

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成23年8月15日

【計算期間】 第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

【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）

【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 高橋 滋

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド管理グループ 畔田 正哉

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目6番1号

【電話番号】 03-4235-6134

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【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、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、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 債券	インデックス型
追加型	海外	不動産投信 その他資産 ()	特殊型
	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、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 年2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
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 (合成指数)
不動産投信	日々	中南米			
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))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング			
資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型 資産配分変更型					

<属性区分表の定義>

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。

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、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）、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）ならびにシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース（為替ヘッジなし））（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。

2 ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックスは、野村證券株式会社が算出している国内債券市場の全体を表す指数です。

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。

4 シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが算出している世界主要国の国債市場の動きを表す指数です。

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	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合	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	シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース（為替ヘッジなし））	外国債券

(2) 【ファンドの沿革】

平成13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。

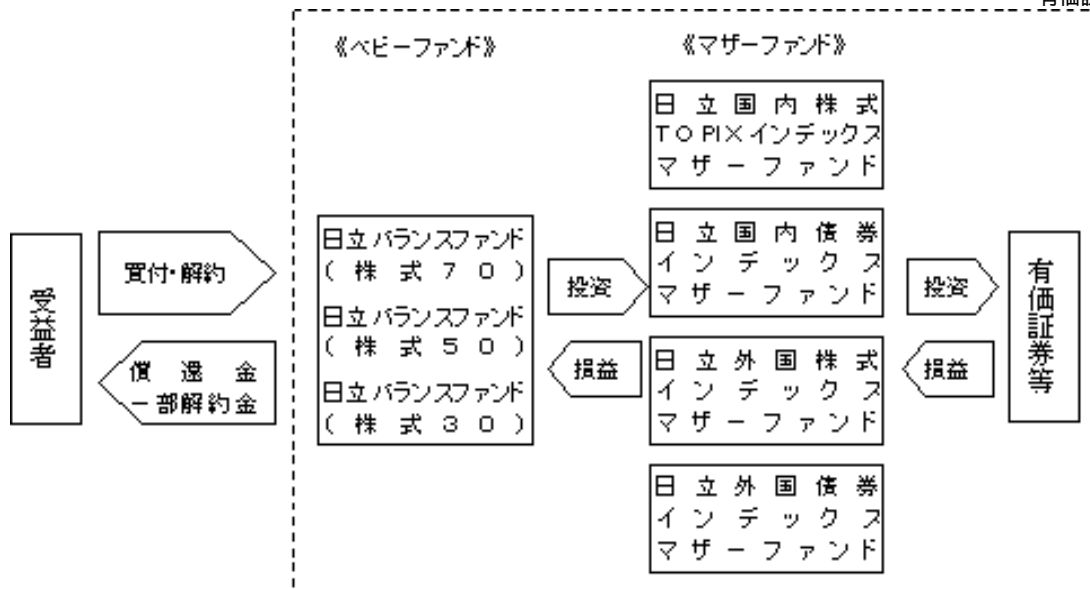
マザーファンド名	設定日
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	平成13年 6月22日
日立国内債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立国内債券マザーファンドN」）	平成12年 4月28日
日立外国株式インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国株式マザーファンドS」）	平成12年 4月 3日
日立外国債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国債券マザーファンドU」）	平成13年 3月29日

(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。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。

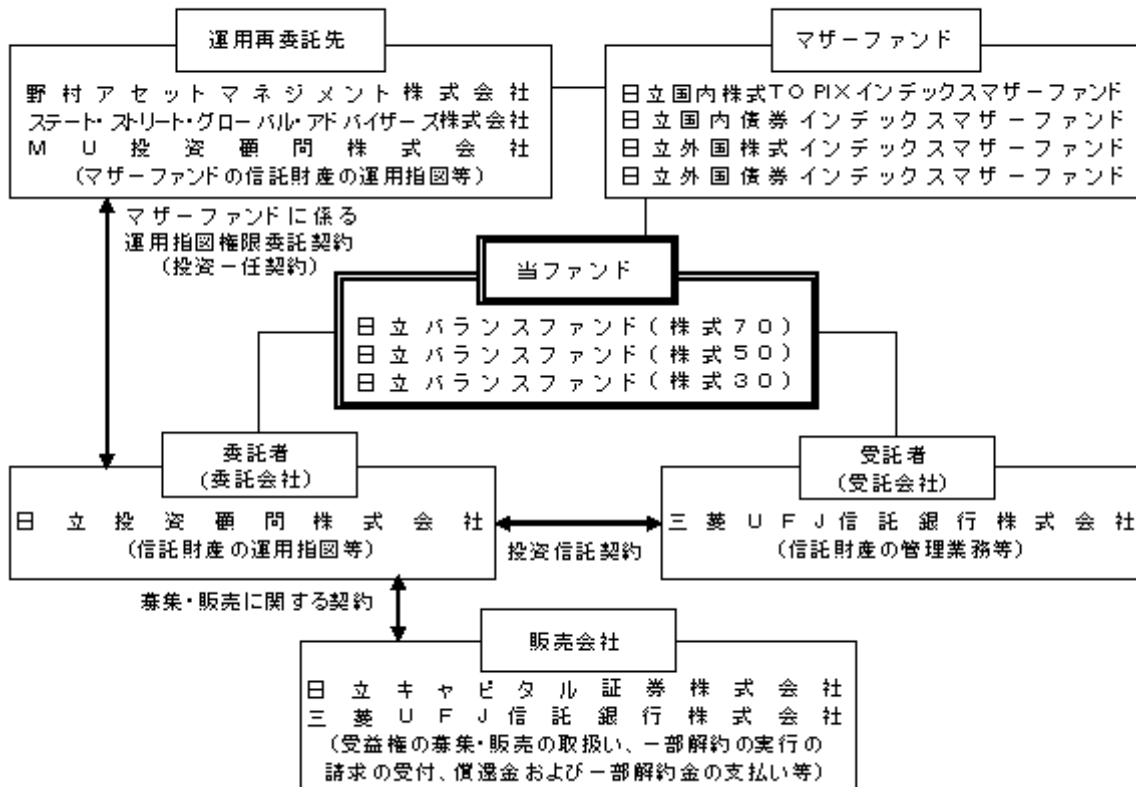
3. 販売会社：日立キャピタル証券株式会社、三菱UFJ信託銀行株式会社

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

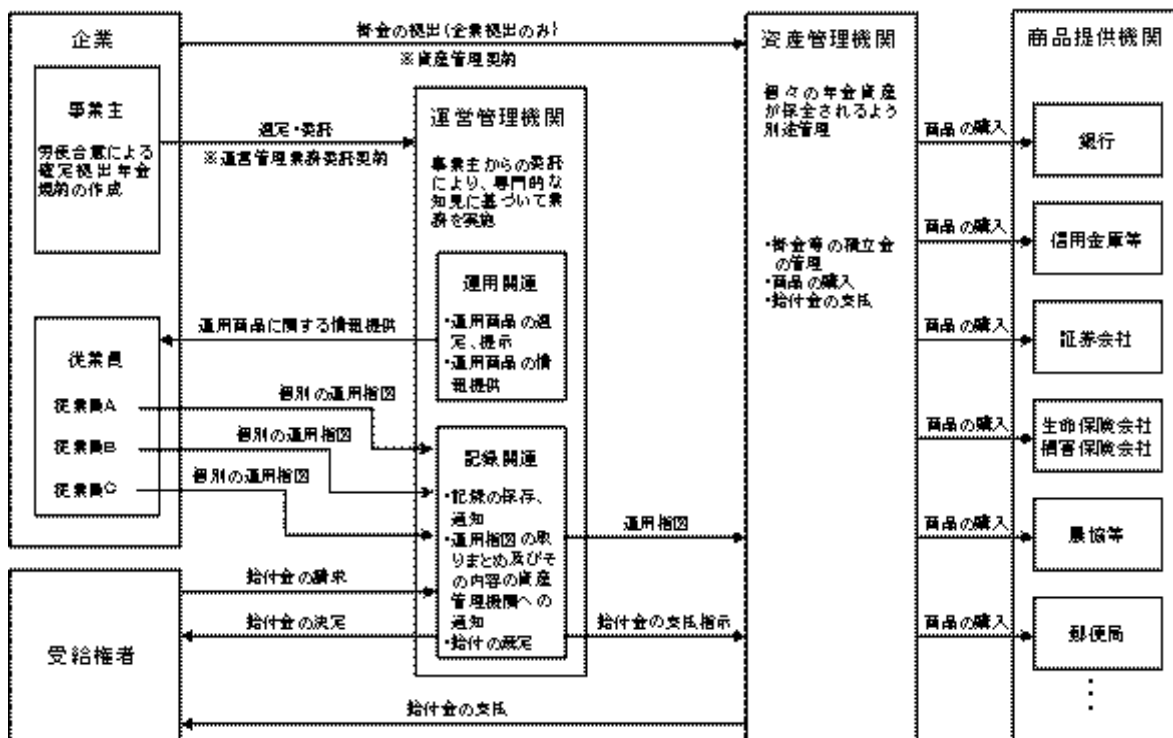


(ご参考)

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、専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（平成23年8月15日現在）

1. 資本の額

3億円

2. 委託会社の沿革

平成11年 8月 5日 会社設立

平成11年 8月31日 投資顧問業者登録

平成12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

平成19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	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合	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	シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース（為替ヘッジなし））	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。

(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。平成23年6月末現在10名程度出席。

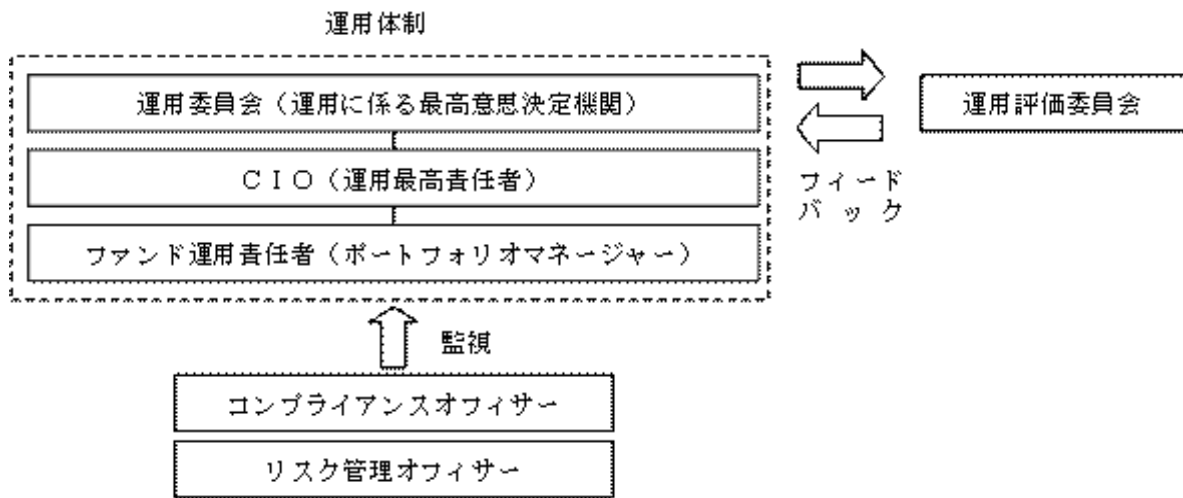
運用評価委員会は、運用再委託先を含む、運用成績、資産配分、リスクおよびポートフォリオの内容等運用状況についての分析および評価を行います。平成23年6月末現在10名程度出席。

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。平成23年6月末現在10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。平成23年6月末現在コンプライアンスオ

ファイサーおよびリスク管理オフィサーは各1名在籍。

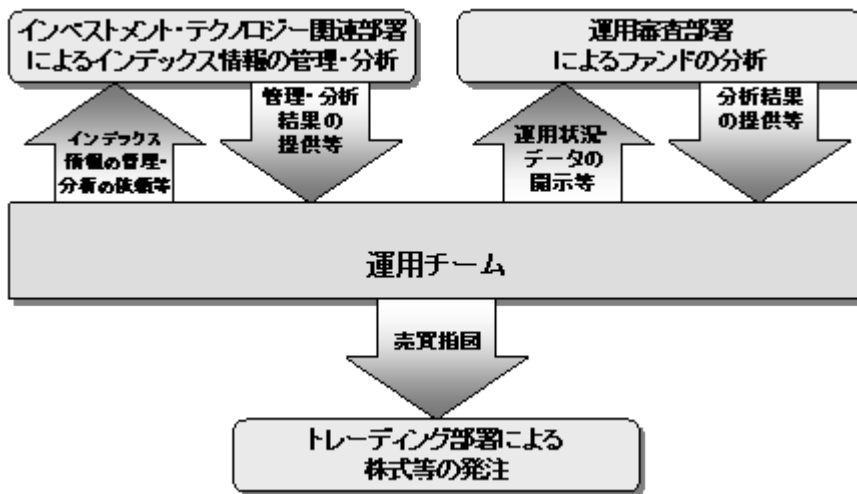
運用体制図



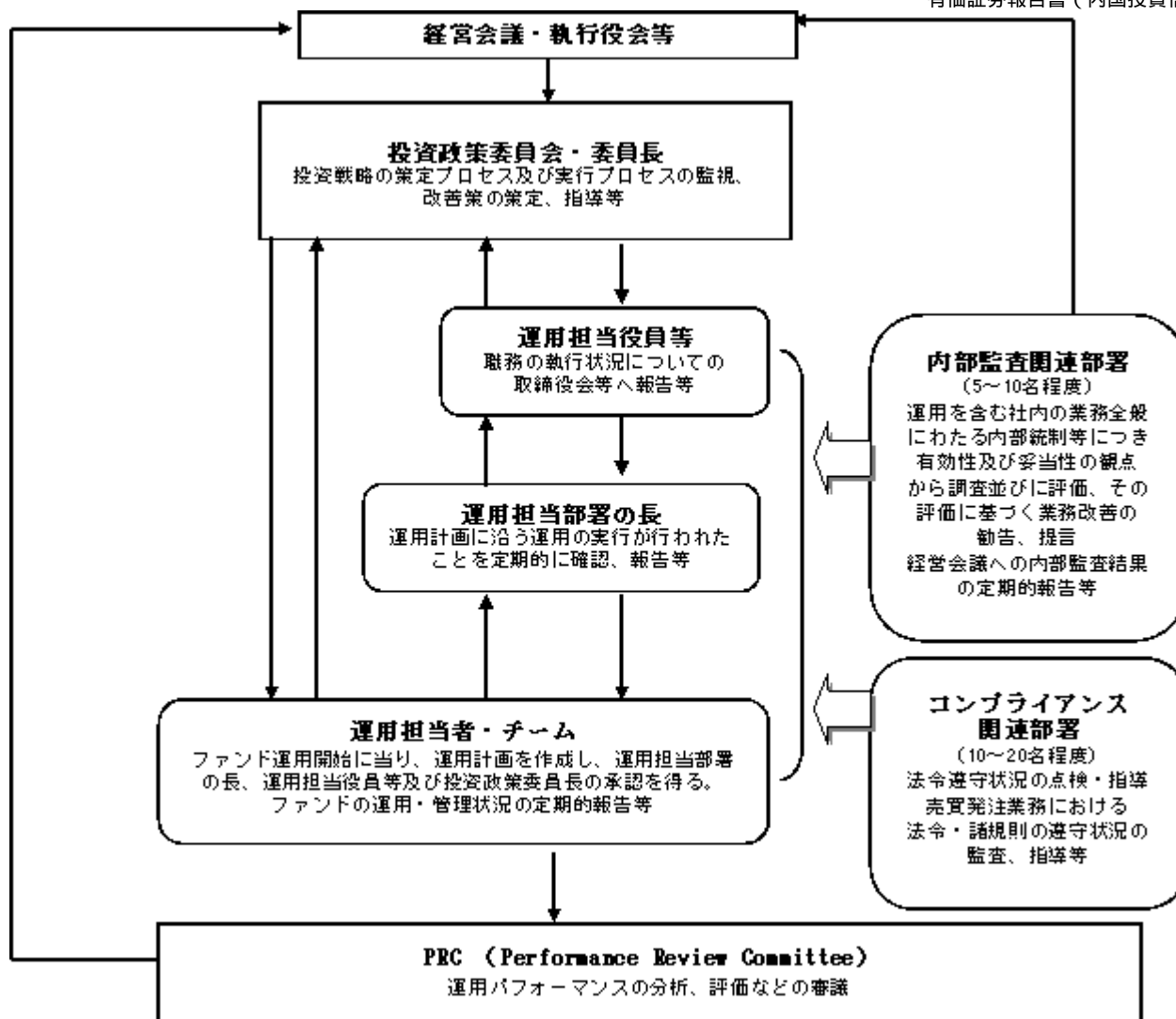
（ご参考）

「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

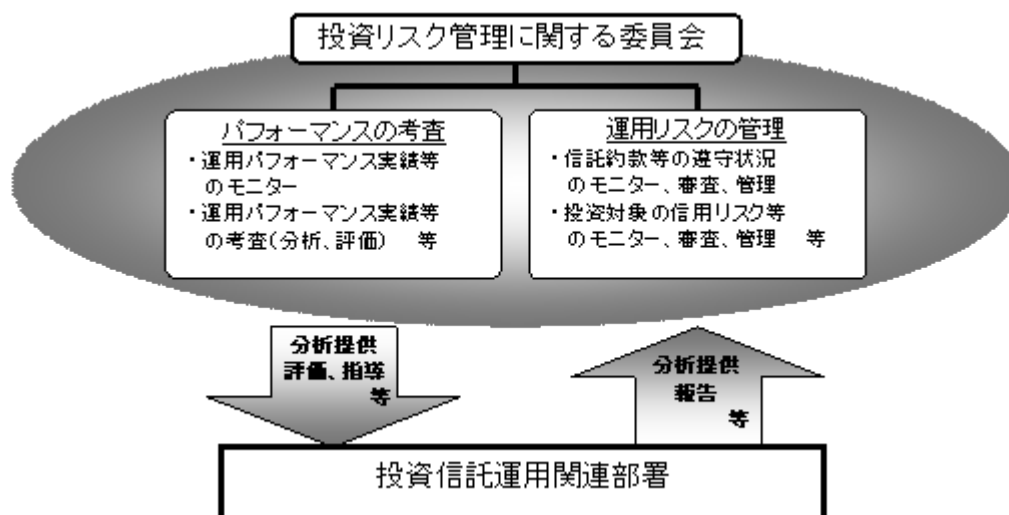
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（平成23年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

