,000	
三和ホールディングス	18,000	1,335.00	24,030,000	
文化シャッター	5,500	1,144.00	6,292,000	
三協立山	2,600	1,695.00	4,407,000	
アルインコ	1,400	1,097.00	1,535,800	
東洋シャッター	500	664.00	332,000	
LIXILグループ	27,600	2,580.00	71,208,000	
日本ファイルコン	1,400	631.00	883,400	
ノーリツ	4,200	2,041.00	8,572,200	
長府製作所	2,100	2,611.00	5,483,100	
リンナイ	3,300	10,820.00	35,706,000	
ダイニチ工業	1,000	820.00	820,000	
日東精工	2,600	804.00	2,090,400	
三洋工業	200	2,182.00	436,400	
岡部	3,800	1,034.00	3,929,200	
ジーテクト	2,100	2,467.00	5,180,700	
中国工業	300	696.00	208,800	
東プレ	3,500	3,390.00	11,865,000	
高周波熱錬	3,600	1,099.00	3,956,400	
東京製綱	1,300	2,126.00	2,763,800	
サンコール	1,100	698.00	767,800	
モリテック スチール	1,500	725.00	1,087,500	
パイオラックス	2,800	3,190.00	8,932,000	
エイチワン	1,800	1,333.00	2,399,400	



日本発條	18,600	1,160.00	21,576,000	
中央発條	200	3,680.00	736,000	
アドバネクス	300	2,555.00	766,500	
立川ブラインド工業	800	1,433.00	1,146,400	
三益半導体工業	1,500	1,969.00	2,953,500	
日本ドライケミカル	300	2,285.00	685,500	
日本製鋼所	6,100	3,500.00	21,350,000	
三浦工業	8,100	3,360.00	27,216,000	
タクマ	6,300	1,373.00	8,649,900	
ツガミ	5,000	1,302.00	6,510,000	
オークマ	2,200	7,000.00	15,400,000	
東芝機械	11,000	638.00	7,018,000	
アマダホールディングス	28,900	1,327.00	38,350,300	
アイダエンジニアリング	4,800	1,290.00	6,192,000	
滝澤鉄工所	600	2,111.00	1,266,600	
F U J I	5,600	2,314.00	12,958,400	
牧野フライス製作所	10,000	1,051.00	10,510,000	
オーエスジー	8,600	2,575.00	22,145,000	
ダイジェット工業	200	1,950.00	390,000	
旭ダイヤモンド工業	5,600	1,041.00	5,829,600	
D M G 森精機	10,400	2,142.00	22,276,800	
ソディック	4,100	1,277.00	5,235,700	
ディスコ	2,500	21,390.00	53,475,000	
日東工器	1,200	2,938.00	3,525,600	
日進工具	500	3,140.00	1,570,000	
パンチ工業	1,600	1,208.00	1,932,800	
富士ダイス	900	978.00	880,200	
豊和工業	1,000	1,094.00	1,094,000	
O K K	700	1,188.00	831,600	
東洋機械金属	1,500	785.00	1,177,500	
津田駒工業	4,000	255.00	1,020,000	
エンシュウ	5,000	180.00	900,000	
島精機製作所	2,400	6,190.00	14,856,000	
オプトラ	1,800	3,500.00	6,300,000	
N C ホールディングス	600	839.00	503,400	
フリー	1,300	940.00	1,222,000	
ヤマシンフィルタ	2,800	1,200.00	3,360,000	
日阪製作所	2,700	1,140.00	3,078,000	
やまびこ	3,600	1,610.00	5,796,000	

平田機工	700	8,840.00	6,188,000	
ペガサスミシン製造	1,800	778.00	1,400,400	
ナブテスコ	10,300	3,745.00	38,573,500	
三井海洋開発	2,000	3,150.00	6,300,000	
レオン自動機	1,700	2,341.00	3,979,700	
S M C	5,900	42,340.00	249,806,000	
新川	1,500	1,163.00	1,744,500	
ホソカワミクロン	700	7,650.00	5,355,000	
ユニオンツール	900	4,280.00	3,852,000	
オイレス工業	2,400	2,526.00	6,062,400	
日精エー・エス・ビー機械	500	5,240.00	2,620,000	
サトーホールディングス	2,500	3,070.00	7,675,000	
技研製作所	1,300	2,523.00	3,279,900	
日本エアーテック	600	889.00	533,400	
カワタ	400	1,641.00	656,400	
日精樹脂工業	1,600	1,310.00	2,096,000	
オカダアイヨン	600	1,508.00	904,800	
ワイエイシイホールディングス	600	1,006.00	603,600	
小松製作所	91,400	3,695.00	337,723,000	
住友重機械工業	10,800	4,230.00	45,684,000	
日立建機	8,800	4,130.00	36,344,000	
日工	500	2,505.00	1,252,500	
巴工業	800	2,185.00	1,748,000	
井関農機	1,900	2,064.00	3,921,600	
T O W A	1,500	1,491.00	2,236,500	
丸山製作所	400	1,993.00	797,200	
北川鉄工所	900	2,969.00	2,672,100	
ローツェ	900	2,611.00	2,349,900	
タカキタ	700	794.00	555,800	
クボタ	101,500	1,927.00	195,590,500	
荏原実業	600	2,442.00	1,465,200	
三菱化工機	700	2,299.00	1,609,300	
月島機械	3,800	1,813.00	6,889,400	
帝国電機製作所	1,300	1,563.00	2,031,900	
東京機械製作所	700	460.00	322,000	
新東工業	4,500	1,189.00	5,350,500	
澁谷工業	1,700	3,680.00	6,256,000	
アイチ コーポレーション	3,300	770.00	2,541,000	
小森コーポレーション	4,800	1,442.00	6,921,600	

鶴見製作所	1,600	2,143.00	3,428,800	
住友精密工業	3,000	387.00	1,161,000	
酒井重工業	400	4,100.00	1,640,000	
荏原製作所	7,800	3,975.00	31,005,000	
石井鐵工所	300	2,087.00	626,100	
西島製作所	1,900	1,072.00	2,036,800	
北越工業	2,100	1,109.00	2,328,900	
ダイキン工業	25,800	13,250.00	341,850,000	
オルガノ	700	3,610.00	2,527,000	
トーヨーカネツ	800	3,725.00	2,980,000	
栗田工業	10,200	3,300.00	33,660,000	
椿本チエイン	11,000	899.00	9,889,000	
大同工業	700	1,596.00	1,117,200	
木村化工機	1,600	473.00	756,800	
アネスト岩田	3,200	1,131.00	3,619,200	
ダイフク	9,600	5,770.00	55,392,000	
サムコ	500	1,321.00	660,500	
加藤製作所	900	3,105.00	2,794,500	
油研工業	400	2,984.00	1,193,600	
タダノ	9,100	1,545.00	14,059,500	
フジテック	6,100	1,393.00	8,497,300	
C K D	5,300	2,345.00	12,428,500	
キトー	1,400	2,108.00	2,951,200	
平和	5,900	2,427.00	14,319,300	
理想科学工業	1,900	2,345.00	4,455,500	
SANKYO	4,700	4,300.00	20,210,000	
日本金銭機械	1,700	1,195.00	2,031,500	
マースエンジニアリング	1,200	2,743.00	3,291,600	
福島工業	1,200	5,110.00	6,132,000	
オーイズミ	800	578.00	462,400	
ダイコク電機	900	1,863.00	1,676,700	
竹内製作所	3,200	2,577.00	8,246,400	
アマノ	5,900	2,717.00	16,030,300	
JUKI	2,800	1,233.00	3,452,400	
サンデンホールディングス	2,300	1,664.00	3,827,200	
蛇の目ミシン工業	1,700	771.00	1,310,700	
マックス	2,900	1,483.00	4,300,700	
グローリー	5,600	3,520.00	19,712,000	
新晃工業	1,900	1,796.00	3,412,400	

大和冷機工業	3,000	1,385.00	4,155,000	
セガサミーホールディングス	18,800	1,896.00	35,644,800	
日本ピストンリング	700	2,340.00	1,638,000	
リケン	900	6,110.00	5,499,000	
T P R	2,100	3,395.00	7,129,500	
ツバキ・ナカシマ	1,900	2,625.00	4,987,500	
ホシザキ	6,000	10,280.00	61,680,000	
大豊工業	1,500	1,525.00	2,287,500	
日本精工	38,900	1,439.00	55,977,100	
N T N	43,800	491.00	21,505,800	
ジェイテクト	20,200	1,749.00	35,329,800	
不二越	18,000	579.00	10,422,000	
日本トムソン	6,000	863.00	5,178,000	
T H K	11,800	3,815.00	45,017,000	
ユーシン精機	1,700	1,471.00	2,500,700	
前澤給装工業	700	1,940.00	1,358,000	
イーグル工業	2,300	2,052.00	4,719,600	
前澤工業	1,400	486.00	680,400	
日本ピラー工業	1,900	1,707.00	3,243,300	
キッツ	7,700	1,026.00	7,900,200	
マキタ	24,700	5,020.00	123,994,000	
日立造船	15,000	581.00	8,715,000	
三菱重工業	31,700	4,193.00	132,918,100	
I H I	14,500	3,950.00	57,275,000	
スター精密	3,000	1,944.00	5,832,000	
日清紡ホールディングス	11,600	1,475.00	17,110,000	
イビデン	11,600	1,706.00	19,789,600	
コニカミノルタ	44,300	1,007.00	44,610,100	
ブラザー工業	23,100	2,522.00	58,258,200	
ミネベアミツミ	35,100	2,230.00	78,273,000	
日立製作所	454,000	864.30	392,392,200	
三菱電機	189,300	1,659.00	314,048,700	
富士電機	57,000	794.00	45,258,000	
東洋電機製造	700	1,848.00	1,293,600	
安川電機	21,900	4,615.00	101,068,500	
シンフォニアテクノロジー	12,000	459.00	5,508,000	
明電舎	16,000	454.00	7,264,000	
オリジン電気	600	2,417.00	1,450,200	
山洋電気	900	10,220.00	9,198,000	

デンヨー	1,700	1,938.00	3,294,600	
東芝テック	14,000	641.00	8,974,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	428.00	1,284,000	
マブチモーター	5,300	5,410.00	28,673,000	
日本電産	22,800	17,605.00	401,394,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	3,080.00	2,156,000	
トレックス・セミコンダクター	500	1,484.00	742,000	
東光高岳	1,000	1,914.00	1,914,000	
ダブル・スコープ	2,800	1,795.00	5,026,000	
ダイヘン	10,000	795.00	7,950,000	
田淵電機	2,600	281.00	730,600	
ヤーマン	2,700	2,473.00	6,677,100	
JVCケンウッド	13,900	356.00	4,948,400	
ミマキエンジニアリング	1,700	931.00	1,582,700	
第一精工	900	2,234.00	2,010,600	
日新電機	4,400	1,129.00	4,967,600	
大崎電気工業	4,100	836.00	3,427,600	
オムロン	20,100	6,030.00	121,203,000	
日東工業	3,000	2,231.00	6,693,000	
I D E C	2,300	2,616.00	6,016,800	
不二電機工業	200	1,421.00	284,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,000	564.00	19,176,000	
サクサホールディングス	500	2,385.00	1,192,500	
メルコホールディングス	900	4,155.00	3,739,500	
テクノメディカ	500	1,975.00	987,500	
日本電気	24,500	3,055.00	74,847,500	
富士通	195,000	670.80	130,806,000	
沖電気工業	7,700	1,316.00	10,133,200	
岩崎通信機	800	818.00	654,400	
電気興業	1,100	3,100.00	3,410,000	
サンケン電気	11,000	683.00	7,513,000	
ナカヨ	400	1,893.00	757,200	
アイホン	1,100	1,860.00	2,046,000	
ルネサスエレクトロニクス	9,800	1,050.00	10,290,000	
セイコーエプソン	28,200	2,044.00	57,640,800	
ワコム	14,700	592.00	8,702,400	
アルバック	4,400	5,700.00	25,080,000	
アクセル	800	857.00	685,600	
E I Z O	1,700	4,900.00	8,330,000	

ジャパンディスプレイ	38,900	146.00	5,679,400	
日本信号	5,200	1,069.00	5,558,800	
京三製作所	4,400	800.00	3,520,000	
能美防災	2,500	2,619.00	6,547,500	
ホーチキ	1,400	2,208.00	3,091,200	
星和電機	600	691.00	414,600	
エレコム	1,600	3,015.00	4,824,000	
パナソニック	216,200	1,629.00	352,189,800	
シャープ	17,600	3,225.00	56,760,000	
アンリツ	13,800	1,530.00	21,114,000	
富士通ゼネラル	5,800	1,763.00	10,225,400	
ソニー	126,500	5,271.00	666,781,500	
T D K	9,900	10,170.00	100,683,000	
帝国通信工業	800	1,300.00	1,040,000	
タムラ製作所	7,300	785.00	5,730,500	
アルプス電気	16,300	2,740.00	44,662,000	
池上通信機	6,000	162.00	972,000	
パイオニア	31,500	162.00	5,103,000	
日本電波工業	1,700	636.00	1,081,200	
鈴木	800	1,070.00	856,000	
日本トリム	400	4,540.00	1,816,000	
ローランド ディー・ジー	1,000	2,640.00	2,640,000	
フォスター電機	2,200	1,991.00	4,380,200	
クラリオン	10,000	300.00	3,000,000	
S M K	5,000	396.00	1,980,000	
ヨコオ	1,200	2,086.00	2,503,200	
ティアック	14,000	42.00	588,000	
ホシデン	4,800	1,203.00	5,774,400	
ヒロセ電機	3,200	14,700.00	47,040,000	
日本航空電子工業	5,000	1,880.00	9,400,000	
T O A	2,000	1,261.00	2,522,000	
マクセルホールディングス	3,800	1,737.00	6,600,600	
古野電気	2,200	956.00	2,103,200	
ユニデンホールディングス	5,000	327.00	1,635,000	
アルパイン	4,500	2,270.00	10,215,000	
スミダコーポレーション	1,900	1,425.00	2,707,500	
アイコム	1,000	2,868.00	2,868,000	
リオン	800	2,321.00	1,856,800	
本多通信工業	1,500	1,033.00	1,549,500	

船井電機	1,900	740.00	1,406,000	
横河電機	18,900	2,086.00	39,425,400	
新電元工業	700	6,430.00	4,501,000	
アズビル	5,700	5,530.00	31,521,000	
東亜ディーケーケー	900	1,317.00	1,185,300	
日本光電工業	7,900	2,952.00	23,320,800	
チノー	700	1,712.00	1,198,400	
共和電業	2,100	455.00	955,500	
日本電子材料	700	1,011.00	707,700	
堀場製作所	3,700	9,420.00	34,854,000	
アドバンテスト	10,600	2,807.00	29,754,200	
小野測器	800	856.00	684,800	
エスベック	1,700	2,749.00	4,673,300	
キーエンス	9,300	68,410.00	636,213,000	
日置電機	1,000	4,250.00	4,250,000	
シスメックス	14,700	9,490.00	139,503,000	
日本マイクロニクス	3,100	1,281.00	3,971,100	
メガチップス	1,500	3,340.00	5,010,000	
O B A R A G R O U P	1,100	6,570.00	7,227,000	
澤藤電機	200	2,041.00	408,200	
コーセル	2,600	1,498.00	3,894,800	
イリソ電子工業	1,600	7,150.00	11,440,000	
新日本無線	1,100	951.00	1,046,100	
オブテックスグループ	3,100	2,915.00	9,036,500	
千代田インテグレ	900	2,417.00	2,175,300	
アイ・オー・データ機器	800	1,221.00	976,800	
レーザーテック	3,900	3,785.00	14,761,500	
スタンレー電気	14,500	3,915.00	56,767,500	
岩崎電気	700	1,742.00	1,219,400	
ウシオ電機	11,500	1,556.00	17,894,000	
岡谷電機産業	1,300	598.00	777,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	802.00	1,283,200	
日本セラミック	1,900	2,721.00	5,169,900	
遠藤照明	1,000	1,015.00	1,015,000	
古河電池	1,300	980.00	1,274,000	
双信電機	800	623.00	498,400	
山一電機	1,400	2,084.00	2,917,600	
図研	1,200	1,796.00	2,155,200	
日本電子	7,000	1,036.00	7,252,000	

カシオ計算機	15,200	1,705.00	25,916,000	
ファナック	18,000	23,820.00	428,760,000	
日本シイエムケイ	3,300	835.00	2,755,500	
エンプラス	900	3,380.00	3,042,000	
大真空	700	1,394.00	975,800	
ローム	8,500	10,660.00	90,610,000	
浜松ホトニクス	13,800	4,505.00	62,169,000	
三井ハイテック	2,500	1,608.00	4,020,000	
新光電気工業	7,100	937.00	6,652,700	
京セラ	31,100	6,752.00	209,987,200	
太陽誘電	8,500	2,435.00	20,697,500	
村田製作所	19,900	15,835.00	315,116,500	
ユーシン	2,800	749.00	2,097,200	
双葉電子工業	3,100	2,109.00	6,537,900	
北陸電気工業	800	1,327.00	1,061,600	
ニチコン	6,000	1,402.00	8,412,000	
日本ケミコン	1,500	3,795.00	5,692,500	
K O A	2,600	2,412.00	6,271,200	
市光工業	2,800	1,374.00	3,847,200	
小糸製作所	11,300	7,940.00	89,722,000	
ミツバ	3,500	1,356.00	4,746,000	
S C R E E Nホールディングス	3,600	9,880.00	35,568,000	
キャノン電子	1,700	2,538.00	4,314,600	
キャノン	101,900	3,798.00	387,016,200	
リコー	56,900	1,054.00	59,972,600	
象印マホービン	3,500	1,602.00	5,607,000	
M U T O Hホールディングス	300	2,462.00	738,600	
東京エレクトロン	12,600	21,650.00	272,790,000	
トヨタ紡織	5,500	2,284.00	12,562,000	
芦森工業	400	2,796.00	1,118,400	
ユニプレス	3,700	2,722.00	10,071,400	
豊田自動織機	15,300	6,900.00	105,570,000	
モリタホールディングス	3,000	2,234.00	6,702,000	
三櫻工業	2,400	767.00	1,840,800	
デンソー	42,000	5,725.00	240,450,000	
東海理化電機製作所	5,000	2,241.00	11,205,000	
三井E & Sホールディングス	6,800	1,686.00	11,464,800	
川崎重工業	14,700	3,525.00	51,817,500	
名村造船所	5,700	564.00	3,214,800	



サノヤホールディングス	2,300	258.00	593,400	
日本車輛製造	7,000	290.00	2,030,000	
三菱ロジスネクスト	2,300	1,158.00	2,663,400	
近畿車輛	300	2,774.00	832,200	
日産自動車	223,200	1,125.50	251,211,600	
いすゞ自動車	54,800	1,671.50	91,598,200	
トヨタ自動車	230,100	7,514.00	1,728,971,400	
日野自動車	27,000	1,306.00	35,262,000	
三菱自動車工業	70,100	873.00	61,197,300	
エフテック	1,200	1,462.00	1,754,400	
レシップホールディングス	700	866.00	606,200	
G M B	300	1,578.00	473,400	
ファルテック	300	1,336.00	400,800	
武蔵精密工業	2,000	4,195.00	8,390,000	
日産車体	7,400	1,082.00	8,006,800	
新明和工業	8,200	1,289.00	10,569,800	
極東開発工業	3,500	1,769.00	6,191,500	
日信工業	3,800	2,119.00	8,052,200	
トピー工業	1,600	3,520.00	5,632,000	
ティラド	700	3,905.00	2,733,500	
曙ブレーキ工業	8,800	258.00	2,270,400	
タチエス	3,200	2,135.00	6,832,000	
N O K	10,200	2,301.00	23,470,200	
フタバ産業	5,800	868.00	5,034,400	
K Y B	2,000	5,440.00	10,880,000	
大同メタル工業	2,400	1,445.00	3,468,000	
プレス工業	10,000	656.00	6,560,000	
ミクニ	2,400	620.00	1,488,000	
太平洋工業	4,000	1,635.00	6,540,000	
ケーヒン	4,300	2,378.00	10,225,400	
河西工業	2,300	1,573.00	3,617,900	
アイシン精機	15,600	5,970.00	93,132,000	
マツダ	59,400	1,447.50	85,981,500	
今仙電機製作所	1,800	1,292.00	2,325,600	
本田技研工業	170,300	3,645.00	620,743,500	
スズキ	37,500	6,278.00	235,425,000	
S U B A R U	58,800	3,550.00	208,740,000	
安永	900	2,233.00	2,009,700	
ヤマハ発動機	26,700	3,360.00	89,712,000	

ショーワ	4,900	1,976.00	9,682,400	
T B K	2,200	535.00	1,177,000	
エクセディ	2,300	3,730.00	8,579,000	
豊田合成	6,900	2,920.00	20,148,000	
愛三工業	3,300	1,195.00	3,943,500	
盟和産業	300	1,310.00	393,000	
日本プラスト	1,000	1,060.00	1,060,000	
ヨロズ	1,900	2,006.00	3,811,400	
エフ・シー・シー	3,100	3,130.00	9,703,000	
シマノ	7,600	14,930.00	113,468,000	
テイ・エス テック	4,400	5,070.00	22,308,000	
ジャムコ	900	2,297.00	2,067,300	
テルモ	29,000	6,390.00	185,310,000	
クリエートメディック	600	1,399.00	839,400	
日機装	6,500	1,239.00	8,053,500	
島津製作所	22,600	3,135.00	70,851,000	
J M S	1,700	628.00	1,067,600	
クボテック	400	551.00	220,400	
長野計器	1,500	1,344.00	2,016,000	
ブイ・テクノロジー	400	28,040.00	11,216,000	
東京計器	1,200	1,403.00	1,683,600	
愛知時計電機	200	4,150.00	830,000	
インターアクション	1,000	1,158.00	1,158,000	
オーバル	1,800	321.00	577,800	
東京精密	3,400	4,505.00	15,317,000	
マニー	2,300	4,790.00	11,017,000	
ニコン	33,000	1,845.00	60,885,000	
トプコン	10,200	2,097.00	21,389,400	
オリンパス	28,200	3,890.00	109,698,000	
理研計器	1,800	2,781.00	5,005,800	
タムロン	1,500	2,267.00	3,400,500	
H O Y A	38,100	6,347.00	241,820,700	
シード	300	7,150.00	2,145,000	
ノーリツ鋼機	1,900	2,760.00	5,244,000	
エー・アンド・デイ	1,700	966.00	1,642,200	
シチズン時計	22,600	782.00	17,673,200	
リズム時計工業	700	2,421.00	1,694,700	
大研医器	1,700	762.00	1,295,400	
メニコン	2,600	2,985.00	7,761,000	

シンシア	200	707.00	141,400
松風	900	1,442.00	1,297,800
セイコーホールディングス	2,900	2,815.00	8,163,500
ニプロ	13,100	1,279.00	16,754,900
中本パックス	500	1,813.00	906,500
スノーピーク	600	1,460.00	876,000
パラマウントベッドホールディングス	2,000	5,160.00	10,320,000
トランザクション	1,000	1,001.00	1,001,000
S H O - B I	600	444.00	266,400
ニホンフラッシュ	900	2,955.00	2,659,500
前田工織	2,100	1,813.00	3,807,300
永大産業	2,500	570.00	1,425,000
アートネイチャー	2,000	739.00	1,478,000
バンダイナムコホールディングス	19,600	4,090.00	80,164,000
アイフィスジャパン	400	785.00	314,000
共立印刷	3,100	371.00	1,150,100
S H O E I	900	4,415.00	3,973,500
フランスベッドホールディングス	2,200	1,011.00	2,224,200
パイロットコーポレーション	3,300	6,110.00	20,163,000
萩原工業	1,100	1,948.00	2,142,800
トッパン・フォームズ	4,100	1,220.00	5,002,000
フジシールインターナショナル	4,200	4,225.00	17,745,000
タカラトミー	7,900	1,054.00	8,326,600
廣済堂	1,800	536.00	964,800
A s - m e エステール	600	829.00	497,400
アーク	9,600	123.00	1,180,800
タカノ	800	1,001.00	800,800
プロネクサス	1,800	1,368.00	2,462,400
ホクシン	1,300	176.00	228,800
ウッドワン	600	1,446.00	867,600
大建工業	1,500	2,752.00	4,128,000
凸版印刷	53,000	917.00	48,601,000
大日本印刷	24,800	2,406.00	59,668,800
図書印刷	1,300	1,055.00	1,371,500
共同印刷	600	3,190.00	1,914,000
N I S S H A	3,900	2,599.00	10,136,100
光村印刷	200	2,431.00	486,200
宝印刷	1,000	2,030.00	2,030,000
アシックス	18,800	1,881.00	35,362,800

ツツミ	600	2,047.00	1,228,200	
小松ウオール工業	600	2,410.00	1,446,000	
ヤマハ	12,800	5,830.00	74,624,000	
河合楽器製作所	600	4,870.00	2,922,000	
クリナップ	1,800	868.00	1,562,400	
ピジョン	11,400	5,170.00	58,938,000	
兼松サステック	100	2,185.00	218,500	
キングジム	1,600	1,087.00	1,739,200	
リンテック	4,500	3,315.00	14,917,500	
イトーキ	4,000	690.00	2,760,000	
任天堂	11,700	46,000.00	538,200,000	
三菱鉛筆	3,100	2,310.00	7,161,000	
タカラスタンダード	3,900	1,879.00	7,328,100	
コクヨ	9,100	2,074.00	18,873,400	
ナカバヤシ	1,900	670.00	1,273,000	
グロープライド	800	3,610.00	2,888,000	
オカムラ	6,600	1,727.00	11,398,200	
美津濃	1,900	4,150.00	7,885,000	
東京電力ホールディングス	151,100	578.00	87,335,800	
中部電力	57,900	1,732.50	100,311,750	
関西電力	77,200	1,635.50	126,260,600	
中国電力	26,200	1,435.00	37,597,000	
北陸電力	18,500	1,130.00	20,905,000	
東北電力	44,300	1,476.00	65,386,800	
四国電力	17,000	1,423.00	24,191,000	
九州電力	41,800	1,296.00	54,172,800	
北海道電力	19,000	815.00	15,485,000	
沖縄電力	3,100	3,290.00	10,199,000	
電源開発	15,100	3,135.00	47,338,500	
エフオン	900	1,629.00	1,466,100	
イーレックス	3,000	1,104.00	3,312,000	
レノバ	1,000	1,078.00	1,078,000	
東京瓦斯	40,400	2,982.00	120,472,800	
大阪瓦斯	36,700	2,430.00	89,181,000	
東邦瓦斯	9,400	3,525.00	33,135,000	
北海道瓦斯	5,000	302.00	1,510,000	
広島ガス	3,900	384.00	1,497,600	
西部瓦斯	2,300	2,961.00	6,810,300	
静岡ガス	5,400	1,033.00	5,578,200	

メタウォーター	1,100	3,180.00	3,498,000	
SBSホールディングス	1,900	1,315.00	2,498,500	
東武鉄道	20,000	3,400.00	68,000,000	
相鉄ホールディングス	6,100	3,195.00	19,489,500	
東京急行電鉄	51,400	1,878.00	96,529,200	
京浜急行電鉄	25,900	1,879.00	48,666,100	
小田急電鉄	28,100	2,350.00	66,035,000	
京王電鉄	10,600	4,945.00	52,417,000	
京成電鉄	13,200	3,690.00	48,708,000	
富士急行	2,600	3,185.00	8,281,000	
新京成電鉄	500	2,267.00	1,133,500	
東日本旅客鉄道	34,000	10,835.00	368,390,000	
西日本旅客鉄道	17,100	7,987.00	136,577,700	
東海旅客鉄道	16,900	21,840.00	369,096,000	
西武ホールディングス	24,100	1,807.00	43,548,700	
鴻池運輸	2,700	2,019.00	5,451,300	
西日本鉄道	5,200	3,025.00	15,730,000	
ハマキョウレックス	1,300	4,025.00	5,232,500	
サカイ引越センター	1,000	6,260.00	6,260,000	
近鉄グループホールディングス	17,900	4,440.00	79,476,000	
阪急阪神ホールディングス	23,900	4,420.00	105,638,000	
南海電気鉄道	8,500	3,075.00	26,137,500	
京阪ホールディングス	8,000	3,690.00	29,520,000	
神戸電鉄	400	4,005.00	1,602,000	
名古屋鉄道	14,300	2,779.00	39,739,700	
山陽電気鉄道	1,400	2,721.00	3,809,400	
日本通運	7,000	8,180.00	57,260,000	
ヤマトホールディングス	31,400	2,980.00	93,572,000	
山九	4,600	5,840.00	26,864,000	
丸運	1,000	356.00	356,000	
丸全昭和運輸	6,000	521.00	3,126,000	
センコーグループホールディングス	10,800	890.00	9,612,000	
トナミホールディングス	400	7,390.00	2,956,000	
ニッコンホールディングス	6,800	3,100.00	21,080,000	
日本石油輸送	200	3,480.00	696,000	
福山通運	2,600	5,450.00	14,170,000	
セイノーホールディングス	13,400	1,904.00	25,513,600	
エスライン	500	1,222.00	611,000	
神奈川中央交通	400	3,760.00	1,504,000	

日立物流	3,900	3,100.00	12,090,000	
丸和運輸機関	900	4,095.00	3,685,500	
C & F ロジホールディングス	2,000	1,464.00	2,928,000	
九州旅客鉄道	15,000	3,430.00	51,450,000	
S Gホールディングス	16,900	2,366.00	39,985,400	
日本郵船	15,000	2,471.00	37,065,000	
商船三井	11,300	3,305.00	37,346,500	
川崎汽船	8,300	2,485.00	20,625,500	
N S ユナイテッド海運	800	2,337.00	1,869,600	
明治海運	1,900	428.00	813,200	
飯野海運	9,100	531.00	4,832,100	
共栄タンカー	100	1,904.00	190,400	
乾汽船	1,400	1,019.00	1,426,600	
日本航空	33,300	4,058.00	135,131,400	
A N A ホールディングス	34,800	4,220.00	146,856,000	
パスコ	2,000	331.00	662,000	
トランコム	500	8,650.00	4,325,000	
日新	1,500	2,801.00	4,201,500	
三菱倉庫	6,200	2,529.00	15,679,800	
三井倉庫ホールディングス	10,000	362.00	3,620,000	
住友倉庫	12,000	760.00	9,120,000	
澁澤倉庫	1,000	1,868.00	1,868,000	
東陽倉庫	3,200	373.00	1,193,600	
日本トランスシティ	4,300	574.00	2,468,200	
ケイヒン	300	1,665.00	499,500	
中央倉庫	1,100	1,178.00	1,295,800	
川西倉庫	400	2,018.00	807,200	
安田倉庫	1,600	977.00	1,563,200	
東洋埠頭	500	1,737.00	868,500	
宇徳	1,500	525.00	787,500	
上組	11,100	2,477.00	27,494,700	
サンリツ	500	813.00	406,500	
キムラユニティー	500	1,174.00	587,000	
キューソー流通システム	500	2,776.00	1,388,000	
近鉄エクスプレス	3,400	2,425.00	8,245,000	
東海運	1,000	398.00	398,000	
エーアイテイナー	1,300	1,221.00	1,587,300	
内外トランスライン	600	1,721.00	1,032,600	
日本コンセプト	300	1,423.00	426,900	