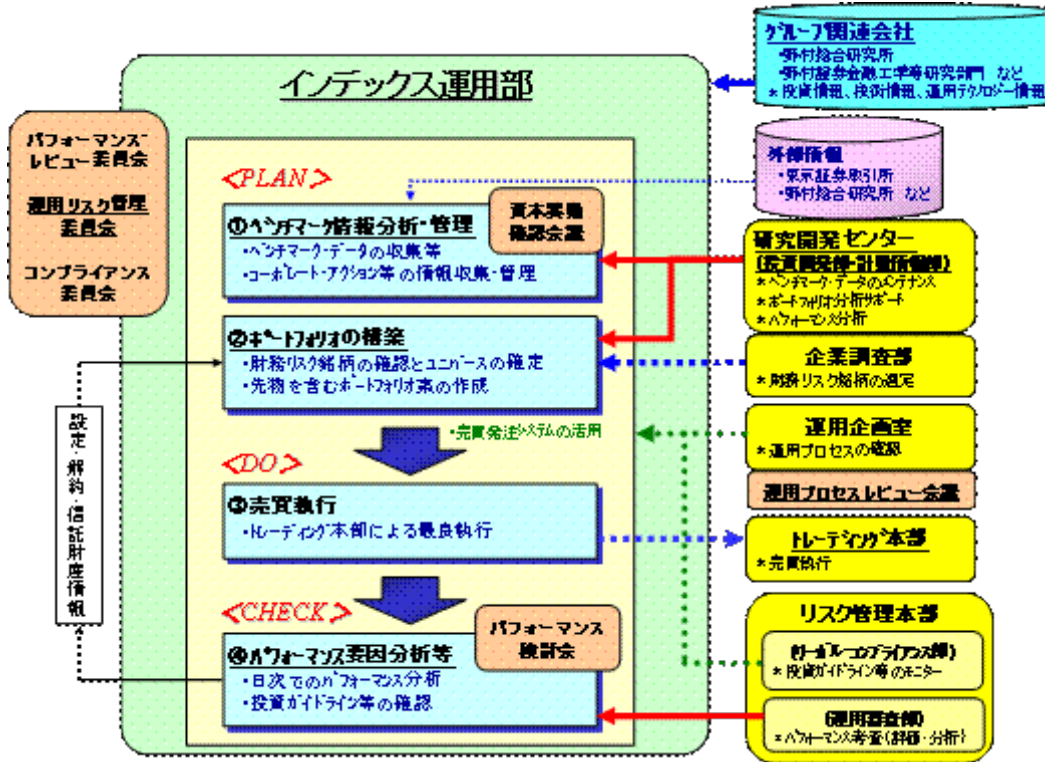


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

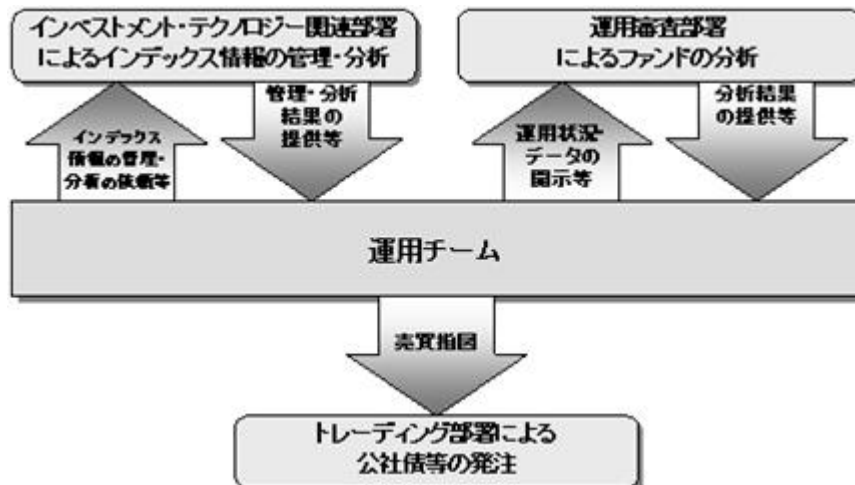
基本的には、東京証券取引所第1部の銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れますが、一部財務リスクの高い銘柄を除外しています。



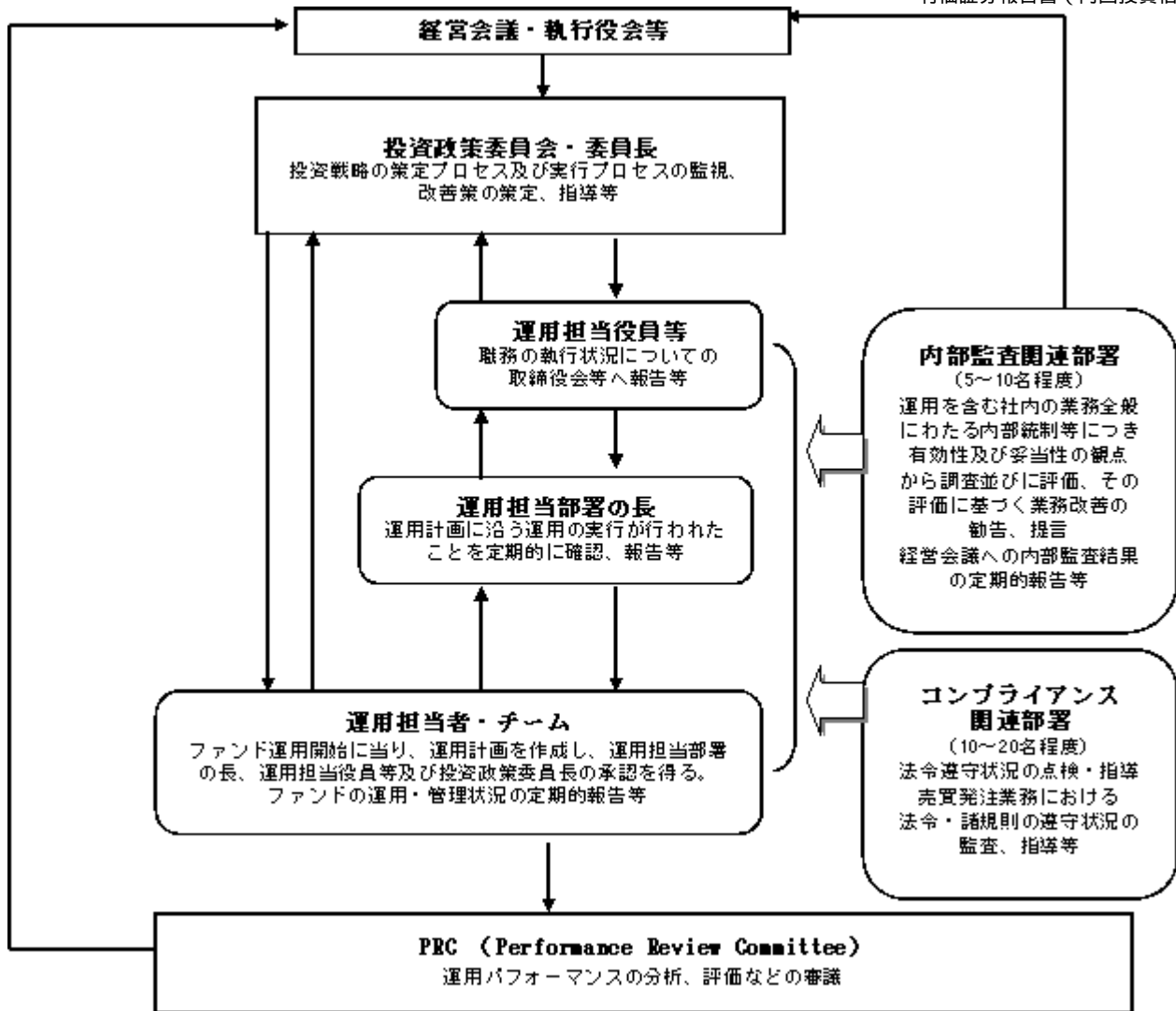
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

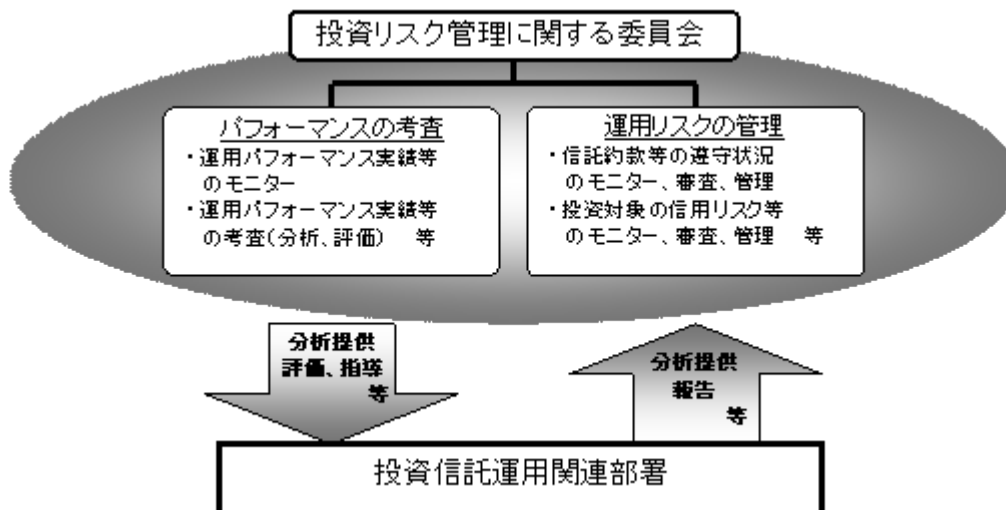
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（平成23年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

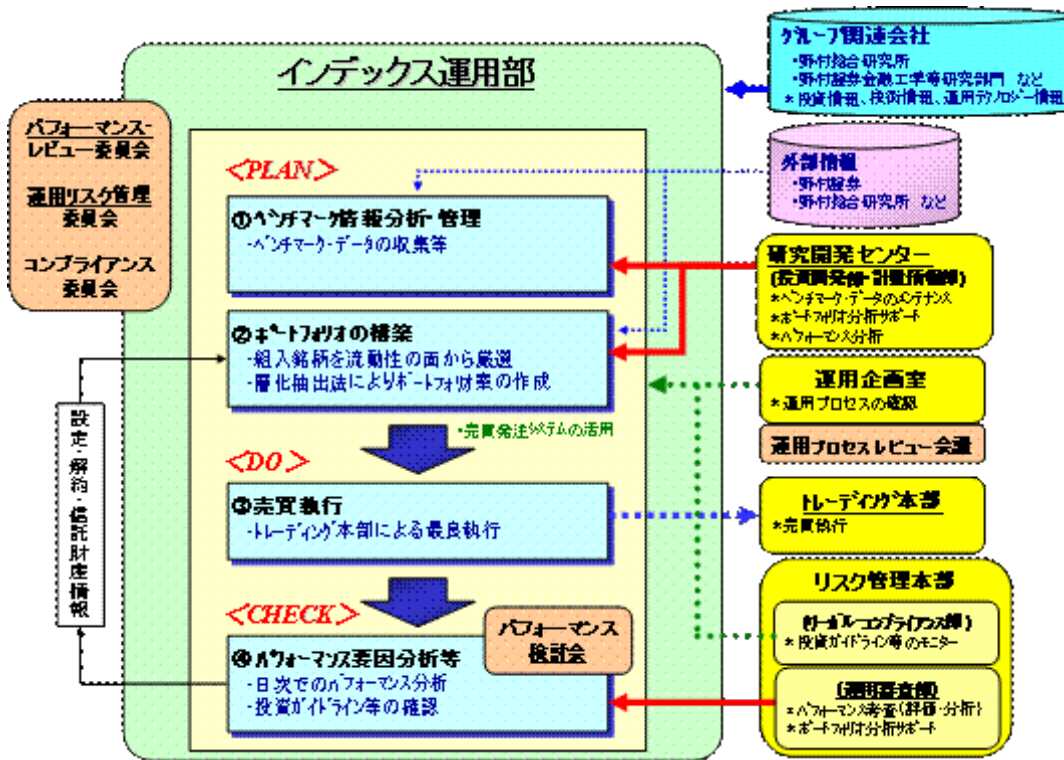


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



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・解約等の資金流入入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。

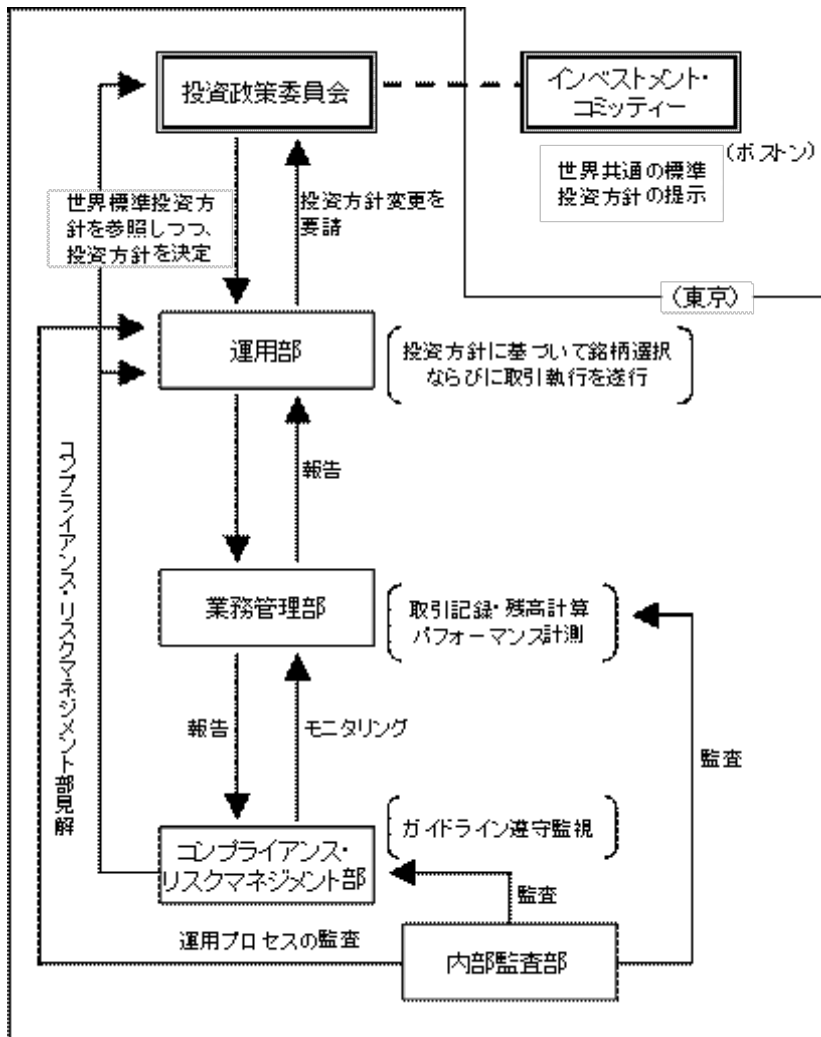


(ご参考)

「日立外国株式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、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に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。(平成23年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。)

基本的には、インデックスに採用されている銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れます。



運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル／プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関わる運用担当者との意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

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、受託資産の毎月末のパフォーマンス、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、同一戦略の受託資産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。

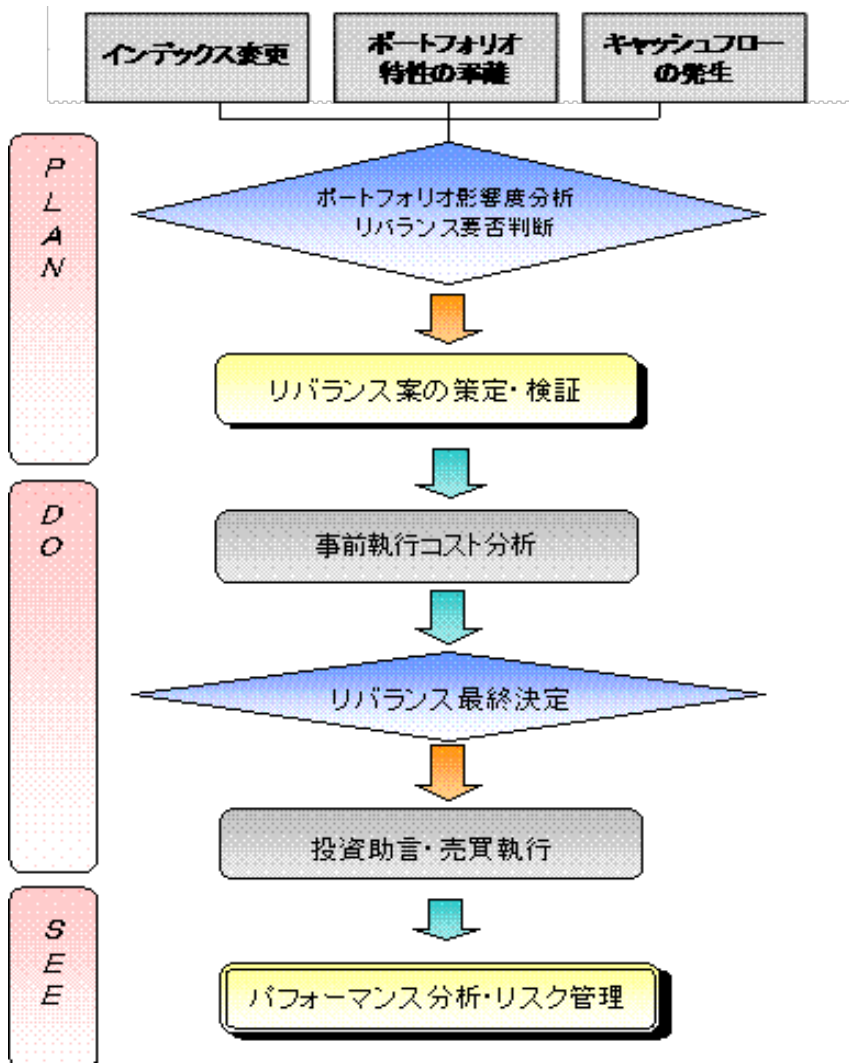
（ご参考）

「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。（平成23年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

債券運用部が、三菱UFJ信託銀行パッシブ運用部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グループ）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グループ）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信託銀行のパッシブ運用部においては、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。受託財産企画部および投資企画部においては、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、月次で開催されるパッシブ運用会議では、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

より行うものとしします。

- 二．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します。
- 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。
- 八．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します。
- 二．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します。
- 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します。
- 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します。
- 八．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します。
- 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します。
- 八．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します。
- 二．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。

[次へ](#)

（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。

(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. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図（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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことの指図をすることができます。

- ロ．金利先渡し取引および為替先渡し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．金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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、金利先渡し取引および為替先渡し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。）

[次へ](#)

（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、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。

(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。
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. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図（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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡し取引および為替先渡し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．金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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、金利先渡し取引および為替先渡し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。）

[次へ](#)

（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

東京都港区赤坂九丁目7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。

(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す。)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. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図（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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことの指図をすることができます。
 - ロ. 金利先渡し取引および為替先渡し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. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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、金利先渡し取引および為替先渡し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たときは、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たときは、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たときは、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。）

[次へ](#)

（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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース（為替ヘッジなし））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

東京都中央区日本橋室町三丁目2番15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す。）
 - 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。

(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
す。)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。
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。

- 二．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。
- 二．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。
- 二．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。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す。

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の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。当該マザーファンドの運用再委託先の変更、委託の中止または委託の内容の変更は、当ファンドの受益者に通知されないことがあります。

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。

平成23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)	5,508,192,981
	日立バランスファンド(株式50)	5,360,376,391
	日立バランスファンド(株式30)	1,385,516,831
	日立国内株式インデックスファンド	9,158,091,459
	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)	21,209,411,229
	合計	42,621,588,891