NEC ネットエスアイ	2,000	2,704.00	5,408,000
システナ	1,500	4,915.00	7,372,500
デジタルアーツ	900	5,460.00	4,914,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,800	3,010.00	8,428,000
キューブシステム	1,100	841.00	925,100
エイジア	400	1,601.00	640,400
コア	800	1,551.00	1,240,800
ソリトンシステムズ	800	1,278.00	1,022,400
ソフトクリエイトホールディングス	900	1,710.00	1,539,000
T I S	6,200	5,040.00	31,248,000
ネオス	600	407.00	244,200
電算システム	600	2,035.00	1,221,000
グリー	10,000	630.00	6,300,000
コーエーテクモホールディングス	3,200	2,184.00	6,988,800
三菱総合研究所	700	4,585.00	3,209,500
ボルテージ	400	903.00	361,200
電算	200	2,379.00	475,800
A G S	1,000	870.00	870,000
ファインデックス	1,500	822.00	1,233,000
ヒト・コミュニケーションズ	400	2,093.00	837,200
ブレインパッド	400	2,883.00	1,153,200
K L a b	3,500	1,719.00	6,016,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホール ディ	1,300	2,050.00	2,665,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,228.00	368,400
ネクソン	41,700	1,651.00	68,846,700
アイスタイル	4,700	1,173.00	5,513,100
エムアップ	600	1,417.00	850,200
エイチーム	1,200	2,280.00	2,736,000
テクノスジャパン	1,700	958.00	1,628,600
e n i s h	600	1,040.00	624,000
コロブラ	5,300	827.00	4,383,100
モバイルクリエイト	1,500	372.00	558,000
オルトプラス	1,100	823.00	905,300
ブロードリーフ	9,200	588.00	5,409,600
クロス・マーケティンググループ	500	644.00	322,000
ハーツユナイテッドグループ	1,000	1,687.00	1,687,000
メディアドゥホールディングス	600	2,060.00	1,236,000
バイキューブ	1,100	609.00	669,900

サイバーリンクス	300	1,139.00	341,700
ディー・エル・イー	1,200	433.00	519,600
フィックスターズ	1,800	1,431.00	2,575,800
VOYAGE GROUP	1,000	1,184.00	1,184,000
オブティム	300	2,638.00	791,400
セレス	600	1,911.00	1,146,600
ベリサーブ	200	3,255.00	651,000
ティーガイア	1,900	2,927.00	5,561,300
セック	200	2,818.00	563,600
日本アジアグループ	1,900	537.00	1,020,300
豆蔵ホールディングス	1,400	1,129.00	1,580,600
テクマトリックス	1,000	2,099.00	2,099,000
プロシップ	300	2,644.00	793,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	50,400	294.00	14,817,600
GMOペイメントゲートウェイ	1,500	11,070.00	16,605,000
ザッパラス	900	380.00	342,000
システムリサーチ	200	2,814.00	562,800
インターネットイニシアティブ	3,000	2,270.00	6,810,000
さくらインターネット	2,200	826.00	1,817,200
ヴィンクス	500	1,397.00	698,500
GMOクラウド	400	2,810.00	1,124,000
SRAホールディングス	1,000	3,180.00	3,180,000
Minor iソリューションズ	400	1,697.00	678,800
システムインテグレータ	300	1,144.00	343,200
朝日ネット	1,700	536.00	911,200
eBASE	500	1,418.00	709,000
アバント	500	935.00	467,500
アドソル日進	700	1,319.00	923,300
フリービット	1,200	1,171.00	1,405,200
コムチュア	900	3,835.00	3,451,500
サイバーコム	300	2,273.00	681,900
インフォテリア	900	1,275.00	1,147,500
メディカル・データ・ビジョン	1,400	1,377.00	1,927,800
gumi	2,100	1,002.00	2,104,200
ショーケース・ティービー	400	1,472.00	588,800
モバイルファクトリー	500	1,426.00	713,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,199.00	959,200



PCIホールディングス	300	3,290.00	987,000
パイブドHD	300	1,012.00	303,600
アイビーシー	300	1,341.00	402,300
ネオジャパン	400	1,408.00	563,200
オープンドア	700	1,880.00	1,316,000
マイネット	500	1,067.00	533,500
アカツキ	500	4,700.00	2,350,000
ベネフィットジャパン	100	1,360.00	136,000
Ubicomホールディングス	300	946.00	283,800
LINE	5,600	4,070.00	22,792,000
シンクロ・フード	600	904.00	542,400
オークネット	800	1,447.00	1,157,600
AOI TYO Holdings	1,500	1,550.00	2,325,000
マクロミル	2,300	2,636.00	6,062,800
ビーグリー	400	1,682.00	672,800
オロ	200	2,804.00	560,800
ソルクシーズ	700	1,193.00	835,100
フェイス	700	1,204.00	842,800
ハイマックス	200	1,824.00	364,800
野村総合研究所	11,800	5,660.00	66,788,000
サイバネットシステム	1,500	836.00	1,254,000
CEホールディングス	500	890.00	445,000
日本システム技術	300	1,416.00	424,800
インテージホールディングス	2,200	1,219.00	2,681,800
東邦システムサイエンス	600	898.00	538,800
ソースネクスト	2,600	810.00	2,106,000
フォーカスシステムズ	1,100	923.00	1,015,300
クレスコ	400	3,635.00	1,454,000
フジ・メディア・ホールディングス	19,500	1,964.00	38,298,000
オービック	5,900	9,080.00	53,572,000
ジャストシステム	3,000	2,532.00	7,596,000
TDCソフト	800	1,476.00	1,180,800
ヤフー	133,900	401.00	53,693,900
トレンドマイクロ	9,100	6,130.00	55,783,000
インフォメーション・ディベロプメント	600	1,426.00	855,600
日本オラクル	3,000	9,010.00	27,030,000
アルファシステムズ	600	2,297.00	1,378,200
フューチャー	2,500	1,428.00	3,570,000
CAC Holdings	1,400	1,064.00	1,489,600

ソフトバンク・テクノロジー	800	1,653.00	1,322,400
トーセ	500	1,195.00	597,500
オービックビジネスコンサルタント	900	7,950.00	7,155,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,500	2,061.00	17,518,500
アイティフォー	2,200	1,208.00	2,657,600
東計電算	300	3,235.00	970,500
エクスネット	300	897.00	269,100
大塚商会	11,200	4,410.00	49,392,000
サイボウズ	2,500	560.00	1,400,000
ソフトブレーン	1,500	516.00	774,000
電通国際情報サービス	1,100	3,240.00	3,564,000
デジタルガレージ	3,300	4,275.00	14,107,500
EMシステムズ	1,300	1,017.00	1,322,100
ウェザーニューズ	600	3,530.00	2,118,000
C I J	1,400	736.00	1,030,400
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,872.00	374,400
日本エンタープライズ	1,900	232.00	440,800
WOWOW	900	3,515.00	3,163,500
スカラ	1,500	807.00	1,210,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,600	1,000.00	1,600,000
ネットワンシステムズ	7,600	1,803.00	13,702,800
システムソフト	4,400	142.00	624,800
アルゴグラフィックス	900	4,060.00	3,654,000
マーベラス	3,100	961.00	2,979,100
エイベックス	3,400	1,651.00	5,613,400
日本ユニシス	5,200	2,522.00	13,114,400
兼松エレクトロニクス	1,200	3,685.00	4,422,000
東京放送ホールディングス	10,300	2,493.00	25,677,900
日本テレビホールディングス	17,100	1,941.00	33,191,100
朝日放送グループホールディングス	1,800	846.00	1,522,800
テレビ朝日ホールディングス	5,100	2,450.00	12,495,000
スカパーJ S A Tホールディングス	14,200	515.00	7,313,000
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,957.00	4,435,500
日本BS放送	600	1,494.00	896,400
ビジョン	500	3,670.00	1,835,000
USEN-NEXT HOLDINGS	500	979.00	489,500
ワイヤレスゲート	900	1,622.00	1,459,800
コネクシオ	1,300	2,137.00	2,778,100
日本通信	16,700	116.00	1,937,200

クロップス	400	886.00	354,400
日本電信電話	133,300	5,429.00	723,685,700
K D D I	167,200	2,967.00	496,082,400
光通信	2,200	17,980.00	39,556,000
N T T ドコモ	133,400	2,817.00	375,787,800
エムティーアイ	2,100	679.00	1,425,900
G M O インターネット	6,800	2,384.00	16,211,200
アйдママーケティングコミュニケーション	400	678.00	271,200
カドカワ	5,400	1,168.00	6,307,200
学研ホールディングス	600	5,080.00	3,048,000
ゼンリン	3,400	2,444.00	8,309,600
昭文社	900	810.00	729,000
インプレスホールディングス	1,500	202.00	303,000
アイネット	1,000	1,665.00	1,665,000
松竹	1,200	16,170.00	19,404,000
東宝	12,200	3,830.00	46,726,000
東映	700	12,070.00	8,449,000
エヌ・ティ・ティ・データ	57,700	1,220.00	70,394,000
ピー・シー・エー	300	1,798.00	539,400
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,094.00	628,200
D T S	1,900	4,470.00	8,493,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,600	5,090.00	43,774,000
シーイーシー	1,100	3,515.00	3,866,500
カプコン	8,000	2,608.00	20,864,000
アイ・エス・ビー	400	2,173.00	869,200
ジャステック	1,100	1,237.00	1,360,700
S C S K	4,300	5,000.00	21,500,000
日本システムウエア	600	2,792.00	1,675,200
アイネス	2,400	1,183.00	2,839,200
T K C	1,600	4,280.00	6,848,000
富士ソフト	2,600	4,435.00	11,531,000
N S D	3,000	2,335.00	7,005,000
コナミホールディングス	7,600	5,390.00	40,964,000
福井コンピュータホールディングス	500	1,917.00	958,500
J B C C ホールディングス	1,500	1,090.00	1,635,000
ミロク情報サービス	1,600	2,786.00	4,457,600
ソフトバンクグループ	84,100	8,579.00	721,493,900

ハウスイ	100	1,169.00	116,900
高千穂交易	700	1,312.00	918,400
伊藤忠食品	500	6,220.00	3,110,000
エレマテック	900	2,665.00	2,398,500
JALUX	500	2,957.00	1,478,500
あらた	900	7,620.00	6,858,000
トーメンデバイス	300	2,914.00	874,200
東京エレクトロン デバイス	700	2,139.00	1,497,300
フィールズ	1,400	1,022.00	1,430,800
双日	110,300	423.00	46,656,900
アルフレッサ ホールディングス	20,700	2,709.00	56,076,300
横浜冷凍	4,700	1,052.00	4,944,400
神栄	300	1,473.00	441,900
ラサ商事	800	986.00	788,800
ラクーン	1,100	650.00	715,000
アルコニックス	2,000	1,956.00	3,912,000
神戸物産	1,200	5,320.00	6,384,000
ペッパーフードサービス	1,300	6,270.00	8,151,000
あい ホールディングス	3,000	2,918.00	8,754,000
ディーブイエックス	700	1,401.00	980,700
ダイワボウホールディングス	1,600	5,740.00	9,184,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,600	1,973.00	7,102,800
ラクト・ジャパン	300	5,440.00	1,632,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,500	1,124.00	3,934,000
八洲電機	1,400	950.00	1,330,000
メディアスホールディングス	1,000	1,022.00	1,022,000
UKCホールディングス	1,200	2,365.00	2,838,000
ジューテックホールディングス	400	1,129.00	451,600
大光	500	885.00	442,500
OCHIホールディングス	500	1,587.00	793,500
TOKAIホールディングス	9,800	1,197.00	11,730,600
Cominix	300	995.00	298,500
三洋貿易	900	2,278.00	2,050,200
ビューティガレージ	200	2,379.00	475,800
ウイン・パートナーズ	1,300	1,492.00	1,939,600
ミタチ産業	400	1,175.00	470,000
シップヘルスケアホールディングス	3,900	4,030.00	15,717,000
明治電機工業	600	2,134.00	1,280,400
デリカフーズホールディングス	400	1,622.00	648,800

スターティアホールディングス	400	921.00	368,400	
コメダホールディングス	3,400	2,140.00	7,276,000	
富士興産	700	629.00	440,300	
協栄産業	200	2,109.00	421,800	
小野建	1,600	1,948.00	3,116,800	
佐鳥電機	1,400	1,083.00	1,516,200	
エコートレーディング	400	735.00	294,000	
伯東	1,100	1,866.00	2,052,600	
コンドーテック	1,500	968.00	1,452,000	
中山福	1,100	740.00	814,000	
ナガイレーベン	2,700	2,944.00	7,948,800	
三菱食品	2,000	3,125.00	6,250,000	
松田産業	1,400	1,897.00	2,655,800	
第一興商	2,800	5,270.00	14,756,000	
メディパルホールディングス	18,700	2,434.00	45,515,800	
S P K	400	2,825.00	1,130,000	
萩原電気ホールディングス	700	3,245.00	2,271,500	
アズワン	1,500	7,370.00	11,055,000	
スズデン	600	1,762.00	1,057,200	
尾家産業	500	1,420.00	710,000	
シモジマ	1,100	1,148.00	1,262,800	
ドウシシャ	2,000	2,570.00	5,140,000	
小津産業	400	2,300.00	920,000	
高速	1,100	1,339.00	1,472,900	
たけびし	700	1,744.00	1,220,800	
リックス	400	2,209.00	883,600	
丸文	1,600	937.00	1,499,200	
ハビネット	1,300	1,530.00	1,989,000	
橋本総業ホールディングス	400	1,779.00	711,600	
日本ライフライン	5,300	2,609.00	13,827,700	
エクセル	700	2,716.00	1,901,200	
マルカキカイ	600	2,057.00	1,234,200	
I D O M	5,700	808.00	4,605,600	
日本エム・ディ・エム	1,200	1,139.00	1,366,800	
進和	1,100	2,638.00	2,901,800	
エスケイジャパン	400	557.00	222,800	
ダイترون	900	2,578.00	2,320,200	
シークス	2,400	2,334.00	5,601,600	
田中商事	600	766.00	459,600	

オーハシテクニカ	1,000	1,813.00	1,813,000	
白銅	700	2,398.00	1,678,600	
伊藤忠商事	136,800	2,022.00	276,609,600	
丸紅	153,200	866.50	132,747,800	
高島	300	2,281.00	684,300	
長瀬産業	11,200	1,975.00	22,120,000	
蝶理	1,200	2,105.00	2,526,000	
豊田通商	20,800	4,090.00	85,072,000	
三共生興	3,200	487.00	1,558,400	
兼松	7,900	1,747.00	13,801,300	
ツカモトコーポレーション	300	1,285.00	385,500	
三井物産	158,300	1,970.00	311,851,000	
日本紙パルプ商事	1,000	4,575.00	4,575,000	
日立ハイテクノロジーズ	6,500	5,200.00	33,800,000	
カメイ	2,400	1,683.00	4,039,200	
東都水産	300	1,878.00	563,400	
OUGホールディングス	300	2,833.00	849,900	
スターゼン	700	6,000.00	4,200,000	
山善	7,300	1,166.00	8,511,800	
椿本興業	400	4,045.00	1,618,000	
住友商事	117,600	1,941.00	228,261,600	
内田洋行	900	3,075.00	2,767,500	
三菱商事	130,800	3,187.00	416,859,600	
第一実業	800	3,400.00	2,720,000	
キャノンマーケティングジャパン	5,300	2,467.00	13,075,100	
西華産業	1,100	2,898.00	3,187,800	
佐藤商事	1,700	1,221.00	2,075,700	
菱洋エレクトロ	1,700	1,845.00	3,136,500	
東京産業	1,900	611.00	1,160,900	
ユアサ商事	1,800	3,870.00	6,966,000	
神鋼商事	400	3,530.00	1,412,000	
小林産業	1,200	354.00	424,800	
阪和興業	3,500	5,130.00	17,955,000	
正栄食品工業	1,000	4,485.00	4,485,000	
カナデン	1,800	1,400.00	2,520,000	
菱電商事	1,300	1,840.00	2,392,000	
フルサト工業	1,000	1,905.00	1,905,000	
岩谷産業	4,100	4,070.00	16,687,000	
すてきナイスグループ	800	1,405.00	1,124,000	

昭光通商	7,000	110.00	770,000	
ニチモウ	300	1,722.00	516,600	
極東貿易	3,000	512.00	1,536,000	
イワキ	2,600	425.00	1,105,000	
三愛石油	5,000	1,672.00	8,360,000	
稲畑産業	4,500	1,622.00	7,299,000	
G S Iクレオス	500	1,625.00	812,500	
明和産業	1,700	511.00	868,700	
ワキタ	4,000	1,213.00	4,852,000	
東邦ホールディングス	5,500	2,838.00	15,609,000	
サンゲツ	6,200	2,311.00	14,328,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,700	896.00	2,419,200	
シナネンホールディングス	800	2,679.00	2,143,200	
伊藤忠エネクス	4,100	1,107.00	4,538,700	
サンリオ	5,200	1,899.00	9,874,800	
サンワテクノス	1,200	1,702.00	2,042,400	
リョーサン	2,300	4,160.00	9,568,000	
新光商事	2,000	2,001.00	4,002,000	
トーヨー	800	2,625.00	2,100,000	
三信電気	1,700	2,183.00	3,711,100	
東陽テクニカ	2,100	952.00	1,999,200	
モスフードサービス	2,400	3,320.00	7,968,000	
加賀電子	1,700	2,807.00	4,771,900	
ソーダニッカ	1,900	779.00	1,480,100	
立花エレテック	1,300	2,183.00	2,837,900	
フォーバル	800	939.00	751,200	
P A L T A C	2,600	6,480.00	16,848,000	
三谷産業	2,000	425.00	850,000	
太平洋興発	800	1,016.00	812,800	
西本W i s m e t t a cホールディングス	500	4,785.00	2,392,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,566.00	313,200	
ヤマタネ	900	2,011.00	1,809,900	
丸紅建材リース	2,000	247.00	494,000	
日鉄住金物産	1,500	6,210.00	9,315,000	
泉州電業	600	3,195.00	1,917,000	
トラスコ中山	3,900	2,834.00	11,052,600	
オートバックスセブン	7,400	2,076.00	15,362,400	
モリト	1,500	1,037.00	1,555,500	
加藤産業	2,900	4,035.00	11,701,500	

イノテック	1,600	1,491.00	2,385,600
イエローハット	1,800	3,355.00	6,039,000
J Kホールディングス	1,900	913.00	1,734,700
日伝	1,500	2,153.00	3,229,500
北沢産業	1,500	282.00	423,000
杉本商事	1,000	2,069.00	2,069,000
因幡電機産業	2,500	4,965.00	12,412,500
バイテックホールディングス	800	2,450.00	1,960,000
東テク	600	2,789.00	1,673,400
ミスミグループ本社	21,700	3,015.00	65,425,500
アルテック	1,600	349.00	558,400
タキヒヨー	600	2,377.00	1,426,200
蔵王産業	300	1,797.00	539,100
スズケン	8,500	5,000.00	42,500,000
ジェコス	1,300	1,177.00	1,530,100
ルネサスイーストン	1,700	706.00	1,200,200
ローソン	4,700	7,180.00	33,746,000
サンエー	1,400	5,770.00	8,078,000
カワチ薬品	1,400	2,684.00	3,757,600
エービーシー・マート	3,400	7,300.00	24,820,000
ハードオフコーポレーション	800	1,127.00	901,600
アスクル	1,600	3,340.00	5,344,000
ゲオホールディングス	3,400	1,730.00	5,882,000
アダストリア	2,900	1,697.00	4,921,300
ジーフット	1,100	792.00	871,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	758.00	151,600
くらコーポレーション	1,100	7,960.00	8,756,000
キャンドゥ	900	1,848.00	1,663,200
パルグループホールディングス	1,000	2,984.00	2,984,000
エディオン	7,200	1,134.00	8,164,800
サーラコーポレーション	3,200	700.00	2,240,000
ワッツ	600	1,154.00	692,400
ハローズ	700	2,741.00	1,918,700
あみやき亭	400	5,340.00	2,136,000
ひらまつ	2,600	538.00	1,398,800
大黒天物産	400	5,910.00	2,364,000
ハニーズホールディングス	1,800	1,054.00	1,897,200
ファーマライズホールディングス	400	748.00	299,200
アルペン	1,400	2,387.00	3,341,800



ハブ	500	1,141.00	570,500
クオール	2,100	2,094.00	4,397,400
ジーンズ	1,300	5,850.00	7,605,000
ビックカメラ	9,900	1,743.00	17,255,700
DCMホールディングス	10,000	1,083.00	10,830,000
MonotaRO	6,600	4,340.00	28,644,000
東京一番フーズ	500	668.00	334,000
DDホールディングス	400	2,987.00	1,194,800
きちり	500	735.00	367,500
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,416.00	3,865,600
J.フロント リテイリング	22,300	1,803.00	40,206,900
ドトール・日レスホールディングス	3,300	2,353.00	7,764,900
マツモトキヨシホールディングス	7,700	5,610.00	43,197,000
ブロンコビリー	1,000	4,380.00	4,380,000
スタートトゥデイ	18,300	3,805.00	69,631,500
トレジャー・ファクトリー	500	798.00	399,000
物語コーポレーション	500	13,840.00	6,920,000
ココカラファイン	1,900	8,380.00	15,922,000
三越伊勢丹ホールディングス	34,900	1,362.00	47,533,800
Hamee	500	1,656.00	828,000
ウエルシアホールディングス	4,900	5,960.00	29,204,000
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,350.00	9,045,000
丸善CHIホールディングス	2,200	357.00	785,400
ミサワ	300	431.00	129,300
ティーライフ	200	1,356.00	271,200
エー・ピーカンパニー	300	789.00	236,700
チムニー	600	2,941.00	1,764,600
シュッピン	1,100	1,484.00	1,632,400
ネクステージ	2,000	1,190.00	2,380,000
ジョイフル本田	2,700	3,970.00	10,719,000
鳥貴族	600	2,792.00	1,675,200
キリン堂ホールディングス	700	3,065.00	2,145,500
ホットランド	1,100	1,373.00	1,510,300
すかいらーく	11,600	1,597.00	18,525,200
綿半ホールディングス	700	3,755.00	2,628,500
ヨシックス	300	3,405.00	1,021,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6,200	1,456.00	9,027,200
ブックオフコーポレーション	1,100	816.00	897,600

ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,271.00	1,016,800
B E E N O S	400	1,642.00	656,800
あさひ	1,400	1,335.00	1,869,000
日本調剤	700	3,300.00	2,310,000
コスモス薬品	900	24,920.00	22,428,000
トーエル	900	1,050.00	945,000
一六堂	400	419.00	167,600
オンリー	300	979.00	293,700
セブン&アイ・ホールディングス	78,100	4,854.00	379,097,400
薬王堂	800	3,975.00	3,180,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング グ	5,000	1,348.00	6,740,000
ツルハホールディングス	4,000	16,490.00	65,960,000
サンマルクホールディングス	1,300	3,000.00	3,900,000
フェリシモ	500	1,377.00	688,500
トリドールホールディングス	2,300	3,805.00	8,751,500
T O K Y O B A S E	1,700	1,059.00	1,800,300
ウイルプラスホールディングス	200	1,158.00	231,600
サツドラホールディングス	300	2,292.00	687,600
ダイユー・リックホールディングス	900	1,159.00	1,043,100
パロックジャパンリミテッド	1,500	1,110.00	1,665,000
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,880.00	11,820,000
力の源ホールディングス	400	1,842.00	736,800
スシローグローバルホールディングス	2,000	6,160.00	12,320,000
L I X I L ビバ	2,400	1,972.00	4,732,800
メディカルシステムネットワーク	2,200	505.00	1,111,000
総合メディカル	1,600	2,512.00	4,019,200
はるやまホールディングス	900	1,046.00	941,400
ノジマ	3,300	2,761.00	9,111,300
カップ・クリエイト	2,300	1,421.00	3,268,300
ライトオン	1,600	1,022.00	1,635,200
ジーンズメイト	600	804.00	482,400
良品計画	2,500	38,550.00	96,375,000
三城ホールディングス	2,300	520.00	1,196,000
アドヴァン	1,900	1,014.00	1,926,600
アルビス	600	3,880.00	2,328,000
コナカ	2,400	572.00	1,372,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,828.00	365,600
G - 7 ホールディングス	500	2,800.00	1,400,000

イオン北海道	1,900	813.00	1,544,700
コジマ	2,700	440.00	1,188,000
ヒマラヤ	600	1,179.00	707,400
コーナン商事	2,600	2,747.00	7,142,200
エコス	800	1,857.00	1,485,600
ワタミ	2,200	1,525.00	3,355,000
マルシェ	500	820.00	410,000
ドンキホーテホールディングス	12,100	5,710.00	69,091,000
西松屋チェーン	4,100	1,276.00	5,231,600
ゼンショーホールディングス	9,700	2,736.00	26,539,200
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,824.00	2,188,800
ハークスレイ	500	1,154.00	577,000
サイゼリヤ	3,100	2,545.00	7,889,500
V Tホールディングス	6,300	526.00	3,313,800
魚力	500	1,431.00	715,500
ポプラ	500	886.00	443,000
フジ・コーポレーション	300	2,560.00	768,000
ユナイテッドアローズ	2,300	4,055.00	9,326,500
ハイデイ日高	2,400	2,760.00	6,624,000
京都きもの友禅	1,200	674.00	808,800
コロワイド	6,200	3,105.00	19,251,000
ピーシーデポコーポレーション	2,800	599.00	1,677,200
壱番屋	1,300	4,595.00	5,973,500
トップカルチャー	700	491.00	343,700
P L A N T	400	1,356.00	542,400
スギホールディングス	4,100	6,680.00	27,388,000
ヴィア・ホールディングス	2,200	701.00	1,542,200
スクロール	2,900	569.00	1,650,100
ヨンドシーホールディングス	1,900	2,783.00	5,287,700
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6,000	11,250.00	67,500,000
木曽路	2,300	2,936.00	6,752,800
S R S ホールディングス	2,200	986.00	2,169,200
千趣会	3,400	580.00	1,972,000
タカキュー	1,400	219.00	306,600
ケーヨー	3,400	574.00	1,951,600
上新電機	2,200	4,195.00	9,229,000
日本瓦斯	3,400	5,550.00	18,870,000
ロイヤルホールディングス	3,300	2,871.00	9,474,300

東天紅	100	1,903.00	190,300
いなげや	2,100	1,803.00	3,786,300
島忠	4,200	3,490.00	14,658,000
チヨダ	2,200	2,718.00	5,979,600
ライフコーポレーション	1,400	2,888.00	4,043,200
リンガーハット	2,300	2,653.00	6,101,900
さが美グループホールディングス	2,000	149.00	298,000
MrMaxHD	2,300	711.00	1,635,300
テンアライド	1,700	487.00	827,900
AOKIホールディングス	3,700	1,798.00	6,652,600
オークワ	3,000	1,170.00	3,510,000
コメリ	2,900	2,940.00	8,526,000
青山商事	3,600	4,180.00	15,048,000
しまむら	2,200	12,550.00	27,610,000
はせがわ	1,000	463.00	463,000
高島屋	29,000	938.00	27,202,000
松屋	3,800	1,425.00	5,415,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,800	2,207.00	19,421,600
近鉄百貨店	700	3,995.00	2,796,500
パルコ	1,800	1,404.00	2,527,200
丸井グループ	17,800	2,297.00	40,886,600
アクシアル リテイリング	1,500	4,300.00	6,450,000
井筒屋	1,000	364.00	364,000
イオン	71,700	2,177.00	156,090,900
イズミ	3,400	7,090.00	24,106,000
東武ストア	200	3,040.00	608,000
平和堂	3,800	2,638.00	10,024,400
フジ	2,200	2,329.00	5,123,800
ヤオコー	2,100	6,270.00	13,167,000
ゼビオホールディングス	2,500	1,963.00	4,907,500
ケーズホールディングス	16,400	1,373.00	22,517,200
Olympicグループ	1,100	570.00	627,000
日産東京販売ホールディングス	2,700	381.00	1,028,700
Genky DrugStores	700	4,470.00	3,129,000
アインホールディングス	2,500	7,460.00	18,650,000
元気寿司	500	3,010.00	1,505,000
ヤマダ電機	62,500	567.00	35,437,500
アークランドサカモト	3,200	1,765.00	5,648,000
ニトリホールディングス	7,400	18,615.00	137,751,000

グルメ杵屋	1,000	1,178.00	1,178,000	
愛眼	1,500	492.00	738,000	
ケーユーホールディングス	1,000	1,113.00	1,113,000	
吉野家ホールディングス	6,100	2,070.00	12,627,000	
松屋フーズ	900	3,830.00	3,447,000	
サガミチェーン	2,500	1,387.00	3,467,500	
関西スーパーマーケット	1,400	1,205.00	1,687,000	
王将フードサービス	1,400	5,590.00	7,826,000	
ブレナス	2,100	1,924.00	4,040,400	
ミニストップ	1,400	2,304.00	3,225,600	
アークス	3,500	3,100.00	10,850,000	
パローホールディングス	4,300	2,863.00	12,310,900	
藤久	100	1,522.00	152,200	
ベルク	800	5,990.00	4,792,000	
大庄	1,000	1,759.00	1,759,000	
ファーストリテイリング	2,500	49,180.00	122,950,000	
サンドラッグ	7,900	5,570.00	44,003,000	
サックスパー ホールディングス	1,800	1,173.00	2,111,400	
ヤマザワ	400	1,799.00	719,600	
やまや	400	3,860.00	1,544,000	
ベルーナ	4,600	1,451.00	6,674,600	
島根銀行	400	1,307.00	522,800	
じもとホールディングス	12,600	187.00	2,356,200	
めぶきフィナンシャルグループ	97,000	428.00	41,516,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,500	2,960.00	7,400,000	
九州フィナンシャルグループ	30,600	558.00	17,074,800	
ゆうちょ銀行	52,900	1,517.00	80,249,300	
富山第一銀行	4,700	504.00	2,368,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	111,500	631.00	70,356,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	12,000	1,394.00	16,728,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,200	882.00	7,232,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,600	2,267.00	3,627,200	
新生銀行	16,200	1,812.00	29,354,400	
あおぞら銀行	11,100	4,425.00	49,117,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,306,900	737.10	963,315,990	
りそなホールディングス	204,900	635.00	130,111,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	36,700	4,831.00	177,297,700	
三井住友フィナンシャルグループ	141,300	4,648.00	656,762,400	
第四銀行	2,300	4,965.00	11,419,500	

北越銀行	1,900	2,477.00	4,706,300	
千葉銀行	66,100	873.00	57,705,300	
群馬銀行	37,900	660.00	25,014,000	
武蔵野銀行	3,000	3,655.00	10,965,000	
千葉興業銀行	5,100	507.00	2,585,700	
筑波銀行	7,800	349.00	2,722,200	
七十七銀行	5,900	2,645.00	15,605,500	
青森銀行	1,400	3,440.00	4,816,000	
秋田銀行	1,200	3,145.00	3,774,000	
山形銀行	2,100	2,357.00	4,949,700	
岩手銀行	1,300	4,455.00	5,791,500	
東邦銀行	16,700	427.00	7,130,900	
東北銀行	900	1,457.00	1,311,300	
みちのく銀行	1,200	1,764.00	2,116,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	76,000	591.00	44,916,000	
静岡銀行	49,300	1,126.00	55,511,800	
十六銀行	2,500	2,972.00	7,430,000	
スルガ銀行	19,100	1,509.00	28,821,900	
八十二銀行	33,800	550.00	18,590,000	
山梨中央銀行	12,000	482.00	5,784,000	
大垣共立銀行	2,900	2,912.00	8,444,800	
福井銀行	1,600	2,337.00	3,739,200	
北國銀行	2,100	4,460.00	9,366,000	
清水銀行	600	3,325.00	1,995,000	
富山銀行	400	3,965.00	1,586,000	
滋賀銀行	18,000	585.00	10,530,000	
南都銀行	2,200	3,000.00	6,600,000	
百五銀行	17,900	506.00	9,057,400	
京都銀行	7,100	6,380.00	45,298,000	
紀陽銀行	7,000	1,849.00	12,943,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	12,400	1,645.00	20,398,000	
広島銀行	27,600	835.00	23,046,000	
山陰合同銀行	11,100	1,084.00	12,032,400	
中国銀行	12,900	1,301.00	16,782,900	
鳥取銀行	600	1,728.00	1,036,800	
伊予銀行	26,600	837.00	22,264,200	
百十四銀行	20,000	365.00	7,300,000	
四国銀行	2,900	1,443.00	4,184,700	
阿波銀行	15,000	725.00	10,875,000	

大分銀行	1,100	3,925.00	4,317,500	
宮崎銀行	1,200	3,680.00	4,416,000	
佐賀銀行	1,100	2,483.00	2,731,300	
十八銀行	11,000	307.00	3,377,000	
沖縄銀行	1,800	4,535.00	8,163,000	
琉球銀行	3,600	1,762.00	6,343,200	
セブン銀行	70,000	354.00	24,780,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,536,300	201.30	510,557,190	
高知銀行	700	1,294.00	905,800	
山口フィナンシャルグループ	23,000	1,393.00	32,039,000	
長野銀行	600	1,827.00	1,096,200	
名古屋銀行	1,500	4,190.00	6,285,000	
北洋銀行	28,100	397.00	11,155,700	
愛知銀行	600	5,290.00	3,174,000	
中京銀行	800	2,338.00	1,870,400	
大光銀行	600	2,312.00	1,387,200	
愛媛銀行	2,600	1,291.00	3,356,600	
トマト銀行	700	1,521.00	1,064,700	
京葉銀行	16,000	510.00	8,160,000	
栃木銀行	9,700	422.00	4,093,400	
北日本銀行	600	2,862.00	1,717,200	
東和銀行	3,300	1,463.00	4,827,900	
福島銀行	1,800	760.00	1,368,000	
大東銀行	900	1,280.00	1,152,000	
トモニホールディングス	15,400	509.00	7,838,600	
フィデアホールディングス	18,100	183.00	3,312,300	
池田泉州ホールディングス	19,800	404.00	7,999,200	
F P G	6,000	1,466.00	8,796,000	
マーキュリアインベストメント	500	1,192.00	596,000	
S B Iホールディングス	21,100	2,959.00	62,434,900	
日本アジア投資	1,700	383.00	651,100	
ジャフコ	2,700	4,780.00	12,906,000	
大和証券グループ本社	160,000	667.30	106,768,000	
野村ホールディングス	321,200	615.50	197,698,600	
岡三証券グループ	16,000	596.00	9,536,000	
丸三証券	5,900	1,030.00	6,077,000	
東洋証券	7,000	288.00	2,016,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,700	766.00	15,856,200	

光世証券	400	1,415.00	566,000
水戸証券	5,400	412.00	2,224,800
いちよし証券	3,900	1,295.00	5,050,500
松井証券	9,100	1,050.00	9,555,000
だいこう証券ビジネス	900	612.00	550,800
マネックスグループ	19,000	660.00	12,540,000
カブドットコム証券	11,900	410.00	4,879,000
極東証券	2,500	1,533.00	3,832,500
岩井コスモホールディングス	1,900	1,548.00	2,941,200
藍澤證券	3,500	787.00	2,754,500
マネーパートナーズグループ	2,400	442.00	1,060,800
小林洋行	500	299.00	149,500
かんぽ生命保険	7,100	2,668.00	18,942,800
S O M P Oホールディングス	36,600	4,728.00	173,044,800
アニコム ホールディングス	1,300	4,000.00	5,200,000
M S & A Dインシュアランスグループホール	48,800	3,754.00	183,195,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	15,300	2,119.00	32,420,700
第一生命ホールディングス	105,600	2,197.50	232,056,000
東京海上ホールディングス	70,300	5,297.00	372,379,100
アドバンテッジリスクマネジメント	600	1,252.00	751,200
T & Dホールディングス	57,700	1,860.50	107,350,850
アドバンスクリエイト	400	2,151.00	860,400
全国保証	5,300	5,060.00	26,818,000
ジェイリース	300	715.00	214,500
イントラスト	400	715.00	286,000
アルヒ	2,100	1,580.00	3,318,000
クレディセゾン	14,200	1,951.00	27,704,200
アクリーティブ	1,000	336.00	336,000
芙蓉総合リース	2,100	8,300.00	17,430,000
興銀リース	3,500	3,105.00	10,867,500
東京センチュリー	3,800	7,170.00	27,246,000
日本証券金融	7,600	652.00	4,955,200
アイフル	31,300	387.00	12,113,100
リコーリース	1,500	3,800.00	5,700,000
イオンフィナンシャルサービス	13,300	2,738.00	36,415,400
アコム	37,500	491.00	18,412,500
ジャックス	2,300	2,505.00	5,761,500
オリエントコーポレーション	40,400	159.00	6,423,600



日立キャピタル	5,100	2,986.00	15,228,600
アプラスフィナンシャル	9,000	117.00	1,053,000
オリックス	124,500	1,970.50	245,327,250
三菱UFJリース	47,400	705.00	33,417,000
九州リースサービス	800	798.00	638,400
日本取引所グループ	53,600	2,079.00	111,434,400
イー・ギャランティ	1,000	2,328.00	2,328,000
アサックス	300	2,014.00	604,200
NECキャピタルソリューション	800	2,003.00	1,602,400
いちご	26,700	493.00	13,163,100
日本駐車場開発	22,500	183.00	4,117,500
ヒューリック	39,000	1,224.00	47,736,000
三栄建築設計	700	1,905.00	1,333,500
スター・マイカ	900	2,516.00	2,264,400
野村不動産ホールディングス	12,400	2,725.00	33,790,000
三重交通グループホールディングス	3,800	535.00	2,033,000
サムティ	1,600	2,079.00	3,326,400
ディア・ライフ	2,100	553.00	1,161,300
コーセーアールイー	400	952.00	380,800
エー・ディー・ワークス	24,700	40.00	988,000
日本商業開発	1,000	1,728.00	1,728,000
プレサンスコーポレーション	2,600	1,787.00	4,646,200
ユニゾホールディングス	2,200	2,266.00	4,985,200
THEグローバル社	900	844.00	759,600
日本管理センター	1,200	1,517.00	1,820,400
サンセイランディック	500	1,295.00	647,500
エストラスト	300	1,010.00	303,000
フージャースホールディングス	4,500	858.00	3,861,000
オープンハウス	3,000	6,510.00	19,530,000
東急不動産ホールディングス	45,200	827.00	37,380,400
飯田グループホールディングス	15,600	2,091.00	32,619,600
イーグランド	300	1,281.00	384,300
ムゲンエステート	1,100	1,186.00	1,304,600
ビーロット	300	2,159.00	647,700
ファーストブラザーズ	500	1,483.00	741,500
ハウズドゥ	300	5,540.00	1,662,000
シーアールイー	300	1,821.00	546,300
ケイアイスター不動産	700	2,798.00	1,958,600
パーク24	10,400	3,005.00	31,252,000

パラカ	500	2,403.00	1,201,500	
三井不動産	93,200	2,969.00	276,710,800	
三菱地所	138,900	2,015.50	279,952,950	
平和不動産	3,300	2,336.00	7,708,800	
東京建物	20,400	1,621.00	33,068,400	
ダイビル	4,800	1,222.00	5,865,600	
京阪神ビルディング	3,100	911.00	2,824,100	
住友不動産	45,000	4,354.00	195,930,000	
大京	3,000	2,544.00	7,632,000	
テーオーシー	6,400	960.00	6,144,000	
東京楽天地	300	5,700.00	1,710,000	
レオパレス21	22,300	908.00	20,248,400	
スターツコーポレーション	2,500	3,040.00	7,600,000	
フジ住宅	2,400	958.00	2,299,200	
空港施設	1,900	651.00	1,236,900	
明和地所	1,000	724.00	724,000	
ゴールドクレスト	1,500	2,074.00	3,111,000	
日本エスリード	700	2,112.00	1,478,400	
日神不動産	2,500	739.00	1,847,500	
日本エスコン	3,400	764.00	2,597,600	
タカラレーベン	8,700	431.00	3,749,700	
サンヨーハウジング名古屋	1,000	1,241.00	1,241,000	
イオンモール	12,000	2,186.00	26,232,000	
ファースト住建	700	1,606.00	1,124,200	
カチタス	2,500	3,885.00	9,712,500	
トーセイ	2,300	1,369.00	3,148,700	
穴吹興産	200	3,395.00	679,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	11,600	1,204.00	13,966,400	
サンフロンティア不動産	2,300	1,358.00	3,123,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	989.00	1,384,600	
インテリックス	500	1,100.00	550,000	
ランドビジネス	900	342.00	307,800	
グランディハウス	1,600	508.00	812,800	
日本空港ビルデング	5,500	5,030.00	27,665,000	
日本工営	1,200	3,280.00	3,936,000	
LIFULL	6,300	700.00	4,410,000	
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,150.00	3,225,000	
日本M&Aセンター	12,500	3,410.00	42,625,000	
メンバーズ	600	1,181.00	708,600	

中広	200	767.00	153,400
タケエイ	1,900	1,273.00	2,418,700
トラスト・テック	800	3,495.00	2,796,000
コシダカホールディングス	1,200	6,630.00	7,956,000
パソナグループ	1,700	1,769.00	3,007,300
C D S	500	1,416.00	708,000
リンクアンドモチベーション	3,300	1,284.00	4,237,200
G C A	2,100	998.00	2,095,800
エス・エム・エス	3,600	3,880.00	13,968,000
パーソルホールディングス	16,700	2,703.00	45,140,100
リニカル	1,200	1,832.00	2,198,400
クックパッド	5,700	577.00	3,288,900
エスクリ	600	930.00	558,000
アイ・ケイ・ケイ	1,100	814.00	895,400
学情	800	1,349.00	1,079,200
スタジオアリス	900	2,490.00	2,241,000
シミックホールディングス	1,000	2,333.00	2,333,000
N J S	400	1,779.00	711,600
総合警備保障	7,200	5,410.00	38,952,000
カカクコム	13,600	2,185.00	29,716,000
セントケア・ホールディング	800	782.00	625,600
サイネックス	300	871.00	261,300
ルネサンス	900	2,133.00	1,919,700
ディップ	2,600	2,758.00	7,170,800
オプトホールディング	1,300	1,722.00	2,238,600
新日本科学	2,200	539.00	1,185,800
ツクイ	4,300	854.00	3,672,200
キャリアデザインセンター	500	2,182.00	1,091,000
エムスリー	19,000	4,315.00	81,985,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	635.00	889,000
プラス	100	900.00	90,000
アウトソーシング	5,400	2,154.00	11,631,600
ウェルネット	1,800	1,260.00	2,268,000
ワールドホールディングス	600	3,715.00	2,229,000
ディー・エヌ・エー	9,700	2,168.00	21,029,600
博報堂D Yホールディングス	25,100	1,638.00	41,113,800
ぐるなび	2,900	995.00	2,885,500
エスアールジータカミヤ	2,100	664.00	1,394,400
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	861.00	1,205,400

ファンコミュニケーションズ	5,000	738.00	3,690,000
ライク	700	2,066.00	1,446,200
ビジネス・ブレイクスルー	800	458.00	366,400
WDBホールディングス	800	3,520.00	2,816,000
ティア	800	1,070.00	856,000
CDG	200	1,943.00	388,600
バリューコマース	1,600	1,645.00	2,632,000
インフォマート	9,100	1,105.00	10,055,500
JPホールディングス	5,700	360.00	2,052,000
EPSホールディングス	2,700	2,200.00	5,940,000
レグス	400	1,000.00	400,000
プレステージ・インターナショナル	3,800	1,509.00	5,734,200
アミューズ	1,200	3,020.00	3,624,000
ドリームインキュベータ	600	2,533.00	1,519,800
クイック	1,100	1,702.00	1,872,200
TAC	1,100	311.00	342,100
ケネディクス	24,000	686.00	16,464,000
電通	22,000	5,140.00	113,080,000
テイクアンドグヴ・ニーズ	800	1,355.00	1,084,000
ぴあ	600	6,060.00	3,636,000
イオンファンタジー	600	6,650.00	3,990,000
シーティーエス	1,800	859.00	1,546,200
ネクシイズグループ	600	1,692.00	1,015,200
みらかホールディングス	5,400	3,560.00	19,224,000
アルプス技研	1,600	2,364.00	3,782,400
ダイオーズ	400	1,412.00	564,800
日本空調サービス	1,900	835.00	1,586,500
オリエンタルランド	21,400	11,310.00	242,034,000
ダスキン	4,900	2,883.00	14,126,700
明光ネットワークジャパン	2,300	1,240.00	2,852,000
ファルコホールディングス	900	1,845.00	1,660,500
秀英予備校	400	496.00	198,400
田谷	300	675.00	202,500
ラウンドワン	5,600	2,010.00	11,256,000
リゾートトラスト	7,700	2,314.00	17,817,800
ビー・エム・エル	2,300	2,706.00	6,223,800
ワタベウェディング	300	545.00	163,500
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,519.00	4,405,100
リソー教育	3,100	840.00	2,604,000

早稲田アカデミー	300	1,964.00	589,200
ユー・エス・エス	22,100	2,297.00	50,763,700
東京個別指導学院	600	1,328.00	796,800
サイバーエージェント	11,100	5,980.00	66,378,000
楽天	92,700	781.50	72,445,050
クリーク・アンド・リバー社	900	1,171.00	1,053,900
テー・オー・ダブリュー	1,700	888.00	1,509,600
セントラルスポーツ	700	4,010.00	2,807,000
フルキャストホールディングス	1,600	2,695.00	4,312,000
リソルホールディングス	200	4,335.00	867,000
テクノプロ・ホールディングス	3,400	6,850.00	23,290,000
アトラ	300	1,015.00	304,500
インターワークス	400	1,034.00	413,600
Keepers 技研	600	1,362.00	817,200
ファーストロジック	300	850.00	255,000
三機サービス	300	1,802.00	540,600
Gunosy	1,100	1,669.00	1,835,900
デザインワン・ジャパン	400	1,418.00	567,200
イー・ガーディアン	900	3,175.00	2,857,500
リブセンス	1,200	488.00	585,600
ジャパンマテリアル	4,900	1,719.00	8,423,100
ベクトル	2,200	2,322.00	5,108,400
ウチヤマホールディングス	900	590.00	531,000
ライクキッズネクスト	400	1,065.00	426,000
キャリアリンク	600	575.00	345,000
IBJ	1,500	699.00	1,048,500
アサンテ	700	2,061.00	1,442,700
N・フィールド	1,000	1,763.00	1,763,000
バリューHR	400	2,085.00	834,000
M&Aキャピタルパートナーズ	500	9,330.00	4,665,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,088.00	761,600
ERIホールディングス	500	1,116.00	558,000
アピスト	300	5,160.00	1,548,000
シグマクシス	1,000	1,735.00	1,735,000
ウィルグループ	800	1,152.00	921,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	426.00	1,065,000
日本ビューホテル	600	1,520.00	912,000
リクルートホールディングス	139,500	2,745.00	382,927,500
エラン	400	2,155.00	862,000

土木管理総合試験所	600	613.00	367,800
日本郵政	102,600	1,333.00	136,765,800
ベルシステム24ホールディングス	3,000	1,714.00	5,142,000
鎌倉新書	300	3,740.00	1,122,000
一蔵	200	883.00	176,600
LITALICO	400	1,648.00	659,200
グローバルグループ	200	1,555.00	311,000
エポラブルアジア	500	2,039.00	1,019,500
ストライク	200	7,490.00	1,498,000
ソラスト	1,100	3,140.00	3,454,000
セラク	400	798.00	319,200
インソース	600	2,348.00	1,408,800
キャリアインデックス	200	2,374.00	474,800
MS - Japan	200	7,890.00	1,578,000
船場	300	1,204.00	361,200
フルテック	200	1,229.00	245,800
グリーンズ	400	1,708.00	683,200
日総工産	300	4,865.00	1,459,500
キュービーネットホールディングス	900	1,963.00	1,766,700
リログループ	9,900	2,715.00	26,878,500
東祥	1,100	3,770.00	4,147,000
エイチ・アイ・エス	2,800	3,735.00	10,458,000
ラックランド	300	2,611.00	783,300
共立メンテナンス	3,200	5,360.00	17,152,000
イチネンホールディングス	2,000	1,475.00	2,950,000
建設技術研究所	1,200	1,432.00	1,718,400
スペース	1,200	1,458.00	1,749,600
長大	700	865.00	605,500
燦ホールディングス	400	2,736.00	1,094,400
スバル興業	100	7,110.00	711,000
東京テアトル	800	1,456.00	1,164,800
タナベ経営	300	2,163.00	648,900
ナガワ	400	4,665.00	1,866,000
よみうりランド	400	4,975.00	1,990,000
東京都競馬	1,400	4,690.00	6,566,000
常磐興産	700	1,818.00	1,272,600
カナモト	2,800	3,645.00	10,206,000
東京ドーム	7,300	1,075.00	7,847,500
西尾レントオール	1,800	3,435.00	6,183,000

	トランス・コスモス	2,000	2,571.00	5,142,000	
	乃村工藝社	4,200	2,229.00	9,361,800	
	藤田観光	700	3,230.00	2,261,000	
	KNT-CTホールディングス	1,100	1,644.00	1,808,400	
	日本管財	1,900	2,182.00	4,145,800	
	トーカイ	1,700	2,448.00	4,161,600	
	白洋舎	200	3,375.00	675,000	
	セコム	19,200	8,195.00	157,344,000	
	セントラル警備保障	900	3,910.00	3,519,000	
	丹青社	3,700	1,320.00	4,884,000	
	メイテック	2,100	5,450.00	11,445,000	
	応用地質	1,900	1,545.00	2,935,500	
	船井総研ホールディングス	3,800	2,703.00	10,271,400	
	進学会ホールディングス	800	666.00	532,800	
	オオバ	1,400	657.00	919,800	
	いであ	400	1,163.00	465,200	
	学究社	700	1,807.00	1,264,900	
	ベネッセホールディングス	6,600	4,015.00	26,499,000	
	イオンディライト	2,200	3,990.00	8,778,000	
	ナック	1,200	966.00	1,159,200	
	ニチイ学館	3,400	1,235.00	4,199,000	
	ダイセキ	3,000	3,500.00	10,500,000	
	ステップ	700	1,736.00	1,215,200	
小計	銘柄数：2,072 組入時価比率：98.1%			48,842,327,960 100.0%	
合計				48,842,327,960	

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、およ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

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 日立国内債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	194,645,397	115,028,067
国債証券	72,295,789,500	73,389,840,200
地方債証券	6,458,870,140	6,387,391,810
特殊債券	7,406,233,776	7,817,466,900
社債券	5,292,658,000	4,764,640,000
未収利息	260,858,598	257,069,627
前払費用	3,636,595	1,751,219
流動資産合計	91,912,692,006	92,733,187,823
資産合計	91,912,692,006	92,733,187,823
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	24,900,000	12,700,000
未払利息	533	315
流動負債合計	24,900,533	12,700,315
負債合計	24,900,533	12,700,315
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,390,813,297	66,546,652,262
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	25,496,978,176	26,173,835,246
元本等合計	91,887,791,473	92,720,487,508
純資産合計	91,887,791,473	92,720,487,508
負債純資産合計	91,912,692,006	92,733,187,823



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の店頭基準気配値段等で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取利息</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,390,813,297口	66,546,652,262口
1口当たり純資産額	1.3840円	1.3933円
(1万口当たり純資産額)	(13,840円)	(13,933円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
2. 金融商品の内容及びリスク	<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、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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>
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。</p> <p>また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。</p> <p>なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## 金融商品の時価に関する事項

項目	2018年5月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 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 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	53,293,450	161,483,200
地方債証券	734,520	10,988,930
特殊債証券	3,091,336	12,335,220
社債券	1,980,000	7,237,000
合計	55,139,306	192,044,350

(注)当計算期間とは、当親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間としております。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	85,854,475,189円	66,390,813,297円
期中追加設定元本額	10,064,332,995円	4,539,070,659円
期中一部解約元本額	29,527,994,887円	4,383,231,694円
期末元本額	66,390,813,297円	66,546,652,262円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	2,716,262,395円	3,070,129,700円
日立バランスファンド（株式50）	5,869,739,582円	6,258,060,854円
日立バランスファンド（株式30）	3,250,286,901円	3,442,666,241円
日立国内債券特化型ファンドN（非課税適格機関投資家専用）	44,051,446,431円	43,113,092,905円
日立国内債券インデックスファンド	10,503,077,988円	10,662,702,562円

（注）\*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

(2018年5月15日現在)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第382回利付国債(2年)	800,000,000	802,888,000	
		第383回利付国債(2年)	300,000,000	301,140,000	
		第385回利付国債(2年)	400,000,000	401,684,000	
		第119回利付国債(5年)	300,000,000	300,789,000	
		第122回利付国債(5年)	320,000,000	321,177,600	
		第123回利付国債(5年)	470,000,000	471,950,500	
		第124回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,105,192,000	
		第125回利付国債(5年)	800,000,000	804,232,000	
		第126回利付国債(5年)	500,000,000	502,930,000	
		第127回利付国債(5年)	400,000,000	402,508,000	
		第128回利付国債(5年)	260,000,000	261,775,800	
		第129回利付国債(5年)	600,000,000	604,332,000	
		第130回利付国債(5年)	300,000,000	302,274,000	
		第131回利付国債(5年)	620,000,000	624,904,200	
		第132回利付国債(5年)	450,000,000	453,699,000	
		第134回利付国債(5年)	470,000,000	474,338,100	
		第135回利付国債(5年)	70,000,000	70,681,100	
		第1回利付国債(40年)	180,000,000	259,057,800	
		第2回利付国債(40年)	100,000,000	139,287,000	
		第3回利付国債(40年)	130,000,000	181,961,000	
		第4回利付国債(40年)	180,000,000	253,114,200	
		第5回利付国債(40年)	200,000,000	270,400,000	
		第6回利付国債(40年)	110,000,000	145,750,000	
第7回利付国債(40年)	150,000,000	189,718,500			
第8回利付国債(40年)	200,000,000	234,146,000			
第9回利付国債(40年)	270,000,000	229,300,200			
第301回利付国債(10年)	500,000,000	509,000,000			

第302回利付国債(10年)	280,000,000	284,732,000	
第303回利付国債(10年)	570,000,000	581,850,300	
第304回利付国債(10年)	450,000,000	458,748,000	
第305回利付国債(10年)	680,000,000	695,619,600	
第306回利付国債(10年)	500,000,000	514,135,000	
第307回利付国債(10年)	200,000,000	205,286,000	
第308回利付国債(10年)	660,000,000	679,833,000	
第310回利付国債(10年)	830,000,000	851,986,700	
第311回利付国債(10年)	430,000,000	439,365,400	
第312回利付国債(10年)	900,000,000	931,068,000	
第313回利付国債(10年)	300,000,000	312,198,000	
第314回利付国債(10年)	370,000,000	382,935,200	
第315回利付国債(10年)	700,000,000	728,707,000	
第316回利付国債(10年)	400,000,000	415,164,000	
第317回利付国債(10年)	630,000,000	655,722,900	
第318回利付国債(10年)	400,000,000	414,988,000	
第319回利付国債(10年)	300,000,000	313,107,000	
第320回利付国債(10年)	510,000,000	530,440,800	
第321回利付国債(10年)	400,000,000	417,056,000	
第322回利付国債(10年)	400,000,000	415,512,000	
第323回利付国債(10年)	400,000,000	416,448,000	
第324回利付国債(10年)	360,000,000	373,323,600	
第325回利付国債(10年)	900,000,000	934,956,000	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	310,938,000	
第327回利付国債(10年)	100,000,000	104,108,000	
第328回利付国債(10年)	600,000,000	620,292,000	
第329回利付国債(10年)	500,000,000	522,780,000	
第330回利付国債(10年)	400,000,000	418,904,000	
第331回利付国債(10年)	300,000,000	310,956,000	
第332回利付国債(10年)	600,000,000	622,764,000	
第333回利付国債(10年)	340,000,000	353,365,400	
第334回利付国債(10年)	170,000,000	176,864,600	
第335回利付国債(10年)	200,000,000	207,070,000	

第336回利付国債(10年)	200,000,000	207,280,000	
第338回利付国債(10年)	500,000,000	515,270,000	
第339回利付国債(10年)	600,000,000	618,564,000	
第340回利付国債(10年)	400,000,000	412,664,000	
第341回利付国債(10年)	250,000,000	256,182,500	
第342回利付国債(10年)	670,000,000	676,311,400	
第343回利付国債(10年)	600,000,000	605,346,000	
第344回利付国債(10年)	400,000,000	403,336,000	
第345回利付国債(10年)	150,000,000	151,159,500	
第346回利付国債(10年)	500,000,000	503,530,000	
第347回利付国債(10年)	500,000,000	503,400,000	
第348回利付国債(10年)	550,000,000	553,586,000	
第349回利付国債(10年)	360,000,000	362,062,800	
第350回利付国債(10年)	230,000,000	231,124,700	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,088,800	
第4回利付国債(30年)	200,000,000	267,400,000	
第5回利付国債(30年)	5,000,000	6,292,000	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	90,384,000	
第8回利付国債(30年)	45,000,000	54,773,100	
第11回利付国債(30年)	65,000,000	78,425,100	
第12回利付国債(30年)	90,000,000	114,103,800	
第13回利付国債(30年)	70,000,000	87,796,100	
第14回利付国債(30年)	120,000,000	158,114,400	
第18回利付国債(30年)	100,000,000	131,121,000	
第19回利付国債(30年)	230,000,000	302,344,200	
第21回利付国債(30年)	310,000,000	408,508,700	
第22回利付国債(30年)	200,000,000	270,852,000	
第23回利付国債(30年)	180,000,000	244,197,000	
第24回利付国債(30年)	200,000,000	271,792,000	
第25回利付国債(30年)	260,000,000	344,315,400	
第26回利付国債(30年)	180,000,000	242,022,600	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	437,145,600	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	410,910,000	

第 2 9 回利付国債( 3 0 年)	290,000,000	393,213,900	
第 3 0 回利付国債( 3 0 年)	280,000,000	375,491,200	
第 3 1 回利付国債( 3 0 年)	320,000,000	424,112,000	
第 3 2 回利付国債( 3 0 年)	150,000,000	202,572,000	
第 3 3 回利付国債( 3 0 年)	240,000,000	310,183,200	
第 3 4 回利付国債( 3 0 年)	100,000,000	133,892,000	
第 3 5 回利付国債( 3 0 年)	420,000,000	546,004,200	
第 3 6 回利付国債( 3 0 年)	330,000,000	429,957,000	
第 3 7 回利付国債( 3 0 年)	380,000,000	487,536,200	
第 3 8 回利付国債( 3 0 年)	200,000,000	252,708,000	
第 3 9 回利付国債( 3 0 年)	100,000,000	128,635,000	
第 4 0 回利付国債( 3 0 年)	150,000,000	189,603,000	
第 4 1 回利付国債( 3 0 年)	270,000,000	335,156,400	
第 4 2 回利付国債( 3 0 年)	200,000,000	248,390,000	
第 4 3 回利付国債( 3 0 年)	280,000,000	347,922,400	
第 4 4 回利付国債( 3 0 年)	130,000,000	161,798,000	
第 4 5 回利付国債( 3 0 年)	250,000,000	299,205,000	
第 4 6 回利付国債( 3 0 年)	320,000,000	383,043,200	
第 4 7 回利付国債( 3 0 年)	200,000,000	244,334,000	
第 4 8 回利付国債( 3 0 年)	200,000,000	234,558,000	
第 4 9 回利付国債( 3 0 年)	200,000,000	234,550,000	
第 5 0 回利付国債( 3 0 年)	340,000,000	347,517,400	
第 5 1 回利付国債( 3 0 年)	310,000,000	276,981,900	
第 5 2 回利付国債( 3 0 年)	280,000,000	263,942,000	
第 5 3 回利付国債( 3 0 年)	300,000,000	290,085,000	
第 5 4 回利付国債( 3 0 年)	350,000,000	356,261,500	
第 5 5 回利付国債( 3 0 年)	300,000,000	305,037,000	
第 5 6 回利付国債( 3 0 年)	470,000,000	477,374,300	
第 5 7 回利付国債( 3 0 年)	280,000,000	284,076,800	
第 5 8 回利付国債( 3 0 年)	190,000,000	192,549,800	
第 4 3 回利付国債( 2 0 年)	130,000,000	135,327,400	
第 4 8 回利付国債( 2 0 年)	70,000,000	74,792,900	
第 4 9 回利付国債( 2 0 年)	60,000,000	63,817,200	

第50回利付国債(20年)	40,000,000	42,316,000	
第51回利付国債(20年)	30,000,000	31,977,900	
第52回利付国債(20年)	65,000,000	69,842,500	
第53回利付国債(20年)	60,000,000	64,777,200	
第54回利付国債(20年)	160,000,000	173,316,800	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	108,129,000	
第56回利付国債(20年)	330,000,000	358,498,800	
第57回利付国債(20年)	130,000,000	140,692,500	
第59回利付国債(20年)	360,000,000	389,746,800	
第60回利付国債(20年)	100,000,000	106,878,000	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	147,387,800	
第62回利付国債(20年)	230,000,000	240,416,700	
第63回利付国債(20年)	130,000,000	142,541,100	
第64回利付国債(20年)	160,000,000	176,966,400	
第65回利付国債(20年)	330,000,000	366,527,700	
第66回利付国債(20年)	80,000,000	88,406,400	
第68回利付国債(20年)	275,000,000	311,536,500	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	135,200,400	
第70回利付国債(20年)	320,000,000	368,048,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	227,584,000	
第72回利付国債(20年)	450,000,000	511,447,500	
第74回利付国債(20年)	210,000,000	239,725,500	
第75回利付国債(20年)	310,000,000	355,402,600	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	271,857,600	
第77回利付国債(20年)	280,000,000	319,088,000	
第78回利付国債(20年)	190,000,000	216,075,600	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	114,435,000	
第80回利付国債(20年)	180,000,000	207,262,800	
第81回利付国債(20年)	280,000,000	321,736,800	
第82回利付国債(20年)	380,000,000	439,443,400	
第83回利付国債(20年)	300,000,000	348,390,000	
第84回利付国債(20年)	340,000,000	392,254,600	
第85回利付国債(20年)	300,000,000	349,827,000	