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)	1,662,332,956
	日立バランスファンド(株式50)	4,354,030,342
	日立バランスファンド(株式30)	2,569,810,208
	日立国内債券インデックスファンド	8,151,345,213
	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)	46,426,861,811
	合計	63,164,380,530

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)	3,274,923,421
	日立バランスファンド(株式50)	2,799,194,385
	日立バランスファンド(株式30)	546,901,408
	日立外国株式インデックスファンド	10,840,348,747
	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)	54,528,571,958
	合計	71,989,939,919

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)	712,986,191
	日立バランスファンド(株式50)	920,259,208
	日立バランスファンド(株式30)	358,128,406
	日立外国債券インデックスファンド	6,736,933,498
	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)	11,875,807,011
	合計	20,604,114,314

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、会計基準等は変更になる可能性があり、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。

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	
日立バランスファンド (株式70)	年率0.336% (税抜0.32%)	委託会社	年率0.21% (税抜0.20%)
		販売会社	年率0.0735% (税抜0.07%)
		受託会社	年率0.0525% (税抜0.05%)
日立バランスファンド (株式50)	年率0.3045% (税抜0.29%)	委託会社	年率0.1785% (税抜0.17%)
		販売会社	年率0.0735% (税抜0.07%)
		受託会社	年率0.0525% (税抜0.05%)
日立バランスファンド (株式30)	年率0.273% (税抜0.26%)	委託会社	年率0.147% (税抜0.14%)
		販売会社	年率0.0735% (税抜0.07%)
		受託会社	年率0.0525% (税抜0.05%)

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、その税率は5%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年0.0525% (税抜0.05%) の

率を乗じて得た額とします。

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、その税率は5%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

1. 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。
2. 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。
3. 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

1. 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、10%（所得税7%および地方税3%）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。平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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、7%（所得税7%）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。

平成26年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

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、平成23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】

(1) 【投資状況】（平成23年6月30日現在）

日立バランスファンド（株式70）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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（評価額）	日本	4,160,338,158	40.31
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	2,016,243,642	19.53
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	3,042,076,365	29.47
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	1,006,950,397	9.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		94,811,408	0.91
合計（純資産総額）		10,320,419,970	100.00

(注)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（以下同じ）。

日立バランスファンド（株式50）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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（評価額）	日本	4,048,692,288	30.32
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	5,281,003,401	39.54
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	2,600,171,664	19.47
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	1,299,682,079	9.73
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		123,216,603	0.92
合計（純資産総額）		13,352,766,035	100.00

日立バランスファンド（株式30）

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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（評価額）	日本	1,046,480,862	20.02
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	3,116,922,801	59.64
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	508,016,717	9.72
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	505,784,747	9.67
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		48,943,590	0.93
合計（純資産総額）		5,226,148,717	100.00

（ご参考）

当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っていますので、実質的な運用は、マザーファンドにより行っています。

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	32,030,261,170	99.49
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		163,941,128	0.50
合計（純資産総額）		32,194,202,298	100.00

日立国内債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債	日本	57,280,941,200	74.76
地方債	日本	5,116,747,914	6.67
特殊債	日本	7,520,274,079	9.81
社債	日本	6,217,747,000	8.11
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		475,910,172	0.62
合計（純資産総額）		76,611,620,365	100.00

日立外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	35,130,916,134	52.53
	カナダ	3,759,863,820	5.62
	ユーロ(ドイツ)	2,881,373,548	4.30
	ユーロ(イタリア)	851,132,968	1.27
	ユーロ(フランス)	3,227,677,443	4.82
	ユーロ(オランダ)	814,491,007	1.21
	ユーロ(スペイン)	1,145,875,290	1.71
	ユーロ(ベルギー)	307,521,097	0.45
	ユーロ(オーストリア)	105,942,127	0.15
	ユーロ(ルクセンブルク)	137,220,398	0.20
	ユーロ(フィンランド)	307,439,992	0.45
	ユーロ(アイルランド)	76,650,296	0.11
	ユーロ(ギリシャ)	61,493,137	0.09
	ユーロ(キプロス)	6,660,158	0.00
	ユーロ(ポルトガル)	76,770,980	0.11
	イギリス	6,798,900,433	10.16
	スイス	2,696,753,057	4.03
	スウェーデン	1,002,624,005	1.49
	ノルウェー	292,374,849	0.43
	デンマーク	336,389,536	0.50
	オーストラリア	2,750,682,493	4.11
	ニュージーランド	37,168,522	0.05
	香港	870,339,461	1.30
シンガポール	538,844,386	0.80	
イスラエル	228,204,001	0.34	
小計	64,443,309,138	96.36	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,430,754,894	3.63
合計（純資産総額）		66,874,064,032	100.00

日立外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	10,880,050,976	37.38
	カナダ	879,432,860	3.02
	メキシコ	274,325,304	0.94
	ユーロ(ドイツ)	2,854,247,021	9.80
	ユーロ(イタリア)	2,949,270,702	10.13
	ユーロ(フランス)	2,931,323,732	10.07
	ユーロ(オランダ)	762,068,210	2.61
	ユーロ(スペイン)	1,285,668,441	4.41
	ユーロ(ベルギー)	809,728,414	2.78
	ユーロ(オーストリア)	548,087,611	1.88
	ユーロ(フィンランド)	192,377,815	0.66
	ユーロ(アイルランド)	175,238,090	0.60
	ユーロ(ポルトガル)	236,174,121	0.81
	イギリス	2,246,249,948	7.71
	スイス	159,135,484	0.54
	スウェーデン	194,285,235	0.66
	ノルウェー	83,309,635	0.28
	デンマーク	253,162,516	0.86
	ポーランド	272,102,628	0.93
	オーストラリア	341,525,529	1.17
	シンガポール	113,815,369	0.39
	マレーシア	159,042,837	0.54
	小計	28,600,622,478	98.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		499,499,063	1.71

合計（純資産総額）	29,100,121,541	100.00
-----------	----------------	--------

(2) 【投資資産】（平成23年6月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

1. 日立バランスファンド（株式70）

イ. 上位銘柄

順位	銘柄名	国/地域 種類	数量	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	日立国内株式 TOPIXイン デックスマ ザーファンド	日本/- 親投資 信託受 益証券	5,508,192,981	0.7371	4,060,089,047	0.7553	4,160,338,158	40.31
2	日立外国株式 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	3,274,923,421	0.9446	3,093,709,772	0.9289	3,042,076,365	29.47
3	日立国内債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	1,662,332,956	1.2109	2,012,918,977	1.2129	2,016,243,642	19.53
4	日立外国債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	712,986,191	1.3927	992,975,869	1.4123	1,006,950,397	9.75

(注)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（以下同じ）。

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.08
合計	99.08

2. 日立バランスファンド（株式50）

イ. 上位銘柄

順位	銘柄名	国/地域 種類	数量	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	日立国内債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	4,354,030,342	1.2109	5,272,295,342	1.2129	5,281,003,401	39.54
2	日立国内株式 TOPIXイン デックスマ ザーファンド	日本/- 親投資 信託受 益証券	5,360,376,391	0.7370	3,950,597,401	0.7553	4,048,692,288	30.32
3	日立外国株式 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	2,799,194,385	0.9446	2,644,387,745	0.9289	2,600,171,664	19.47
4	日立外国債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	920,259,208	1.3931	1,282,092,399	1.4123	1,299,682,079	9.73

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
----	---------

親投資信託受益証券	99.07
合計	99.07

3. 日立バランスファンド（株式30）

イ. 上位銘柄

順位	銘柄名	国/地域 種類	数量	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	日立国内債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	2,569,810,208	1.2109	3,111,783,181	1.2129	3,116,922,801	59.64
2	日立国内株式 TOPIXイン デックスマ ザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	1,385,516,831	0.7371	1,021,304,288	0.7553	1,046,480,862	20.02
3	日立外国株式 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	546,901,408	0.9441	516,377,838	0.9289	508,016,717	9.72
4	日立外国債券 インデックス マザーファン ド	日本/- 親投資 信託受 益証券	358,128,406	1.3930	498,897,438	1.4123	505,784,747	9.67

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.06
合計	99.06

【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。

[次へ](#)

(ご参考)

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄(平成23年6月30日現在)

イ.上位銘柄(上位30銘柄)

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	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 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	359,900	3,347.21	1,204,663,850	3,300.00	1,187,670,000	3.68
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	2,092,500	383.65	802,788,349	390.00	816,075,000	2.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	236,300	3,121.76	737,672,148	3,085.00	728,985,500	2.26
日本	株式	キヤノン	電気機器	174,000	3,630.01	631,621,924	3,810.00	662,940,000	2.05
日本	株式	三井住友フィ ナンシャルグ ループ	銀行業	210,800	2,576.53	543,134,255	2,468.00	520,254,400	1.61
日本	株式	みずほフィナ ンシャルグ ループ	銀行業	3,411,200	137.42	468,793,980	132.00	450,278,400	1.39
日本	株式	三菱商事	卸売業	215,700	2,296.47	495,348,636	2,000.00	431,400,000	1.33
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	109,900	3,875.63	425,932,776	3,715.00	408,278,500	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	103,800	3,738.18	388,023,660	3,865.00	401,187,000	1.24
日本	株式	ファナック	電気機器	29,200	12,597.40	367,844,240	13,380.00	390,696,000	1.21
日本	株式	ソフトバンク	情報・通 信業	123,300	3,306.24	407,660,360	3,030.00	373,599,000	1.16
日本	株式	小松製作所	機械	139,000	2,808.26	390,349,020	2,497.00	347,083,000	1.07
日本	株式	ソニー	電気機器	157,300	2,640.29	415,317,772	2,117.00	333,004,100	1.03
日本	株式	三井物産	卸売業	238,600	1,485.57	354,459,328	1,384.00	330,222,400	1.02
日本	株式	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	情報・通 信業	2,278	146,215.85	333,079,724	143,000.00	325,754,000	1.01
日本	株式	パナソニック	電気機器	326,200	1,045.03	340,890,159	980.00	319,676,000	0.99
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	353,900	740.96	262,225,830	842.00	297,983,800	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	629,000	434.28	273,164,910	473.00	297,517,000	0.92
日本	株式	三菱地所	不動産業	193,000	1,406.23	271,402,650	1,406.00	271,358,000	0.84
日本	株式	三菱電機	電気機器	280,000	978.58	274,004,600	930.00	260,400,000	0.80
日本	株式	セブン&アイ ・ホールディ ングス	小売業	115,700	2,123.13	245,646,485	2,157.00	249,564,900	0.77
日本	株式	KDDI	情報・通 信業	429	517,611.96	222,055,534	577,000.00	247,533,000	0.76
日本	株式	任天堂	その他製 品	16,000	22,260.98	356,175,782	15,070.00	241,120,000	0.74
日本	株式	東京海上ホー ルディングス	保険業	105,000	2,222.88	233,403,184	2,245.00	235,725,000	0.73
日本	株式	東芝	電気機器	553,000	407.21	225,192,000	422.00	233,366,000	0.72
日本	株式	野村ホール ディングス	証券・商 品先物取 引業	582,200	433.34	252,293,288	396.00	230,551,200	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄 道	陸運業	48,700	4,626.07	225,289,963	4,600.00	224,020,000	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	48,900	4,135.80	202,240,952	4,295.00	210,025,500	0.65
日本	株式	アステラス製 薬	医薬品	65,100	3,080.62	200,548,708	3,115.00	202,786,500	0.62
日本	株式	日本たばこ産 業	食料品	652	300,884.37	196,176,610	309,500.00	201,794,000	0.62

ロ.業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.67
		建設業	2.21

	食料品	3.11
	繊維製品	0.94
	パルプ・紙	0.36
	化学	6.06
	医薬品	4.65
	石油・石炭製品	0.91
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	1.33
	鉄鋼	2.23
	非鉄金属	1.38
	金属製品	0.74
	機械	5.40
	電気機器	14.59
	輸送用機器	10.43
	精密機器	1.49
	その他製品	1.74
	電気・ガス業	3.21
	陸運業	3.39
	海運業	0.51
	空運業	0.30
	倉庫・運輸関連業	0.22
	情報・通信業	5.95
	卸売業	5.31
	小売業	3.75
	銀行業	9.07
	証券、商品先物取引業	1.29
	保険業	2.52
	その他金融業	0.75
	不動産業	2.31
	サービス業	1.71
	合計	99.49

投資不動産物件(平成23年6月30日現在)

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)(平成23年6月30日現在)

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	評価額	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物	買建	19	日本円	154,101,970	161,405,000	0.50

(注)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。

[次へ](#)

(ご参考)

日立国内債券インデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄(平成23年6月30日現在)

イ.上位銘柄(上位30銘柄)

国/地域	種類	銘柄名	数量	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 (%)
日本	国債 証券	第301回利付 国債(2年)	1,750,000,000	100.02	1,750,471,000	100.09	1,751,680,000	0.2	2013/2/15	2.28
日本	国債 証券	第300回利付 国債(2年)	1,500,000,000	100.04	1,500,660,000	100.09	1,501,365,000	0.2	2013/1/15	1.95
日本	国債 証券	第304回利付 国債(2年)	1,500,000,000	100.06	1,500,981,000	100.07	1,501,110,000	0.2	2013/5/15	1.95
日本	国債 証券	第313回利付 国債(10年)	1,100,000,000	100.48	1,105,384,500	101.79	1,119,778,000	1.3	2021/3/20	1.46
日本	国債 証券	第89回利付国 債(5年)	1,050,000,000	99.84	1,048,372,500	100.25	1,052,656,500	0.4	2015/6/20	1.37
日本	国債 証券	第312回利付 国債(10年)	940,000,000	99.82	938,364,400	101.16	950,904,000	1.2	2020/12/20	1.24
日本	国債 証券	第299回利付 国債(2年)	880,000,000	100.05	880,519,200	100.08	880,756,800	0.2	2012/12/15	1.14
日本	国債 証券	第311回利付 国債(10年)	880,000,000	96.60	850,088,800	97.98	862,241,600	0.8	2020/9/20	1.12
日本	国債 証券	第80回利付国 債(5年)	700,000,000	101.51	710,584,000	101.48	710,367,000	0.8	2013/12/20	0.92
日本	国債 証券	第94回利付国 債(5年)	700,000,000	100.59	704,161,000	100.96	706,748,000	0.6	2015/12/20	0.92
日本	国債 証券	第302回利付 国債(2年)	700,000,000	100.02	700,182,000	100.08	700,588,000	0.2	2013/3/15	0.91
日本	国債 証券	第297回利付 国債(10年)	630,000,000	103.82	654,082,600	104.66	659,395,800	1.4	2018/12/20	0.86
日本	国債 証券	第96回利付国 債(5年)	650,000,000	100.28	651,878,000	100.43	652,847,000	0.5	2016/3/20	0.85
日本	国債 証券	第300回利付 国債(10年)	580,000,000	104.18	604,261,400	105.23	610,357,200	1.5	2019/3/20	0.79
日本	国債 証券	第244回利付 国債(10年)	600,000,000	101.41	608,484,000	101.24	607,470,000	1	2012/12/20	0.79
日本	国債 証券	第245回利付 国債(10年)	580,000,000	101.23	587,163,000	101.10	586,380,000	0.9	2012/12/20	0.76
日本	国債 証券	第125回利付 国債(20年)	550,000,000	101.94	560,700,900	105.20	578,633,000	2.2	2031/3/20	0.75
日本	国債 証券	第35回利付国 債(20年)	495,000,000	115.62	572,348,700	115.66	572,536,800	3.3	2017/3/20	0.74
日本	国債 証券	第82回利付国 債(5年)	550,000,000	101.84	560,158,500	101.84	560,136,500	0.9	2014/3/20	0.73
日本	国債 証券	第297回利付 国債(2年)	550,000,000	99.91	549,538,000	99.96	549,785,500	0.1	2012/10/15	0.71
日本	国債 証券	第314回利付 国債(10年)	550,000,000	99.67	548,224,500	99.95	549,758,000	1.1	2021/3/20	0.71
日本	国債 証券	第287回利付 国債(10年)	490,000,000	107.52	526,862,700	107.91	528,773,700	1.9	2017/6/20	0.69
日本	国債 証券	第81回利付国 債(5年)	500,000,000	101.55	507,770,000	101.57	507,870,000	0.8	2014/3/20	0.66
日本	国債 証券	第295回利付 国債(10年)	480,000,000	104.77	502,896,000	105.55	506,654,400	1.5	2018/6/20	0.66
日本	国債 証券	第95回利付国 債(5年)	500,000,000	100.29	501,487,000	100.90	504,500,000	0.6	2016/3/20	0.65
日本	国債 証券	第87回利付国 債(5年)	500,000,000	100.49	502,470,000	100.71	503,595,000	0.5	2014/12/20	0.65
日本	国債 証券	第88回利付国 債(5年)	500,000,000	100.40	502,000,000	100.67	503,385,000	0.5	2015/3/20	0.65
日本	国債 証券	第288回利付 国債(10年)	470,000,000	106.42	500,188,300	106.77	501,856,600	1.7	2017/9/20	0.65
日本	国債 証券	第254回利付 国債(10年)	480,000,000	102.84	493,675,200	102.69	492,945,600	1.4	2013/9/20	0.64
日本	国債 証券	第293回利付 国債(10年)	450,000,000	106.88	480,996,000	107.58	484,128,000	1.8	2018/6/20	0.63

□.種類別投資比率

国内 / 外国	種類	投資比率 (%)
国内	国債証券	74.76
	地方債証券	6.67
	特殊債証券	9.81
	社債証券	8.11
	合計	99.37

投資不動産物件（平成23年6月30日現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの（平成23年6月30日現在）

該当事項はありません。

[次へ](#)

（ご参考）

日立外国株式インデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄（平成23年6月30日現在）

イ.上位銘柄（上位30銘柄）

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	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 （%）
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	173,322	6,833.79	1,184,446,930	6,478.58	1,122,880,876	1.67
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	32,170	28,164.07	906,038,166	26,967.04	867,529,972	1.29
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	42,605	13,233.26	563,803,110	13,767.69	586,572,611	0.87
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	70,303	8,721.81	613,169,943	8,176.33	574,820,837	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	372,202	1,622.93	604,061,193	1,498.34	557,688,420	0.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	264,456	2,065.88	546,334,546	2,068.30	546,975,032	0.81
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	206,494	2,479.67	512,038,722	2,523.61	521,112,346	0.77
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	95,961	4,822.32	462,755,596	5,353.20	513,699,029	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	97,818	5,011.58	490,222,870	5,049.66	493,947,788	0.73
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	279,869	1,639.94	458,969,543	1,668.68	467,014,349	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	139,318	3,734.74	520,316,644	3,265.52	454,946,899	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	175,038	2,556.37	447,461,894	2,266.09	396,652,053	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	72,214	5,338.67	385,527,069	5,385.49	388,908,374	0.58
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	141,356	2,677.67	378,506,095	2,618.07	370,080,454	0.55
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	8,790	46,622.08	409,808,132	40,168.82	353,083,981	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	101,505	3,597.20	365,133,918	3,350.29	340,071,693	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	62,862	5,314.45	334,077,326	5,341.90	335,802,775	0.50
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	191,957	1,659.80	318,611,917	1,726.81	331,474,169	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	354,036	1,078.45	381,812,228	899.33	318,395,974	0.47
アメリカ	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	47,697	7,537.35	359,509,423	6,879.00	328,107,820	0.49
ドイツ	株式	SIEMENS AG	資本財	28,751	11,270.68	324,043,377	10,912.85	313,755,522	0.46
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	73,850	5,007.66	369,815,829	4,570.19	337,509,018	0.50
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	617,808	851.99	526,371,402	794.77	491,016,944	0.73
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,810,785	231.00	418,306,545	214.65	388,696,082	0.58
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	656,586	594.98	390,661,413	583.16	382,898,913	0.57
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	124,649	2,918.87	363,834,798	2,820.11	351,525,063	0.52
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	121,035	5,160.95	624,656,670	5,019.74	607,565,441	0.90

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	81,616	4,899.18	399,852,105	4,903.34	400,191,813	0.59
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエン ス	24,551	12,816.82	314,665,988	13,580.00	333,402,580	0.49
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	112,194	3,948.17	442,961,601	3,731.18	418,616,065	0.62

ロ.業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	11.76
		素材	8.06
		資本財	7.75
		商業・専門サービス	0.78
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	1.48
		耐久消費財・アパレル	1.26
		消費者サービス	1.49
		メディア	2.68
		小売	2.71
		食品・生活必需品小売り	2.06
		食品・飲料・タバコ	6.25
		家庭用品・パーソナル用品	1.62
		ヘルスケア機器・サービス	2.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.86
		銀行	8.11
		各種金融	4.79
		保険	3.88
		不動産	2.17
		ソフトウェア・サービス	4.13
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.81		
電気通信サービス	4.01		
公益事業	3.72		
半導体・半導体製造装置	1.49		
	合計	96.36	

投資不動産物件（平成23年6月30日現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの（平成23年6月30日現在）

（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	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	245	ドル	15,516,577.5	15,977,675	1,289,877,702	1.92
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE 601109	買建	13	カナダドル	1,928,030	1,967,160	164,021,800	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 1109	買建	117	ユーロ	3,240,274.84	3,280,680	383,314,651	0.57
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1109	買建	13	オーストラリアドル	1,480,500	1,468,675	126,996,327	0.18
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1109	買建	38	ポンド	2,194,510	2,214,640	287,415,979	0.42
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI 1109	買建	20	スイスフラン	1,244,360	1,220,400	118,378,800	0.17

(注)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。

[次へ](#)

（ご参考）

日立外国債券インデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄（平成23年6月30日現在）

イ. 上位銘柄（上位30銘柄）

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	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 （%）
アメリカ	国債 証券	3.625% US TREASURY N/B	2,280,000	8,314.04	189,560,326	8,566.20	195,309,583	3.625	2020/2/15	0.67
アメリカ	国債 証券	2.625% US TREASURY N/B	2,400,000	7,599.54	182,389,179	7,838.37	188,121,081	2.625	2020/8/15	0.64
アメリカ	国債 証券	3.50% US TREASURY N/B	2,180,000	8,193.81	178,625,142	8,453.94	184,295,994	3.5	2020/5/15	0.63
アメリカ	国債 証券	3.375% US TREASURY N/B	1,960,000	8,160.03	159,936,725	8,442.59	165,474,803	3.375	2019/11/15	0.56
アメリカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	1,680,000	7,886.31	132,490,039	8,178.95	137,406,496	2.75	2019/2/15	0.47
アメリカ	国債 証券	3.750% US TREASURY N/B	1,530,000	8,482.95	129,789,242	8,776.86	134,286,029	3.75	2018/11/15	0.46
アメリカ	国債 証券	1.375% US TREASURY N/B	1,490,000	8,170.75	121,744,308	8,187.78	121,998,040	1.375	2012/11/15	0.41
アメリカ	国債 証券	1.375% US TREASURY N/B	1,400,000	8,166.34	114,328,816	8,201.66	114,823,288	1.375	2013/2/15	0.39
アメリカ	国債 証券	2.5% US TREASURY N/B	1,300,000	8,308.25	108,007,279	8,483.58	110,286,640	2.5	2015/3/31	0.37
アメリカ	国債 証券	4.375% US TREASURY N/B	1,360,000	7,967.19	108,353,862	8,083.09	109,930,041	4.375	2040/5/15	0.37
アメリカ	国債 証券	1.125% US TREASURY N/B	1,340,000	8,134.80	109,006,438	8,163.82	109,395,204	1.125	2012/12/15	0.37
アメリカ	国債 証券	3.875% US TREASURY N/B	1,470,000	7,208.93	105,971,369	7,401.93	108,808,398	3.875	2040/8/15	0.37
アメリカ	国債 証券	1.375% US TREASURY N/B	1,300,000	8,164.93	106,144,180	8,205.44	106,670,819	1.375	2013/3/15	0.36
アメリカ	国債 証券	1.375% US TREASURY N/B	1,300,000	8,170.75	106,219,866	8,184.00	106,392,048	1.375	2012/10/15	0.36
アメリカ	国債 証券	0.625% US TREASURY N/B	1,300,000	8,095.65	105,243,524	8,103.90	105,350,757	0.625	2013/1/31	0.36
アメリカ	国債 証券	4.25% US TREASURY N/B	1,330,000	7,724.13	102,731,023	7,903.97	105,122,821	4.25	2040/11/15	0.36
アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,210,000	8,223.73	99,507,230	8,384.56	101,453,264	2.125	2014/11/30	0.34
アメリカ	国債 証券	2.375% US TREASURY N/B	1,200,000	8,303.20	99,638,479	8,453.31	101,439,767	2.375	2014/10/31	0.34
アメリカ	国債 証券	0.625% US TREASURY N/B	1,220,000	8,105.37	98,885,547	8,100.75	98,829,161	0.625	2013/4/30	0.33
ドイツ	国債 証券	4.25% DEUTSCHLAND REP	810,000	12,380.36	100,280,967	12,428.27	100,668,993	4.25	2014/1/4	0.34
イタリア	国債 証券	6.00% BUONI POLIENNALI	910,000	12,437.06	113,177,299	12,309.09	112,012,755	6	2031/5/1	0.38
イタリア	国債 証券	6.50% BUONI POLIENNALI	790,000	13,157.14	103,941,448	13,046.35	103,066,199	6.5	2027/11/1	0.35
フランス	国債 証券	4.00% FRANCE GOV'T	910,000	12,233.90	111,328,575	12,264.69	111,608,722	4	2013/10/25	0.38
フランス	国債 証券	3.00% FRANCE GOV'T	900,000	11,785.65	106,070,857	11,943.38	107,490,463	3	2015/10/25	0.36
フランス	国債 証券	4.25% FRANCE GOV'T	830,000	12,144.16	100,796,559	12,346.48	102,475,807	4.25	2023/10/25	0.35
フランス	国債 証券	3.75% FRANCE GOV'T	850,000	11,716.71	99,592,079	12,028.67	102,243,763	3.75	2021/4/25	0.35
フランス	国債 証券	3.75% FRANCE GOV'T	840,000	12,080.81	101,478,811	12,064.89	101,345,146	3.75	2013/1/12	0.34
イギリス	国債 証券	4.50% UK TREASURY	1,000,000	13,763.16	137,631,690	13,782.63	137,826,360	4.5	2013/3/7	0.47
イギリス	国債 証券	2.75% UK TREASURY	950,000	13,262.71	125,995,809	13,488.16	128,137,569	2.75	2015/1/22	0.44
イギリス	国債 証券	3.75% UK TREASURY	780,000	13,101.16	102,189,057	13,421.06	104,684,337	3.75	2020/9/7	0.35

□.種類別投資比率

国内 / 外国	種類	投資比率 (%)
外国	国債証券	98.28
	合計	98.28

投資不動産物件（平成23年6月30日現在）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの（平成23年6月30日現在）

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年6月30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。

1. 日立バランスファンド（株式70）

期	年月日	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
1期	（平成14年5月15日）	824,957,456	（同左）	1.0425	（同左）
2期	（平成15年5月15日）	1,654,708,771	（同左）	0.8980	（同左）
3期	（平成16年5月17日）	3,043,602,596	（同左）	1.0493	（同左）
4期	（平成17年5月16日）	4,337,258,806	（同左）	1.1095	（同左）
5期	（平成18年5月15日）	5,967,972,636	（同左）	1.4006	（同左）
6期	（平成19年5月15日）	7,952,582,586	（同左）	1.5762	（同左）
7期	（平成20年5月15日）	8,796,702,937	（同左）	1.4088	（同左）
8期	（平成21年5月15日）	7,514,498,384	（同左）	1.0030	（同左）
9期	（平成22年5月17日）	9,225,602,031	（同左）	1.0903	（同左）
10期	（平成23年5月16日）	9,981,783,949	（同左）	1.0860	（同左）
	平成22年 6月末日	8,945,685,337	（同左）	1.0195	（同左）
	平成22年 7月末日	9,218,063,541	（同左）	1.0441	（同左）
	平成22年 8月末日	8,861,179,830	（同左）	1.0017	（同左）
	平成22年 9月末日	9,304,193,787	（同左）	1.0468	（同左）
	平成22年10月末日	9,208,869,689	（同左）	1.0333	（同左）
	平成22年11月末日	9,464,346,936	（同左）	1.0629	（同左）
	平成22年12月末日	9,834,077,324	（同左）	1.0895	（同左）
	平成23年 1月末日	10,037,007,731	（同左）	1.1035	（同左）
	平成23年 2月末日	10,329,796,797	（同左）	1.1324	（同左）
	平成23年 3月末日	10,127,553,185	（同左）	1.1124	（同左）
	平成23年 4月末日	10,191,011,743	（同左）	1.1145	（同左）
	平成23年 5月末日	10,037,484,879	（同左）	1.0936	（同左）
	平成23年 6月末日	10,320,419,970	（同左）	1.0925	（同左）

2. 日立バランスファンド（株式50）

期	年月日	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
1期	（平成14年5月15日）	1,138,871,233	（同左）	1.0340	（同左）
2期	（平成15年5月15日）	2,366,767,262	（同左）	0.9439	（同左）
3期	（平成16年5月17日）	4,167,344,407	（同左）	1.0503	（同左）
4期	（平成17年5月16日）	5,813,706,184	（同左）	1.1002	（同左）
5期	（平成18年5月15日）	7,525,748,822	（同左）	1.2949	（同左）
6期	（平成19年5月15日）	9,511,032,546	（同左）	1.4211	（同左）
7期	（平成20年5月15日）	10,707,119,419	（同左）	1.3181	（同左）
8期	（平成21年5月15日）	9,992,837,733	（同左）	1.0486	（同左）
9期	（平成22年5月17日）	11,843,460,727	（同左）	1.1195	（同左）
10期	（平成23年5月16日）	12,815,240,356	（同左）	1.1195	（同左）
	平成22年 6月末日	11,775,138,896	（同左）	1.0707	（同左）
	平成22年 7月末日	12,030,415,163	（同左）	1.0897	（同左）
	平成22年 8月末日	11,735,429,862	（同左）	1.0598	（同左）
	平成22年 9月末日	12,149,550,234	（同左）	1.0938	（同左）
	平成22年10月末日	12,045,300,513	（同左）	1.0815	（同左）
	平成22年11月末日	12,264,123,186	（同左）	1.1009	（同左）
	平成22年12月末日	12,634,605,510	（同左）	1.1213	（同左）
	平成23年 1月末日	12,789,313,510	（同左）	1.1304	（同左）
	平成23年 2月末日	13,089,507,544	（同左）	1.1515	（同左）
	平成23年 3月末日	12,925,988,705	（同左）	1.1373	（同左）
	平成23年 4月末日	13,014,273,820	（同左）	1.1396	（同左）
	平成23年 5月末日	12,886,115,221	（同左）	1.1253	（同左）
	平成23年 6月末日	13,352,766,035	（同左）	1.1258	（同左）

3. 日立バランスファンド（株式30）

期	年月日	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
1期	（平成14年5月15日）	396,155,985	（同左）	1.0254	（同左）
2期	（平成15年5月15日）	853,065,745	（同左）	0.9899	（同左）
3期	（平成16年5月17日）	1,528,300,100	（同左）	1.0483	（同左）
4期	（平成17年5月16日）	2,170,984,245	（同左）	1.0877	（同左）
5期	（平成18年5月15日）	2,728,426,299	（同左）	1.1929	（同左）
6期	（平成19年5月15日）	3,360,090,941	（同左）	1.2761	（同左）
7期	（平成20年5月15日）	3,922,794,405	（同左）	1.2262	（同左）
8期	（平成21年5月15日）	3,974,772,532	（同左）	1.0839	（同左）
9期	（平成22年5月17日）	4,585,652,650	（同左）	1.1345	（同左）
10期	（平成23年5月16日）	5,018,619,209	（同左）	1.1371	（同左）
	平成22年 6月末日	4,640,924,155	（同左）	1.1096	（同左）
	平成22年 7月末日	4,719,150,071	（同左）	1.1221	（同左）
	平成22年 8月末日	4,663,255,897	（同左）	1.1059	（同左）
	平成22年 9月末日	4,763,791,130	（同左）	1.1271	（同左）
	平成22年10月末日	4,738,469,189	（同左）	1.1162	（同左）
	平成22年11月末日	4,806,574,217	（同左）	1.1245	（同左）
	平成22年12月末日	4,934,435,382	（同左）	1.1380	（同左）
	平成23年 1月末日	4,969,508,077	（同左）	1.1418	（同左）
	平成23年 2月末日	5,027,411,737	（同左）	1.1544	（同左）
	平成23年 3月末日	5,010,534,460	（同左）	1.1455	（同左）
	平成23年 4月末日	5,034,572,954	（同左）	1.1481	（同左）
	平成23年 5月末日	5,023,511,662	（同左）	1.1410	（同左）
	平成23年 6月末日	5,226,148,717	（同左）	1.1431	（同左）

【分配の推移】

期	1口当たり分配金（円）		
	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）
1期	0	0	0
2期	0	0	0
3期	0	0	0
4期	0	0	0
5期	0	0	0
6期	0	0	0
7期	0	0	0
8期	0	0	0
9期	0	0	0
10期	0	0	0

【収益率の推移】

期	収益率（％）		
	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）
1期	4.25	3.40	2.54
2期	13.86	8.71	3.46
3期	16.85	11.27	5.90
4期	5.74	4.75	3.76
5期	26.24	17.70	9.67
6期	12.54	9.75	6.97
7期	10.62	7.25	3.91
8期	28.80	20.45	11.60
9期	8.70	6.76	4.67
10期	0.39	0	0.23

(4) 【設定及び解約の実績】

下記決算期中の設定及び解約の実績及び当該決算期末の発行済み口数は次のとおりです。

日立バランスファンド（株式70）

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
1期	793,773,425	2,446,397	791,327,028
2期	1,132,451,158	81,138,864	1,842,639,322
3期	1,194,469,772	136,578,719	2,900,530,375
4期	1,162,297,934	153,730,257	3,909,098,052
5期	1,198,702,047	846,715,091	4,261,085,008
6期	1,141,150,858	356,787,366	5,045,448,500
7期	1,925,543,368	726,870,391	6,244,121,477
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

(注1)設定口数には、当初自己設定の口数を含みません（以下同じ）。

(注2)本邦外における受益証券の発行はありません（以下同じ）。

日立バランスファンド（株式50）

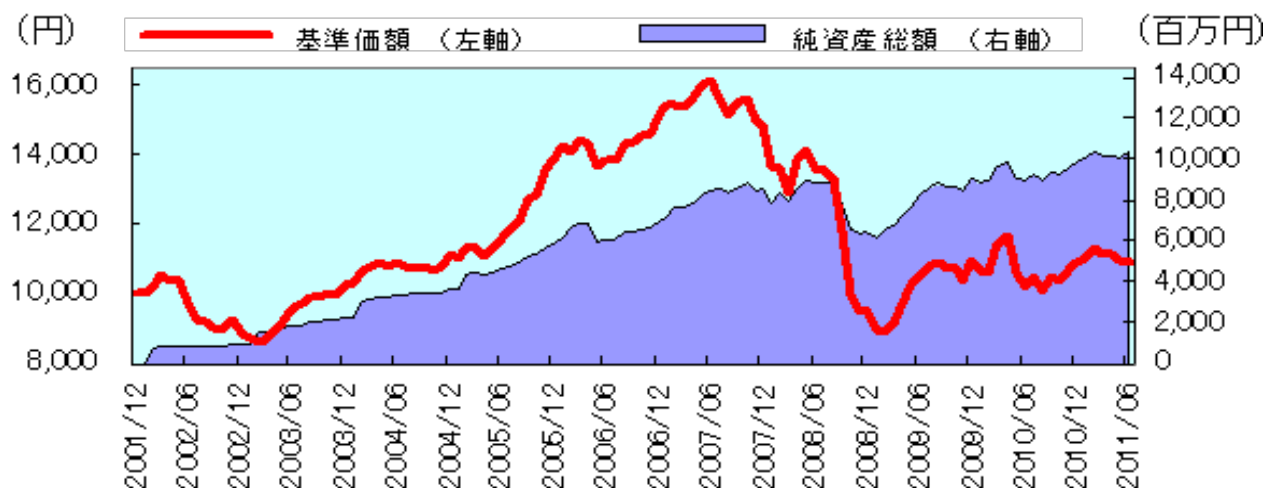
期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
1期	1,103,560,899	2,176,747	1,101,384,152
2期	1,487,396,376	81,386,486	2,507,394,042
3期	1,619,091,839	158,826,005	3,967,659,876
4期	1,526,874,373	210,133,661	5,284,400,588
5期	1,434,455,552	906,909,247	5,811,946,893
6期	1,286,976,301	406,245,246	6,692,677,948
7期	2,108,694,765	678,289,390	8,123,083,323
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

日立バランスファンド（株式30）

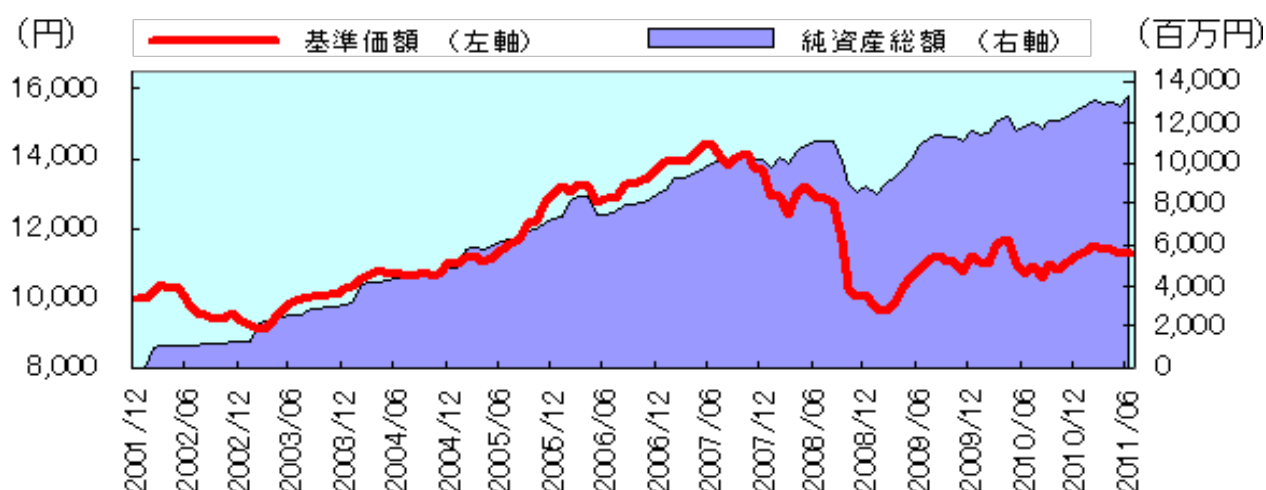
期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
1期	389,094,409	2,760,026	386,334,383
2期	512,838,283	37,383,630	861,789,036
3期	660,403,814	64,314,401	1,457,878,449
4期	628,049,359	89,946,386	1,995,981,422
5期	659,583,722	368,307,319	2,287,257,825
6期	597,181,917	251,325,554	2,633,114,188
7期	941,530,654	375,461,591	3,199,183,251
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