第 8 6 回利付国債(20年)	250,000,000	295,447,500	
第 8 7 回利付国債(20年)	280,000,000	328,703,200	
第 8 9 回利付国債(20年)	200,000,000	235,812,000	
第 9 0 回利付国債(20年)	270,000,000	319,585,500	
第 9 1 回利付国債(20年)	60,000,000	71,520,000	
第 9 2 回利付国債(20年)	140,000,000	165,132,800	
第 9 3 回利付国債(20年)	200,000,000	234,958,000	
第 9 4 回利付国債(20年)	200,000,000	236,724,000	
第 9 6 回利付国債(20年)	90,000,000	106,947,900	
第 9 7 回利付国債(20年)	240,000,000	288,547,200	
第 9 8 回利付国債(20年)	180,000,000	214,732,800	
第 9 9 回利付国債(20年)	300,000,000	359,082,000	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	300,000,000	363,180,000	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	310,000,000	381,358,900	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	180,000,000	222,267,600	
第 1 0 3 回利付国債(20年)	150,000,000	183,717,000	
第 1 0 4 回利付国債(20年)	200,000,000	240,942,000	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	190,000,000	229,624,500	
第 1 0 6 回利付国債(20年)	160,000,000	195,011,200	
第 1 0 7 回利付国債(20年)	170,000,000	206,084,200	
第 1 0 8 回利付国債(20年)	200,000,000	238,248,000	
第 1 0 9 回利付国債(20年)	220,000,000	262,761,400	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	220,000,000	268,285,600	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	210,000,000	256,836,300	
第 1 1 4 回利付国債(20年)	320,000,000	392,470,400	
第 1 1 5 回利付国債(20年)	220,000,000	272,340,200	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	100,000,000	124,072,000	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	320,000,000	393,299,200	
第 1 1 8 回利付国債(20年)	140,000,000	170,871,400	
第 1 1 9 回利付国債(20年)	100,000,000	119,673,000	
第 1 2 0 回利付国債(20年)	100,000,000	117,296,000	
第 1 2 1 回利付国債(20年)	280,000,000	339,197,600	
第 1 2 2 回利付国債(20年)	60,000,000	71,958,000	

第123回利付国債(20年)	300,000,000	371,865,000	
第124回利付国債(20年)	230,000,000	282,083,500	
第125回利付国債(20年)	250,000,000	313,592,500	
第126回利付国債(20年)	250,000,000	307,310,000	
第127回利付国債(20年)	250,000,000	304,170,000	
第128回利付国債(20年)	320,000,000	390,169,600	
第129回利付国債(20年)	100,000,000	120,649,000	
第130回利付国債(20年)	300,000,000	362,637,000	
第131回利付国債(20年)	150,000,000	179,368,500	
第132回利付国債(20年)	200,000,000	239,394,000	
第133回利付国債(20年)	200,000,000	242,198,000	
第134回利付国債(20年)	370,000,000	448,839,600	
第135回利付国債(20年)	200,000,000	239,766,000	
第136回利付国債(20年)	250,000,000	296,347,500	
第138回利付国債(20年)	200,000,000	234,678,000	
第139回利付国債(20年)	200,000,000	237,408,000	
第140回利付国債(20年)	290,000,000	348,725,000	
第141回利付国債(20年)	300,000,000	361,008,000	
第143回利付国債(20年)	200,000,000	238,132,000	
第145回利付国債(20年)	380,000,000	458,485,200	
第146回利付国債(20年)	380,000,000	459,066,600	
第147回利付国債(20年)	350,000,000	417,795,000	
第148回利付国債(20年)	500,000,000	589,410,000	
第149回利付国債(20年)	400,000,000	471,888,000	
第151回利付国債(20年)	300,000,000	339,999,000	
第152回利付国債(20年)	200,000,000	226,498,000	
第153回利付国債(20年)	360,000,000	413,496,000	
第154回利付国債(20年)	300,000,000	339,483,000	
第155回利付国債(20年)	420,000,000	461,046,600	
第156回利付国債(20年)	190,000,000	188,898,000	
第157回利付国債(20年)	470,000,000	449,959,200	
第158回利付国債(20年)	270,000,000	272,057,400	
第159回利付国債(20年)	300,000,000	306,930,000	

		第160回利付国債(20年)	160,000,000	166,225,600	
		第161回利付国債(20年)	230,000,000	234,416,000	
		第162回利付国債(20年)	320,000,000	325,356,800	
		第163回利付国債(20年)	290,000,000	294,387,700	
		第164回利付国債(20年)	150,000,000	149,191,500	
	小計	銘柄数:230 組入時価比率:79.2%	66,255,000,000	73,389,840,200 79.5%	
地方債証券	日本円	第10回東京都公募公債(東京再生都債)	100,000,000	130,762,000	
		第734回東京都公募公債	100,000,000	102,921,000	
		第740回東京都公募公債	100,000,000	102,514,000	
		第748回東京都公募公債	100,000,000	102,597,000	
		第754回東京都公募公債	100,000,000	99,602,000	
		平成22年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,654,000	
		平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	102,593,000	
		第3回神奈川県公募公債	100,000,000	114,172,000	
		第201回神奈川県公募公債	100,000,000	103,462,000	
		第209回神奈川県公募公債	100,000,000	102,931,000	
		第6回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	119,476,000	
		第327回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,859,000	
		第405回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,369,000	
		第420回大阪府公募公債(10年)	110,000,000	109,852,600	
		平成22年度第5回京都府公募公債	100,000,000	103,199,000	
		第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	121,773,000	
		平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,392,000	
		平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,520,000	
		平成26年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	103,006,000	
		平成21年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,817,000	
		平成22年度第9回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,668,000	
		平成22年度第11回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,215,000	

平成26年度第4回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	116,041,000	
平成22年度第6回広島県公募公債	100,000,000	103,316,000	
平成22年度第8回埼玉県公募公債	47,000,000	48,154,320	
第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	119,604,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,970,000	
平成21年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,514,000	
平成26年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,070,000	
平成21年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,880,000	
平成25年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,640,000	
平成25年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,279,000	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,790,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,923,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,509,000	
第89回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,300,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,122,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,262,000	
第110回共同発行市場公募地方債	117,000,000	121,022,460	
第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,508,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,350,000	
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,602,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,078,000	
第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,456,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,278,000	
第132回共同発行市場公募地方債	101,000,000	104,477,430	
第163回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,213,000	
平成28年度第3回島根県公募公債	100,000,000	99,878,000	
平成25年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	103,231,000	
第2回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,088,000	
第475回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,445,000	
第482回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,872,000	
第2回京都市公募公債(20年)	100,000,000	114,613,000	

		第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,178,000	
		平成28年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	100,518,000	
		第1回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	115,212,000	
		平成25年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,431,000	
		第50回川崎市公募公債（5年）	100,000,000	99,897,000	
		第87回川崎市公募公債	100,000,000	102,303,000	
		北九州市第1回15年公募公債	100,000,000	107,329,000	
		平成23年度第5回広島市公募公債	100,000,000	103,683,000	
	小計	銘柄数：61 組入時価比率：6.9%	6,075,000,000	6,387,391,810 6.9%	
特殊債券	日本円	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,520,000	
		第23回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	108,000,000	111,938,760	
		第34回日本政策投資銀行債券	100,000,000	135,628,000	
		第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,528,000	
		第33回日本高速道路債券・機構承継	100,000,000	136,222,000	
		第55回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,590,000	
		第87回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,978,000	
		第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,185,000	
		第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	108,426,340	
		第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	108,000,000	110,557,440	
		第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,335,000	
		第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,027,000	
		第130回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,664,000	
		第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,593,000	
		第169回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,375,000	
		第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	109,847,800	

第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,282,000	
第216回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,637,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,751,000	
第224回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,708,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,172,000	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,300,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,655,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	121,973,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,781,000	
第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	121,601,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	120,148,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,526,000	
第37回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,276,000	
20年第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	113,485,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,282,000	
第48回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,750,000	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,312,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,216,000	
第3回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	101,890,000	
第26回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	104,717,000	
第31回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,216,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	103,995,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	100,000,000	103,741,000	
第38回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,740,000	
第56回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,551,000	
第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,180,000	

第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,450,000	14,896,938	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,988,000	17,855,067	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,543,000	15,116,430	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,922,000	18,985,312	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,173,000	21,376,722	
第15回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,746,000	
第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,459,000	20,715,273	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,268,000	31,699,373	
第23回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,288,000	15,874,600	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,888,000	57,339,054	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,665,000	31,145,955	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,025,000	29,138,895	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,235,000	37,647,540	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,138,000	40,440,009	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,551,000	39,675,635	
第37回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,849,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,806,000	17,784,781	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,812,000	83,075,981	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,527,000	18,615,601	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,742,000	41,000,271	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,022,000	107,549,551	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,599,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,053,000	63,092,282	

		第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,071,000	64,432,801	
		第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,506,000	69,892,337	
		第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,854,000	69,951,367	
		第 9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,392,000	74,490,678	
		第 1 0 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,786,000	
		第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,071,000	94,372,967	
		第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,045,000	95,644,733	
		第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,456,000	96,207,238	
		第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,020,000	99,609,169	
		第 1 8 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,907,000	
		第 1 1 回成田国際空港株式会社債（一般担保付）	100,000,000	103,742,000	
		第 1 3 回成田国際空港株式会社債（一般担保付）	100,000,000	103,236,000	
		い第 7 7 1 号商工債	100,000,000	100,134,000	
		い第 7 7 8 号商工債	100,000,000	100,223,000	
		い第 7 9 1 号商工債	100,000,000	99,817,000	
		第 3 0 4 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,344,000	
		第 3 1 0 回信金中金債（5年）	100,000,000	100,377,000	
		第 3 3 5 回信金中金債（5年）	100,000,000	99,933,000	
		第 2 0 9 号商工債（3年）	100,000,000	99,830,000	
		第 1 3 回中日本高速道路株式会社債（一般担保付、独立行政法人）	100,000,000	102,336,000	
		第 3 0 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,353,000	
		第 6 5 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,328,000	
	小計	銘柄数：87 組入時価比率：8.4%	7,363,970,000	7,817,466,900 8.5%	
社債券	日本円	クレディ・アグリコル・エス・エー 第 6 回円貨社債	100,000,000	103,511,000	
		第 1 回 H S B C ホールディングス	100,000,000	100,862,000	



第15回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーショ	100,000,000	104,971,000	
第10回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201	100,000,000	100,016,000	
第36回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,984,000	
第30回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人	100,000,000	99,681,000	
第5回大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位	100,000,000	100,908,000	
第8回明治ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位	100,000,000	100,025,000	
第41回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,172,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,707,000	
第38回三菱化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,403,000	
第63回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,987,000	
第21回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	102,686,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	100,340,000	
第56回日産自動車株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,796,000	
第15回トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	100,000,000	100,932,000	
第84回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,972,000	
第85回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	116,145,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,500,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,018,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,728,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限	100,000,000	101,799,000	
株式会社三井住友フィナンシャルグループ第1回無担保劣後社債	100,000,000	102,128,000	
第7回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,328,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保変動利付社債(社債間限定同	100,000,000	102,985,000	

	第31回株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	100,707,000	
	第99回住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,691,000	
	第5回イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,849,000	
	第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順)	100,000,000	120,526,000	
	第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特)	100,000,000	119,014,000	
	第5回東海旅客鉄道株式会社普通社債(一般担保付)	100,000,000	104,385,000	
	第44回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	100,000,000	101,805,000	
	第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	100,000,000	123,446,000	
	第11回日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,453,000	
	第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,902,000	
	第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,723,000	
	第492回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,981,000	
	第366回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,713,000	
	第382回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,262,000	
	第308回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,154,000	
	第450回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,723,000	
	第411回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,700,000	
	第35回電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,026,000	
	第39回電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,708,000	
	第17回北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,993,000	
	第9回西部瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,295,000	
小計	銘柄数: 46 組入時価比率: 5.1%	4,600,000,000	4,764,640,000 5.2%	
	合計		92,359,338,910	

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 日立外国株式インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	2,846,018,309	3,352,223,469
コール・ローン	40,850,920	17,935,888
株式	73,547,664,048	81,522,081,306
派生商品評価勘定	70,968,412	95,886,320
未収入金	34,258,777	6,354,592
未収配当金	142,746,925	159,875,454
差入委託証拠金	514,521,376	796,579,374
流動資産合計	77,197,028,767	85,950,936,403
資産合計	77,197,028,767	85,950,936,403
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	481,125	12,389,085
未払金	-	11,943,909
未払解約金	6,500,000	16,900,000
未払利息	111	49
流動負債合計	6,981,236	41,233,043
負債合計	6,981,236	41,233,043
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	35,421,743,810	35,500,274,151
<b>剰余金</b>		
剰余金又は欠損金（ ）	41,768,303,721	50,409,429,209
元本等合計	77,190,047,531	85,909,703,360
純資産合計	77,190,047,531	85,909,703,360
負債純資産合計	77,197,028,767	85,950,936,403

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、原則として計算日に知り得る直近の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>外国為替予約取引</p> <p>原則として、計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>受取利息</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,421,743,810口	35,500,274,151口
1口当たり純資産額	2.1792円	2.4200円
(1万口当たり純資産額)	(21,792円)	(24,200円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
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。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

## 金融商品の時価に関する事項

項目	2018年5月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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ぬ。
2. 時価の算定方法	有価証券等 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、時価は帳簿価額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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,171,350,446	3,357,549,069
合計	1,171,350,446	3,357,549,069

(注)当計算期間とは、当親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間としております。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引、通貨関連では為替予約取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額・為替等の変動によるリスクを回避する目的で行ないます。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で、また、通貨関連では外貨建有価証券等の為替変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2017年5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,509,904,105	-	3,580,500,310	58,087,143
	S&P500 EMINI	2,333,178,567	-	2,357,267,095	22,845,327
	S&PTSE60 1706	151,141,548	-	151,528,266	403,595
	EURX50 1706	460,082,737	-	490,859,509	24,392,410
	FTSE100 1706	297,443,822	-	302,598,912	4,071,017
	SMI 1706	134,743,639	-	144,188,213	7,884,815
	SPI200 1706	133,313,792	-	134,058,315	1,510,021
合計	3,509,904,105	-	3,580,500,310	58,087,143	

(2018年5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,229,472,813	-	4,312,971,949	186,312,004
	S&P500 EMINI	2,898,553,011	-	2,906,982,959	94,371,452
	S&PTSE60 1806	156,549,659	-	163,593,850	8,268,015
	EURX50 1806	546,031,147	-	578,037,500	37,646,301
	FTSE100 1806	328,788,198	-	354,778,074	30,515,228
	SMI 1806	152,542,873	-	157,747,846	6,609,517
	SPI200 1806	147,007,925	-	151,831,720	8,901,491
	合計	4,229,472,813	-	4,312,971,949	186,312,004

## 時価の算定方法

## 先物取引

## 外国先物取引について

先物取引の評価においては、計算日に知り得る直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (通貨関連)

(2017年5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	24,400,000	-	24,291,085	108,915
	ドル	18,400,000	-	18,319,241	80,759
	カナダドル	6,000,000	-	5,971,844	28,156
	合計	24,400,000	-	24,291,085	108,915

(2018年5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	5,000,000	-	5,001,908	1,908
	ユーロ	5,000,000	-	5,001,908	1,908
	合計	5,000,000	-	5,001,908	1,908



## 時価の算定方法

## 為替予約取引

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	38,765,426,428円	35,421,743,810円
期中追加設定元本額	1,328,624,338円	1,611,901,330円
期中一部解約元本額	4,672,306,956円	1,533,370,989円
期末元本額	35,421,743,810円	35,500,274,151円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	2,689,302,871円	2,726,780,948円
日立バランスファンド（株式50）	1,912,998,178円	1,856,755,358円
日立バランスファンド（株式30）	350,398,448円	333,812,606円
日立外国株式特化型ファンド（非課税適格機関投資家専用）	19,717,723,596円	19,487,159,191円
日立外国株式インデックスファンド	10,751,320,717円	11,095,766,048円

（注）\* は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

(2018年5月15日現在)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ドル	ANADAECO PETROLEUM CORP	10,700	69.20	740,440.00	
	ANDEAVOR	2,900	142.11	412,119.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,800	18.93	90,864.00	
	APACHE CORP	7,528	42.31	318,509.68	
	APERGY CORP	1,550	39.19	60,744.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	8,161	35.68	291,184.48	
	CABOT OIL & GAS CORP	8,300	23.27	193,141.00	
	CHENIERE ENERGY INC	3,900	62.71	244,569.00	
	CHEVRON CORP	37,603	130.39	4,903,055.17	
	CIMAREX ENERGY CO	1,800	96.92	174,456.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,800	150.55	421,540.00	
	CONOCOPHILLIPS	24,100	69.59	1,677,119.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,600	68.04	108,864.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,422	41.32	389,317.04	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,700	124.24	211,208.00	
	ENBRIDGE INC	13,753	33.25	457,287.25	
	EOG RESOURCES INC	11,600	118.68	1,376,688.00	
	EQT CORP	4,800	51.69	248,112.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	84,522	81.83	6,916,435.26	
	HALLIBURTON CO	16,752	52.50	879,480.00	
	HELMERICH & PAYNE	2,000	69.68	139,360.00	
	HESS CORP	5,400	63.13	340,902.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,100	69.04	214,024.00	
	KINDER MORGAN INC	40,457	16.64	673,204.48	
	MARATHON OIL CORP	16,235	21.42	347,753.70	
	MARATHON PETROLEUM CORP	10,534	78.34	825,233.56	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,509	41.06	308,319.54	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	4,200	28.68	120,456.00	
	NOBLE ENERGY INC	8,300	35.24	292,492.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	14,820	84.89	1,258,069.80	
ONEOK INC	7,800	66.59	519,402.00		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,700	31.62	148,614.00		

PHILLIPS 66	9,150	118.29	1,082,353.50	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,300	201.62	665,346.00	
PLAINS GP HOLDINGS L	1,652	24.71	40,820.92	
RANGE RESOURCES CORP	3,600	14.76	53,136.00	
SCHLUMBERGER LTD	27,661	71.60	1,980,527.60	
TARGA RESOURCES CORP	4,500	48.85	219,825.00	
TECHNIPFMC PLC	4,300	31.74	136,482.00	
VALERO ENERGY CORP	8,968	115.87	1,039,122.16	
WILLIAMS COS INC	16,384	27.25	446,464.00	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,390	166.76	732,076.40	
ALBEMARLE CORP	2,300	99.24	228,252.00	
AVERY DENNISON CORP	1,898	108.19	205,344.62	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,600	31.29	143,934.00	
BALL CORP	6,252	38.36	239,826.72	
CELANESE CORP-SERIES A	2,900	108.20	313,780.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,000	40.47	202,350.00	
CHEMOURS CO/THE	3,500	50.99	178,465.00	
CROWN HOLDINGS INC	2,800	44.92	125,776.00	
DOWDUPONT INC	46,325	67.53	3,128,327.25	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,000	106.71	320,130.00	
ECOLAB INC	5,100	146.29	746,079.00	
FMC CORP	2,700	89.79	242,433.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	27,827	16.20	450,797.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	7,585	54.21	411,182.85	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,636	126.30	206,626.80	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,800	111.98	761,464.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,140	213.47	243,355.80	
MONSANTO CO	8,516	124.95	1,064,074.20	
MOSAIC CO/THE	6,500	27.17	176,605.00	
NEWMONT MINING CORP	10,253	40.39	414,118.67	
NUCOR CORP	6,244	62.76	391,873.44	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,900	116.72	221,768.00	
PPG INDUSTRIES INC	5,156	102.97	530,913.32	
PRAXAIR INC	5,494	158.45	870,524.30	
SEALED AIR CORP	4,154	43.92	182,443.68	
SHERWIN-WILLIAMS CO	1,735	384.58	667,246.30	
STEEL DYNAMICS INC	4,600	48.56	223,376.00	
VULCAN MATERIALS CO	2,651	126.84	336,252.84	
WESTROCK CO	4,973	61.21	304,397.33	

WR GRACE & CO	1,400	72.47	101,458.00
3M CO	11,776	205.76	2,423,029.76
ACUITY BRANDS INC	900	115.65	104,085.00
AERCAP HOLDINGS NV	3,109	55.47	172,456.23
AGCO CORP	1,500	64.31	96,465.00
ALLEGION PLC	1,800	76.85	138,330.00
AMETEK INC	4,450	74.25	330,412.50
ARCONIC INC	9,134	18.32	167,334.88
BOEING CO	11,176	344.59	3,851,137.84
CATERPILLAR INC	11,720	155.28	1,819,881.60
DEERE & CO	5,322	146.75	781,003.50
DOVER CORP	3,100	77.76	241,056.00
EATON CORP PLC	8,795	76.58	673,521.10
EMERSON ELECTRIC CO	12,446	72.16	898,103.36
FASTENAL CO	5,600	51.78	289,968.00
FLOWSERVE CORP	2,800	44.41	124,348.00
FLUOR CORP	2,594	46.84	121,502.96
FORTIVE CORP	6,308	76.30	481,300.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,000	56.15	168,450.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,086	203.07	1,032,814.02
GENERAL ELECTRIC CO	170,441	14.71	2,507,187.11
GRAINGER (W W) INC	1,123	295.71	332,082.33
HARRIS CORP	2,400	155.17	372,408.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,800	39.92	151,696.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	14,469	147.30	2,131,283.70
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	900	218.45	196,605.00
IDEX CORP	1,400	137.72	192,808.00
ILLINOIS TOOL WORKS	6,216	145.50	904,428.00
INGERSOLL-RAND PLC	4,941	89.16	440,539.56
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,600	62.99	163,774.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,800	61.80	296,640.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	37.29	167,805.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,116	36.48	660,871.68
L3 TECHNOLOGIES INC	1,500	191.87	287,805.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	700	202.60	141,820.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	5,157	319.08	1,645,495.56
MASCO CORP	6,270	37.64	236,002.80
MIDDLEBY CORP	1,200	105.96	127,152.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,300	318.72	1,051,776.00

OWENS CORNING	2,100	66.15	138,915.00	
PACCAR INC	6,975	63.19	440,750.25	
PARKER HANNIFIN CORP	2,666	176.43	470,362.38	
PENTAIR PLC	3,592	44.83	161,029.36	
RAYTHEON COMPANY	5,722	209.19	1,196,985.18	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,531	178.86	452,694.66	
ROCKWELL COLLINS	3,137	135.19	424,091.03	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,000	278.64	557,280.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,600	52.01	187,236.00	
SMITH (A.O.) CORP	2,800	63.66	178,248.00	
SNAP-ON INC	1,200	149.60	179,520.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,200	84.09	184,998.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,883	143.46	413,595.18	
TEXTRON INC	5,384	65.53	352,813.52	
TRANSDIGM GROUP INC	1,000	332.67	332,670.00	
UNITED RENTALS INC	1,600	165.56	264,896.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	14,958	124.98	1,869,450.84	
WABCO HOLDINGS INC	1,100	129.33	142,263.00	
WABTEC CORP	1,700	93.18	158,406.00	
XYLEM INC	3,748	73.47	275,365.56	
CINTAS CORP	1,674	183.27	306,793.98	
COSTAR GROUP INC	700	391.23	273,861.00	
EQUIFAX INC	2,298	113.49	260,800.02	
IHS MARKIT LTD	8,134	51.93	422,398.62	
MANPOWERGROUP	1,326	95.21	126,248.46	
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,000	30.52	213,640.00	
REPUBLIC SERVICES INC	4,745	67.78	321,616.10	
ROBERT HARF INTL INC	2,744	62.85	172,460.40	
ROLLINS INC	1,800	50.29	90,522.00	
STERICYCLE INC	1,800	64.13	115,434.00	
TRANSUNION	3,800	69.20	262,960.00	
VERISK ANALYTICS INC	3,100	105.25	326,275.00	
WASTE CONNECTIONS INC	5,026	75.25	378,206.50	
WASTE MANAGEMENT INC	8,835	82.63	730,036.05	
AMERCO	100	343.86	34,386.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,600	42.46	110,396.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,700	85.68	231,336.00	
CSX CORP	16,786	62.90	1,055,839.40	
DELTA AIR LINES INC	3,700	52.09	192,733.00	

EXPEDITORS INTL WASH INC	3,600	72.22	259,992.00	
FEDEX CORPORATION	4,945	251.35	1,242,925.75	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,900	123.76	235,144.00	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	125,000	0.34	42,500.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,200	108.81	239,382.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,600	40.66	105,716.00	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,500	38.29	57,435.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,678	150.44	854,198.32	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,100	146.28	160,908.00	
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	3,062	52.20	159,836.40	
UNION PACIFIC CORP	15,624	140.71	2,198,453.04	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,600	66.64	106,624.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	13,415	116.34	1,560,701.10	
APTIV PLC	5,400	95.72	516,888.00	
AUTOLIV INC	1,700	143.38	243,746.00	
BORGWARNER INC	4,200	50.98	214,116.00	
FORD MOTOR COMPANY	72,045	11.18	805,463.10	
GENERAL MOTORS CO	25,500	36.63	934,065.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,200	25.48	132,496.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	3,514	40.88	143,652.32	
LEAR CORP	1,500	197.39	296,085.00	
TESLA, INC.	2,700	291.97	788,319.00	
DR HORTON INC	6,733	43.51	292,952.83	
GARMIN LTD	2,400	59.39	142,536.00	
HANESBRANDS INC	7,100	16.74	118,854.00	
HASBRO INC	2,300	86.63	199,249.00	
LEGGETT & PLATT INC	2,900	41.75	121,075.00	
LENNAR CORP-A	5,600	54.29	304,024.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,200	98.72	217,184.00	
MATTEL INC	6,441	14.19	91,397.79	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,200	63.19	202,208.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,200	210.64	252,768.00	
NEWELL BRANDS INC	10,027	27.11	271,831.97	
NIKE INC -CL B	26,268	68.84	1,808,289.12	
NVR INC	80	3,052.00	244,160.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,300	106.91	138,983.00	
PULTE GROUP INC	5,800	30.96	179,568.00	
PVH CORP	1,600	154.32	246,912.00	
RALPH LAUREN CORP	1,100	110.48	121,528.00	

TAPESTRY INC	5,500	45.70	251,350.00
TOLL BROTHERS INC	2,900	42.79	124,091.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,700	18.44	68,228.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	3,726	16.66	62,075.16
VF CORP	6,416	77.58	497,753.28
WHIRLPOOL CORP	1,460	157.65	230,169.00
ARAMARK	4,900	38.00	186,200.00
CARNIVAL CORP	7,103	64.82	460,416.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	600	425.06	255,036.00
DARDEN RESTAURANTS INC	2,400	86.97	208,728.00
DOMINO'S PIZZA INC	900	246.14	221,526.00
H&R BLOCK INC	4,224	27.70	117,004.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,633	82.97	467,370.01
LAS VEGAS SANDS CORP	8,400	77.49	650,916.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,589	139.35	918,177.15
MCDONALD'S CORPORATION	16,135	164.72	2,657,757.20
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED	5,137	31.23	160,428.51
MGM RESORTS INTERNATIONAL	8,700	32.32	281,184.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,400	51.42	226,248.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,400	107.13	364,242.00
STARBUCKS CORP	28,516	57.13	1,629,119.08
VAIL RESORTS INC	800	237.87	190,296.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,100	111.35	233,835.00
WYNN RESORTS LTD	2,000	191.63	383,260.00
YUM! BRANDS INC	6,726	83.60	562,293.60
CBS CORP-CL B	7,526	53.65	403,769.90
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3,780	272.84	1,031,335.20
COMCAST CORP-CL A	93,650	32.14	3,009,911.00
DISCOVERY INC-A	2,707	23.83	64,507.81
DISCOVERY INC-C	5,902	22.51	132,854.02
DISH NETWORK CORP-A	4,500	31.83	143,235.00
INTERPUBLIC GROUP COS INC	8,398	24.22	203,399.56
LIBERTY BROADBAND CORP	2,000	72.28	144,560.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,888	30.22	147,715.36
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,796	29.55	348,571.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,700	30.29	112,073.00
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM A	2,000	44.38	88,760.00
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM C	4,000	44.30	177,200.00

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,600	42.72	111,072.00	
NEWS CORP-CLASS A	7,998	15.82	126,528.36	
OMNICOM GROUP	4,740	74.98	355,405.20	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	33,400	6.85	228,790.00	
THE WALT DISNEY CO	30,207	102.44	3,094,405.08	
TIME WARNER INC	15,542	94.38	1,466,853.96	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX	8,653	37.29	322,670.37	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	21,294	37.76	804,061.44	
VIACOM INC-CL B	6,626	28.74	190,431.24	
ADVANCE AUTO PARTS	1,500	121.61	182,415.00	
AMAZON COM INC	8,194	1,601.54	13,123,018.76	
AUTONATION INC	1,500	46.60	69,900.00	
AUTOZONE INC	570	666.02	379,631.40	
BEST BUY COMPANY INC	5,731	78.25	448,450.75	
BOOKING HOLDINGS INC	1,000	2,072.02	2,072,020.00	
CARMAX INC	3,774	64.78	244,479.72	
DOLLAR GENERAL CORP	5,600	93.72	524,832.00	
DOLLAR TREE INC	4,721	94.86	447,834.06	
EXPEDIA GROUP INC	2,400	114.64	275,136.00	
GAP INC	4,463	30.38	135,585.94	
GENUINE PARTS CO	3,010	91.75	276,167.50	
HOME DEPOT INC	23,358	191.08	4,463,246.64	
KOHL'S CORP	3,621	61.18	221,532.78	
L BRANDS INC	4,905	33.23	162,993.15	
LKQ CORP	6,300	30.60	192,780.00	
LOWE'S COMPANIES	17,150	86.58	1,484,847.00	
MACY'S	6,114	29.63	181,157.82	
NETFLIX INC	8,600	328.53	2,825,358.00	
NORDSTROM INC	2,500	49.32	123,300.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,900	272.85	518,415.00	
QURATE RETAIL INC QVC GROUP	8,062	22.36	180,266.32	
ROSS STORES INC	8,000	82.66	661,280.00	
TARGET CORP	10,626	72.90	774,635.40	
TIFFANY & CO	2,621	102.99	269,936.79	
TJX COMPANIES INC	12,762	84.92	1,083,749.04	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,800	71.21	199,388.00	
TRIPADVISOR INC	2,500	48.67	121,675.00	
ULTA BEAUTY INC	1,200	247.04	296,448.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	8,789	195.88	1,721,589.32	