◆基準価額・純資産の推移(当初設定日(2001年12月5日)～2011年6月末)

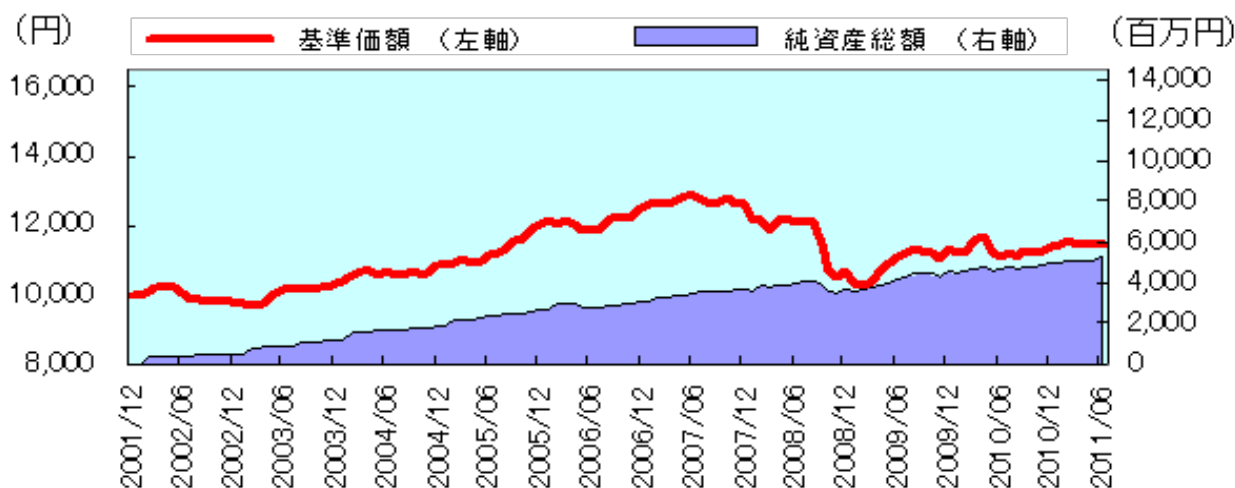
日立バランスファンド(株式70)



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、それぞれの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TOPX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	3.7%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.5%
本田技研工業	輸送用機器	2.3%
キヤノン	電気機器	2.1%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.6%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.4%
三菱商事	卸売業	1.3%
武田薬品工業	医薬品	1.3%
日本電信電話	情報・通信業	1.2%
ファナック	電気機器	1.2%
合計		18.6%

○組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	14.6%
輸送用機器	10.4%
銀行業	9.1%
化学	6.1%
情報・通信業	6.0%
機械	5.4%
卸売業	5.3%
医薬品	4.7%
小売業	3.8%
陸運業	3.4%
合計	68.8%

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	発行国	組入比率
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	1.7%
APPLE INC	アメリカ	1.3%
NESTLE SA-REGISTERED	スイス	0.9%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	0.9%
CHEVRON CORP	アメリカ	0.9%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	0.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%
AT&T INC	アメリカ	0.8%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	0.7%
合計		9.6%

○組入上位10ヶ国

発行国	組入比率
アメリカ	52.5%
イギリス	10.2%
カナダ	5.6%
フランス	4.8%
ドイツ	4.3%
オーストラリア	4.1%
スイス	4.0%
スペイン	1.7%
スウェーデン	1.5%
香港	1.3%
合計	90.0%

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	残存年数	組入比率
第301回利付国債(2年)	1.6年	2.3%
第300回利付国債(2年)	1.5年	2.0%
第304回利付国債(2年)	1.9年	2.0%
第313回利付国債(10年)	9.7年	1.5%
第89回利付国債(5年)	4.0年	1.4%
第312回利付国債(10年)	9.5年	1.2%
第299回利付国債(2年)	1.5年	1.1%
第311回利付国債(10年)	9.2年	1.1%
第80回利付国債(5年)	2.5年	0.9%
第94回利付国債(5年)	4.5年	0.9%
合計		14.4%

○債券種別構成比(NOMURA-BPIに準拠)

債券種別	組入比率
国債	74.8%
地方債	7.2%
政保債	4.6%
金融債	1.3%
事業債	9.1%
その他(円建外債、MBS、ABS)	2.4%
合計	99.4%

○残存年数別構成比

残存年数	組入比率
1年未満	0.0%
1年以上3年未満	25.8%
3年以上7年未満	34.3%
7年以上	39.3%
合計	99.4%

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	残存年数	組入比率
米国債 3.625%	8.6年	0.7%
米国債 2.625%	9.1年	0.6%
米国債 3.500%	8.9年	0.6%
米国債 3.375%	8.4年	0.6%
英国債 4.500%	1.7年	0.5%
米国債 2.750%	7.6年	0.5%
米国債 3.750%	7.4年	0.5%
英国債 2.750%	3.6年	0.4%
米国債 1.375%	1.4年	0.4%
米国債 1.375%	1.6年	0.4%
合計		5.2%

○組入上位5ヶ国

発行国	組入比率
アメリカ	37.4%
イタリア	10.1%
フランス	10.1%
ドイツ	9.8%
イギリス	7.7%
合計	75.1%

○残存年数別構成比

残存年数	組入比率
1年未満	1.4%
1年以上3年未満	27.2%
3年以上7年未満	32.1%
7年以上	36.8%
合計	97.4%

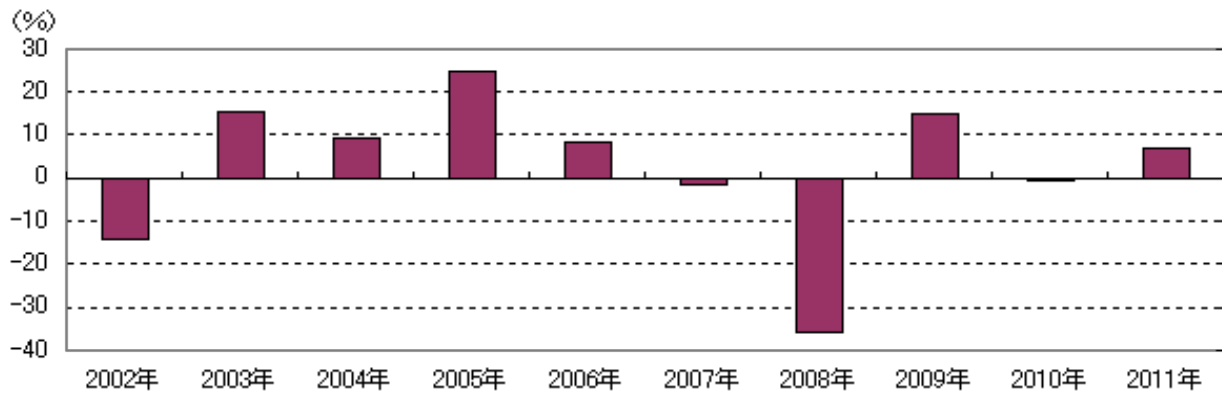
ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

◆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。)

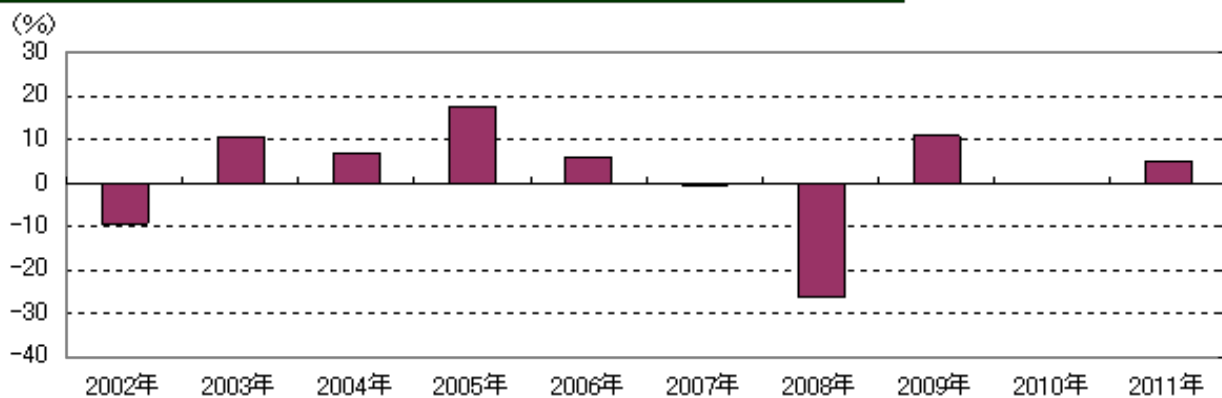
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド 株式(70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	40.3%	29.5%	19.5%	9.8%	0.9%
日立バランスファンド 株式(50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	30.3%	19.5%	39.5%	9.7%	0.9%
日立バランスファンド 株式(30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	20.0%	9.7%	59.6%	9.7%	0.9%

◆年間収益率の推移

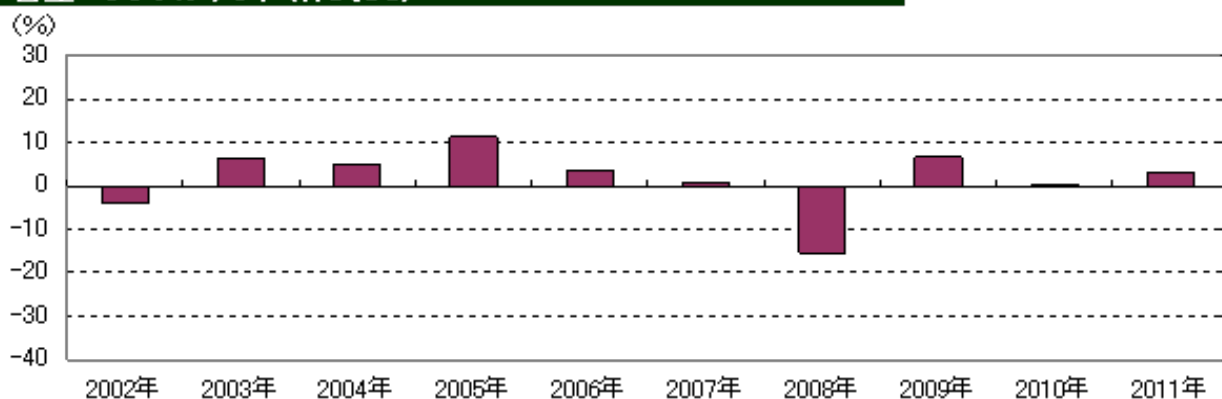
日立バランスファンド(株式70)



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)



※ 2011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 - 4235 - 6100（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（平成13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ます。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。

運用に係る報告等開示方法

委託者は、証券取引法の規定に基づき各計算期間終了毎に有価証券報告書を、計算期間開始6ヶ月経過毎に半期報告書を提出します。

また、委託者は、投信法の規定に基づき各計算期間終了毎に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。

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たがって行われるため、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9期計算期間（平成21年5月16日から平成22年5月17日まで）および第10期計算期間（平成22年5月18日から平成23年5月16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【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9期 (平成22年5月17日現在)	第10期 (平成23年5月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	117,418,054	122,725,238
親投資信託受益証券	9,130,557,004	9,879,455,804
未収入金	-	3,800,000
未収利息	160	168
流動資産合計	9,247,975,218	10,005,981,210
資産合計	9,247,975,218	10,005,981,210
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,965,380	7,556,040
未払受託者報酬	2,407,478	2,600,201
未払委託者報酬	13,000,329	14,041,020
流動負債合計	22,373,187	24,197,261
負債合計	22,373,187	24,197,261
純資産の部		
元本等		
元本	8,461,774,880	9,191,568,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	763,827,151	790,215,893
元本等合計	9,225,602,031	9,981,783,949
純資産合計	9,225,602,031	9,981,783,949
負債純資産合計	9,247,975,218	10,005,981,210

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
営業収益		
受取利息	42,553	46,288
有価証券売買等損益	709,759,821	10,118,800
営業収益合計	709,802,374	10,165,088
営業費用		
受託者報酬	4,638,515	5,037,488
委託者報酬	25,047,843	27,202,290
営業費用合計	29,686,358	32,239,778
営業利益又は営業損失（ ）	680,116,016	22,074,690
経常利益又は経常損失（ ）	680,116,016	22,074,690
当期純利益又は当期純損失（ ）	680,116,016	22,074,690
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（ ）	41,762,789	11,775,380
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,583,838	763,827,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	108,288,604	100,489,691
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	108,288,604	100,489,691
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,398,518	63,801,639
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,398,518	63,801,639
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	763,827,151	790,215,893

(3) 【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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。	同左
2. その他計算書類の作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成21年5月16日から平成22年5月17日までとなっております。	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成22年5月18日から平成23年5月16日までとなっております。

貸借対照表に関する注記

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	8,461,774,880口	9,191,568,056口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0903円 (10,903円)	1.0860円 (10,860円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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注記)

第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16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。	1. 金融商品に対する取組方針 同左

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
---	---

（金融商品の時価等に関する事項）

<p>第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日</p>	<p>第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

関連当事者との取引に関する注記

第9期（自平成21年5月16日 至平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自平成22年5月18日 至平成23年5月16日）

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

第9期（自平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

その他の注記

（貸借対照表関係）

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
期首元本額	7,491,914,546円	8,461,774,880円
期中追加設定元本額	1,563,787,337円	1,463,693,183円
期中一部解約元本額	593,927,003円	733,900,007円

（有価証券関係）

売買目的有価証券

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
種類	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	641,402,013円	1,176,949円
合計	641,402,013円	1,176,949円

（デリバティブ取引関係）

第9期（自平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】（平成23年5月16日現在）

第1 有価証券明細表

(イ) 株式 該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
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	1,672,630,430	2,025,388,187	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	5,332,646,834	3,931,760,510	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	702,504,730	978,097,335	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	3,113,918,321	2,944,209,772	
親投資信託 受益証券計	銘柄数：4	10,821,700,315	9,879,455,804	
	組入時価比率：99.0%		100.0%	
合計			9,879,455,804	

(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 デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第5 不動産等明細表

該当事項はありません。

第6 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第7 借入金明細表

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9期 (平成22年5月17日現在)	第10期 (平成23年5月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	139,692,786	151,306,225
親投資信託受益証券	11,722,611,354	12,685,322,413
未収入金	-	2,000,000
未収利息	191	207
流動資産合計	11,862,304,331	12,838,628,845
資産合計	11,862,304,331	12,838,628,845
負債の部		
流動負債		
未払解約金	941,866	4,121,365
未払受託者報酬	3,086,515	3,321,929
未払委託者報酬	14,815,223	15,945,195
流動負債合計	18,843,604	23,388,489
負債合計	18,843,604	23,388,489
純資産の部		
元本等		
元本	10,579,431,901	11,447,799,967
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,264,028,826	1,367,440,389
元本等合計	11,843,460,727	12,815,240,356
純資産合計	11,843,460,727	12,815,240,356
負債純資産合計	11,862,304,331	12,838,628,845

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
営業収益		
受取利息	53,988	58,117
有価証券売買等損益	738,703,671	54,411,059
営業収益合計	738,757,659	54,469,176
営業費用		
受託者報酬	6,002,145	6,502,858
委託者報酬	28,810,189	31,213,572
営業費用合計	34,812,334	37,716,430
営業利益又は営業損失（ ）	703,945,325	16,752,746
経常利益又は経常損失（ ）	703,945,325	16,752,746
当期純利益又は当期純損失（ ）	703,945,325	16,752,746
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（ ）	29,678,709	5,940,011
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	463,520,159	1,264,028,826
剰余金増加額又は欠損金減少額	154,767,061	156,779,272
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	154,767,061	156,779,272
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,525,010	76,060,466
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,525,010	76,060,466
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,264,028,826	1,367,440,389

(3) 【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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。	同左
2. その他計算書類の作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成21年5月16日から平成22年5月17日までとなっております。	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成22年5月18日から平成23年5月16日までとなっております。

貸借対照表に関する注記

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	10,579,431,901口	11,447,799,967口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1195円 (11,195円)	1.1195円 (11,195円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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注記)

第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日

<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
--	---

(金融商品の時価等に関する事項)

<p>第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日</p>	<p>第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

関連当事者との取引に関する注記

第9期（自平成21年5月16日至平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

第9期（自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

その他の注記

（貸借対照表関係）

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
期首元本額	9,529,317,574円	10,579,431,901円
期中追加設定元本額	1,596,166,519円	1,516,114,802円
期中一部解約元本額	546,052,192円	647,746,736円

（有価証券関係）

売買目的有価証券

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
種類	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	645,302,928円	42,379,977円
合計	645,302,928円	42,379,977円

（デリバティブ取引関係）

第9期（自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】（平成23年5月16日現在）

第1 有価証券明細表

(イ) 株式 該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
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	4,265,143,588	5,164,662,370	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	5,076,356,352	3,742,797,538	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	892,330,963	1,242,392,399	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	2,681,618,304	2,535,470,106	
親投資信託 受益証券計	銘柄数：4	12,915,449,207	12,685,322,413	
	組入時価比率：99.0%		100.0%	
合計			12,685,322,413	

(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 デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第5 不動産等明細表

該当事項はありません。

第6 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第7 借入金明細表

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9期 (平成22年5月17日現在)	第10期 (平成23年5月16日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,149,616	60,241,223
親投資信託受益証券	4,539,312,456	4,967,932,046
未収入金	1,200,000	-
未収利息	72	82
流動資産合計	4,593,662,144	5,028,173,351
資産合計	4,593,662,144	5,028,173,351
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,816,877	2,851,053
未払受託者報酬	1,190,896	1,289,065
未払委託者報酬	5,001,721	5,414,024
流動負債合計	8,009,494	9,554,142
負債合計	8,009,494	9,554,142
純資産の部		
元本等		
元本	4,041,863,602	4,413,400,829
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	543,789,048	605,218,380
元本等合計	4,585,652,650	5,018,619,209
純資産合計	4,585,652,650	5,018,619,209
負債純資産合計	4,593,662,144	5,028,173,351

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
営業収益		
受取利息	21,377	23,051
有価証券売買等損益	205,799,322	27,819,590
営業収益合計	205,820,699	27,842,641
営業費用		
受託者報酬	2,322,873	2,536,105
委託者報酬	9,755,943	10,651,525
営業費用合計	12,078,816	13,187,630
営業利益又は営業損失（ ）	193,741,883	14,655,011
経常利益又は経常損失（ ）	193,741,883	14,655,011
当期純利益又は当期純損失（ ）	193,741,883	14,655,011
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（ ）	10,336,445	669,800
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	307,636,666	543,789,048
剰余金増加額又は欠損金減少額	76,759,596	84,194,614
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	76,759,596	84,194,614
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,012,652	38,090,093
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,012,652	38,090,093
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	543,789,048	605,218,380

(3) 【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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。	同左
2. その他計算書類の作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成21年5月16日から平成22年5月17日までとなっております。	計算期間末日が休日のため、計算期間が平成22年5月18日から平成23年5月16日までとなっております。

貸借対照表に関する注記

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	4,041,863,602口	4,413,400,829口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1345円 (11,345円)	1.1371円 (11,371円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
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注記)

第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日

<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
--	---

(金融商品の時価等に関する事項)

<p>第9期 自平成21年5月16日 至平成22年5月17日</p>	<p>第10期 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

関連当事者との取引に関する注記

第9期（自平成21年5月16日至平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

第9期（自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

その他の注記

（貸借対照表関係）

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
期首元本額	3,667,135,866円	4,041,863,602円
期中追加設定元本額	652,963,008円	656,838,408円
期中一部解約元本額	278,235,272円	285,301,181円

（有価証券関係）

売買目的有価証券

区分	第9期 平成22年5月17日現在	第10期 平成23年5月16日現在
種類	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	178,141,738円	22,721,829円
合計	178,141,738円	22,721,829円

（デリバティブ取引関係）

第9期（自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

第10期（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】（平成23年5月16日現在）

第1 有価証券明細表

(イ) 株式 該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
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	2,502,562,129	3,030,352,482	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	1,312,768,600	967,904,288	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	348,701,744	485,497,438	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	512,086,556	484,177,838	
親投資信託 受益証券計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	4,676,119,029	4,967,932,046	100.0%

合計			4,967,932,046	
----	--	--	---------------	--

(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 デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第4 為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

第5 不動産等明細表

該当事項はありません。

第6 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第7 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（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。

[次へ](#)

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。

(1) 貸借対照表

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	271,286,273	248,528,255
株式	39,199,405,392	33,176,605,870
派生商品評価勘定	142,740	19,657,950
未収入金	-	1,896,736,781
未収配当金	395,090,227	402,555,938
未収利息	371	340
差入委託証拠金	31,071,000	48,412,000
流動資産合計	39,896,996,003	35,792,497,134
資産合計	39,896,996,003	35,792,497,134
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,898,470	18,579,980
未払金	23,709,591	11,262,550
未払解約金	-	3,800,000
流動負債合計	43,608,061	33,642,530
負債合計	43,608,061	33,642,530
純資産の部		
元本等		
元本	49,774,656,907	48,500,902,900
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,921,268,965	12,742,048,296
元本等合計	39,853,387,942	35,758,854,604
純資産合計	39,853,387,942	35,758,854,604
負債・純資産合計	39,896,996,003	35,792,497,134

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。	同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。 受取利息、有価証券売買等損益、派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。	同左

貸借対照表に関する注記

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	49,774,656,907口	48,500,902,900口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8007円 (8,007円)	0.7373円 (7,373円)

金融商品に関する注記

(金融商品の状況に関する注記)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日

<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>
--	---

関連当事者との取引に関する注記

(自平成21年5月16日 至 平成22年5月17日)

該当事項はありません。

(自平成22年5月18日 至 平成23年5月16日)

該当事項はありません。

その他の注記

(貸借対照表関係)

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 期首元本額	49,633,429,453円	49,774,656,907円
期中追加設定元本額	14,148,778,108円	7,092,609,078円
期中一部解約元本額	14,007,550,654円	8,366,363,085円
期末元本額	49,774,656,907円	48,500,902,900円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド(株式70)	4,555,526,952円	5,332,646,834円
日立バランスファンド(株式50)	4,353,267,970円	5,076,356,352円
日立バランスファンド(株式30)	1,102,243,725円	1,312,768,600円
日立国内株式TOPIXインデックスファンド	32,155,911,930円	28,073,313,404円
日立国内株式インデックスファンド	7,607,706,330円	8,705,817,710円
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額		
元本の欠損	9,921,268,965円	12,742,048,296円

(注) *は当該親投資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。

(有価証券関係)

売買目的有価証券

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
種類	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
国内株式証券	2,463,570,366円	1,574,024,821円
合計	2,463,570,366円	1,574,024,821円

(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。

(デリバティブ取引関係)

取引の状況に関する事項

自平成21年5月16日	自平成22年5月18日
-------------	-------------

至平成22年5月17日	至平成23年5月16日
1.取引の内容 利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連で有価証券先物取引等であります。	同左
2.取引に対する取組方針 デリバティブ取引は、将来の価額の変動によるリスクを回避する目的で行います。	同左
3.取引の利用目的 デリバティブ取引は、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。	同左
4.取引に係るリスクの内容 有価証券先物取引等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。	同左
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。	同左
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。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年5月17日現在)

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 （国内・買建）	673,976,000	-	654,265,000	37,578,150
合計		673,976,000	-	654,265,000	37,578,150

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
銘柄明細 市場取引	株価指数先物取引 （東証株価指数先物）	673,976,000	-	654,265,000	37,578,150

(平成23年5月16日現在)

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 （国内・買建）	672,386,000	-	673,515,000	27,945,000
合計		672,386,000	-	673,515,000	27,945,000

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
銘柄明細 市場取引	株価指数先物取引 （東証株価指数先物）	672,386,000	-	673,515,000	27,945,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引について

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。

[次へ](#)

（ 3 ） 附属明細表(平成23年5月16日現在)

第 1 有価証券明細表

（イ）株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
株式	日本円	極洋	13,000	169.00	2,197,000	
		日本水産	38,300	239.00	9,153,700	
		マルハニチロホールディングス	66,000	123.00	8,118,000	
		サカタのタネ	4,900	1,149.00	5,630,100	
		ホクト	3,400	1,751.00	5,953,400	
		住石ホールディングス	9,200	105.00	966,000	
		日鉄鉱業	8,000	346.00	2,768,000	
		三井松島産業	19,000	168.00	3,192,000	
		国際石油開発帝石	337	524,000.00	176,588,000	
		日本海洋掘削	800	2,755.00	2,204,000	
		関東天然瓦斯開発	3,000	451.00	1,353,000	
		石油資源開発	5,300	3,630.00	19,239,000	
		ショーボンドホールディングス	3,000	2,045.00	6,135,000	
		ミライト・ホールディングス	8,700	570.00	4,959,000	
		ダイセキ環境ソリューション	3	185,700.00	557,100	
		間組	12,900	113.00	1,457,700	
		東急建設	11,810	226.00	2,669,060	
		コムシスホールディングス	16,200	812.00	13,154,400	
		ミサワホーム	3,900	473.00	1,844,700	
		高松コンストラクショングループ	2,500	1,098.00	2,745,000	
		東建コーポレーション	1,240	3,260.00	4,042,400	
		ヤマウラ	1,500	200.00	300,000	
		大成建設	158,000	189.00	29,862,000	
		大林組	100,000	360.00	36,000,000	
		清水建設	95,000	347.00	32,965,000	
		飛鳥建設	96,000	30.00	2,880,000	
		長谷工コーポレーション	208,000	58.00	12,064,000	
		松井建設	4,000	308.00	1,232,000	
		鹿島建設	146,000	240.00	35,040,000	
		不動テトラ	23,500	174.00	4,089,000	
		大末建設	12,000	67.00	804,000	
		鉄建建設	20,000	108.00	2,160,000	
		安藤建設	11,000	103.00	1,133,000	
		太平工業	7,000	327.00	2,289,000	
		西松建設	44,000	121.00	5,324,000	
		三井住友建設	18,300	79.00	1,445,700	
		大豊建設	10,000	115.00	1,150,000	
		前田建設工業	20,000	258.00	5,160,000	
		佐田建設	11,000	79.00	869,000	
		ナカノフドー建設	2,500	181.00	452,500	
奥村組	32,000	294.00	9,408,000			
大和小田急建設	1,500	204.00	306,000			
東鉄工業	4,000	723.00	2,892,000			
イチケン	4,000	110.00	440,000			
浅沼組	11,000	85.00	935,000			

戸田建設	36,000	305.00	10,980,000
熊谷組	25,000	86.00	2,150,000
青木あすなろ建設	2,000	406.00	812,000
北野建設	7,000	194.00	1,358,000
植木組	4,000	167.00	668,000
三井ホーム	4,000	399.00	1,596,000
矢作建設工業	4,100	415.00	1,701,500
ピーエス三菱	2,100	307.00	644,700
大東建託	13,000	6,650.00	86,450,000
新日本建設	4,000	259.00	1,036,000
N I P P O	8,000	591.00	4,728,000
東亜道路工業	6,000	173.00	1,038,000
前田道路	10,000	728.00	7,280,000
日本道路	10,000	235.00	2,350,000
東亜建設工業	27,000	150.00	4,050,000
若築建設	18,000	106.00	1,908,000
東洋建設	45,000	94.00	4,230,000
五洋建設	41,500	197.00	8,175,500
大林道路	4,000	192.00	768,000
世紀東急工業	8,000	58.00	464,000
福田組	5,000	243.00	1,215,000
住友林業	22,900	719.00	16,465,100
日本基礎技術	4,300	298.00	1,281,400
日成ビルド工業	10,000	181.00	1,810,000
エス・バイ・エル	16,000	67.00	1,072,000
巴コーポレーション	4,500	288.00	1,296,000
パナホーム	11,000	530.00	5,830,000
大和ハウス工業	83,000	986.00	81,838,000
ライト工業	6,900	274.00	1,890,600
積水ハウス	100,000	772.00	77,200,000
日特建設	9,000	158.00	1,422,000
北陸電気工事	2,000	222.00	444,000
ユアテック	5,000	432.00	2,160,000
西部電気工業	3,000	336.00	1,008,000
四電工	3,000	325.00	975,000
中電工	4,800	945.00	4,536,000
関電工	15,000	376.00	5,640,000
きんでん	22,000	633.00	13,926,000
東京エネシス	4,000	456.00	1,824,000
トーエネック	5,000	423.00	2,115,000
住友電設	2,300	380.00	874,000
日本電設工業	6,000	773.00	4,638,000
協和エクシオ	11,900	796.00	9,472,400
新日本空調	2,300	398.00	915,400
日本電話施設	5,000	254.00	1,270,000
九電工	6,000	462.00	2,772,000
三機工業	8,000	438.00	3,504,000
日揮	33,000	2,056.00	67,848,000
中外炉工業	11,000	290.00	3,190,000
ヤマト	3,000	315.00	945,000
太平電業	4,000	590.00	2,360,000
高砂熱学工業	9,500	629.00	5,975,500

三晃金属工業	4,000	232.00	928,000
NEC ネットエスアイ	2,800	987.00	2,763,600
朝日工業社	4,000	359.00	1,436,000
大気社	5,100	1,450.00	7,395,000
ダイダン	4,000	467.00	1,868,000
日比谷総合設備	4,400	757.00	3,330,800
東芝プラントシステム	5,000	847.00	4,235,000
東洋エンジニアリング	20,000	281.00	5,620,000
千代田化工建設	22,000	824.00	18,128,000
新興プランテック	6,400	839.00	5,369,600
日本製粉	19,000	377.00	7,163,000
日清製粉グループ本社	30,000	984.00	29,520,000
日東富士製粉	3,000	290.00	870,000
昭和産業	13,000	218.00	2,834,000
鳥越製粉	2,900	685.00	1,986,500
協同飼料	12,000	86.00	1,032,000
中部飼料	2,900	538.00	1,560,200
日本配合飼料	10,000	85.00	850,000
東洋精糖	5,000	102.00	510,000
日本甜菜製糖	18,000	175.00	3,150,000
三井製糖	13,000	361.00	4,693,000
森永製菓	32,000	184.00	5,888,000
中村屋	8,000	371.00	2,968,000
江崎グリコ	12,000	895.00	10,740,000
名糖産業	1,500	1,018.00	1,527,000
不二家	19,000	135.00	2,565,000
山崎製パン	24,000	999.00	23,976,000
第一屋製パン	4,000	90.00	360,000
モロゾフ	5,000	254.00	1,270,000
カルビー	2,000	2,494.00	4,988,000
森永乳業	28,000	328.00	9,184,000
ヤクルト本社	17,800	2,195.00	39,071,000
明治ホールディングス	9,900	3,355.00	33,214,500
雪印メグミルク	6,500	1,330.00	8,645,000
プリマハム	19,000	101.00	1,919,000
日本ハム	23,000	1,097.00	25,231,000
伊藤ハム	18,000	320.00	5,760,000
林兼産業	11,000	80.00	880,000
丸大食品	15,000	249.00	3,735,000
米久	3,000	600.00	1,800,000
S Foods	2,000	668.00	1,336,000
サッポロホールディングス	47,000	307.00	14,429,000
アサヒビール	62,400	1,492.00	93,100,800
キリンホールディングス	134,000	1,111.00	148,874,000
宝ホールディングス	28,000	394.00	11,032,000
オエノンホールディングス	9,000	182.00	1,638,000
養命酒製造	3,000	729.00	2,187,000
三国コカ・コーラボトリング	4,000	701.00	2,804,000
コカ・コーラウエスト	10,200	1,523.00	15,534,600
コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,700	1,074.00	3,973,800
ダイドードリンコ	1,400	3,090.00	4,326,000
伊藤園	10,100	1,383.00	13,968,300

キーコーヒー	2,900	1,399.00	4,057,100
ユニカフェ	800	376.00	300,800
ジャパンフーズ	400	788.00	315,200
日清オイリオグループ	14,000	374.00	5,236,000
不二製油	8,100	1,144.00	9,266,400
J-オイルミルズ	12,000	246.00	2,952,000
キッコーマン	27,000	818.00	22,086,000
味の素	90,000	911.00	81,990,000
キューピー	17,200	953.00	16,391,600
ハウス食品	11,800	1,322.00	15,599,600
カゴメ	11,900	1,405.00	16,719,500
焼津水産化学工業	1,600	725.00	1,160,000
アリアケジャパン	2,700	1,432.00	3,866,400
ニチレイ	37,000	343.00	12,691,000
東洋水産	14,000	1,824.00	25,536,000
日清食品ホールディングス	11,900	2,879.00	34,260,100
永谷園	3,000	812.00	2,436,000
フジッコ	4,000	963.00	3,852,000
ロック・フィールド	1,600	1,248.00	1,996,800
日本たばこ産業	692	323,500.00	223,862,000
わらべや日洋	1,800	954.00	1,717,200
なとり	1,500	789.00	1,183,500
ミヨシ油脂	10,000	113.00	1,130,000
片倉工業	3,600	805.00	2,898,000
グンゼ	21,000	277.00	5,817,000
川島織物セルコン	11,000	58.00	638,000
東洋紡績	131,000	123.00	16,113,000
ユニチカ	70,000	60.00	4,200,000
富士紡ホールディングス	14,000	170.00	2,380,000
日清紡ホールディングス	20,000	760.00	15,200,000
倉敷紡績	30,000	143.00	4,290,000
シキボウ	19,000	93.00	1,767,000
日本毛織	11,000	696.00	7,656,000
大東紡織	5,000	65.00	325,000
トーア紡コーポレーション	12,000	62.00	744,000
ダイドーリミテッド	3,800	801.00	3,043,800
帝国繊維	3,000	484.00	1,452,000
帝人	118,000	380.00	44,840,000
東レ	241,000	591.00	142,431,000
サカイオーベックス	9,000	125.00	1,125,000
住江織物	8,000	165.00	1,320,000
日本フェルト	1,700	374.00	635,800
イチカワ	2,000	153.00	306,000
日本バイリーン	3,000	372.00	1,116,000
日東製網	4,000	107.00	428,000
芦森工業	7,000	119.00	833,000
アツギ	27,000	98.00	2,646,000
ダイニック	6,000	138.00	828,000
セーレン	7,700	510.00	3,927,000
東海染工	4,000	81.00	324,000
小松精練	5,000	338.00	1,690,000
ワコールホールディングス	19,000	991.00	18,829,000

ホギメディカル	1,700	3,390.00	5,763,000
サンエー・インターナショナル	1,500	898.00	1,347,000
レナウン	6,000	151.00	906,000
クラウドシア	400	1,116.00	446,400
三陽商会	15,000	238.00	3,570,000
ナイガイ	9,000	39.00	351,000
オンワードホールディングス	21,000	585.00	12,285,000
ルック	5,000	121.00	605,000
ゴールドウイン	7,000	244.00	1,708,000
東京スタイル	11,000	541.00	5,951,000
デサント	8,000	345.00	2,760,000
ヤマトインターナショナル	1,900	343.00	651,700
特種東海製紙	20,000	156.00	3,120,000
王子製紙	137,000	353.00	48,361,000
三菱製紙	44,000	75.00	3,300,000
北越紀州製紙	19,500	468.00	9,126,000
中越パルプ工業	12,000	134.00	1,608,000
巴川製紙所	5,000	191.00	955,000
大王製紙	13,000	559.00	7,267,000
日本製紙グループ本社	15,000	1,582.00	23,730,000
レンゴー	25,000	507.00	12,675,000
トーモク	10,000	215.00	2,150,000
ザ・バック	2,200	1,306.00	2,873,200
クラレ	45,900	1,164.00	53,427,600
旭化成	181,000	529.00	95,749,000
共和レザー	1,800	274.00	493,200
コープケミカル	5,000	101.00	505,000
昭和電工	207,000	162.00	33,534,000
住友化学	214,000	405.00	86,670,000
日本化成	6,000	155.00	930,000
住友精化	6,000	429.00	2,574,000
日産化学工業	22,100	832.00	18,387,200
ラサ工業	12,000	120.00	1,440,000
クレハ	20,000	361.00	7,220,000
テイカ	5,000	291.00	1,455,000
石原産業	52,000	101.00	5,252,000
片倉チッカリン	2,000	216.00	432,000
日本曹達	18,000	311.00	5,598,000
東ソー	78,000	323.00	25,194,000
トクヤマ	48,000	400.00	19,200,000
セントラル硝子	30,000	319.00	9,570,000
東亜合成	32,000	400.00	12,800,000
ダイソー	12,000	274.00	3,288,000
関東電化工業	7,000	530.00	3,710,000
電気化学工業	65,000	429.00	27,885,000
信越化学工業	51,800	4,110.00	212,898,000
日本カーバイド工業	7,000	196.00	1,372,000
堺化学工業	10,000	368.00	3,680,000
エア・ウォーター	25,000	955.00	23,875,000
大陽日酸	41,000	613.00	25,133,000
日本化学工業	12,000	179.00	2,148,000
日本パーカライジング	7,000	991.00	6,937,000