KROGER CO	17,458	24.73	431,736.34	
SYSCO CORP	10,529	62.90	662,274.10	
WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	16,654	65.10	1,084,175.40	
WALMART INC	29,862	84.39	2,520,054.18	
ALTRIA GROUP INC	38,062	55.02	2,094,171.24	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,669	44.42	518,336.98	
BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR	8,748	51.54	450,871.92	
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	5,030	57.31	288,269.30	
BUNGE LIMITED	2,700	71.04	191,808.00	
CAMPBELL SOUP CO	3,847	40.04	154,033.88	
COCA-COLA COMPANY	79,928	42.04	3,360,173.12	
CONAGRA BRANDS INC	7,981	37.75	301,282.75	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,400	221.82	754,188.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,614	119.70	432,595.80	
GENERAL MILLS INC	11,664	42.53	496,069.92	
HERSHEY CO/THE	2,800	92.54	259,112.00	
HORMEL FOODS CORP	6,000	36.08	216,480.00	
INGREDION INC	1,500	111.33	166,995.00	
JM SMUCKER CO/THE COM	2,255	111.58	251,612.90	
KELLOGG CO	5,300	61.65	326,745.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,847	59.28	702,290.16	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,300	106.93	245,939.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,600	60.42	217,512.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	30,242	39.22	1,186,091.24	
MONSTER BEVERAGE CORP	8,000	48.93	391,440.00	
PEPCICO INC	28,038	97.15	2,723,891.70	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	31,062	80.86	2,511,673.32	
TYSON FOODS INC-CL A	5,700	67.62	385,434.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	47.04	244,608.00	
CLOROX COMPANY	2,474	119.04	294,504.96	
COLGATE-PALMOLIVE CO	16,500	62.04	1,023,660.00	
COTY INC-CL A	10,123	14.15	143,240.45	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,400	140.63	618,772.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	6,938	104.80	727,102.40	
PROCTER & GAMBLE CO	50,636	73.28	3,710,606.08	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	600	75.17	45,102.00	
ABBOTT LABORATORIES	34,427	62.02	2,135,162.54	
AETNA INC	6,805	177.82	1,210,065.10	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,400	286.42	400,988.00	

AMERISOURCEBERGEN CORP	3,100	87.28	270,568.00	
ANTHEM INC	5,076	232.31	1,179,205.56	
BAXTER INTERNATIONAL INC	9,825	71.20	699,540.00	
BECTON DICKINSON & CO	5,191	227.18	1,179,291.38	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	26,747	29.86	798,665.42	
CARDINAL HEALTH INC	6,114	55.16	337,248.24	
CENTENE CORP	3,200	114.73	367,136.00	
CERNER CORP	5,800	59.05	342,490.00	
CIGNA CORP	5,012	177.54	889,830.48	
COOPER COS INC/THE	1,000	235.17	235,170.00	
CVS HEALTH CORPORATION	20,021	66.82	1,337,803.22	
DANAHER CORP	12,516	102.67	1,285,017.72	
DAVITA INC	3,200	66.60	213,120.00	
DENTSPLY SIRONA INC	4,700	47.51	223,297.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,100	138.06	566,046.00	
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,069	41.74	86,360.06	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,193	73.67	824,588.31	
HCA HEALTHCARE INC	6,100	101.78	620,858.00	
HENRY SCHEIN INC	3,200	73.32	234,624.00	
HOLOGIC INC	4,844	38.30	185,525.20	
HUMANA INC	2,900	289.63	839,927.00	
IDEXX LABORATORIES INC	1,700	210.88	358,496.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,250	466.19	1,048,927.50	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,000	177.14	354,280.00	
MCKESSON CORP	4,352	151.02	657,239.04	
MEDTRONIC PLC	27,136	86.18	2,338,580.48	
QUEST DIAGNOSTICS	2,638	102.93	271,529.34	
RESMED INC	2,900	102.15	296,235.00	
STRYKER CORP	6,576	169.15	1,112,330.40	
TELEFLEX INC	800	265.29	212,232.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	19,364	242.90	4,703,515.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,800	118.71	213,678.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,800	117.63	211,734.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,000	76.75	153,500.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,893	115.20	448,473.60	
ABBVIE INC	31,720	105.89	3,358,830.80	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,296	69.21	435,746.16	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,300	122.85	528,255.00	
ALKERMES, INC	3,100	47.04	145,824.00	

ALLERGAN PLC	6,534	154.36	1,008,588.24	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,700	103.13	175,321.00	
AMGEN INC	13,425	175.96	2,362,263.00	
BIOGEN INC	4,310	282.34	1,216,885.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,200	89.54	286,528.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32,503	52.02	1,690,806.06	
CELGENE CORP	15,800	85.31	1,347,898.00	
GILEAD SCIENCES INC	25,700	67.05	1,723,185.00	
ILLUMINA INC	2,900	269.44	781,376.00	
INCYTE CORP	3,300	67.22	221,826.00	
IQVIA HOLDINGS INC	2,867	102.89	294,985.63	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,300	166.00	215,800.00	
JOHNSON & JOHNSON	53,607	126.06	6,757,698.42	
LILLY (ELI) & CO	19,349	83.07	1,607,321.43	
MERCK & CO. INC.	53,892	59.68	3,216,274.56	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	500	568.92	284,460.00	
MYLAN INC	8,700	38.26	332,862.00	
PERRIGO CO PLC	2,771	74.94	207,658.74	
PFIZER INC	118,956	35.86	4,265,762.16	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,500	309.54	464,310.00	
SEATTLE GENETICS INC	2,100	57.58	120,918.00	
TESARO INC	700	49.13	34,391.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,928	217.41	1,723,626.48	
UNITED THERAPEUTICS CORP	900	106.56	95,904.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,000	157.46	787,300.00	
WATERS CORPORATION	1,574	196.96	310,015.04	
ZOETIS INC	9,373	84.06	787,894.38	
BANK OF AMERICA CORP	197,236	31.12	6,137,984.32	
BB&T CORPORATION	15,800	55.00	869,000.00	
CIT GROUP INC	3,800	53.71	204,098.00	
CITIGROUP INC	52,305	72.62	3,798,389.10	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,000	42.34	423,400.00	
COMERICA INC	3,358	98.02	329,151.16	
EAST WEST BANCORP INC	2,700	70.28	189,756.00	
FIFTH THIRD BANCORP	15,272	34.03	519,706.16	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,000	97.33	291,990.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,800	15.11	314,288.00	
JPMORGAN CHASE & CO	69,018	113.90	7,861,150.20	
KEYCORP	21,593	20.16	435,314.88	

M & T BANK CORP	2,844	184.31	524,177.64	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,200	11.82	108,744.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	6,700	18.57	124,419.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,567	150.35	1,438,398.45	
REGIONS FINANCIAL CORP	24,984	19.20	479,692.80	
SIGNATURE BANK	1,000	130.95	130,950.00	
SUNTRUST BANKS INC	9,567	68.93	659,453.31	
SVB FINANCIAL GROUP	1,000	319.20	319,200.00	
US BANCORP	33,294	51.18	1,703,986.92	
WELLS FARGO COMPANY	93,538	54.48	5,095,950.24	
ZIONS BANCORPORATION	3,800	57.61	218,918.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	165.86	182,446.00	
AGNC INVESTMENT CORP	6,500	18.97	123,305.00	
ALLY FINANCIAL INC	8,900	26.75	238,075.00	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	15,222	101.29	1,541,836.38	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,224	138.96	448,007.04	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,800	10.44	248,472.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,760	57.30	1,189,548.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,150	199.18	5,009,377.00	
BLACKROCK INC	2,400	539.76	1,295,424.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,385	93.19	874,588.15	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,900	108.11	205,409.00	
CME GROUP INC	6,600	161.03	1,062,798.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,816	75.45	589,717.20	
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,500	63.87	351,285.00	
EATON VANCE CORP	2,500	56.79	141,975.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,400	33.70	249,380.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,008	243.91	1,709,321.28	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,550	71.72	828,366.00	
INVESCO LTD	7,880	28.55	224,974.00	
LEUCADIA NATIONAL CORP	6,500	24.57	159,705.00	
MOODY'S CORP	3,436	172.00	590,992.00	
MORGAN STANLEY	27,333	55.22	1,509,328.26	
MSCI INC	1,900	160.54	305,026.00	
NASDAQ INC	2,200	90.40	198,880.00	
NORTHERN TRUST CORP	4,121	108.64	447,705.44	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,600	93.79	243,854.00	
S&P GLOBAL INC	5,090	199.07	1,013,266.30	
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,152	58.93	1,423,277.36	

SEI INVESTMENTS COMPANY	2,600	63.98	166,348.00
STATE STREET CORP	7,524	102.31	769,780.44
SYNCHRONY FINANCIAL	16,111	33.94	546,807.34
T ROWE PRICE GROUP INC	5,000	118.01	590,050.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,800	61.00	353,800.00
VOYA FINANCIAL INC	3,900	52.62	205,218.00
AFLAC INC	15,838	45.24	716,511.12
ALLEGHANY CORP	341	583.44	198,953.04
ALLSTATE CORP	7,385	95.46	704,972.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,400	110.51	154,714.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,625	52.92	932,715.00
AON PLC	5,315	143.23	761,267.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,400	79.17	190,008.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,700	67.55	249,935.00
ASSURANT INC	1,200	87.27	104,724.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,200	47.10	150,720.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,800	56.82	102,276.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,647	48.80	80,373.60
CHUBB LTD	9,071	135.05	1,225,038.55
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,140	70.56	221,558.40
EVEREST RE GROUP LTD	800	226.91	181,528.00
FNF GROUP	4,596	38.21	175,613.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,732	52.46	405,620.72
LINCOLN NATIONAL CORP	4,651	68.08	316,640.08
LOEWS CORP	5,696	51.26	291,976.96
MARKEL CORP	280	1,131.69	316,873.20
MARSH & MCLENNAN COS	10,033	81.12	813,876.96
METLIFE INC	18,126	46.96	851,196.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,800	59.11	342,838.00
PROGRESSIVE CORP	11,236	61.72	693,485.92
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,524	99.87	851,291.88
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,200	150.16	180,192.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	800	127.32	101,856.00
TORCHMARK CORP	2,275	84.75	192,806.25
TRAVELERS COS INC/THE	5,732	130.00	745,160.00
UNUM GROUP	4,583	37.88	173,604.04
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,583	154.42	398,866.86
WR BERKLEY CORP	1,800	76.11	136,998.00
XL GROUP LTD	5,400	54.99	296,946.00

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,000	126.98	253,960.00	
AMERICAN TOWER CORP	8,600	138.29	1,189,294.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,731	164.54	449,358.74	
BOSTON PROPERTIES INC	3,000	122.44	367,320.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,500	14.48	94,120.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,800	86.19	155,142.00	
CBRE GROUP INC	6,100	46.96	286,456.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	9,400	6.05	56,870.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	8,200	103.29	846,978.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,900	108.23	422,097.00	
DUKE REALTY CORP	7,100	28.51	202,421.00	
EQUINIX INC	1,556	397.95	619,210.20	
EQUITY RESIDENTIAL	7,100	62.29	442,259.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,300	242.06	314,678.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,600	94.34	245,284.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,300	117.41	152,633.00	
GGP INC	11,003	20.50	225,561.50	
HCP INC	9,600	23.79	228,384.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	22,000	7.21	158,620.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	14,257	20.88	297,686.16	
INVITATION HOMES INC	5,700	23.27	132,639.00	
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	5,306	33.51	177,804.06	
JONES LANG LASALLE INC	900	169.37	152,433.00	
KIMCO REALTY CORP	8,200	14.28	117,096.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,100	43.36	134,416.00	
MACERICH CO/THE	2,300	55.88	128,524.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,100	91.53	192,213.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3,200	39.82	127,424.00	
PROLOGIS INC	10,172	65.21	663,316.12	
PUBLIC STORAGE	3,200	209.44	670,208.00	
REALTY INCOME CORP	5,000	52.78	263,900.00	
REGENCY CENTERS CORP	3,000	57.70	173,100.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,500	157.99	394,975.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,069	158.02	959,023.38	
SL GREEN REALTY CORP	1,900	98.96	188,024.00	
UDR INC	5,300	36.08	191,224.00	
VENTAS INC	7,000	53.16	372,120.00	
VEREIT INC	17,850	7.07	126,199.50	
VORNADO REALTY TRUST	3,327	68.99	229,529.73	

WELLTOWER INC	7,000	55.51	388,570.00	
WEYERHAEUSER CO	14,976	36.39	544,976.64	
NEW CA INC	6,284	35.09	220,505.56	
ACCENTURE PLC-CL A	12,100	155.57	1,882,397.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,400	71.70	1,032,480.00	
ADOBE SYSTEMS INC	9,700	238.37	2,312,189.00	
AKAMA I TECHNOLOGIES	3,300	76.69	253,077.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,000	209.45	209,450.00	
ALPHABET INC-CL A	5,930	1,106.60	6,562,138.00	
ALPHABET INC-CL C	6,245	1,100.20	6,870,749.00	
ANSYS INC	1,600	166.97	267,152.00	
AUTODESK INC	4,000	134.11	536,440.00	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	8,885	126.68	1,125,551.80	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,500	116.03	290,075.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	5,500	42.19	232,045.00	
CDK GLOBAL INC	2,600	64.19	166,894.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,539	98.95	251,234.05	
CITRIX SYSTEMS INC	3,098	106.74	330,680.52	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,800	75.86	895,148.00	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,372	73.66	322,041.52	
DXC TECHNOLOGY CO	5,471	102.58	561,215.18	
EBAY INC	20,736	38.39	796,055.04	
ELECTRONIC ARTS INC	6,012	132.53	796,770.36	
FACEBOOK INC-A	47,600	186.64	8,884,064.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	6,627	104.70	693,846.90	
FIRST DATA CORP- CLASS A	9,600	19.65	188,640.00	
FISERV INC	8,484	72.42	614,411.28	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,800	202.30	364,140.00	
FORTINET INC	2,900	59.55	172,695.00	
GARTNER INC	1,700	134.80	229,160.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,900	114.90	333,210.00	
IAC/INTERACTIVECORP	1,400	143.71	201,194.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	17,705	144.30	2,554,831.50	
INTUIT INC	4,716	192.59	908,254.44	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,500	122.24	183,360.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	2,700	62.30	168,210.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	18,900	192.12	3,631,068.00	
MERCADOLIBRE INC	900	298.58	268,722.00	
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	4,431	17.18	76,124.58	

MICROSOFT CORP	146,156	98.03	14,327,672.68
ORACLE CORPORATION	61,856	46.82	2,896,097.92
PAYCHEX INC	6,457	63.53	410,213.21
PAYPAL HOLDINGS INC	22,436	78.81	1,768,181.16
RED HAT INC	3,500	164.75	576,625.00
SABRE CORP	3,500	23.60	82,600.00
SALESFORCE.COM INC	13,700	127.69	1,749,353.00
SERVICENOW INC	3,500	173.73	608,055.00
SPLUNK INC	2,900	112.10	325,090.00
SQUARE INC - A	4,800	54.28	260,544.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,300	48.42	208,206.00
SYMANTEC CORP	12,200	21.40	261,080.00
SYNOPSYS INC	2,900	89.89	260,681.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,000	114.40	228,800.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,458	86.69	299,774.02
TWITTER INC	12,500	33.39	417,375.00
VERISIGN INC	1,926	126.65	243,927.90
VISA INC-CLASS A SHARES	36,240	131.21	4,755,050.40
VMWARE INC-CLASS A	1,400	141.25	197,750.00
WESTERN UNION CO	9,260	19.75	182,885.00
WORKDAY INC-CLASS A	2,700	133.96	361,692.00
WORLDPAY INC-CLASS A	3,700	80.94	299,478.00
ZILLOW GROUP INC - C	1,800	54.65	98,370.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,000	88.19	529,140.00
APPLE INC	102,390	188.15	19,264,678.50
ARISTA NETWORKS INC	900	253.52	228,168.00
ARROW ELECTRONICS INC	1,800	75.66	136,188.00
AVNET INC	2,400	40.45	97,080.00
CDW CORP/DE	2,900	78.35	227,215.00
CISCO SYSTEMS INC	98,039	45.70	4,480,382.30
COGNEX CORP	3,200	49.21	157,472.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	3,700	29.31	108,447.00
CORNING INC	18,360	28.07	515,365.20
CUMMINS INC	3,200	144.87	463,584.00
F5 NETWORKS INC	1,300	172.59	224,367.00
FLEX LTD	10,362	14.69	152,217.78
FLIR SYSTEMS INC	2,500	55.25	138,125.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,267	17.59	567,576.53
HP INC	34,267	22.57	773,406.19



IPG PHOTONICS CORP	700	252.98	177,086.00
JUNIPER NETWORKS INC	7,000	26.75	187,250.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,295	107.38	353,817.10
NETAPP INC	5,498	70.74	388,928.52
PALO ALTO NETWORKS INC	1,700	200.10	340,170.00
SEAGATE TECHNOLOGY	5,700	57.07	325,299.00
TE CONNECTIVITY LTD	7,087	95.05	673,619.35
TRIMBLE INCORPORATED	5,100	34.93	178,143.00
WESTERN DIGITAL CORP	5,974	81.12	484,610.88
XEROX CORP	4,199	28.87	121,225.13
AT&T INC	122,530	32.19	3,944,240.70
CENTURYLINK INC	18,774	19.24	361,211.76
SPRINT CORP	13,834	5.14	71,106.76
T-MOBILE US INC	5,650	56.46	318,999.00
VERIZON COMMUNICATIONS	82,325	48.49	3,991,939.25
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,500	33.69	117,915.00
AES CORPORATION	12,900	12.35	159,315.00
ALLIANT ENERGY CORP	4,600	41.41	190,486.00
AMEREN CORPORATION	4,872	56.59	275,706.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	9,477	67.11	636,001.47
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,600	82.67	297,612.00
ATMOS ENERGY CORP	2,000	87.46	174,920.00
CENTRPOINT ENERGY INC	8,100	26.49	214,569.00
CMS ENERGY CORP	5,400	45.25	244,350.00
CONSOLIDATED EDISON INC	6,138	76.63	470,354.94
DOMINION ENERGY INC	12,926	64.23	830,236.98
DTE ENERGY COMPANY	3,627	102.29	371,005.83
DUKE ENERGY CORP	14,059	77.83	1,094,211.97
EDISON INTERNATIONAL	6,279	62.33	391,370.07
ENTERGY CORP	3,519	78.55	276,417.45
EVERSOURCE ENERGY	6,436	57.53	370,263.08
EXELON CORPORATION	19,331	40.34	779,812.54
FIRSTENERGY CORP	8,493	33.75	286,638.75
NEXTERA ENERGY INC	9,344	160.20	1,496,908.80
NISOURCE INC	6,800	24.85	168,980.00
OGE ENERGY CORP	4,200	33.99	142,758.00
P G & E CORPORATION	9,809	43.23	424,043.07
PINNACLE WEST CAPITAL	2,200	78.08	171,776.00
PPL CORPORATION	13,428	27.65	371,284.20

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9,766	50.89	496,991.74	
	SCANA CORP	2,700	34.94	94,338.00	
	SEMPRA ENERGY	4,665	106.51	496,869.15	
	SOUTHERN CO	20,123	44.55	896,479.65	
	UGI CORP	3,600	49.99	179,964.00	
	VISTRA ENERGY CORP	7,200	23.10	166,320.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	6,117	61.82	378,152.94	
	WESTAR ENERGY INC	3,000	54.19	162,570.00	
	XCEL ENERGY INC	10,200	45.01	459,102.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	14,900	12.23	182,227.00	
	ANALOG DEVICES	7,196	93.87	675,488.52	
	APPLIED MATERIALS INC	20,952	55.26	1,157,807.52	
	BROADCOM INC	8,177	244.76	2,001,402.52	
	INTEL CORP	93,357	54.90	5,125,299.30	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,070	112.73	346,081.10	
	LAM RESEARCH CORP	3,200	204.03	652,896.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,200	21.93	201,756.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,700	58.41	332,937.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,700	93.46	439,262.00	
	MICRON TECHNOLOGY	22,827	53.00	1,209,831.00	
	NVIDIA CORP	12,000	255.36	3,064,320.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,565	110.74	727,008.10	
	QORVO INC	2,425	81.67	198,049.75	
	QUALCOMM INC	28,736	56.74	1,630,480.64	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,600	99.02	356,472.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	19,509	110.64	2,158,475.76	
	XILINX INC	5,026	71.44	359,057.44	
小計	銘柄数：643			489,166,883.83	
				(53,681,173,831)	
	組入時価比率：62.5%			65.8%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	2,900	25.55	74,095.00	
	ARC RESOURCES LTD	6,839	13.48	92,189.72	
	CAMECO CORP	7,406	14.80	109,608.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	21,264	47.02	999,833.28	
	CENOVUS ENERGY INC	21,366	13.98	298,696.68	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,800	10.79	116,532.00	
	ENBRIDGE INC	19,368	42.57	824,495.76	
	ENCANA CORP	18,966	16.92	320,904.72	
	HUSKY ENERGY INC	7,031	19.15	134,643.65	

IMPERIAL OIL LTD	5,812	42.27	245,673.24
INTER PIPELINE LTD	7,000	23.95	167,650.00
KEYERA CORP	3,500	36.25	126,875.00
PEMBINA PIPELINE CORP	10,269	44.67	458,716.23
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	3,957	26.97	106,720.29
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	4,700	16.74	78,678.00
SUNCOR ENERGY INC	33,159	52.70	1,747,479.30
TOURMALINE OIL CORP	4,000	23.94	95,760.00
TRANSCANADA CORPORATION	17,243	56.08	966,987.44
VERMILION ENERGY INC	2,200	44.17	97,174.00
AGNCIO EAGLE MINES LTD	4,200	57.39	241,038.00
BARRICK GOLD CORP	23,204	17.25	400,269.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,000	62.82	188,460.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	13,467	20.82	280,382.94
FRANCO-NEVADA CORP	3,800	93.00	353,400.00
GOLDCORP INC	16,042	17.64	282,980.88
KINROSS GOLD CORP	27,869	4.78	133,213.82
LUNDIN MINING CORP	14,700	8.71	128,037.00
METHANEX CORP	1,900	89.30	169,670.00
NUTRIEN LTD	12,471	64.70	806,873.70
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,175	36.34	406,099.50
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	22,130	3.78	83,651.40
WEST FRASER TIMBER CO.LTD.	1,600	89.84	143,744.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	8,200	27.96	229,272.00
BOMBARDIER INC 'B'	45,050	4.19	188,759.50
CAE INC	4,706	24.62	115,861.72
FINNING INTERNATIONAL INC	3,100	33.95	105,245.00
SNC-LAVALIN GROUP	3,100	56.46	175,026.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,040	101.95	1,533,328.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,928	239.08	700,026.24
LINAMAR CORP	1,200	75.00	90,000.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,760	83.74	649,822.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,000	36.81	147,240.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIO	4,427	73.08	323,525.16
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,586	26.17	224,695.62
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,305	165.59	216,094.95
DOLLARAMA INC	2,200	148.11	325,842.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,800	54.10	476,080.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,600	24.61	88,596.00

LOBLAW COMPANIES LTD	4,525	66.18	299,464.50	
METRO INC	4,600	41.47	190,762.00	
THE JEAN COUTU GROUP (PJC) INC	2,300	24.50	56,350.00	
WESTON (GEORGE) LTD	927	104.86	97,205.22	
SAPUTO INC	5,000	42.98	214,900.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	6,724	26.63	179,060.12	
BANK OF MONTREAL	12,853	101.14	1,299,952.42	
BANK OF NOVA SCOTIA	24,092	80.48	1,938,924.16	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,500	116.20	987,700.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	6,716	63.51	426,533.16	
ROYAL BANK OF CANADA	28,886	100.99	2,917,197.14	
TORONTO-DOMINION BANK	36,772	75.08	2,760,841.76	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,607	52.30	920,846.10	
CI FINANCIAL CORP	5,196	24.99	129,848.04	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	8,600	5.11	43,946.00	
IGM FINANCIAL INC	2,146	39.04	83,779.84	
ONEX CORPORATION	1,506	92.15	138,777.90	
THOMSON REUTERS CORP	6,686	49.15	328,616.90	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	600	711.71	427,026.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	5,718	33.30	190,409.40	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,800	52.45	94,410.00	
INTACT FINANCIAL CORP	2,500	95.69	239,225.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	39,942	24.80	990,561.60	
POWER CORP OF CANADA	7,630	29.76	227,068.80	
POWER FINANCIAL CORP	5,066	32.11	162,669.26	
SUN LIFE FINANCIAL INC	12,213	55.07	672,569.91	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2,800	20.67	57,876.00	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,600	20.59	53,534.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	23.70	78,210.00	
SMARTCENTRES REIT VAR VT UN	1,700	28.27	48,059.00	
BLACKBERRY LTD	10,600	14.87	157,622.00	
CGI GROUP INC	5,318	77.00	409,486.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	400	972.89	389,156.00	
OPEN TEXT CORP	4,800	44.35	212,880.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,700	182.30	309,910.00	
BCE INC	2,682	54.00	144,828.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	7,164	61.73	442,233.72	
TELUS CORP	4,138	45.62	188,775.56	
ATCO LTD -CLASS I	1,400	38.73	54,222.00	

小計	CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	31.58	78,950.00	
	EMERA INC	1,300	40.24	52,312.00	
	FORTIS INC	8,600	42.23	363,178.00	
	HYDRO ONE LTD	6,200	19.28	119,536.00	
	銘柄数：91 組入時価比率：3.5%			35,449,361.45 (3,039,782,744) 3.7%	
ユ-口	ENAGAS	4,673	24.65	115,189.45	
	ENI SPA	51,141	16.67	852,827.31	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,497	17.18	180,338.46	
	NESTE OYJ	2,299	67.44	155,044.56	
	OMV AG	3,001	54.56	163,734.56	
	REPSOL SA	25,429	16.67	423,901.43	
	SNAM SPA	45,945	3.90	179,185.50	
	TECHNIPFMC PLC	4,304	26.80	115,347.20	
	TENARIS SA	9,799	16.24	159,184.75	
	TOTAL SA	47,761	53.70	2,564,765.70	
	VOPAK	1,270	41.35	52,514.50	
	AIR LIQUIDE	8,602	107.90	928,155.80	
	AKZO NOBEL	4,816	74.64	359,466.24	
	ARCELORMITTAL	13,552	30.47	412,997.20	
	ARKEMA	1,321	109.30	144,385.30	
	BASF SE	18,301	86.76	1,587,794.76	
	COVESTRO AG	3,330	78.74	262,204.20	
	CRH PLC	16,972	30.31	514,421.32	
	ENSO OY-R SHS	10,794	17.15	185,171.07	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,100	31.27	96,937.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,252	45.12	56,490.24	
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,951	79.38	234,250.38	
	IMERYS	847	74.35	62,974.45	
	K+S AG	3,605	25.24	90,990.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,674	85.72	314,935.28	
	LANXESS	1,926	69.28	133,433.28	
	LINDE AG - TENDER	3,742	193.15	722,767.30	
	SOLVAY SA	1,454	115.05	167,282.70	
	SYMRIS AG	2,280	71.28	162,518.40	
	THYSSENKRUPP AG	8,998	23.22	208,933.56	
UMICORE	4,394	47.79	209,989.26		
UPM-KYMMENE OYJ	10,567	31.03	327,894.01		

VOESTALPINE AG	2,387	46.80	111,711.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,967	36.80	182,785.60
AIRBUS SE	11,611	97.08	1,127,195.88
ALSTOM	3,054	38.57	117,792.78
ANDRITZ AG	1,550	43.98	68,169.00
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,055	23.88	49,073.40
BOUYGUES SA	4,227	42.53	179,774.31
BRENTAG AG	2,876	49.58	142,592.08
CNH INDUSTRIAL NV	20,044	10.43	209,058.92
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,977	44.81	447,069.37
DASSAULT AVIATION SA	38	1,680.00	63,840.00
EIFFAGE	1,265	100.45	127,069.25
FERROVIAL SA	10,312	17.64	181,903.68
GEA GROUP AG	3,672	32.65	119,890.80
HOCHTIEF AG	478	150.30	71,843.40
KION GROUP AG	1,466	72.26	105,933.16
KONE OYJ	6,697	41.39	277,188.83
LEGRAND SA	5,375	66.18	355,717.50
LEONARDO SPA	8,588	9.43	80,984.84
MAN SE	739	97.15	71,793.85
METSO OYJ	1,982	30.46	60,371.72
MTU AERO ENGINES AG	1,102	151.30	166,732.60
OSRAM LICHT AG	1,730	50.48	87,330.40
PRYSMIAN SPA	3,502	26.19	91,717.38
REXEL SA	5,843	12.98	75,842.14
SAFRAN SA	6,730	98.86	665,327.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,374	75.26	856,007.24
SIEMENS AG	15,237	115.48	1,759,568.76
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	5,095	13.94	71,024.30
THALES SA	1,986	110.85	220,148.10
VINCI SA	10,194	85.78	874,441.32
WARTSILA OYJ	8,148	17.91	145,971.42
BIC	608	85.00	51,680.00
BUREAU VERITAS SA	5,558	21.59	119,997.22
EDENRED	4,148	27.63	114,609.24
RANDSTAD NV	2,180	53.18	115,932.40
RELX NV	19,788	17.89	354,106.26
TELEPERFORMANCE	1,232	135.30	166,689.60
WOLTERS KLUWER	6,187	46.53	287,881.11

ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,206	18.28	259,756.71	
ADP	525	186.30	97,807.50	
AENA SME SA	1,262	179.05	225,961.10	
ATLANTIA SPA	8,442	28.24	238,402.08	
BOLLORE	18,379	4.46	82,080.61	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	4,712	25.23	118,883.76	
DEUTSCHE POST AG	19,538	34.39	671,911.82	
FRAPORT AG	978	82.66	80,841.48	
GETLINK SE	10,135	11.83	119,947.72	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	17,049	7.86	134,073.33	
RYANAIR HOLDINGS PLC	3,667	15.44	56,618.48	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,677	92.16	615,352.32	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,095	80.90	88,585.50	
CONTINENTAL AG	2,196	222.80	489,268.80	
DAIMLER AG	19,212	66.66	1,280,671.92	
FAURECIA	1,684	70.70	119,058.80	
FERRARI NV	2,395	113.70	272,311.50	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	21,439	18.99	407,126.61	
MICHELIN (CGDE)-B	3,490	118.50	413,565.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,044	32.45	66,327.80	
PEUGEOT SA	12,179	20.06	244,310.74	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	3,107	69.80	216,868.60	
RENAULT SA	3,887	88.67	344,660.29	
SCHAEFFLER AG	3,812	13.41	51,118.92	
VALEO SA	4,728	57.38	271,292.64	
VOLKSWAGEN AG	621	169.00	104,949.00	
VOLKSWAGEN AG PFD	3,740	171.34	640,811.60	
ADIDAS AG	3,786	189.10	715,932.60	
HERMES INTERNATIONAL	672	586.80	394,329.60	
HUGO BOSS AG-ORD	1,378	74.70	102,936.60	
KERING	1,527	458.60	700,282.20	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,163	52.78	166,943.14	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,563	294.75	1,639,694.25	
PUMA SE	127	417.00	52,959.00	
SEB SA	383	160.30	61,394.90	
ACCOR SA	3,320	46.83	155,475.60	
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,658	90.00	149,220.00	
SODEXO	1,818	83.30	151,439.40	
ALTICE NV -A-W/I	9,678	7.86	76,069.08	