高圧ガス工業	5,000	454.00	2,270,000
チタン工業	4,000	452.00	1,808,000
四国化成工業	4,000	467.00	1,868,000
戸田工業	4,000	748.00	2,992,000
ステラ ケミファ	1,400	3,010.00	4,214,000
保土谷化学工業	7,000	323.00	2,261,000
日本触媒	25,000	1,026.00	25,650,000
大日精化工業	11,000	397.00	4,367,000
カネカ	39,000	547.00	21,333,000
三菱瓦斯化学	49,000	605.00	29,645,000
三井化学	141,000	286.00	40,326,000
J S R	26,000	1,579.00	41,054,000
東京応化工業	5,600	1,719.00	9,626,400
三菱ケミカルホールディングス	180,500	544.00	98,192,000
日本合成化学工業	7,000	513.00	3,591,000
ダイセル化学工業	40,000	507.00	20,280,000
住友ベークライト	29,000	514.00	14,906,000
積水化学工業	65,000	641.00	41,665,000
日本ゼオン	29,000	698.00	20,242,000
アイカ工業	9,000	1,043.00	9,387,000
宇部興産	130,000	231.00	30,030,000
積水樹脂	4,000	806.00	3,224,000
タキロン	7,000	301.00	2,107,000
旭有機材工業	11,000	221.00	2,431,000
日立化成工業	13,400	1,577.00	21,131,800
ニチバン	3,000	266.00	798,000
リケンテクノス	5,000	277.00	1,385,000
大倉工業	7,000	252.00	1,764,000
積水化成成品工業	7,000	301.00	2,107,000
群栄化学工業	8,000	215.00	1,720,000
タイガースポリマー	1,500	372.00	558,000
日本カーリット	2,500	402.00	1,005,000
日本化薬	22,000	765.00	16,830,000
日本精化	2,600	491.00	1,276,600
A D E K A	12,400	757.00	9,386,800
日油	27,000	340.00	9,180,000
ハリマ化成	2,600	598.00	1,554,800
花王	84,700	2,003.00	169,654,100
第一工業製薬	6,000	245.00	1,470,000
三洋化成工業	9,000	603.00	5,427,000
大日本塗料	18,000	101.00	1,818,000
日本ペイント	27,000	547.00	14,769,000
関西ペイント	35,000	685.00	23,975,000
トウベ	3,000	87.00	261,000
中国塗料	8,000	665.00	5,320,000
日本特殊塗料	2,400	317.00	760,800
藤倉化成	3,900	433.00	1,688,700
太陽ホールディングス	2,300	2,360.00	5,428,000
D I C	119,000	201.00	23,919,000
サカタインクス	6,000	356.00	2,136,000
東洋インキ S C ホールディングス	28,000	374.00	10,472,000
富士フイルムホールディングス	66,400	2,365.00	157,036,000

資生堂	51,600	1,325.00	68,370,000
ライオン	36,000	417.00	15,012,000
高砂香料工業	10,000	393.00	3,930,000
マンダム	3,100	2,001.00	6,203,100
ミルボン	1,700	2,335.00	3,969,500
ファンケル	6,000	1,061.00	6,366,000
コーセー	5,600	1,945.00	10,892,000
ドクターシーラボ	21	340,000.00	7,140,000
ポーラ・オルビスホールディングス	3,700	1,830.00	6,771,000
エステー	1,500	851.00	1,276,500
コニシ	2,400	1,002.00	2,404,800
長谷川香料	3,900	1,224.00	4,773,600
小林製薬	4,300	3,745.00	16,103,500
荒川化学工業	2,400	720.00	1,728,000
メック	2,000	352.00	704,000
日本高純度化学	9	232,900.00	2,096,100
荏原ユーザイト	400	2,480.00	992,000
アース製薬	2,200	2,725.00	5,995,000
イハラケミカル工業	6,000	245.00	1,470,000
北興化学工業	3,000	247.00	741,000
大成ラミック	900	2,255.00	2,029,500
クミアイ化学工業	6,000	219.00	1,314,000
日本農薬	7,000	359.00	2,513,000
アキレス	25,000	110.00	2,750,000
有沢製作所	4,800	437.00	2,097,600
日東電工	25,600	4,190.00	107,264,000
レック	800	1,197.00	957,600
アロン化成	2,000	498.00	996,000
きもと	2,800	714.00	1,999,200
藤森工業	2,200	1,127.00	2,479,400
前澤化成工業	2,200	785.00	1,727,000
J S P	2,000	1,308.00	2,616,000
エフビコ	1,500	4,650.00	6,975,000
天馬	2,700	834.00	2,251,800
信越ポリマー	6,100	428.00	2,610,800
東リ	8,000	176.00	1,408,000
ニフコ	5,900	1,964.00	11,587,600
日本バルカー工業	13,000	225.00	2,925,000
ユニ・チャーム	17,200	3,310.00	56,932,000
協和発酵キリン	37,000	785.00	29,045,000
武田薬品工業	116,500	3,750.00	436,875,000
アステラス製薬	69,000	3,065.00	211,485,000
大日本住友製薬	22,000	733.00	16,126,000
塩野義製薬	45,300	1,291.00	58,482,300
田辺三菱製薬	25,900	1,310.00	33,929,000
わかもと製薬	3,000	240.00	720,000
あすか製薬	4,000	588.00	2,352,000
日本新薬	7,000	978.00	6,846,000
中外製薬	31,000	1,301.00	40,331,000
科研製薬	13,000	1,085.00	14,105,000
エーザイ	38,300	2,961.00	113,406,300
ロート製薬	14,000	874.00	12,236,000

小野薬品工業	15,600	4,125.00	64,350,000
久光製薬	8,800	3,375.00	29,700,000
有機合成薬品工業	2,000	219.00	438,000
持田製薬	12,000	872.00	10,464,000
大正製薬	25,000	1,830.00	45,750,000
参天製薬	9,600	3,130.00	30,048,000
扶桑薬品工業	10,000	227.00	2,270,000
日本ケミファ	5,000	281.00	1,405,000
ツムラ	8,500	2,552.00	21,692,000
日医工	4,800	1,995.00	9,576,000
キッセイ薬品工業	6,300	1,512.00	9,525,600
生化学工業	5,900	882.00	5,203,800
栄研化学	2,400	1,010.00	2,424,000
日水製薬	1,200	660.00	792,000
鳥居薬品	2,100	1,581.00	3,320,100
東和薬品	1,600	4,205.00	6,728,000
沢井製薬	2,000	7,460.00	14,920,000
ゼリア新薬工業	4,000	972.00	3,888,000
第一三共	104,600	1,532.00	160,247,200
キョーリン製薬ホールディングス	8,000	1,476.00	11,808,000
大幸薬品	1,400	801.00	1,121,400
ダイト	900	1,415.00	1,273,500
大塚ホールディングス	72,000	2,139.00	154,008,000
昭和シェル石油	27,800	811.00	22,545,800
コスモ石油	86,000	258.00	22,188,000
ニチレキ	4,000	365.00	1,460,000
東燃ゼネラル石油	47,000	987.00	46,389,000
ユシロ化学工業	1,500	984.00	1,476,000
ビービー・カストロール	1,300	329.00	427,700
AOCホールディングス	7,900	470.00	3,713,000
MORESCO	500	812.00	406,000
出光興産	3,700	8,670.00	32,079,000
JXホールディングス	345,100	515.00	177,726,500
横浜ゴム	35,000	430.00	15,050,000
東洋ゴム工業	26,000	185.00	4,810,000
ブリヂストン	97,500	1,874.00	182,715,000
住友ゴム工業	21,800	924.00	20,143,200
藤倉ゴム工業	1,900	312.00	592,800
オカモト	11,000	299.00	3,289,000
フコク	1,300	692.00	899,600
ニッタ	2,800	1,463.00	4,096,400
東海ゴム工業	4,800	977.00	4,689,600
三ツ星ベルト	8,000	384.00	3,072,000
バンドー化学	11,000	324.00	3,564,000
日東紡績	25,000	192.00	4,800,000
旭硝子	153,000	962.00	147,186,000
日本板硝子	133,000	239.00	31,787,000
石塚硝子	4,000	148.00	592,000
日本山村硝子	13,000	206.00	2,678,000
日本電気硝子	64,000	1,101.00	70,464,000
オハラ	1,200	813.00	975,600
住友大阪セメント	59,000	223.00	13,157,000

太平洋セメント	131,000	153.00	20,043,000
デイ・シイ	3,200	233.00	745,600
日本ヒューム	2,000	313.00	626,000
日本コンクリート工業	5,000	214.00	1,070,000
東海カーボン	29,000	423.00	12,267,000
日本カーボン	15,000	183.00	2,745,000
東洋炭素	1,700	4,325.00	7,352,500
ノリタケカンパニーリミテド	16,000	291.00	4,656,000
TOTO	45,000	590.00	26,550,000
日本碍子	37,000	1,403.00	51,911,000
日本特殊陶業	28,000	1,076.00	30,128,000
ダントーホールディングス	4,000	94.00	376,000
MARUWA	700	2,957.00	2,069,900
品川リフラクトリーズ	8,000	222.00	1,776,000
黒崎播磨	7,000	329.00	2,303,000
東京窯業	4,000	186.00	744,000
ニッカトー	1,100	428.00	470,800
フジミインコーポレーテッド	2,800	996.00	2,788,800
エーアンドエーマテリアル	6,000	86.00	516,000
ニチアス	15,000	452.00	6,780,000
ニチハ	3,100	684.00	2,120,400
新日本製鐵	816,000	244.00	199,104,000
住友金属工業	576,000	162.00	93,312,000
神戸製鋼所	431,000	182.00	78,442,000
日新製鋼	119,000	154.00	18,326,000
中山製鋼所	16,000	113.00	1,808,000
合同製鐵	17,000	206.00	3,502,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	73,600	2,087.00	153,603,200
東京製鐵	17,200	789.00	13,570,800
共英製鋼	3,300	1,385.00	4,570,500
大和工業	7,100	2,569.00	18,239,900
東京製鋼	6,000	220.00	1,320,000
大阪製鐵	1,900	1,433.00	2,722,700
淀川製鋼所	24,000	333.00	7,992,000
東洋鋼鋳	7,000	381.00	2,667,000
住友鋼管	2,100	570.00	1,197,000
丸一鋼管	10,400	1,915.00	19,916,000
モリ工業	5,000	313.00	1,565,000
大同特殊鋼	52,000	470.00	24,440,000
日本高周波鋼業	12,000	108.00	1,296,000
日本金属工業	24,000	90.00	2,160,000
日本冶金工業	16,000	200.00	3,200,000
山陽特殊製鋼	15,000	464.00	6,960,000
愛知製鋼	17,000	461.00	7,837,000
日立金属	20,000	990.00	19,800,000
日本金属	8,000	169.00	1,352,000
大平洋金属	22,000	553.00	12,166,000
日本電工	12,000	519.00	6,228,000
栗本鐵工所	16,000	141.00	2,256,000
旭テック	22,000	29.00	638,000
日本鑄鉄管	3,000	192.00	576,000
三菱製鋼	19,000	249.00	4,731,000

日亜鋼業	4,000	203.00	812,000
日本精線	2,000	394.00	788,000
シンニッタン	2,900	360.00	1,044,000
新家工業	7,000	126.00	882,000
日本軽金属	70,000	151.00	10,570,000
大紀アルミニウム工業所	5,000	221.00	1,105,000
三井金属鉱業	90,000	280.00	25,200,000
東邦亜鉛	18,000	369.00	6,642,000
三菱マテリアル	194,000	246.00	47,724,000
住友金属鉱山	86,000	1,276.00	109,736,000
DOWAホールディングス	37,000	499.00	18,463,000
古河機械金属	52,000	85.00	4,420,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,400	5,860.00	19,924,000
東邦チタニウム	5,000	2,250.00	11,250,000
住友軽金属工業	52,000	96.00	4,992,000
古河スカイ	13,000	224.00	2,912,000
古河電気工業	98,000	301.00	29,498,000
住友電気工業	109,800	1,141.00	125,281,800
フジクラ	47,000	370.00	17,390,000
昭和電線ホールディングス	37,000	97.00	3,589,000
東京特殊電線	4,000	109.00	436,000
タツタ電線	6,000	366.00	2,196,000
日立電線	24,000	189.00	4,536,000
沖電線	3,000	177.00	531,000
カナレ電気	300	1,240.00	372,000
平河ヒューテック	600	653.00	391,800
リョービ	17,000	297.00	5,049,000
アサヒホールディングス	4,300	1,583.00	6,806,900
稲葉製作所	1,500	847.00	1,270,500
宮地エンジニアリンググループ	10,000	105.00	1,050,000
三協・立山ホールディングス	42,000	112.00	4,704,000
トーカロ	1,600	1,573.00	2,516,800
アルファC O	900	872.00	784,800
SUMCO	19,000	1,443.00	27,417,000
川田テクノロジーズ	700	1,281.00	896,700
東洋製罐	22,000	1,260.00	27,720,000
ホッカンホールディングス	7,000	236.00	1,652,000
コロナ	1,400	806.00	1,128,400
横河ブリッジホールディングス	5,000	470.00	2,350,000
日本橋梁	1,100	222.00	244,200
駒井ハルテック	6,000	225.00	1,350,000
高田機工	3,000	187.00	561,000
三和ホールディングス	31,000	270.00	8,370,000
文化シャッター	8,000	217.00	1,736,000
東洋シャッター	600	315.00	189,000
住生活グループ	37,500	2,056.00	77,100,000
日本フィルコン	2,200	380.00	836,000
ノーリツ	5,600	1,397.00	7,823,200
長府製作所	3,000	1,900.00	5,700,000
リンナイ	5,000	5,480.00	27,400,000
ダイニチ工業	1,600	612.00	979,200
日東精工	4,000	217.00	868,000

三洋工業	4,000	140.00	560,000
岡部	6,600	420.00	2,772,000
中国工業	5,000	103.00	515,000
東プレ	6,000	639.00	3,834,000
高周波熱錬	4,100	598.00	2,451,800
東京製綱	21,000	299.00	6,279,000
バイオラックス	1,300	1,815.00	2,359,500
日本発條	23,000	781.00	17,963,000
中央発條	4,000	284.00	1,136,000
アドバネクス	6,000	81.00	486,000
三益半導体工業	2,600	913.00	2,373,800
アタカ大機	2,000	276.00	552,000
日本製鋼所	48,000	600.00	28,800,000
日立ツール	1,800	816.00	1,468,800
三浦工業	5,000	2,243.00	11,215,000
タクマ	11,000	338.00	3,718,000
ツガミ	9,000	520.00	4,680,000
オークマ	20,000	712.00	14,240,000
東芝機械	18,000	440.00	7,920,000
アマダ	44,000	599.00	26,356,000
アイダエンジニアリング	8,000	329.00	2,632,000
牧野フライス製作所	14,000	751.00	10,514,000
オーエスジー	13,700	1,023.00	14,015,100
ダイジェット工業	4,000	126.00	504,000
旭ダイヤモンド工業	7,000	1,623.00	11,361,000
森精機製作所	16,400	1,050.00	17,220,000
ディスコ	3,100	5,300.00	16,430,000
日東工器	1,800	1,930.00	3,474,000
豊和工業	16,000	78.00	1,248,000
大阪機工	11,000	110.00	1,210,000
東洋機械金属	2,500	212.00	530,000
オーエム製作所	1,000	512.00	512,000
津田駒工業	8,000	193.00	1,544,000
エンシュウ	7,000	99.00	693,000
島精機製作所	4,000	2,139.00	8,556,000
日阪製作所	4,000	817.00	3,268,000
やまびこ	1,200	865.00	1,038,000
ペガサスミシン製造	3,100	235.00	728,500
ナプテスコ	11,700	1,934.00	22,627,800
三井海洋開発	2,600	1,319.00	3,429,400
レオン自動機	3,000	179.00	537,000
S M C	9,300	13,640.00	126,852,000
新川	2,200	700.00	1,540,000
ホソカワミクロン	5,000	363.00	1,815,000
ユニオンツール	1,900	1,744.00	3,313,600
オイレス工業	3,100	1,403.00	4,349,300
サトー	3,000	1,011.00	3,033,000
日本エアーテック	900	364.00	327,600
日精樹脂工業	2,500	258.00	645,000
ワイエイシイ	1,300	704.00	915,200
小松製作所	147,300	2,651.00	390,492,300
住友重機械工業	79,000	568.00	44,872,000

日立建機	13,900	1,812.00	25,186,800
日工	4,000	293.00	1,172,000
巴工業	1,200	1,651.00	1,981,200
井関農機	32,000	176.00	5,632,000
T O W A	3,000	504.00	1,512,000
丸山製作所	7,000	165.00	1,155,000
北川鉄工所	14,000	148.00	2,072,000
クボタ	130,000	710.00	92,300,000
荏原実業	700	1,239.00	867,300
三菱化工機	9,000	196.00	1,764,000
月島機械	5,000	708.00	3,540,000
帝国電機製作所	1,000	1,386.00	1,386,000
東京機械製作所	9,000	72.00	648,000
新東工業	6,300	787.00	4,958,100
澁谷工業	1,800	797.00	1,434,600
アイチ コーポレーション	5,100	354.00	1,805,400
小森コーポレーション	8,200	699.00	5,731,800
鶴見製作所	2,000	560.00	1,120,000
住友精密工業	5,000	666.00	3,330,000
酒井重工業	6,000	153.00	918,000
荏原製作所	55,000	441.00	24,255,000
石井鐵工所	5,000	173.00	865,000
西島製作所	3,600	1,174.00	4,226,400
ダイキン工業	32,400	2,691.00	87,188,400
オルガノ	5,000	589.00	2,945,000
トーヨーカネツ	17,000	182.00	3,094,000
栗田工業	17,100	2,256.00	38,577,600
椿本チエイン	16,000	419.00	6,704,000
大同工業	6,000	156.00	936,000
日本コンベヤ	10,000	80.00	800,000
木村化工機	2,800	383.00	1,072,400
アネスト岩田	5,000	395.00	1,975,000
ダイフク	12,500	521.00	6,512,500
加藤製作所	7,000	230.00	1,610,000
油研工業	5,000	198.00	990,000
タダノ	13,000	416.00	5,408,000
フジテック	9,000	405.00	3,645,000
シーケーディ	8,300	674.00	5,594,200
キトー	9	71,400.00	642,600
平和	6,400	1,247.00	7,980,800
理想科学工業	2,300	1,364.00	3,137,200
S A N K Y O	9,000	3,960.00	35,640,000
日本金銭機械	2,700	668.00	1,803,600
マースエンジニアリング	1,500	1,257.00	1,885,500
福島工業	900	930.00	837,000
オーイズミ	1,000	237.00	237,000
ダイコク電機	1,200	858.00	1,029,600
アマノ	8,200	704.00	5,772,800
J U K I	18,000	185.00	3,330,000
サンデン	17,000	378.00	6,426,000
蛇の目マシン工業	29,000	70.00	2,030,000
マックス	5,000	989.00	4,945,000