AXEL SPRINGER SE	697	66.25	46,176.25
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,737	18.42	68,854.22
JC DECAUX SA	1,735	29.36	50,939.60
LAGARDERE S C A	2,596	23.23	60,305.08
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,637	29.72	137,811.64
PUBLICIS GROUPE	4,295	61.32	263,369.40
RTL GROUP	830	70.90	58,847.00
SES	7,131	13.73	97,908.63
TELENET GROUP HOLDING NV	895	49.42	44,230.90
VIVENDI SA	20,526	23.43	480,924.18
INDITEX	21,074	26.87	566,258.38
ZALANDO SE	2,325	44.12	102,579.00
CARREFOUR SA	11,246	16.31	183,422.26
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,151	40.70	46,845.70
COLRUYT SA	1,154	47.39	54,688.06
JERONIMO MARTINS	4,401	13.82	60,821.82
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	24,646	19.73	486,462.74
METRO AG	3,399	11.72	39,836.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,268	80.06	1,222,356.08
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	3,995	32.20	128,639.00
DANONE	12,018	64.78	778,526.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	13,234	6.31	83,572.71
HEINEKEN HOLDING NV	2,380	84.70	201,586.00
HEINEKEN NV	5,228	87.48	457,345.44
KERRY GROUP PLC-A	3,234	89.85	290,574.90
PERNOD-RICARD SA	4,241	139.05	589,711.05
REMY COINTREAU	349	117.40	40,972.60
BEIERSDORF AG	1,876	97.20	182,347.20
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,556	105.00	373,380.00
HENKEL AG + CO KGAA	2,050	98.65	202,232.50
L OREAL	5,058	201.70	1,020,198.60
UNILEVER NV-CVA	32,491	47.57	1,545,759.32
BIOMERIEUX	989	68.50	67,746.50
ESSILOR INTERNATIONAL	4,139	114.95	475,778.05
FRESENIUS MEDICAL CARE	4,102	85.46	350,556.92
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,397	67.10	563,438.70
KONINKLIJKE PHILIPS NV	18,727	35.23	659,845.84
SIEMENS HEALTHINEERS AG	2,965	33.96	100,691.40
BAYER AG	16,475	102.56	1,689,676.00



EUROFINS SCIENTIFIC	210	448.00	94,080.00	
GRIFOLS SA	5,658	25.34	143,373.72	
IPSEN	815	129.90	105,868.50	
MERCK KGAA	2,622	85.16	223,289.52	
ORION OYJ	2,156	25.81	55,646.36	
QIAGEN N.V.	4,152	29.58	122,816.16	
RECORDATI SPA	2,290	30.84	70,623.60	
SANOFI	22,562	64.40	1,452,992.80	
UCB SA	2,532	64.20	162,554.40	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,713	24.77	215,821.01	
AIB GROUP PLC	18,322	5.05	92,526.10	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	133,972	6.83	915,430.67	
BANCO DE SABADELL SA	106,555	1.73	184,606.53	
BANCO ESPRITO SANTO-REG	34,679	0.12	4,161.48	
BANCO SANTANDER SA	321,230	5.50	1,768,692.38	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,770	7.45	139,836.50	
BANKIA SA	27,345	3.72	101,750.74	
BANKINTER SA	12,257	9.14	112,127.03	
BNP PARIBAS	22,082	62.88	1,388,516.16	
CAIXABANK S.A	71,706	4.31	309,411.39	
COMMERZBANK AG	21,811	10.60	231,196.60	
CREDIT AGRICOLE	22,297	13.41	299,002.77	
ERSTE GROUP BANK AG	5,981	38.66	231,225.46	
ING GROEP NV-CVA	77,655	13.51	1,049,429.67	
INTESA SANPAOLO	268,837	3.15	846,836.55	
INTESA SANPAOLO-RNC	17,943	3.29	59,032.47	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	9,736	0.21	2,112.71	
KBC GROEP NV	5,077	71.14	361,177.78	
MEDIOBANCA SPA	10,646	10.03	106,779.38	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	3,201	28.78	92,124.78	
SOCIETE GENERAL-A	15,449	42.73	660,213.01	
UNICREDIT SPA	39,782	17.79	707,721.78	
AMUNDI SA	1,351	71.02	95,948.02	
DEUTSCHE BANK AG -REG	41,391	11.44	473,844.16	
DEUTSCHE BOERSE AG	3,910	115.40	451,214.00	
EURAZEO	1,081	69.20	74,805.20	
EXOR NV	1,939	64.66	125,375.74	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,538	92.18	141,772.84	
NATIXIS	18,867	6.87	129,654.02	

WENDEL	576	126.20	72,691.20	
AEGON NV	38,167	5.81	221,750.27	
AGEAS	3,810	44.45	169,354.50	
ALLIANZ SE-REG	8,879	190.30	1,689,673.70	
ASSICURAZIONI GENERALI	25,331	16.56	419,481.36	
AXA	38,989	22.56	879,786.78	
CNP ASSURANCES	3,610	20.76	74,943.60	
HANNOVER RUECK SE	1,105	112.50	124,312.50	
MAPFRE SA	24,819	2.89	71,875.82	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,104	191.45	594,260.80	
NN GROUP NV	6,520	38.71	252,389.20	
POSTE ITALIANE SPA	11,616	8.15	94,716.86	
SAMPO OYJ-A SHS	8,918	44.17	393,908.06	
SCOR SE	3,230	33.07	106,816.10	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	20,200	2.18	44,076.40	
BGP HOLDINGS PLC	293,880	0.00	0.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,121	40.04	285,124.84	
FONCIERE DES REGIONS	648	96.30	62,402.40	
GECINA SA	968	144.90	140,263.20	
ICADE	777	80.10	62,237.70	
KLEPIERRE	4,095	34.26	140,294.70	
UNIBAIL-RODAMCO SE	1,906	196.00	373,576.00	
VONOVIA SE	9,913	39.40	390,572.20	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	8,860	63.80	565,268.00	
ATOS SE	1,902	111.40	211,882.80	
CAPGEMINI	3,272	115.95	379,388.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	2,408	110.10	265,120.80	
SAP SE	19,578	96.20	1,883,403.60	
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,418	86.76	123,025.68	
UNITEDINTERNET AG-REG SHARE	2,578	56.08	144,574.24	
WIRECARD AG	2,439	122.80	299,509.20	
INGENICO GROUP	1,177	73.70	86,744.90	
NOKIA OYJ	112,385	5.29	594,741.42	
1 AND 1 DRILLISCH AG	1,236	62.20	76,879.20	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	66,203	14.28	945,709.85	
ELISA OYJ	2,977	37.16	110,625.32	
ILIAD SA	498	165.50	82,419.00	
KONINKLIJKE KPN NV	67,714	2.50	169,758.99	
ORANGE S.A.	38,443	15.01	577,029.43	

	PROXIMUS	3,331	23.95	79,777.45
	TELECOM ITALIA SPA	235,511	0.80	189,209.53
	TELECOM ITALIA-RNC	130,726	0.70	91,508.20
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,690	4.03	51,204.15
	TELEFONICA SA	93,994	8.23	774,416.56
	E.ON SE	43,788	9.27	406,002.33
	ELECTRICITE DE FRANCE	11,657	12.24	142,681.68
	ENDESA SA	5,847	19.61	114,659.67
	ENEL SPA	160,934	5.10	822,050.87
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	46,642	3.40	158,582.80
	ENGIE	36,673	14.69	538,726.37
	FORTUM OYJ	8,308	20.16	167,489.28
	GAS NATURAL SDG-E	6,588	21.85	143,947.80
	IBERDROLA SA	119,977	6.52	783,209.85
	INNOGY SE	2,894	36.27	104,965.38
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,680	17.29	150,077.20
	RWE AG	9,558	19.85	189,726.30
	SUEZ	6,252	11.90	74,398.80
	TERNA SPA	28,742	4.91	141,209.44
	UNIPER SE	4,449	27.06	120,389.94
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,367	19.73	184,810.91
	ASML HOLDING NV	7,698	169.25	1,302,886.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,976	24.13	554,410.88
	STMICROELECTRONS NV	12,525	20.37	255,134.25
小計	銘柄数：251			83,002,906.77 (10,873,380,786)
	組入時価比率：12.7%			13.3%
ボンド	BP PLC	393,502	5.70	2,244,928.91
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	90,212	26.61	2,400,541.32
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	74,534	27.39	2,041,486.26
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,250	6.58	87,291.00
	ANGLO AMERICAN PLC	27,974	18.40	514,945.39
	ANTOFAGASTA PLC	8,267	10.48	86,638.16
	BHP BILLITON PLC	42,497	17.21	731,373.37
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,747	45.92	126,142.24
	FRESNILLO PLC	4,105	12.86	52,810.82
	GLENCORE PLC	244,573	3.85	942,095.19
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,577	34.43	123,156.11
	MONDI PLC	7,704	19.79	152,500.68

RANDGOLD RESOURCES LTD	1,720	59.08	101,617.60
RIO TINTO PLC - REG	23,956	42.41	1,015,973.96
ASHTED GROUP PLC	9,877	22.39	221,146.03
BAE SYSTEMS PLC	63,429	6.31	400,363.84
BUNZL PLC	6,247	22.31	139,370.57
COBHAM PLC	50,764	1.17	59,596.93
DCC PLC	1,895	72.20	136,819.00
FERGUSON PLC	4,800	56.50	271,200.00
IMI PLC	5,551	10.99	61,005.49
MEGGITT PLC	16,271	4.83	78,654.01
MELROSE INDUSTRIES PLC	94,283	2.31	218,359.42
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	34,976	8.25	288,761.85
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	2,483,296	0.00	2,483.29
SMITHS GROUP PLC	7,921	16.55	131,092.55
TRAVIS PERKINS PLC	4,953	13.01	64,463.29
WEIR GROUP PLC/THE	4,029	22.58	90,974.82
BABCOCK INTL GROUP PLC	4,339	7.55	32,759.45
EXPERIAN PLC	19,082	17.15	327,256.30
G4S PLC	31,744	2.62	83,454.97
INTERTEK GROUP PLC	3,254	50.56	164,522.24
RELX PLC	21,722	15.81	343,424.82
EASYJET PLC	2,823	16.85	47,567.55
ROYAL MAIL PLC	17,445	6.13	107,077.41
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,737	5.53	114,717.08
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,325	41.37	96,185.25
BURBERRY GROUP PLC	9,073	18.06	163,903.74
PERSIMMON PLC	6,182	27.66	170,994.12
TAYLOR WIMPEY PLC	67,800	1.95	132,277.80
NEW WHITBREAD PLC	3,686	42.07	155,070.02
CARNIVAL PLC	3,719	48.75	181,301.25
COMPASS GROUP PLC	30,433	15.25	464,255.41
GVC HOLDINGS PLC	10,739	9.40	100,946.60
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	3,519	47.27	166,343.13
MERLIN ENTERTAINME	15,043	3.73	56,140.47
TUI AG-DI	10,569	17.65	186,595.69
ITV PLC	67,620	1.68	113,669.22
PEARSON PLC	16,588	9.09	150,884.44
SKY PLC	20,929	13.57	284,006.53
WPP PLC	24,717	12.97	320,703.07

KINGFISHER PLC	46,566	2.91	135,693.32
MARKS & SPENCER PLC	29,916	2.89	86,636.73
NEXT PLC	2,745	56.02	153,774.90
MORRISON (WM)SUPERMAKETS	40,547	2.51	101,935.15
SAINSBURY (J) PLC	29,462	3.04	89,741.25
TESCO PLC	197,361	2.45	485,113.33
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,223	27.35	197,549.05
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	37,024	38.11	1,410,984.64
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,416	25.71	87,825.36
DIAGEO PLC	49,973	26.63	1,330,780.99
IMPERIAL BRANDS PLC	18,546	27.65	512,796.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,106	57.75	756,871.50
UNILEVER PLC	24,874	41.37	1,029,161.75
CONVATEC GROUP PLC	25,296	2.31	58,661.42
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	8,511	7.04	59,968.50
SMITH & NEPHEW PLC	18,115	13.06	236,581.90
ASTRAZENECA PLC	25,255	52.95	1,337,252.25
GLAXOSMITHKLINE PLC	96,842	14.76	1,429,775.28
SHIRE PLC	18,263	41.37	755,540.31
BARCLAYS PLC	342,558	2.11	725,880.40
HSBC HOLDINGS PLC	399,348	7.33	2,927,220.84
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,443,546	0.66	962,412.11
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	66,117	2.93	193,722.81
STANDARD CHARTERED PLC	66,516	7.61	506,718.88
3I GROUP PLC	20,126	9.73	195,825.98
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,861	18.75	109,893.75
INVESTEC PLC	13,643	5.74	78,338.10
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	6,372	44.17	281,451.24
SCHRODERS PLC	2,720	34.11	92,779.20
ST JAMES'S PLACE PLC	11,204	11.74	131,590.98
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	50,720	3.68	187,055.36
ADMIRAL GROUP PLC	4,144	19.30	79,979.20
AVIVA PLC	77,936	5.38	419,295.68
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	25,118	3.63	91,203.45
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	118,567	2.77	329,379.12
OLD MUTUAL PLC	99,338	2.56	254,503.95
PRUDENTIAL PLC	51,707	19.06	985,535.42
RSA INSURANCE GROUP PLC	19,922	6.48	129,253.93
BRITISH LAND COMPANY PLC	19,730	6.90	136,215.92

	HAMMERSON PLC	14,884	5.59	83,201.56	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	13,918	9.68	134,823.66	
	SEGRO PLC	19,279	6.49	125,236.38	
	AUTO TRADER GROUP PLC	21,805	3.79	82,728.17	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	3,764	12.78	48,103.92	
	SAGE GROUP PLC (THE)	22,144	6.68	148,010.49	
	WORLDPAY INC-CLASS A	2,342	59.85	140,168.70	
	BT GROUP PLC	163,100	2.11	345,445.80	
	VODAFONE GROUP PLC	532,707	2.07	1,103,768.90	
	NEW SEVERN TRENT PLC	4,591	19.71	90,488.61	
	CENTRICA PLC	104,016	1.49	155,139.86	
	NATIONAL GRID PLC	66,790	8.50	567,915.37	
	SSE PLC	20,088	14.12	283,642.56	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,662	7.63	104,323.03	
小計	銘柄数 : 104			39,237,746.52	
				(5,842,500,456)	
	組入時価比率 : 6.8%			7.2%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	5,084	24.47	124,405.48	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	179	635.50	113,754.50	
	GIVAUDAN-REG	187	2,267.00	423,929.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,097	52.52	477,774.44	
	SIKA FINANZ AG-BEARER	40	8,250.00	330,000.00	
	ABB LTD	36,723	23.88	876,945.24	
	GEBERIT AG-REG	704	444.80	313,139.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	413	206.60	85,325.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	750	213.40	160,050.00	
	ADECCO GROUP AG(REG)	3,057	64.08	195,892.56	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	108	2,509.00	270,972.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,036	153.60	159,129.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-RE	10,494	97.76	1,025,893.44	
	THE SWATCH GROUP AG-B	627	482.60	302,590.20	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,059	89.45	94,727.55	
	DUFREY AG-REG	892	147.75	131,793.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	36	1,809.00	65,124.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	21	6,400.00	134,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	75,700.00	151,400.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	61,733	77.30	4,771,960.90	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,023	165.10	168,897.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	204	686.50	140,046.00	

	LONZA AG-REG	1,504	266.30	400,515.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	44,162	78.22	3,454,351.64	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	13,956	224.80	3,137,308.80	
	VIFOR PHARMA AG	860	160.50	138,030.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	48,094	16.92	813,750.48	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,462	62.88	280,570.56	
	PARGESA HOLDING SA-BR	618	91.00	56,238.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	362	732.50	265,165.00	
	UBS GROUP AG	73,434	16.29	1,196,239.86	
	BALOISE HOLDING AG	974	154.50	150,483.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	646	358.50	231,591.00	
	SWISS RE AG	6,247	94.28	588,967.16	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,043	314.80	957,936.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,456	93.70	136,427.20	
	SWISSCOM AG-REG	488	458.20	223,601.60	
小計	銘柄数：37			22,549,326.11	
				(2,474,337,554)	
	組入時価比率：2.9%			3.0%	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,036	271.90	1,097,388.40	
	BOLIDEN AB	5,336	321.80	1,717,124.80	
	ALFA LAVAL AB	5,961	228.00	1,359,108.00	
	ASSA ABLOY AB-B	19,972	190.00	3,794,680.00	
	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	13,400	7.99	107,079.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,400	352.50	4,723,500.00	
	ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	7,768	7.99	62,081.85	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	7,768	321.10	2,494,304.80	
	SANDVIK AB	22,957	157.95	3,626,058.15	
	SKANSKA AB-B SHS	6,310	168.20	1,061,342.00	
	SKF AB-B SHARES	7,877	183.50	1,445,429.50	
	VOLVO AB-B SHS	30,709	156.50	4,805,958.50	
	SECURITAS AB-B SHS	6,874	138.30	950,674.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	4,382	226.80	993,837.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	6,990	85.08	594,709.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,262	139.26	2,543,166.12	
	ICA GRUPPEN AB	1,353	276.20	373,698.60	
	SWEDISH MATCH AB	3,438	416.00	1,430,208.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	11,598	232.50	2,696,535.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,119	85.00	350,115.00	

	NORDEA BANK AB	58,625	90.32	5,295,010.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	30,737	83.90	2,578,834.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	30,392	99.92	3,036,768.64	
	SWEDBANK AB-A SHARES	18,085	192.40	3,479,554.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,591	192.15	690,010.65	
	INVESTOR AB-B SHS	9,210	375.60	3,459,276.00	
	KINNEVIK AB-B	4,812	315.80	1,519,629.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,224	301.60	369,158.40	
	ERICSSON LM-B SHS	58,617	67.50	3,956,647.50	
	HEXAGON AB-B SHS	5,253	478.40	2,513,035.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,276	557.00	710,732.00	
	TELE2 AB -B SHS	7,717	114.30	882,053.10	
	TELIA COMPANY AB	52,719	43.28	2,281,678.32	
小計	銘柄数 : 33			66,999,386.83	
	組入時価比率 : 1.0%			(851,562,206)	
				1.0%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	22,391	216.80	4,854,368.80	
	NORSK HYDRO ASA	24,600	47.77	1,175,142.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,685	337.80	1,244,793.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,116	218.00	461,288.00	
	MARINE HARVEST	8,700	169.95	1,478,565.00	
	ORKLA ASA	15,899	74.06	1,177,479.94	
	DNB ASA	19,796	154.50	3,058,482.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,225	126.20	533,195.00	
	TELENOR ASA	15,221	170.80	2,599,746.80	
小計	銘柄数 : 9			16,583,060.54	
	組入時価比率 : 0.3%			(226,524,606)	
				0.3%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,788	581.80	1,040,258.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,275	312.40	1,335,510.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	4,391	437.40	1,920,623.40	
	ISS A/S	3,266	214.70	701,210.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	78	9,605.00	749,190.00	
	A.P.MOLLER MAERSK	129	10,205.00	1,316,445.00	
	DSV A/S	3,796	539.00	2,046,044.00	
	PANDORA A/S	2,204	664.20	1,463,896.80	
	CARLSBERG AS-B	2,128	711.60	1,514,284.80	
	COLOPLAST-B	2,205	601.60	1,326,528.00	



	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,275	234.00	532,350.00	
	GENMAB A/S	1,069	1,263.50	1,350,681.50	
	H LUNDBECK A/S	1,500	409.90	614,850.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	37,127	313.55	11,641,170.85	
	DANSKE BANK A/S	14,878	214.50	3,191,331.00	
	TRYG A/S	2,225	146.90	326,852.50	
	ORSTED A/S	3,969	402.70	1,598,316.30	
小計	銘柄数 : 17			32,669,542.75	
	組入時価比率 : 0.7%			(574,657,256)	
				0.7%	
オーストラリア アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	5,600	30.79	172,424.00	
	OIL SEARCH LTD	25,200	8.48	213,696.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	34,072	9.85	335,609.20	
	SANTOS LIMITED	39,255	6.25	245,343.75	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	19,146	33.97	650,389.62	
	ALUMINA LIMITED	44,109	2.83	124,828.47	
	AMCOR LIMITED	22,932	13.88	318,296.16	
	BHP BILLITON LTD	64,144	33.79	2,167,425.76	
	BLUESCOPE STEEL LTD	12,343	18.03	222,544.29	
	BORAL LIMITED	19,736	6.66	131,441.76	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	31,592	4.98	157,328.16	
	INCITEC PIVOT LTD	29,915	3.50	104,702.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	9,121	23.48	214,161.08	
	NEWCREST MINING LTD	14,369	22.01	316,261.69	
	ORICA LTD	7,027	18.28	128,453.56	
	RIO TINTO LIMITED	8,100	84.50	684,450.00	
	SOUTH32 LTD	106,395	4.01	426,643.95	
	CIMIC GROUP LTD	1,981	44.16	87,480.96	
	BRAMBLES LTD	31,468	9.88	310,903.84	
	SEEK LTD	5,659	20.80	117,707.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	37,911	4.41	167,187.51	
	SYDNEY AIRPORT	20,265	7.19	145,705.35	
	TRANSURBAN GROUP	42,015	11.92	500,818.80	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,488	28.68	300,795.84	
	CROWN RESORTS LTD	6,363	13.49	85,836.87	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,392	42.06	58,547.52	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	690	60.17	41,517.30	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	42,433	4.52	191,797.16	

HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	12,902	3.47	44,769.94
WESFARMERS LTD	22,870	44.36	1,014,513.20
WOOLWORTHS GROUP LTD	25,534	28.74	733,847.16
COCA-COLA AMATIL LIMITED	11,767	9.00	105,903.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	13,372	17.94	239,893.68
COCHLEAR LIMITED	1,225	196.36	240,541.00
HEALTHSCOPE LTD	34,746	2.58	89,644.68
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,698	65.58	176,934.84
SONIC HEALTHCARE LIMITED	7,795	23.81	185,598.95
CSL LIMITED	9,084	176.90	1,606,959.60
AUST&NZ BANKING GROUP LTD	58,757	27.63	1,623,455.91
BANK OF QUEENSLAND LTD	8,205	10.13	83,116.65
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	9,422	10.90	102,699.80
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	34,915	70.80	2,471,982.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	53,747	28.49	1,531,252.03
WESTPAC BANKING CORPORATION	67,195	30.02	2,017,193.90
AMP LIMITED	60,012	3.85	231,046.20
ASX LTD	3,775	61.85	233,483.75
CHALLENGER LTD	10,914	12.57	137,188.98
MACQUARIE GROUP LIMITED	6,441	111.75	719,781.75
INSURANSE AUSTRALIA GROUP LTD	47,902	8.30	397,586.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	53,115	3.03	160,938.45
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	27,727	10.31	285,865.37
SUNCORP GROUP LTD	25,477	14.06	358,206.62
DEXUS	19,048	9.67	184,194.16
GENERAL PROPERTY TRUST	34,873	4.92	171,575.16
GOODMAN GROUP	34,811	8.98	312,602.78
LENDLEASE GROUP	10,803	18.25	197,154.75
MIRVAC GROUP	72,458	2.27	164,479.66
SCENTRE GROUP	105,980	4.13	437,697.40
STOCKLAND	44,625	4.25	189,656.25
VICINITY CENTRES	65,627	2.58	169,317.66
WESTFIELD CORP	39,111	9.05	353,954.55
COMPUTERSHARE LIMITED	9,784	17.53	171,513.52
REA GROUP LTD	936	89.91	84,155.76
TELSTRA CORPORATION LTD	86,358	3.04	262,528.32
TPG TELECOM LTD	8,799	5.53	48,658.47
AGL ENERGY LTD	12,687	21.85	277,210.95
APA GROUP	21,714	8.44	183,266.16

小計	AUSNET SERVICES	45,140	1.71	77,415.10	
	銘柄数：68			26,700,083.01	
	組入時価比率：2.6%			(2,207,295,862)	2.7%
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	16,606	6.37	105,780.22	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	20,441	6.68	136,545.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	12,713	13.12	166,794.56	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,687	11.40	99,031.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	32,442	3.53	114,682.47	
	MERCURY NZ LTD	11,046	3.15	34,850.13	
	MERIDIAN ENERGY LTD	19,836	2.98	59,111.28	
	小計	銘柄数：7			716,796.34
	組入時価比率：0.1%			(54,419,178)	0.1%
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	52,275	93.20	4,872,030.00	
	NWS HOLDINGS LTD	33,500	14.94	500,490.00	
	MTR CORP	29,031	45.90	1,332,522.90	
	MINTH GROUP LTD	16,000	38.50	616,000.00	
	LI & FUNG LTD	117,200	4.36	510,992.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	26,500	49.90	1,322,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	15,000	22.90	343,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	46,000	69.80	3,210,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	23.15	463,000.00	
	SANDS CHINA LTD	47,600	47.35	2,253,860.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	22,378	14.98	335,222.44	
	SJM HOLDINGS LTD	40,000	9.18	367,200.00	
	WYNN MACAU LTD	30,000	29.90	897,000.00	
	WH GROUP LTD	157,000	8.23	1,292,110.00	
	BANK OF EAST ASIA	26,154	34.65	906,236.10	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	75,000	41.15	3,086,250.00	
	HANG SENG BANK	15,500	203.20	3,149,600.00	
	FIRST PACIFIC CO	42,250	3.99	168,577.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,700	265.60	6,294,720.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	94,000	4.02	377,880.00	
	AIA GROUP LTD	240,600	74.35	17,888,610.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	51,275	69.50	3,563,612.50	
HANG LUNG GROUP LTD	15,000	25.50	382,500.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	44,000	18.92	832,480.00		

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	22,777	51.95	1,183,265.15	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	11,221	45.90	515,043.90	
	KERRY PROPERTIES LTD	16,000	39.15	626,400.00	
	LINK REIT	42,500	68.65	2,917,625.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	118,525	12.02	1,424,670.50	
	SINO LAND CO	62,674	13.64	854,873.36	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	28,000	129.40	3,623,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD A	11,500	80.00	920,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	21,000	30.15	633,150.00	
	THE WHARF (HOLDINGS)	26,625	25.85	688,256.25	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	26,625	64.00	1,704,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	16,000	58.90	942,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	58,000	10.02	581,160.00	
	PCCW LTD	91,000	4.67	424,970.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	13,000	61.60	800,800.00	
	CLP HOLDINGS LIMITED	32,400	83.05	2,690,820.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	42,223	7.31	308,650.13	
	HONG KONG & CHINA GAS	169,813	17.18	2,917,387.34	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	28,000	56.70	1,587,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,700	106.60	714,220.00	
小計	銘柄数：44			81,026,035.07	
				(1,132,743,970)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP	29,400	8.24	242,256.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	22,160	3.10	68,696.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	28,000	3.44	96,320.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	31,000	1.17	36,270.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	48,000	2.34	112,320.00	
	SATS LTD	10,800	5.54	59,832.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	9,600	11.01	105,696.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	124,800	1.30	162,240.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	33,750	2.76	93,150.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	33.39	66,780.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	96,680	0.36	34,804.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	40,000	3.17	126,800.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,200	29.22	1,057,764.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	63,550	13.16	836,318.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	25,800	29.52	761,616.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	17,000	7.69	130,730.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	52,387	2.67	139,873.29	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	53,636	1.78	95,472.08	
	CAPITALAND LIMITED	53,000	3.63	192,390.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	43,000	2.10	90,300.00	
	CITY DEVELOPMENTS	8,000	12.40	99,200.00	
	SUNTEC REIT	42,000	1.88	78,960.00	
	UOL GROUP LIMITED	7,600	8.61	65,436.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	159,090	3.52	559,996.80	
	STARHUB LTD	11,000	2.14	23,540.00	
小計	銘柄数：25			5,336,760.97	
	組入時価比率：0.5%			(438,735,119)	0.5%
イスラエル シュケル	FRUTAROM	978	344.50	336,921.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	11,685	16.27	190,114.95	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	406.20	154,762.20	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	17,616	72.40	1,275,398.40	
	BANK HAPOALIM BM	21,329	26.00	554,554.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	28,417	22.40	636,540.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,797	67.56	188,965.32	
	AZRIELI GROUP	722	164.30	118,624.60	
	NICE LTD	1,245	361.40	449,943.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	46,036	4.10	188,793.63	
	小計	銘柄数：10			4,094,617.90
	組入時価比率：0.1%			(124,967,738)	0.2%
合計				81,522,081,306	(81,522,081,306)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、およ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

該当事項はありません。

## 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
ドル	株式 643銘柄	100.0%	65.8%
カナダドル	株式 91銘柄	100.0%	3.7%
ユーロ	株式 251銘柄	100.0%	13.3%
債券	株式 104銘柄	100.0%	7.2%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	株式 68銘柄	100.0%	2.7%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式 44銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式 25銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%	0.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日立外国債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)

	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	72,804,796	81,244,735
コール・ローン	25,210,330	35,234,982
国債証券	30,507,106,123	30,989,974,092
未収利息	242,080,507	263,645,729
前払費用	11,225,359	11,549,485
流動資産合計	30,858,427,115	31,381,649,023
資産合計	30,858,427,115	31,381,649,023
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	16,500,000	15,300,000
未払利息	69	96
流動負債合計	16,500,069	15,300,096
負債合計	16,500,069	15,300,096
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,486,326,210	14,518,481,580
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,355,600,836	16,847,867,347
元本等合計	30,841,927,046	31,366,348,927
純資産合計	30,841,927,046	31,366,348,927
負債純資産合計	30,858,427,115	31,381,649,023

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取利息</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,486,326,210口	14,518,481,580口
1口当たり純資産額	2.1290円	2.1604円
(1万口当たり純資産額)	(21,290円)	(21,604円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
2. 金融商品の内容及びリスク	<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、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替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>
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。</p> <p>また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。</p> <p>なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>



## 金融商品の時価に関する事項

項目	2018年5月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 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 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2017年5月15日現在	2018年5月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	24,105,209	381,436,737
合計	24,105,209	381,436,737

(注)当計算期間とは、当親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの計算期間末日までの期間としております。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	自 2016年5月17日 至 2017年5月15日	自 2017年5月16日 至 2018年5月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,162,835,626円	14,486,326,210円
期中追加設定元本額	1,153,628,391円	787,187,667円
期中一部解約元本額	830,137,807円	755,032,297円
期末元本額	14,486,326,210円	14,518,481,580円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	888,384,118円	979,726,414円
日立バランスファンド（株式50）	954,256,538円	975,391,167円
日立バランスファンド（株式30）	353,470,075円	362,048,493円
日立外国債券特化型ファンドU（為替ヘッジなし） （非課税適格機関投資家専用）	5,745,943,412円	5,611,160,008円
日立外国債券インデックスファンド	6,544,272,067円	6,590,155,498円

（注）\*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

(2018年5月15日現在)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	0.750% US TREASURY N/B	610,000.00	598,562.50	
		0.750% US TREASURY N/B	550,000.00	538,742.18	
		0.875% US TREASURY N/B	340,000.00	333,864.06	
		0.875% US TREASURY N/B	460,000.00	450,476.56	
		1.000% US TREASURY N/B	550,000.00	541,707.03	
		1.000% US TREASURY N/B	300,000.00	294,515.62	
		1.000% US TREASURY N/B	400,000.00	392,125.00	
		1.000% US TREASURY N/B	420,000.00	411,468.75	
		1.000% US TREASURY N/B	480,000.00	469,537.50	
		1.000% US TREASURY N/B	370,000.00	361,703.90	
		1.125% US TREASURY N/B	500,000.00	489,140.62	
		1.125% US TREASURY N/B	450,000.00	438,292.97	
		1.125% US TREASURY N/B	410,000.00	398,725.00	
		1.125% US TREASURY N/B	860,000.00	823,785.93	
		1.125% US TREASURY N/B	600,000.00	571,312.50	
		1.125% US TREASURY N/B	570,000.00	541,811.72	
		1.125% US TREASURY N/B	200,000.00	189,515.62	
		1.250% US TREASURY N/B	560,000.00	553,000.00	
		1.250% US TREASURY N/B	660,000.00	650,100.00	
		1.250% US TREASURY N/B	270,000.00	265,275.00	
		1.250% US TREASURY N/B	720,000.00	704,756.25	
		1.250% US TREASURY N/B	500,000.00	488,789.06	
		1.250% US TREASURY N/B	730,000.00	700,800.00	
		1.250% US TREASURY N/B	620,000.00	571,417.19	
1.375% US TREASURY N/B	700,000.00	691,523.44			
1.375% US TREASURY N/B	600,000.00	591,281.25			
1.375% US TREASURY N/B	460,000.00	451,985.93			

1.375% US TREASURY N/B	300,000.00	294,445.31	
1.375% US TREASURY N/B	420,000.00	412,026.56	
1.375% US TREASURY N/B	200,000.00	196,031.25	
1.375% US TREASURY N/B	530,000.00	519,151.56	
1.375% US TREASURY N/B	590,000.00	577,324.22	
1.375% US TREASURY N/B	620,000.00	605,856.25	
1.375% US TREASURY N/B	630,000.00	614,742.18	
1.375% US TREASURY N/B	700,000.00	680,476.56	
1.375% US TREASURY N/B	270,000.00	262,385.15	
1.375% US TREASURY N/B	660,000.00	640,818.75	
1.375% US TREASURY N/B	500,000.00	484,804.69	
1.375% US TREASURY N/B	620,000.00	598,832.81	
1.375% US TREASURY N/B	450,000.00	432,984.37	
1.375% US TREASURY N/B	210,000.00	201,764.06	
1.375% US TREASURY N/B	670,000.00	622,419.53	
1.375% US TREASURY N/B	700,000.00	648,429.69	
1.375% US TREASURY N/B	520,000.00	481,040.62	
1.500% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,153,638.28	
1.500% US TREASURY N/B	850,000.00	837,316.41	
1.500% US TREASURY N/B	380,000.00	372,014.06	
1.500% US TREASURY N/B	750,000.00	733,710.93	
1.500% US TREASURY N/B	500,000.00	488,945.31	
1.500% US TREASURY N/B	790,000.00	754,388.28	
1.500% US TREASURY N/B	720,000.00	676,631.25	
1.500% US TREASURY N/B	550,000.00	516,269.53	
1.500% US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,167,128.12	
1.625% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,061,139.06	
1.625% US TREASURY N/B	660,000.00	653,915.62	
1.625% US TREASURY N/B	550,000.00	544,328.12	
1.625% US TREASURY N/B	800,000.00	788,812.50	
1.625% US TREASURY N/B	780,000.00	764,339.06	
1.625% US TREASURY N/B	660,000.00	645,923.44	
1.625% US TREASURY N/B	760,000.00	741,890.62	

1.625% US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,081,556.25	
1.625% US TREASURY N/B	640,000.00	609,600.00	
1.625% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,272,057.81	
1.625% US TREASURY N/B	500,000.00	471,601.56	
1.625% US TREASURY N/B	400,000.00	376,843.75	
1.625% US TREASURY N/B	420,000.00	393,421.87	
1.625% US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,123,459.38	
1.625% US TREASURY N/B	1,100,000.00	993,179.69	
1.750% US TREASURY N/B	490,000.00	485,291.40	
1.750% US TREASURY N/B	620,000.00	606,582.81	
1.750% US TREASURY N/B	500,000.00	489,023.44	
1.750% US TREASURY N/B	650,000.00	634,816.40	
1.750% US TREASURY N/B	450,000.00	434,566.40	
1.750% US TREASURY N/B	730,000.00	702,739.06	
1.750% US TREASURY N/B	720,000.00	692,325.00	
1.750% US TREASURY N/B	660,000.00	634,012.50	
1.750% US TREASURY N/B	660,000.00	633,806.25	
1.750% US TREASURY N/B	750,000.00	719,824.22	
1.750% US TREASURY N/B	480,000.00	460,237.50	
1.750% US TREASURY N/B	610,000.00	582,931.25	
1.750% US TREASURY N/B	860,000.00	815,656.25	
1.875% US TREASURY N/B	260,000.00	256,120.31	
1.875% US TREASURY N/B	660,000.00	640,457.81	
1.875% US TREASURY N/B	630,000.00	609,328.12	
1.875% US TREASURY N/B	370,000.00	357,512.50	
1.875% US TREASURY N/B	400,000.00	386,093.75	
1.875% US TREASURY N/B	500,000.00	482,265.62	
1.875% US TREASURY N/B	580,000.00	557,887.50	
1.875% US TREASURY N/B	500,000.00	480,078.12	
1.875% US TREASURY N/B	500,000.00	469,921.87	
2.000% US TREASURY N/B	600,000.00	594,796.87	
2.000% US TREASURY N/B	630,000.00	621,682.03	
2.000% US TREASURY N/B	520,000.00	512,321.87	

2.000% US TREASURY N/B	600,000.00	590,156.25	
2.000% US TREASURY N/B	510,000.00	500,557.03	
2.000% US TREASURY N/B	670,000.00	655,971.87	
2.000% US TREASURY N/B	720,000.00	703,012.50	
2.000% US TREASURY N/B	720,000.00	701,775.00	
2.000% US TREASURY N/B	870,000.00	848,182.03	
2.000% US TREASURY N/B	780,000.00	758,306.25	
2.000% US TREASURY N/B	660,000.00	638,550.00	
2.000% US TREASURY N/B	510,000.00	492,309.37	
2.000% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,292,890.62	
2.000% US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,232,000.00	
2.000% US TREASURY N/B	550,000.00	522,500.00	
2.000% US TREASURY N/B	320,000.00	303,650.00	
2.000% US TREASURY N/B	380,000.00	360,257.81	
2.000% US TREASURY N/B	1,050,000.00	988,722.66	
2.000% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,133,429.68	
2.000% US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,026,576.56	
2.125% US TREASURY N/B	570,000.00	563,587.50	
2.125% US TREASURY N/B	610,000.00	601,088.28	
2.125% US TREASURY N/B	690,000.00	677,493.75	
2.125% US TREASURY N/B	980,000.00	961,165.62	
2.125% US TREASURY N/B	700,000.00	685,671.87	
2.125% US TREASURY N/B	490,000.00	479,013.28	
2.125% US TREASURY N/B	620,000.00	603,385.94	
2.125% US TREASURY N/B	740,000.00	717,106.25	
2.125% US TREASURY N/B	460,000.00	441,995.30	
2.125% US TREASURY N/B	480,000.00	459,975.00	
2.125% US TREASURY N/B	530,000.00	507,433.59	
2.125% US TREASURY N/B	460,000.00	438,976.56	
2.125% US TREASURY N/B	500,000.00	476,406.25	
2.125% US TREASURY N/B	770,000.00	732,522.66	
2.125% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,013,407.03	
2.250% US TREASURY N/B	430,000.00	427,648.43	

2.250% US TREASURY N/B	510,000.00	503,664.84	
2.250% US TREASURY N/B	660,000.00	651,389.06	
2.250% US TREASURY N/B	630,000.00	620,451.56	
2.250% US TREASURY N/B	500,000.00	482,812.50	
2.250% US TREASURY N/B	430,000.00	412,497.65	
2.250% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,035,450.00	
2.250% US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,207,690.62	
2.250% US TREASURY N/B	960,000.00	904,275.00	
2.250% US TREASURY N/B	910,000.00	854,333.59	
2.250% US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,406,250.00	
2.250% US TREASURY N/B	780,000.00	651,726.56	
2.375% US TREASURY N/B	330,000.00	327,499.22	
2.375% US TREASURY N/B	510,000.00	499,441.40	
2.375% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,171,525.78	
2.375% US TREASURY N/B	990,000.00	940,886.72	
2.500% US TREASURY N/B	600,000.00	590,437.50	
2.500% US TREASURY N/B	890,000.00	873,729.68	
2.500% US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,299,243.75	
2.500% US TREASURY N/B	300,000.00	291,773.43	
2.500% US TREASURY N/B	770,000.00	682,713.28	
2.500% US TREASURY N/B	630,000.00	556,565.62	
2.500% US TREASURY N/B	580,000.00	512,031.25	
2.625% US TREASURY N/B	820,000.00	820,256.25	
2.625% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,149,101.56	
2.625% US TREASURY N/B	600,000.00	587,531.25	
2.750% US TREASURY N/B	960,000.00	953,250.00	
2.750% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,051,470.31	
2.750% US TREASURY N/B	350,000.00	342,371.09	
2.750% US TREASURY N/B	490,000.00	460,102.34	
2.750% US TREASURY N/B	500,000.00	469,257.81	
2.750% US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,075,628.12	
2.875% US TREASURY N/B	570,000.00	546,042.18	
2.875% US TREASURY N/B	780,000.00	744,717.19	

2.875% US TREASURY N/B	760,000.00	723,543.75	
3.000% US TREASURY N/B	300,000.00	294,703.11	
3.000% US TREASURY N/B	700,000.00	684,578.12	
3.000% US TREASURY N/B	770,000.00	752,614.84	
3.000% US TREASURY N/B	690,000.00	674,475.00	
3.000% US TREASURY N/B	720,000.00	702,675.00	
3.000% US TREASURY N/B	190,000.00	185,205.46	
3.125% US TREASURY N/B	780,000.00	789,079.69	
3.125% US TREASURY N/B	270,000.00	271,054.68	
3.125% US TREASURY N/B	370,000.00	371,445.31	
3.125% US TREASURY N/B	410,000.00	410,896.87	
3.125% US TREASURY N/B	640,000.00	640,350.00	
3.375% US TREASURY N/B	780,000.00	790,420.31	
3.375% US TREASURY N/B	840,000.00	877,931.25	
3.500% US TREASURY N/B	550,000.00	559,839.84	
3.500% US TREASURY N/B	230,000.00	245,219.53	
3.625% US TREASURY N/B	380,000.00	385,700.00	
3.625% US TREASURY N/B	750,000.00	763,886.72	
3.625% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,024,921.88	
3.625% US TREASURY N/B	670,000.00	728,886.72	
3.625% US TREASURY N/B	860,000.00	936,593.75	
3.750% US TREASURY N/B	270,000.00	299,088.28	
3.750% US TREASURY N/B	830,000.00	921,624.22	
3.875% US TREASURY N/B	270,000.00	304,087.50	
4.250% US TREASURY N/B	210,000.00	248,357.81	
4.250% US TREASURY N/B	290,000.00	344,442.97	
4.375% US TREASURY N/B	250,000.00	300,859.37	
4.375% US TREASURY N/B	450,000.00	542,531.25	
4.375% US TREASURY N/B	320,000.00	387,350.00	
4.500% US TREASURY N/B	250,000.00	300,058.59	
4.500% US TREASURY N/B	30,000.00	36,464.06	
4.500% US TREASURY N/B	250,000.00	305,429.68	
4.625% US TREASURY N/B	420,000.00	522,703.12	



	4.750% US TREASURY N/B	470,000.00	596,973.43	
	5.000% US TREASURY N/B	130,000.00	166,460.93	
	5.250% US TREASURY N/B	240,000.00	288,300.00	
	5.250% US TREASURY N/B	120,000.00	144,590.62	
	5.375% US TREASURY N/B	230,000.00	287,176.56	
	5.500% US TREASURY N/B	120,000.00	146,268.75	
	6.000% US TREASURY N/B	140,000.00	169,465.62	
	6.125% US TREASURY N/B	120,000.00	150,937.50	
	6.250% US TREASURY N/B	200,000.00	232,906.25	
	6.250% US TREASURY N/B	100,000.00	132,398.43	
	6.500% US TREASURY N/B	90,000.00	113,751.56	
	8.000% US TREASURY N/B	260,000.00	305,256.25	
	8.125% US TREASURY N/B	140,000.00	149,843.75	
	8.750% US TREASURY N/B	210,000.00	238,153.12	
小計	銘柄数：206 組入時価比率：42.5%	124,120,000.00	121,531,482.39 (13,336,864,877) 43.0%	
カナダドル	0.750% CANADA GOV'T	300,000.00	296,250.00	
	0.750% CANADA GOV'T	400,000.00	385,516.00	
	0.750% CANADA GOV'T	310,000.00	296,335.20	
	1.250% CANADA GOV'T	200,000.00	197,812.00	
	1.500% CANADA GOV'T	590,000.00	585,132.50	
	1.500% CANADA GOV'T	350,000.00	337,221.50	
	1.500% CANADA GOV'T	320,000.00	299,446.40	
	1.750% CANADA GOV'T	480,000.00	479,462.40	
	2.250% CANADA GOV'T	460,000.00	456,789.20	
	2.500% CANADA GOV'T	310,000.00	313,093.80	
	2.750% CANADA GOV'T	420,000.00	428,920.80	
	2.750% CANADA GOV'T	220,000.00	234,080.00	
	2.750% CANADA GOV'T	120,000.00	131,125.20	
	3.250% CANADA GOV'T	440,000.00	454,577.20	
	3.500% CANADA GOV'T	470,000.00	484,024.80	
	3.500% CANADA GOV'T	200,000.00	241,116.00	

小計	3.750% CANADA GOV'T	560,000.00	571,491.20	
	4.000% CANADA GOV'T	290,000.00	367,485.10	
	5.000% CANADA GOV'T	310,000.00	429,027.60	
	5.750% CANADA GOV'T	240,000.00	316,768.80	
	5.750% CANADA GOV'T	200,000.00	282,624.00	
	8.000% CANADA GOV'T	100,000.00	145,302.00	
	銘柄数 : 22 組入時価比率 : 2.1%	7,290,000.00	7,733,601.70 (663,156,345) 2.1%	
メキシコペソ	5.000%MEX BONOS DESARR F	6,270,000.00	6,034,248.00	
	5.750%MEX BONOS DESARR F	3,150,000.00	2,819,565.00	
	6.500%MEX BONOS DESARR F	3,960,000.00	3,849,120.00	
	6.500%MEX BONOS DESARR F	2,100,000.00	2,021,040.00	
	7.500%MEX BONOS DESARR F	3,100,000.00	3,078,610.00	
	7.750%MEX BONOS DESARR F	2,320,000.00	2,329,976.00	
	7.750%MEX BONOS DESARR F	2,800,000.00	2,805,180.00	
	7.750%MEX BONOS DESARR F	4,180,000.00	4,174,787.54	
	8.000%MEX BONOS DESARR F	4,570,000.00	4,613,415.00	
	8.000%MEX BONOS DESARR F	4,140,000.00	4,221,980.28	
	8.500%MEX BONOS DESARR F	2,980,000.00	3,170,422.00	
	8.500%MEX BONOS DESARR F	3,570,000.00	3,836,911.05	
	銘柄数 : 12 組入時価比率 : 0.8%	43,140,000.00	42,955,254.87 (240,549,427) 0.8%	
ユーロ	0.000% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	434,558.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	414,838.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	414,428.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	190,000.00	191,007.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	210,000.00	210,147.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	360,000.00	347,652.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	500,000.00	504,700.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	320,000.00	322,784.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	340,000.00	341,224.00	

0.000% FRANCE GOV'T	290,000.00	288,782.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	340,000.00	342,482.00	
0.050% BUONI POLIENNALI	100,000.00	100,450.00	
0.200% BELGIUM KINGDOM	40,000.00	40,044.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	303,660.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	490,000.00	498,771.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	519,824.00	
0.250% FRANCE GOV'T	410,000.00	416,642.00	
0.250% FRANCE GOV'T	650,000.00	630,045.00	
0.250% NETHERLANDS GOV'T	230,000.00	233,197.00	
0.250% NETHERLANDS GOV'T	280,000.00	277,368.00	
0.350% BUONI POLIENNALI	200,000.00	200,600.00	
0.375% FINNISH GOV'T	40,000.00	40,732.00	
0.400% SPANISH GOV'T	320,000.00	323,840.00	
0.450% BUONI POLIENNALI	200,000.00	201,900.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	360,000.00	366,300.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	454,905.00	
0.500% FINNISH GOV'T	100,000.00	99,830.00	
0.500% FRANCE GOV'T	650,000.00	660,205.00	
0.500% FRANCE GOV'T	500,000.00	503,100.00	
0.500% FRANCE GOV'T	560,000.00	557,872.00	
0.500% NETHERLANDS GOV'T	300,000.00	299,880.00	
0.650% BUONI POLIENNALI	340,000.00	345,712.00	
0.650% BUONI POLIENNALI	260,000.00	256,646.00	
0.700% BUONI POLIENNALI	360,000.00	365,976.00	
0.750% FINNISH GOV'T	110,000.00	106,898.00	
0.750% FRANCE GOV'T	240,000.00	238,248.00	
0.750% NETHERLANDS GOV'T	170,000.00	171,887.00	
0.750% REP OF AUSTRIA	290,000.00	292,871.00	
0.750% SPANISH GOV'T	450,000.00	461,835.00	
0.800% BELGIUM KINGDOM	310,000.00	317,223.00	
0.800% IRISH GOV'T	30,000.00	31,008.00	
0.875% FINNISH GOV'T	90,000.00	92,790.00	

0.900% BUONI POLIENNALI	160,000.00	162,304.00	
0.950% BUONI POLIENNALI	320,000.00	323,232.00	
1.000% BELGIUM KINGDOM	420,000.00	432,894.00	
1.000% BELGIUM KINGDOM	120,000.00	118,524.00	
1.000% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	315,390.00	
1.000% DEUTSCHLAND REP	750,000.00	788,100.00	
1.000% FRANCE GOV'T	340,000.00	345,372.00	
1.000% FRANCE GOV'T	590,000.00	612,538.00	
1.000% FRANCE GOV'T	400,000.00	410,560.00	
1.000% IRISH GOV'T	160,000.00	163,600.00	
1.050% BUONI POLIENNALI	270,000.00	275,427.00	
1.150% SPANISH GOV'T	260,000.00	268,138.00	
1.200% REP OF AUSTRIA	190,000.00	199,975.00	
1.250% BUONI POLIENNALI	360,000.00	348,552.00	
1.250% FRANCE GOV'T	380,000.00	375,136.00	
1.300% SPANISH GOV'T	420,000.00	427,392.00	
1.350% BUONI POLIENNALI	440,000.00	455,136.00	
1.400% SPANISH GOV'T	280,000.00	288,288.00	
1.400% SPANISH GOV'T	100,000.00	100,800.00	
1.450% BELGIUM KINGDOM	140,000.00	140,840.00	
1.450% BUONI POLIENNALI	290,000.00	300,701.00	
1.450% SPANISH GOV'T	50,000.00	50,920.00	
1.500% BUONI POLIENNALI	350,000.00	357,630.00	
1.500% BUONI POLIENNALI	330,000.00	332,673.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	340,000.00	364,310.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	247,273.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	310,000.00	333,653.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	310,000.00	335,172.00	
1.500% FINNISH GOV'T	110,000.00	117,667.00	
1.500% FRANCE GOV'T	650,000.00	684,190.00	
1.500% REP OF AUSTRIA	80,000.00	79,648.00	
1.500% SPANISH GOV'T	470,000.00	482,925.00	
1.600% BELGIUM KINGDOM	90,000.00	88,596.00	

1.600% BUONI POLIENNALI	300,000.00	300,270.00	
1.600% SPANISH GOV'T	420,000.00	443,268.00	
1.625% FINNISH GOV'T	100,000.00	107,280.00	
1.650% BUONI POLIENNALI	370,000.00	343,286.00	
1.650% REP OF AUSTRIA	230,000.00	249,366.00	
1.700% IRISH GOV'T	100,000.00	102,440.00	
1.750% DEUTSCHLAND REP	600,000.00	648,360.00	
1.750% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	306,460.00	
1.750% FRANCE GOV'T	670,000.00	726,079.00	
1.750% FRANCE GOV'T	600,000.00	654,900.00	
1.750% FRANCE GOV'T	270,000.00	262,359.00	
1.750% NETHERLANDS GOV'T	340,000.00	369,648.00	
1.750% REP OF AUSTRIA	200,000.00	217,320.00	
1.900% BELGIUM KINGDOM	190,000.00	204,953.00	
1.950% SPANISH GOV'T	270,000.00	289,413.00	
1.950% SPANISH GOV'T	540,000.00	562,626.00	
2.000% BUONI POLIENNALI	370,000.00	383,431.00	
2.000% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	346,592.00	
2.000% DEUTSCHLAND REP	310,000.00	342,116.00	
2.000% FINNISH GOV'T	90,000.00	99,288.00	
2.000% IRISH GOV'T	190,000.00	201,096.00	
2.000% NETHERLANDS GOV'T	290,000.00	321,436.00	
2.050% BUONI POLIENNALI	60,000.00	61,164.00	
2.100% REP OF AUSTRIA	40,000.00	43,092.00	
2.150% BELGIUM KINGDOM	70,000.00	74,949.00	
2.150% BUONI POLIENNALI	400,000.00	426,080.00	
2.150% SPANISH GOV'T	440,000.00	479,424.00	
2.200% BUONI POLIENNALI	470,000.00	486,168.00	
2.250% BELGIUM KINGDOM	240,000.00	266,520.00	
2.250% BELGIUM KINGDOM	60,000.00	66,816.00	
2.250% BUONI POLIENNALI	250,000.00	239,275.00	
2.250% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	414,921.00	
2.250% DEUTSCHLAND REP	370,000.00	401,783.00	

2.250% FRANCE GOV'T	830,000.00	914,162.00	
2.250% FRANCE GOV'T	590,000.00	660,741.00	
2.250% NETHERLANDS GOV'T	310,000.00	340,845.00	
2.400% IRISH GOV'T	210,000.00	239,232.00	
2.400% REP OF AUSTRIA	100,000.00	117,680.00	
2.450% BUONI POLIENNALI	130,000.00	130,650.00	
2.500% BUONI POLIENNALI	330,000.00	338,910.00	
2.500% BUONI POLIENNALI	420,000.00	453,096.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	560,000.00	604,072.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	360,000.00	464,184.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	585,765.00	
2.500% FRANCE GOV'T	650,000.00	696,540.00	
2.500% FRANCE GOV'T	610,000.00	715,408.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	280,000.00	338,100.00	
2.600% BELGIUM KINGDOM	340,000.00	387,430.00	
2.625% FINNISH GOV'T	90,000.00	115,992.00	
2.700% BUONI POLIENNALI	260,000.00	249,314.00	
2.750% FINNISH GOV'T	130,000.00	155,350.00	
2.750% FRANCE GOV'T	730,000.00	865,415.00	
2.750% NETHERLANDS GOV'T	160,000.00	217,136.00	
2.750% SPANISH GOV'T	390,000.00	401,778.00	
2.750% SPANISH GOV'T	400,000.00	452,560.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	190,000.00	173,489.00	
2.900% SPANISH GOV'T	150,000.00	166,800.00	
2.950% BUONI POLIENNALI	30,000.00	31,164.00	
3.000% BELGIUM KINGDOM	210,000.00	220,101.00	
3.000% BELGIUM KINGDOM	140,000.00	175,224.00	
3.000% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	462,551.00	
3.000% FRANCE GOV'T	740,000.00	831,686.00	
3.150% REP OF AUSTRIA	220,000.00	303,160.00	
3.250% BUONI POLIENNALI	270,000.00	288,036.00	
3.250% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	414,882.00	
3.250% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	312,004.00	

3.250% DEUTSCHLAND REP	270,000.00	389,556.00	
3.250% FRANCE GOV'T	760,000.00	851,200.00	
3.250% FRANCE GOV'T	450,000.00	613,980.00	
3.250% NETHERLANDS GOV'T	280,000.00	312,004.00	
3.375% FINNISH GOV'T	110,000.00	118,162.00	
3.400% IRISH GOV'T	120,000.00	141,480.00	
3.400% REP OF AUSTRIA	220,000.00	254,100.00	
3.450% BUONI POLIENNALI	250,000.00	271,825.00	
3.450% SPANISH GOV'T	310,000.00	372,806.00	
3.500% BUONI POLIENNALI	380,000.00	432,060.00	
3.500% FINNISH GOV'T	160,000.00	177,872.00	
3.500% FRANCE GOV'T	650,000.00	700,375.00	
3.500% FRANCE GOV'T	670,000.00	827,249.00	
3.500% NETHERLANDS GOV'T	320,000.00	348,032.00	
3.500% REP OF AUSTRIA	320,000.00	360,160.00	
3.650% REP OF AUSTRIA	150,000.00	172,215.00	
3.750% BELGIUM KINGDOM	300,000.00	329,790.00	
3.750% BELGIUM KINGDOM	150,000.00	220,785.00	
3.750% BUONI POLIENNALI	470,000.00	518,363.00	
3.750% BUONI POLIENNALI	300,000.00	332,070.00	
3.750% BUONI POLIENNALI	630,000.00	701,568.00	
3.750% BUONI POLIENNALI	370,000.00	427,757.00	
3.750% FRANCE GOV'T	700,000.00	743,400.00	
3.750% FRANCE GOV'T	730,000.00	817,965.00	
3.750% NETHERLANDS GOV'T	30,000.00	35,313.00	
3.750% NETHERLANDS GOV'T	300,000.00	460,440.00	
3.800% REP OF AUSTRIA	50,000.00	83,535.00	
3.800% SPANISH GOV'T	370,000.00	439,449.00	
3.900% IRISH GOV'T	80,000.00	94,640.00	
3.900% REP OF AUSTRIA	240,000.00	262,632.00	
4.000% BELGIUM KINGDOM	250,000.00	290,525.00	
4.000% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	233,529.00	
4.000% BUONI POLIENNALI	520,000.00	568,568.00	

4.000% BUONI POLIENNALI	530,000.00	642,201.00	
4.000% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	587,574.00	
4.000% FINNISH GOV'T	100,000.00	125,240.00	
4.000% FRANCE GOV'T	480,000.00	706,512.00	
4.000% FRANCE GOV'T	310,000.00	499,069.00	
4.000% FRANCE GOV'T	270,000.00	446,040.00	
4.000% NETHERLANDS GOV'T	210,000.00	221,361.00	
4.000% NETHERLANDS GOV'T	270,000.00	404,352.00	
4.000% SPANISH GOV'T	500,000.00	542,000.00	
4.150% REP OF AUSTRIA	250,000.00	372,375.00	
4.200% SPANISH GOV'T	440,000.00	593,208.00	
4.250% BELGIUM KINGDOM	310,000.00	357,275.00	
4.250% BELGIUM KINGDOM	260,000.00	309,140.00	
4.250% BELGIUM KINGDOM	290,000.00	445,817.00	
4.250% BUONI POLIENNALI	480,000.00	508,320.00	
4.250% BUONI POLIENNALI	480,000.00	518,400.00	
4.250% DEUTSCHLAND REP	270,000.00	431,703.00	
4.250% FRANCE GOV'T	770,000.00	941,941.00	
4.300% SPANISH GOV'T	340,000.00	363,290.00	
4.375% FINNISH GOV'T	130,000.00	137,332.00	
4.400% IRISH GOV'T	110,000.00	115,896.00	
4.400% SPANISH GOV'T	370,000.00	448,588.00	
4.500% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	261,560.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	460,000.00	497,122.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	330,000.00	389,763.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	680,000.00	811,852.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	320,000.00	390,112.00	
4.500% FRANCE GOV'T	620,000.00	989,768.00	
4.500% IRISH GOV'T	50,000.00	54,790.00	
4.600% SPANISH GOV'T	370,000.00	392,459.00	
4.650% SPANISH GOV'T	340,000.00	430,882.00	
4.700% SPANISH GOV'T	270,000.00	394,173.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	350,000.00	401,940.00	



4.750% BUONI POLIENNALI	510,000.00	612,255.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	390,000.00	490,347.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	290,000.00	387,266.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	190,000.00	267,786.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	370,000.00	582,121.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	290,000.00	498,220.00	
4.750% FRANCE GOV'T	440,000.00	679,228.00	
4.800% SPANISH GOV'T	400,000.00	496,400.00	
4.850% REP OF AUSTRIA	180,000.00	240,516.00	
4.850% SPANISH GOV'T	440,000.00	494,736.00	
4.900% SPANISH GOV'T	320,000.00	475,264.00	
5.000% BELGIUM KINGDOM	350,000.00	549,360.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	460,000.00	539,718.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	470,000.00	583,364.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	410,000.00	549,154.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	350,000.00	476,420.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	360,000.00	489,492.00	
5.000% IRISH GOV'T	240,000.00	271,512.00	
5.150% SPANISH GOV'T	380,000.00	520,068.00	
5.150% SPANISH GOV'T	230,000.00	360,502.00	
5.250% BUONI POLIENNALI	480,000.00	634,368.00	
5.400% IRISH GOV'T	280,000.00	371,840.00	
5.400% SPANISH GOV'T	390,000.00	483,483.00	
5.500% BELGIUM KINGDOM	340,000.00	493,918.00	
5.500% BUONI POLIENNALI	410,000.00	496,018.00	
5.500% BUONI POLIENNALI	460,000.00	558,624.00	
5.500% DEUTSCHLAND REP	260,000.00	408,902.00	
5.500% FRANCE GOV'T	520,000.00	772,252.00	
5.500% NETHERLANDS GOV'T	250,000.00	364,200.00	
5.500% SPANISH GOV'T	480,000.00	559,680.00	
5.625% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	650,012.00	
5.750% BUONI POLIENNALI	330,000.00	467,742.00	
5.750% FRANCE GOV'T	640,000.00	1,040,000.00	

	5.750% SPANISH GOV'T	530,000.00	803,215.00	
	5.850% SPANISH GOV'T	460,000.00	559,314.00	
	5.900% IRISH GOV'T	250,000.00	272,800.00	
	5.900% SPANISH GOV'T	330,000.00	456,192.00	
	6.000% BUONI POLIENNALI	480,000.00	682,320.00	
	6.000% FRANCE GOV'T	220,000.00	310,530.00	
	6.000% SPANISH GOV'T	130,000.00	189,943.00	
	6.250% DEUTSCHLAND REP	200,000.00	269,380.00	
	6.250% DEUTSCHLAND REP	140,000.00	227,360.00	
	6.250% REP OF AUSTRIA	320,000.00	479,104.00	
	6.500% BUONI POLIENNALI	660,000.00	928,554.00	
	6.500% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	430,500.00	
	7.250% BUONI POLIENNALI	220,000.00	317,680.00	
	7.500% NETHERLANDS GOV'T	80,000.00	108,200.00	
	8.500% FRANCE GOV'T	80,000.00	90,504.00	
	8.500% FRANCE GOV'T	170,000.00	240,873.00	
	9.000% BUONI POLIENNALI	100,000.00	143,040.00	
小計	銘柄数：257	84,020,000.00	97,825,790.00	
	組入時価比率：40.9%		(12,815,178,490)	
			41.4%	
ボンド	1.250% UK TREASURY	150,000.00	146,625.00	
	1.500% UK TREASURY	560,000.00	569,576.00	
	1.500% UK TREASURY	430,000.00	433,440.00	
	1.500% UK TREASURY	200,000.00	182,360.00	
	1.750% UK TREASURY	30,000.00	30,372.00	
	1.750% UK TREASURY	770,000.00	793,023.00	
	1.750% UK TREASURY	130,000.00	127,075.00	
	2.000% UK TREASURY	500,000.00	512,900.00	
	2.000% UK TREASURY	460,000.00	482,586.00	
	2.250% UK TREASURY	440,000.00	464,728.00	
	2.500% UK TREASURY	320,000.00	403,744.00	
	2.750% UK TREASURY	320,000.00	349,472.00	
	3.250% UK TREASURY	410,000.00	520,126.00	

	3.500% UK TREASURY	380,000.00	504,868.00	
	3.500% UK TREASURY	320,000.00	518,240.00	
	3.750% UK TREASURY	240,000.00	249,600.00	
	3.750% UK TREASURY	390,000.00	416,481.00	
	3.750% UK TREASURY	400,000.00	437,160.00	
	3.750% UK TREASURY	320,000.00	476,544.00	
	4.000% UK TREASURY	300,000.00	334,230.00	
	4.000% UK TREASURY	250,000.00	419,200.00	
	4.250% UK TREASURY	240,000.00	299,136.00	
	4.250% UK TREASURY	350,000.00	458,920.00	
	4.250% UK TREASURY	300,000.00	409,680.00	
	4.250% UK TREASURY	260,000.00	367,588.00	
	4.250% UK TREASURY	270,000.00	386,667.00	
	4.250% UK TREASURY	340,000.00	514,896.00	
	4.250% UK TREASURY	260,000.00	407,602.00	
	4.250% UK TREASURY	330,000.00	554,103.00	
	4.500% UK TREASURY	350,000.00	482,335.00	
	4.500% UK TREASURY	370,000.00	557,960.00	
	4.750% UK TREASURY	300,000.00	321,660.00	
	4.750% UK TREASURY	290,000.00	390,543.00	
	4.750% UK TREASURY	250,000.00	372,625.00	
	5.000% UK TREASURY	300,000.00	373,140.00	
	6.000% UK TREASURY	170,000.00	243,525.00	
	8.000% UK TREASURY	30,000.00	36,480.00	
小計	銘柄数：37 組入時価比率：6.9%	11,730,000.00	14,549,210.00 (2,166,377,369) 7.0%	
スイスフラン	2.000% SWITZERLAND	60,000.00	64,704.00	
	3.000% SWITZERLAND	130,000.00	134,901.00	
	4.000% SWITZERLAND	100,000.00	121,180.00	
	4.000% SWITZERLAND	100,000.00	138,280.00	
小計	銘柄数：4	390,000.00	459,065.00 (50,373,202)	

	組入時価比率：0.2%		0.2%	
スウェーデンクローナ	1.000% SWEDEN GOV'T	780,000.00	807,300.00	
	1.500% SWEDEN GOV'T	1,200,000.00	1,288,440.00	
	2.500% SWEDEN GOV'T	700,000.00	802,760.00	
	3.500% SWEDEN GOV'T	1,860,000.00	2,133,420.00	
	3.500% SWEDEN GOV'T	1,380,000.00	1,899,846.00	
	5.000% SWEDEN GOV'T	2,000,000.00	2,280,200.00	
	小計	銘柄数：6	7,920,000.00	9,211,966.00 (117,084,087)
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ノルウェークローネ	1.500% NORWEGIAN GOV'T	880,000.00	862,048.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	840,000.00	842,856.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	300,000.00	297,120.00	
	2.000% NORWEGIAN GOV'T	1,360,000.00	1,393,320.00	
	3.000% NORWEGIAN GOV'T	480,000.00	517,152.00	
	3.750% NORWEGIAN GOV'T	1,400,000.00	1,506,820.00	
	4.500% NORWEGIAN GOV'T	1,330,000.00	1,379,742.00	
	小計	銘柄数：7	6,590,000.00	6,799,058.00 (92,875,132)
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
デンマーククローネ	0.500%KINGDOM OF DENMARK	450,000.00	445,275.00	
	1.500%KINGDOM OF DENMARK	840,000.00	903,840.00	
	1.750%KINGDOM OF DENMARK	1,310,000.00	1,443,620.00	
	3.000%KINGDOM OF DENMARK	1,570,000.00	1,750,864.00	
	4.000%KINGDOM OF DENMARK	1,820,000.00	1,944,852.00	
	4.500%KINGDOM OF DENMARK	2,370,000.00	3,921,165.00	
	小計	銘柄数：6	8,360,000.00	10,409,616.00 (183,105,145)
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
ポーランドズロチ	1.500% POLAND GOV'T	710,000.00	709,361.00	
	1.750% POLAND GOV'T	210,000.00	208,530.00	
	2.000% POLAND GOV'T	420,000.00	421,218.00	
	2.500% POLAND GOV'T	690,000.00	658,674.00	

小計	2.500% POLAND GOV'T	490,000.00	462,854.00	
	2.750% POLAND GOV'T	260,000.00	249,548.00	
	3.250% POLAND GOV'T	410,000.00	419,020.00	
	3.250% POLAND GOV'T	430,000.00	436,751.00	
	4.000% POLAND GOV'T	780,000.00	833,508.00	
	5.250% POLAND GOV'T	630,000.00	683,802.00	
	5.500% POLAND GOV'T	400,000.00	423,240.00	
	5.750% POLAND GOV'T	280,000.00	314,440.00	
	5.750% POLAND GOV'T	660,000.00	752,202.00	
	銘柄数：13	6,370,000.00	6,573,148.00	(201,466,986)
組入時価比率：0.6%			0.7%	
オーストラリアドル	1.750% AUSTRALIAN GOV'T	590,000.00	583,923.00	
	2.250% AUSTRALIAN GOV'T	410,000.00	389,787.00	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	410,000.00	414,740.01	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	460,000.00	465,980.00	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	450,000.00	449,010.00	
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	240,000.00	230,766.24	
	3.000% AUSTRALIAN GOV'T	290,000.00	273,963.00	
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	660,000.00	686,598.00	
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	610,000.00	636,291.00	
	3.750% AUSTRALIAN GOV'T	260,000.00	283,764.00	
	4.250% AUSTRALIAN GOV'T	400,000.00	444,360.00	
	4.500% AUSTRALIAN GOV'T	540,000.00	565,272.00	
	4.500% AUSTRALIAN GOV'T	280,000.00	328,916.00	
	4.750% AUSTRALIAN GOV'T	470,000.00	544,918.00	
	5.500% AUSTRALIAN GOV'T	310,000.00	354,113.00	
	5.750% AUSTRALIAN GOV'T	450,000.00	496,350.00	
	5.750% AUSTRALIAN GOV'T	720,000.00	818,784.00	
	銘柄数：17	7,550,000.00	7,967,535.25	(658,676,139)
組入時価比率：2.1%			2.1%	
シンガポールドル	1.625% SINGAPORE GOV'T	30,000.00	29,919.00	

小計	2.000% SINGAPORE GOV'T	70,000.00	70,070.00	
	2.250% SINGAPORE GOV'T	120,000.00	120,384.00	
	2.500% SINGAPORE GOV'T	90,000.00	90,657.00	
	2.750% SINGAPORE GOV'T	120,000.00	122,616.00	
	2.750% SINGAPORE GOV'T	140,000.00	136,360.00	
	3.000% SINGAPORE GOV'T	250,000.00	258,625.00	
	3.125% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	62,520.00	
	3.250% SINGAPORE GOV'T	100,000.00	102,720.00	
	3.375% SINGAPORE GOV'T	190,000.00	203,547.00	
	3.500% SINGAPORE GOV'T	220,000.00	236,302.00	
	銘柄数：11 組入時価比率：0.4%	1,390,000.00	1,433,720.00 (117,866,121) 0.4%	
マレーシアリン ギット	3.480% MALAYSIAN GOV'T	300,000.00	293,130.00	
	3.492% MALAYSIAN GOV'T	410,000.00	407,871.69	
	3.502% MALAYSIAN GOV'T	430,000.00	407,683.43	
	3.795% MALAYSIAN GOV'T	30,000.00	29,813.22	
	3.844% MALAYSIAN GOV'T	520,000.00	476,656.44	
	3.889% MALAYSIAN GOV'T	300,000.00	300,547.50	
	3.899% MALAYSIAN GOV'T	300,000.00	295,410.90	
	3.900% MALAYSIAN GOV'T	150,000.00	146,625.00	
	3.955% MALAYSIAN GOV'T	600,000.00	589,350.00	
	4.048% MALAYSIAN GOV'T	250,000.00	251,833.00	
	4.160% MALAYSIAN GOV'T	760,000.00	766,722.96	
	4.181% MALAYSIAN GOV'T	310,000.00	311,627.19	
	4.378% MALAYSIAN GOV'T	210,000.00	212,268.00	
	4.498% MALAYSIAN GOV'T	240,000.00	240,147.12	
	4.736% MALAYSIAN GOV'T	140,000.00	136,604.44	
	4.762% MALAYSIAN GOV'T	160,000.00	159,680.00	
4.935% MALAYSIAN GOV'T	180,000.00	180,901.44		
小計	銘柄数：17 組入時価比率：0.5%	5,290,000.00	5,206,872.33 (144,646,913) 0.5%	

ランド	10.50% REPUBLIC OF SOUTH	2,870,000.00	3,246,257.00	
	6.250% REPUBLIC OF SOUTH	2,560,000.00	1,922,816.00	
	6.500% REPUBLIC OF SOUTH	3,120,000.00	2,312,856.00	
	6.750% REPUBLIC OF SOUTH	1,980,000.00	1,946,538.00	
	7.000% REPUBLIC OF SOUTH	3,270,000.00	2,813,508.00	
	7.250% REPUBLIC OF SOUTH	750,000.00	750,675.00	
	7.750% REPUBLIC OF SOUTH	1,010,000.00	1,010,505.00	
	8.000% REPUBLIC OF SOUTH	1,150,000.00	1,086,750.00	
	8.250% REPUBLIC OF SOUTH	920,000.00	870,780.00	
	8.50% REPUBLIC OF SOUTH	1,850,000.00	1,741,405.00	
	8.750% REPUBLIC OF SOUTH	1,880,000.00	1,780,924.00	
	8.750% REPUBLIC OF SOUTH	2,790,000.00	2,645,199.00	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH	550,000.00	540,760.00	
	小計	銘柄数 : 13 組入時価比率 : 0.6%	24,700,000.00	22,668,973.00 (201,753,859) 0.7%
合計			30,989,974,092 (30,989,974,092)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
ドル	国債証券 206銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 257銘柄	100.0%	41.4%
ポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
ランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2018年6月末現在)

## 日立バランスファンド（株式70）

資産総額	21,948,642,939 円
負債総額	22,511,106 円
純資産総額（ - ）	21,926,131,833 円
発行済口数	9,948,006,309 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2041 円
（1万口当たり純資産額）	（22,041 円）

## 日立バランスファンド（株式50）

資産総額	22,106,080,472 円
負債総額	10,841,499 円
純資産総額（ - ）	22,095,238,973 円
発行済口数	11,269,233,421 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9607 円
（1万口当たり純資産額）	（19,607 円）

## 日立バランスファンド（株式30）

資産総額	8,175,852,065 円
負債総額	13,350,958 円
純資産総額（ - ）	8,162,501,107 円
発行済口数	4,789,556,170 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7042 円
（1万口当たり純資産額）	（17,042 円）

（ご参考）

## 日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

資産総額	49,053,740,655 円
負債総額	486,325,907 円
純資産総額（ - ）	48,567,414,748 円
発行済口数	27,237,492,591 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7831 円
（1万口当たり純資産額）	（17,831 円）

## 日立国内債券インデックスマザーファンド

資産総額	92,567,466,479 円
負債総額	462,706,235 円
純資産総額（ - ）	92,104,760,244 円
発行済口数	65,922,462,066 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3972 円
（1万口当たり純資産額）	（13,972 円）

## 日立外国株式インデックスマザーファンド

資産総額	84,942,835,063 円
負債総額	79,115,875 円
純資産総額（ - ）	84,863,719,188 円
発行済口数	35,535,609,386 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3881 円
（1万口当たり純資産額）	（23,881 円）

## 日立外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	39,831,076,609 円
負債総額	1,056,535,137 円
純資産総額（ - ）	38,774,541,472 円
発行済口数	18,056,876,757 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1474 円
（1万口当たり純資産額）	（21,474 円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者名簿

作成しません。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(6) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払います。

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

(1) 資本の額（2018年8月15日現在）

資本金  
3億円  
発行可能株式総数  
24,000株  
発行済株式総数  
6,000株  
最近5年間における資本金の増減  
ありません。

(2) 委託会社等の機構

経営体制

取締役は、5名以内とします。

取締役の任期は就任後1年内の最終の決算期に関する定時株主総会終結の時に終了し、他の取締役在任中新たに就任した取締役の任期は、他の在任取締役の残任期間とします。

代表取締役は、取締役会の決議をもって定めます。また、取締役会の決議をもって取締役社長1名を定めます。

投資運用の意思決定機構

当ファンドの運用指図は、当ファンドの運用の基本方針に基づき、委託者が行います。

当社の運用方針策定のための最高意思決定機関は運用委員会であり、チーフ・インベストメント・オフィサー（以下「CIO」といいます。）を議長とし、取締役社長、各グループ長、コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサー等を構成メンバーとして、原則として月1回開催します。運用委員会においては、政治、経済、金融情勢等の投資環境及び市場分析を行い、全社的運用方針など運用等に関する基本的な重要事項を協議、策定し、併せて個別ファンドの運用についての具体的諸方策を協議し、決定します。

運用グループにおいては、個別ファンド等の運用に直接的に関連する諸情報の分析、検討を行うため、ファンドマネージャー会議を原則週1回開催します。

ファンドマネージャーは、当ファンドの運用の基本方針、運用委員会およびファンドマネージャー会議の方針に基づき、ファンド毎に運用計画を立案し、具体的な銘柄選択を行い、組入る有価証券等の売買の指図を行います。

運用状況の評価のため、リスク管理オフィサーを議長とし、取締役社長、コンプライアンスオフィサー、CIOおよび各グループ長等を構成メンバーとし、運用評価委員会を原則として月1回開催します。運用評価委員会では、当ファンドの運用成績、資産配分、リスクおよびポートフォリオの内容など運用状況についての分析、評価および検討を行います。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

委託者は、株式会社日立製作所により1999年8月5日に設立された会社です。

委託者は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。

2018年6月末日現在、委託者が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、19本であり、その純資産総額の合計は558,993百万円です。(なお、親投資信託17本は、ファンド数及び純資産総額の合計からは除いております。)

基本的性格	募集形態	ファンド数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	公募	7	127,550
	私募	12	431,443
合計		19	558,993

### 3 【委託会社等の経理状況】

- 1 . 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)第2条の規定により、「財務諸表等規則」及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 . 財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3 . 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2017年4月1日から2018年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第18期 (2017年3月31日現在)	第19期 (2018年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,720	1,068
未収委託者報酬	300,667	282,669
未収運用受託報酬	3,538	3,585
関係会社預け金	1 1,124,706	1 1,252,115
前払費用	27,001	27,077
繰延税金資産	16,196	15,780
その他	-	58
流動資産合計	1,473,830	1,582,355
固定資産		
無形固定資産		
ソフトウェア	1,118	839
無形固定資産合計	1,118	839
投資その他の資産		
敷金	24,362	23,992
繰延税金資産	31,444	33,636
投資その他の資産合計	55,806	57,629
固定資産合計	56,925	58,468
資産合計	1,530,756	1,640,823

(単位:千円)

	第18期 (2017年3月31日現在)		第19期 (2018年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
未払金	1	3	137,063	108,065
未払費用	1		363,585	441,830
未払法人税等	2		12,423	15,085
預り金			4,563	5,668
賞与引当金			32,683	29,437
流動負債合計			550,319	600,088
固定負債				
退職給付引当金			100,842	107,836
固定負債合計			100,842	107,836
負債合計			651,161	707,924
純資産の部				
株主資本				
資本金			300,000	300,000
利益剰余金				
利益準備金			75,000	75,000
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金			504,594	557,898
利益剰余金合計			579,594	632,898
株主資本合計			879,594	932,898
純資産合計			879,594	932,898
負債純資産合計			1,530,756	1,640,823



## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第18期 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)		第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		1,075,114		1,179,939
運用受託報酬		577,359		581,932
営業収益計		1,652,473		1,761,871
営業費用				
支払手数料		704,312		791,230
委託計算費		47,707		49,965
調査費		237,465		232,263
営業雑経費				
通信費		2,689		2,815
印刷費		5,069		4,370
諸会費		3,832		3,772
営業雑経費計		11,591		10,958
営業費用計		1,001,078		1,084,417
一般管理費				
給料				
役員報酬		12,842		19,840
給料・手当		219,480		231,988
賞与		1,267		2,812
給料計		233,589		254,642
交際費		6,089		7,035
旅費交通費		4,905		7,227
租税公課		104		92
不動産賃借料		33,602		33,602
賞与引当金繰入額		62,486		58,874
退職給付費用		11,067		10,436
その他の人件費		46,071		41,982
その他の不動産関係費		5,579		5,486
減価償却費		851		279
諸雑費		16,412		16,719
一般管理費計	1	420,759	1	436,378
営業利益		230,635		241,075
営業外収益				
受取利息		269		286
為替差益		-		53
賞与引当金戻入額		1,485		-
その他		25		43
営業外収益計	1	1,780	1	383
営業外費用				
為替差損		29		-
その他		51		16
営業外費用合計		81		16
経常利益		232,335		241,441
税引前当期純利益		232,335		241,441
法人税等	2	75,921	2	77,714
法人税等調整額		2,771		1,776
法人税等合計		73,149		75,937
当期純利益		159,185		165,504

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本				株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	利 益 剰 余 金		利益剰余金 合計		
		利益準備金	その他 利益剰余金 繰越利益剰余金			
当 期 首 残 高	300,000	75,000	453,408	528,408	828,408	828,408
当 期 変 動 額						
剰余金の配当			108,000	108,000	108,000	108,000
当期純利益			159,185	159,185	159,185	159,185
当期変動額合計	-	-	51,185	51,185	51,185	51,185
当 期 末 残 高	300,000	75,000	504,594	579,594	879,594	879,594

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本				株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	利 益 剰 余 金		利益剰余金 合計		
		利益準備金	その他 利益剰余金 繰越利益剰余金			
当 期 首 残 高	300,000	75,000	504,594	579,594	879,594	879,594
当 期 変 動 額						
剰余金の配当			112,200	112,200	112,200	112,200
当期純利益			165,504	165,504	165,504	165,504
当期変動額合計	-	-	53,304	53,304	53,304	53,304
当 期 末 残 高	300,000	75,000	557,898	632,898	932,898	932,898

## 重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法	(1)無形固定資産 減価償却の方法は、自社利用ソフトウェアについて見込利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。
2. 引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち、当期の負担額を計上しております。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)消費税等の処理方法 消費税および地方消費税の会計処理については税抜方式によっております。 (2)連結納税制度の適用 株式会社日立製作所を連結納税親会社とする法人税に係る連結納税制度を適用しております。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第18期 (2017年3月31日現在)	第19期 (2018年3月31日現在)
1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,124,706千円 未払金 58,243千円 未払費用 217千円	1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,252,115千円 未払金 59,583千円 未払費用 191千円
2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 4,871千円 未払事業税 6,608千円 未払事業所税 943千円	2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 5,323千円 未払事業税 8,779千円 未払事業所税 983千円
3. 消費税等の取扱い 未払消費税は、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「未払金」に含めて表示しております。	3. 消費税等の取扱い 同左

## （損益計算書関係）

第18期 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)	第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)
1. 関係会社との取引高 一般管理費 8,835千円 営業外収益 269千円	1. 関係会社との取引高 一般管理費 7,951千円 営業外収益 286千円
2. 法人税等には、住民税及び事業税を含んでおります。	2. 同左

## (株主資本等変動計算書関係)

第18期 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)	第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)
<b>1. 発行済株式に関する事項</b> (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 <b>2. 自己株式に関する事項</b> - <b>3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項</b> - <b>4. 配当に関する事項</b> (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 2016年6月30日 第17回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 108,000,000円 1株当たり配当額 18,000円 基準日 2016年 3月31日 効力発生日 2016年 6月30日 (2) 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 2017年5月26日 第18回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 112,200,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 18,700円 基準日 2017年 3月31日 効力発生日 2017年 5月29日	<b>1. 発行済株式に関する事項</b> (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 <b>2. 自己株式に関する事項</b> - <b>3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項</b> - <b>4. 配当に関する事項</b> (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 2017年5月26日 第18回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 112,200,000円 1株当たり配当額 18,700円 基準日 2017年 3月31日 効力発生日 2017年 5月29日 (2) 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 2018年5月25日 第19回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 115,800,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 19,300円 基準日 2018年 3月31日 効力発生日 2018年 5月28日

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第18期 (自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日)	第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)
1年内	2,443千円	2,443千円
1年超	11,197千円	8,754千円
合計	13,640千円	11,197千円

## （金融商品関係）

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組み方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を行っており、当社の資金運用については、銀行預金及び親会社である株式会社日立製作所への預け金に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されておりますが、ほとんどが企業年金の顧客であり、顧客との新規契約には社内審査を行っておりリスクは僅少です。

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

また、資金管理にあたっては、投資信託財産に属する金銭を信託銀行で管理することで、投資信託委託会社としての金銭等との混同を来たさないようにしております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

2017年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	1,720	1,720	-
未収委託者報酬	300,667	300,667	-
未収運用受託報酬	3,538	3,538	-
関係会社預け金	1,124,706	1,124,706	-
資産計	1,430,633	1,430,633	-
未払金	137,063	137,063	-
未払費用	363,585	363,585	-
負債計	500,649	500,649	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、関係会社預け金、未払金、並びに未払費用これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	第17期 (2016年3月31日現在)	第18期 (2017年3月31日現在)
敷金	24,732	24,362

（ ）敷金については、償還時期を合理的に見積ることができず、時価を把握する事が極めて困難と認められるため、時価評価は行っておりません。

## （注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,720	-	-	-
未収委託者報酬	300,667	-	-	-
未収運用受託報酬	3,538	-	-	-
関係会社預け金	1,124,706	-	-	-
合計	1,430,633	-	-	-

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組み方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を行っており、当社の資金運用については、銀行預金及び親会社である株式会社日立製作所への預け金に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されておりますが、ほとんどが企業年金の顧客であり、顧客との新規契約には社内審査を行っておりリスクは僅少です。

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

また、資金管理にあたっては、投資信託財産に属する金銭を信託銀行で管理することで、投資信託委託会社としての金銭等との混同を来たさないようにしております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	1,068	1,068	-
未収委託者報酬	282,669	282,669	-
未収運用受託報酬	3,585	3,585	-
関係会社預け金	1,252,115	1,252,115	-
資産計	1,539,439	1,539,439	-
未払金	108,065	108,065	-
未払費用	441,830	441,830	-
負債計	549,896	549,896	-

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、関係会社預け金、未払金、並びに未払費用これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	第18期 （2017年3月31日現在）	第19期 （2018年3月31日現在）
敷金	24,362	23,992

（ ）敷金については、償還時期を合理的に見積ることができず、時価を把握する事が極めて困難と認められるため、時価評価は行っておりません。

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,068	-	-	-
未収委託者報酬	282,669	-	-	-
未収運用受託報酬	3,585	-	-	-
関係会社預け金	1,252,115	-	-	-
合計	1,539,439	-	-	-

## （有価証券関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
該当事項はありません。	同左

## （デリバティブ取引関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
該当事項はありません。	同左

## （退職給付関係）

第18期 （2017年3月31日現在）	第19期 （2018年3月31日現在）
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。なお、退職一時金制度については設立時に設定しております。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 100,842千円（退職給付引当金）	2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 107,836千円（退職給付引当金）
3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 11,067千円（退職給付費用）	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 10,436千円（退職給付費用）
4. なお、退職給付債務および退職給付費用の算定方法として簡便法を採用しております。	4. 同左

## （税効果会計関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 （繰延税金資産） 賞与引当金 10,086 千円 退職給付引当金 30,886 未払事業税 2,039 未払社会保険料 1,514 その他 3,115 繰延税金資産合計 47,640	1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 （繰延税金資産） 賞与引当金 9,013 千円 退職給付引当金 33,019 未払事業税 2,688 未払社会保険料 1,422 その他 3,272 繰延税金資産合計 49,417
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異要因 （％） 法定実効税率 30.9 （調整） 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.4 その他 0.1 税効果会計適用後の法人税等の負担率 31.4	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異要因 （％） 法定実効税率 30.9 （調整） 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6 その他 0.1 税効果会計適用後の法人税等の負担率 31.5

## （ストックオプション等関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
該当事項はありません。	同左

## （持分法損益等関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
該当事項はありません。	同左

## （資産除去債務関係）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）																
<p>1. 当該資産除去債務の概要 当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。</p> <p>また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。</p> <p>2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。</p> <p>3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">1,233千円</td> </tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td> <td style="text-align: right;">370千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td style="text-align: right;">1,603千円</td> </tr> </table>	期首残高	1,233千円	建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円	当年度の負担に属する償却額	370千円	期末残高	1,603千円	<p>1. 当該資産除去債務の概要 当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。</p> <p>また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。</p> <p>2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。</p> <p>3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">1,603千円</td> </tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td> <td style="text-align: right;">370千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td style="text-align: right;">1,973千円</td> </tr> </table>	期首残高	1,603千円	建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円	当年度の負担に属する償却額	370千円	期末残高	1,973千円
期首残高	1,233千円																
建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円																
当年度の負担に属する償却額	370千円																
期末残高	1,603千円																
期首残高	1,603千円																
建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円																
当年度の負担に属する償却額	370千円																
期末残高	1,973千円																



## (セグメント情報等)

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1)製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

該当事項はありません。

## (3)主要な顧客ごとの情報

顧客の名称または氏名	売上高（千円）
日立企業年金基金	342,038
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	245,391
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	193,539

（注）当社は、投資信託委託会社として、約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ております。そのため、投資信託からの営業収益については当該投資信託を顧客として開示しております。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1)製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

該当事項はありません。

## (3)主要な顧客ごとの情報

顧客の名称または氏名	売上高（千円）
日立企業年金基金	388,614
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	330,127
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	249,260

（注）当社は、投資信託委託会社として、約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ております。そのため、投資信託からの営業収益については当該投資信託を顧客として開示しております。

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の受入等	事業上の関係				
主要株主	㈱日立製作所	東京都千代田区	458,790 百万円	電機 機器 製造業	100.0%	受入 1名  兼任 3名	営業上 の取 引、 資金の 預け入 れ等	連結納税の未払金の支払い	60,834	未払金	57,691
								預け金の利息	269	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,744,555	関係会社 預け金	1,124,706
								親会社に対する預け金の減少	1,694,931		

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

関係会社預け金の金利：市場金利に基づいて決定しております。

3. 役員の受入1名は当社代表取締役1名、役員の兼任3名は当社非常勤取締役2名、当社非常勤監査役1名です。

## (イ)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他関係会社の子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の受入等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	㈱日立アーバンインベストメント	東京都千代田区	2,000 百万円	不動産業	-	-	建物の賃借	敷金の支払	-	敷金	24,362

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

近隣の取引事例を参考の上、決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

株式会社日立製作所(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の受入等	事業上の関係				
主要株主	㈱日立製作所	東京都千代田区	458,790 百万円	電機機器製造業	100.0%	受入1名  兼任3名	営業上の取引、資金の預け入れ等	連結納税の未払金の支払い	57,691	未払金	59,080
								預け金の利息	286	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,880,681	関係会社預け金	1,252,115
								親会社に対する預け金の減少	1,753,272		

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

関係会社預け金の金利：市場金利に基づいて決定しております。

3. 役員の受入1名は当社代表取締役1名、役員の兼任3名は当社非常勤取締役2名、当社非常勤監査役1名です。

(イ)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他関係会社の子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の受入等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	㈱日立アーバンインベストメント	東京都千代田区	2,000 百万円	不動産業	-	-	建物の賃借	敷金の支払	-	敷金	23,992

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

近隣の取引事例を参考の上、決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

株式会社日立製作所(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

## （1株当たり情報）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
1株当たり純資産額 146,599円11銭 1株当たり当期純利益 26,530円99銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	1株当たり純資産額 155,483円15銭 1株当たり当期純利益 27,584円03銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 159,185千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項なし 普通株式に係る当期純利益 159,185千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株	1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 165,504千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項なし 普通株式に係る当期純利益 165,504千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

## （重要な後発事象）

第18期 （自 2016年4月 1日 至 2017年3月31日）	第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）
該当事項はありません。	同左

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見取の条件と異なる条件であつて見取の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）又は子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 前記(3)(4)に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であつて、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

#### 5【その他】

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託者およびファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生しておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（2018年6月末現在）

#### (1) 受託者（受託会社）

名称	資本金の額	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の名称、資本金の額及び事業の内容

名称	資本金の額	事業の内容
野村アセットマネジメント株式会社 （1959年12月1日設立）	17,180百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社 （1998年2月25日設立）	310百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
MU投資顧問株式会社 （1993年9月27日設立）	2,526百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託者（受託会社）

ファンドの受託者として、信託財産に属する有価証券の保管・管理・計算事務を行います。

#### (2) 販売会社

ファンドの販売会社として、受益権の募集・販売の取扱い等（確定拠出年金による申込みに限りません。）及び一部解約金・償還金の支払い等に関する事務等を行います。

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の業務の概況

マザーファンドの運用の再委託先として、信託財産の運用の指図、有価証券の売買の発注等を行います。

## 3【資本関係】

該当ありません。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書(表紙を含みます。以下同じ)に、委託者の名称、ロゴを使用し、ファンドの形態等を記載することがあります。
- (2) 目論見書に、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- (3) 目論見書に、目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (4) 目論見書に、有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関し記載することがあります。
- (5) 目論見書に、請求目論見書は投資家の請求により交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- (6) 目論見書に、商品内容に関して重大な変更を行う場合に、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき、事前に受益者の意向を確認する手続きを行う旨を記載することがあります。
- (7) 目論見書に、投資信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨を記載することがあります。
- (8) 目論見書に、「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 目論見書に、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額を記載することがあります。
- (10) 目論見書に、委託会社のインターネットホームページアドレス、電話番号及び受付時間等を記載することがあります。
- (11) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (12) 目論見書に、以下の趣旨を示す記載をすることがあります。

投資信託は、金融機関の預金または保険契約とは商品性が異なります。

投資信託は預貯金ではありません。

投資信託は預金保険機構または保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

投資信託は元本保証および利回り保証のいずれもありません。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、ご購入した投資家の皆様が負うこととなります。

ファンドの投資目的が達成される保証はありません。

投資信託をご購入の際は最新の「目論見書」を必ずご覧ください。
- (13) 当ファンドの約款の全文を請求目論見書に記載することがあります。
- (14) 目論見書は、電子媒体として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (15) 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

# 独立監査人の監査報告書

2018年5月24日

日立投資顧問株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井 純子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日立投資顧問株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第19期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立投資顧問株式会社の2018年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2018年7月13日

日立投資顧問株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井 純子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式70）の2017年5月16日から2018年5月15日までの第17期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式70）の2018年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する第17期計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

日立投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年7月13日

日立投資顧問株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井 純子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式50）の2017年5月16日から2018年5月15日までの第17期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式50）の2018年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する第17期計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

日立投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2018年7月13日

日立投資顧問株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井 純子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式30）の2017年5月16日から2018年5月15日までの第17期計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式30）の2018年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する第17期計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

日立投資顧問株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。