グローリー	8,200	1,712.00	14,038,400
大和冷機工業	4,000	399.00	1,596,000
セガサミーホールディングス	29,500	1,436.00	42,362,000
日本ピストンリング	12,000	175.00	2,100,000
リケン	12,000	324.00	3,888,000
帝国ピストンリング	3,600	777.00	2,797,200
ホシザキ電機	6,000	1,532.00	9,192,000
大豊工業	2,100	668.00	1,402,800
日本精工	66,000	709.00	46,794,000
NTN	69,000	403.00	27,807,000
ジェイテクト	31,500	1,022.00	32,193,000
不二越	30,000	432.00	12,960,000
日本トムソン	10,000	647.00	6,470,000
THK	19,700	2,029.00	39,971,300
ユースン精機	1,500	1,481.00	2,221,500
前澤給装工業	1,100	1,067.00	1,173,700
イーグル工業	4,000	916.00	3,664,000
前澤工業	2,200	256.00	563,200
日本ピラー工業	3,000	634.00	1,902,000
キッツ	12,200	384.00	4,684,800
日立工機	7,900	721.00	5,695,900
マキタ	19,400	3,455.00	67,027,000
日立造船	125,000	114.00	14,250,000
三菱重工業	498,000	378.00	188,244,000
IHI	203,000	193.00	39,179,000
イピデン	18,100	2,650.00	47,965,000
コニカミノルタホールディングス	78,500	686.00	53,851,000
ブラザー工業	38,400	1,092.00	41,932,800
ミネベア	44,000	407.00	17,908,000
日立製作所	667,000	452.00	301,484,000
東芝	586,000	433.00	253,738,000
三菱電機	297,000	904.00	268,488,000
富士電機	89,000	240.00	21,360,000
東洋電機製造	5,000	410.00	2,050,000
安川電機	33,000	894.00	29,502,000
シンフォニアテクノロジー	18,000	232.00	4,176,000
明電舎	29,000	349.00	10,121,000
オリジン電気	4,000	399.00	1,596,000
デンヨー	2,800	1,099.00	3,077,200
東芝テック	19,000	363.00	6,897,000
芝浦メカトロニクス	5,000	304.00	1,520,000
マブチモーター	4,000	3,975.00	15,900,000
日本電産	14,700	7,300.00	107,310,000
高岳製作所	12,000	291.00	3,492,000
ダイヘン	16,000	313.00	5,008,000
JVC・ケンウッド・ホールディングス	14,100	387.00	5,456,700
第一精工	800	3,715.00	2,972,000
日新電機	5,000	674.00	3,370,000
大崎電気工業	4,000	641.00	2,564,000
オムロン	33,100	2,115.00	70,006,500
日東工業	4,500	807.00	3,631,500
IDEC	3,500	869.00	3,041,500

エルピーダメモリ	26,400	1,158.00	30,571,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,000	523.00	29,811,000
サクサホールディングス	7,000	127.00	889,000
メルコホールディングス	1,600	2,379.00	3,806,400
テクノメディカ	2	284,000.00	568,000
日本電気	384,000	171.00	65,664,000
富士通	286,000	427.00	122,122,000
沖電気工業	108,000	69.00	7,452,000
岩崎通信機	13,000	82.00	1,066,000
電気興業	9,000	375.00	3,375,000
サンケン電気	17,000	453.00	7,701,000
ナカヨ通信機	3,000	170.00	510,000
アイホン	1,900	1,294.00	2,458,600
ルネサスエレクトロニクス	7,700	699.00	5,382,300
セイコーエプソン	20,300	1,381.00	28,034,300
ワコム	58	97,300.00	5,643,400
アルバック	5,500	1,853.00	10,191,500
アクセル	1,400	1,539.00	2,154,600
ピクセラ	1,200	237.00	284,400
ナナオ	2,500	1,604.00	4,010,000
日本信号	6,900	593.00	4,091,700
京三製作所	6,000	453.00	2,718,000
能美防災	4,000	456.00	1,824,000
ホーチキ	3,000	370.00	1,110,000
マスプロ電工	2,100	692.00	1,453,200
日本無線	9,000	197.00	1,773,000
パナソニック	345,800	959.00	331,622,200
シャープ	133,000	716.00	95,228,000
アンリツ	13,000	628.00	8,164,000
富士通ゼネラル	7,000	453.00	3,171,000
日立国際電気	7,000	677.00	4,739,000
ソニー	166,700	2,241.00	373,574,700
T D K	16,700	4,100.00	68,470,000
帝国通信工業	7,000	151.00	1,057,000
ミツミ電機	10,500	893.00	9,376,500
タムラ製作所	9,000	253.00	2,277,000
アルプス電気	23,400	808.00	18,907,200
池上通信機	9,000	68.00	612,000
パイオニア	42,100	345.00	14,524,500
日本電波工業	2,300	1,224.00	2,815,200
日本トリム	350	1,919.00	671,650
ローランド ディー . ジー .	1,300	1,215.00	1,579,500
フォスター電機	2,800	1,666.00	4,664,800
クラリオン	16,000	132.00	2,112,000
S M K	9,000	329.00	2,961,000
ヨコオ	2,500	515.00	1,287,500
東光	13,000	194.00	2,522,000
ティアック	16,000	37.00	592,000
ホシデン	7,400	755.00	5,587,000
ヒロセ電機	4,800	8,320.00	39,936,000
日本航空電子工業	7,000	558.00	3,906,000
T O A	4,000	451.00	1,804,000

ユニデン	9,000	296.00	2,664,000
アルパイン	5,800	980.00	5,684,000
スミダコーポレーション	1,800	717.00	1,290,600
アイコム	1,600	2,240.00	3,584,000
船井電機	2,700	2,362.00	6,377,400
横河電機	29,700	655.00	19,453,500
新電元工業	10,000	360.00	3,600,000
山武	8,300	1,801.00	14,948,300
日本光電工業	5,500	1,825.00	10,037,500
チノー	6,000	210.00	1,260,000
共和電業	3,000	285.00	855,000
日本電子材料	1,300	470.00	611,000
堀場製作所	5,100	2,540.00	12,954,000
アドバンテスト	20,200	1,512.00	30,542,400
小野測器	3,000	220.00	660,000
エスペック	3,100	576.00	1,785,600
パナソニック電工SUNX	2,600	429.00	1,115,400
キーエンス	6,600	20,050.00	132,330,000
日置電機	1,400	1,585.00	2,219,000
シスメックス	10,400	2,828.00	29,411,200
メガチップス	2,700	1,240.00	3,348,000
OBARA	2,100	985.00	2,068,500
日本電産コパル電子	3,100	551.00	1,708,100
ミヤチテクノス	1,400	620.00	868,000
東京電波	900	481.00	432,900
澤藤電機	2,000	275.00	550,000
コーセル	4,300	1,289.00	5,542,700
日立メディコ	2,000	1,012.00	2,024,000
新日本無線	2,000	203.00	406,000
オプテックス	2,000	1,106.00	2,212,000
千代田インテグレ	1,400	1,039.00	1,454,600
東光電気	2,000	412.00	824,000
スタンレー電気	20,100	1,284.00	25,808,400
岩崎電気	11,000	234.00	2,574,000
ウシオ電機	18,000	1,592.00	28,656,000
岡谷電機産業	1,600	401.00	641,600
ヘリオス テクノ ホールディング	2,700	207.00	558,900
日本セラミック	1,900	1,640.00	3,116,000
新神戸電機	2,000	1,140.00	2,280,000
日本デジタル研究所	2,500	945.00	2,362,500
古河電池	2,000	580.00	1,160,000
双信電機	1,400	424.00	593,600
山一電機	3,000	245.00	735,000
図研	1,700	540.00	918,000
日本電子	11,000	234.00	2,574,000
カシオ計算機	28,300	621.00	17,574,300
ファナック	30,900	12,930.00	399,537,000
日本シイエムケイ	5,800	293.00	1,699,400
エンプラス	1,500	1,108.00	1,662,000
ローム	14,900	4,610.00	68,689,000
浜松ホトニクス	11,600	3,230.00	37,468,000
三井ハイテック	3,500	383.00	1,340,500

新光電気工業	7,500	778.00	5,835,000
京セラ	24,700	8,510.00	210,197,000
太陽誘電	13,000	1,026.00	13,338,000
村田製作所	31,200	5,330.00	166,296,000
ユーシン	3,500	557.00	1,949,500
双葉電子工業	5,100	1,447.00	7,379,700
北陸電気工業	12,000	159.00	1,908,000
ニチコン	9,300	1,195.00	11,113,500
日本ケミコン	18,000	459.00	8,262,000
K O A	3,700	836.00	3,093,200
市光工業	7,000	172.00	1,204,000
小糸製作所	15,000	1,199.00	17,985,000
ミツバ	5,000	585.00	2,925,000
スター精密	5,600	862.00	4,827,200
大日本スクリーン製造	33,000	702.00	23,166,000
キャノン電子	2,700	1,905.00	5,143,500
キャノン	184,500	3,715.00	685,417,500
リコー	89,000	849.00	75,561,000
日本電産サンキョー	7,000	534.00	3,738,000
MUTOHホールディングス	4,000	172.00	688,000
東京エレクトロン	23,300	4,535.00	105,665,500
トヨタ紡織	10,400	1,212.00	12,604,800
鬼怒川ゴム工業	7,000	429.00	3,003,000
ユニプレス	4,300	1,754.00	7,542,200
豊田自動織機	27,000	2,429.00	65,583,000
モリタホールディングス	5,000	460.00	2,300,000
三櫻工業	3,400	639.00	2,172,600

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
株式	日本円	デンソー	65,200	2,763.00	180,147,600	
		東海理化電機製作所	7,000	1,417.00	9,919,000	
		三井造船	115,000	190.00	21,850,000	
		佐世保重工業	19,000	138.00	2,622,000	
		川崎重工業	231,000	312.00	72,072,000	
		日本車輛製造	11,000	339.00	3,729,000	
		日本輸送機	3,000	187.00	561,000	
		近畿車輛	4,000	329.00	1,316,000	
		日産自動車	375,100	803.00	301,205,300	
		いすゞ自動車	172,000	355.00	61,060,000	
		トヨタ自動車	381,500	3,340.00	1,274,210,000	
		日野自動車	37,000	419.00	15,503,000	
		三菱自動車工業	613,000	98.00	60,074,000	
		エフテック	1,000	1,166.00	1,166,000	
		武蔵精密工業	2,900	1,910.00	5,539,000	
		トヨタ車体	5,400	1,313.00	7,090,200	
		日産車体	12,000	572.00	6,864,000	
		関東自動車工業	4,500	534.00	2,403,000	
		新明和工業	13,000	314.00	4,082,000	
		極東開発工業	5,500	386.00	2,123,000	
		日信工業	6,000	1,300.00	7,800,000	
		トピー工業	24,000	197.00	4,728,000	
		ティラド	11,000	332.00	3,652,000	
		曙ブレーキ工業	13,800	389.00	5,368,200	
		タチエス	3,900	1,358.00	5,296,200	
		NOK	14,400	1,390.00	20,016,000	
		フタバ産業	8,400	498.00	4,183,200	
		カヤバ工業	19,000	584.00	11,096,000	
		シロキ工業	7,000	254.00	1,778,000	
		大同メタル工業	5,000	715.00	3,575,000	
		プレス工業	14,000	357.00	4,998,000	
		カルソニックカンセイ	15,000	358.00	5,370,000	
		太平洋工業	6,000	379.00	2,274,000	
		ケーヒン	6,100	1,608.00	9,808,800	
		河西工業	4,000	395.00	1,580,000	
		アイシン精機	24,500	2,870.00	70,315,000	
		富士機工	3,000	259.00	777,000	
		マツダ	230,000	196.00	45,080,000	
		ダイハツ工業	32,000	1,274.00	40,768,000	
		愛知機械工業	7,000	281.00	1,967,000	
		今仙電機製作所	2,000	1,031.00	2,062,000	
		本田技研工業	250,500	3,130.00	784,065,000	
		スズキ	62,100	1,785.00	110,848,500	
富士重工業	94,000	588.00	55,272,000			
ヤマハ発動機	45,100	1,500.00	67,650,000			
ショーワ	6,300	509.00	3,206,700			
T B K	3,000	390.00	1,170,000			
エクセディ	3,600	2,483.00	8,938,800			
豊田合成	8,400	1,660.00	13,944,000			
愛三工業	3,600	771.00	2,775,600			

ヨロズ	1,800	1,650.00	2,970,000
エフ・シー・シー	4,400	1,830.00	8,052,000
シマノ	12,100	4,015.00	48,581,500
タカタ	4,600	2,211.00	10,170,600
テイ・エス テック	5,600	1,383.00	7,744,800
日本電産トーソク	1,800	718.00	1,292,400
テルモ	23,300	4,480.00	104,384,000
クリエートメディック	900	792.00	712,800
日機装	10,000	626.00	6,260,000
島津製作所	35,000	711.00	24,885,000
JMS	4,000	265.00	1,060,000
クボテック	6	41,650.00	249,900
モリテックス	600	425.00	255,000
長野計器	1,900	646.00	1,227,400
ブイ・テクノロジー	4	682,000.00	2,728,000
東京計器	10,000	111.00	1,110,000
愛知時計電機	3,000	287.00	861,000
東京精密	5,700	1,585.00	9,034,500
ニコン	51,700	1,771.00	91,560,700
トプコン	6,800	419.00	2,849,200
オリンパス	35,000	2,430.00	85,050,000
理研計器	2,400	643.00	1,543,200
タムロン	2,900	1,747.00	5,066,300
HOYA	68,200	1,670.00	113,894,000
ノーリツ鋼機	2,700	470.00	1,269,000
エー・アンド・デイ	2,900	296.00	858,400
日本電産コパル	2,300	923.00	2,122,900
シチズンホールディングス	32,300	445.00	14,373,500
リズム時計工業	15,000	113.00	1,695,000
大研医器	400	859.00	343,600
セイコーホールディングス	15,000	252.00	3,780,000
ニプロ	5,900	1,607.00	9,481,300
SRIスポーツ	19	86,200.00	1,637,800
バンダイナムコホールディングス	33,200	875.00	29,050,000
共立印刷	3,500	145.00	507,500
フランスベッドホールディングス	20,000	99.00	1,980,000
パイロットコーポレーション	28	147,600.00	4,132,800
トッパン・フォームズ	6,400	615.00	3,936,000
フジシールインターナショナル	3,100	1,591.00	4,932,100
タカラトミー	8,900	685.00	6,096,500
廣済堂	2,300	208.00	478,400
アーク	10,000	100.00	1,000,000
タカノ	1,200	470.00	564,000
プロネクサス	3,300	384.00	1,267,200
ホクシン	2,100	124.00	260,400
ウッドワン	5,000	313.00	1,565,000
大建工業	12,000	259.00	3,108,000
凸版印刷	84,000	614.00	51,576,000
大日本印刷	90,000	936.00	84,240,000
図書印刷	5,000	138.00	690,000
共同印刷	9,000	178.00	1,602,000
日本写真印刷	5,400	1,522.00	8,218,800

光村印刷	3,000	242.00	726,000
宝印刷	1,700	665.00	1,130,500
アシックス	28,000	1,198.00	33,544,000
ツツミ	1,300	1,843.00	2,395,900
ローランド	2,800	936.00	2,620,800
小松ウオール工業	1,100	735.00	808,500
ヤマハ	23,600	894.00	21,098,400
河合楽器製作所	11,000	146.00	1,606,000
クリナップ	3,000	541.00	1,623,000
ビジョン	2,100	2,733.00	5,739,300
パラマウントベッド	2,300	2,093.00	4,813,900
兼松日産農林	5,000	159.00	795,000
キングジム	2,500	627.00	1,567,500
リンテック	6,400	2,199.00	14,073,600
田崎真珠	6,000	61.00	366,000
イトーキ	6,200	183.00	1,134,600
任天堂	17,000	18,210.00	309,570,000
三菱鉛筆	2,500	1,460.00	3,650,000
タカラスタンダード	14,000	597.00	8,358,000
コクヨ	15,400	584.00	8,993,600
ナカバヤシ	6,000	160.00	960,000
グローブライド	13,000	83.00	1,079,000
岡村製作所	11,000	469.00	5,159,000
美津濃	15,000	353.00	5,295,000
ユニハア-	3,300	736.00	2,428,800
東京電力	218,600	420.00	91,812,000
中部電力	90,900	1,417.00	128,805,300
関西電力	121,200	1,508.00	182,769,600
中国電力	41,100	1,295.00	53,224,500
北陸電力	29,100	1,512.00	43,999,200
東北電力	74,200	1,060.00	78,652,000
四国電力	29,400	1,860.00	54,684,000
九州電力	65,600	1,362.00	89,347,200
北海道電力	27,800	1,323.00	36,779,400
沖縄電力	1,800	3,370.00	6,066,000
電源開発	18,400	2,027.00	37,296,800
東京瓦斯	371,000	341.00	126,511,000
大阪瓦斯	288,000	290.00	83,520,000
東邦瓦斯	76,000	380.00	28,880,000
北海道瓦斯	6,000	250.00	1,500,000
西部瓦斯	33,000	184.00	6,072,000
静岡瓦斯	7,500	470.00	3,525,000
東武鉄道	155,000	313.00	48,515,000
相鉄ホールディングス	47,000	224.00	10,528,000
東京急行電鉄	163,000	332.00	54,116,000
京浜急行電鉄	76,000	558.00	42,408,000
小田急電鉄	95,000	642.00	60,990,000
京王電鉄	77,000	446.00	34,342,000
京成電鉄	48,000	459.00	22,032,000
富士急行	8,000	415.00	3,320,000
新京成電鉄	4,000	342.00	1,368,000
東日本旅客鉄道	51,600	4,505.00	232,458,000

西日本旅客鉄道	277	304,500.00	84,346,500
東海旅客鉄道	258	624,000.00	160,992,000
アートコーポレーション	100	1,783.00	178,300
西日本鉄道	38,000	345.00	13,110,000
ハマキョウレックス	800	2,414.00	1,931,200
サカイ引越センター	500	1,560.00	780,000
近畿日本鉄道	268,000	240.00	64,320,000
阪急阪神ホールディングス	199,000	351.00	69,849,000
南海電気鉄道	62,000	306.00	18,972,000
京阪電気鉄道	67,000	332.00	22,244,000
名糖運輸	1,100	579.00	636,900
名古屋鉄道	104,000	211.00	21,944,000
日本通運	118,000	313.00	36,934,000
ヤマトホールディングス	60,400	1,211.00	73,144,400
山九	36,000	361.00	12,996,000
丸運	1,600	197.00	315,200
丸全昭和運輸	10,000	244.00	2,440,000
センコー	12,000	237.00	2,844,000
トナミホールディングス	6,000	133.00	798,000
日本梱包運輸倉庫	9,000	816.00	7,344,000
日本石油輸送	3,000	206.00	618,000
福山通運	21,000	391.00	8,211,000
セイノーホールディングス	23,000	581.00	13,363,000
神奈川中央交通	3,000	402.00	1,206,000
日立物流	5,200	1,171.00	6,089,200
日本郵船	251,000	302.00	75,802,000
商船三井	145,000	440.00	63,800,000
川崎汽船	92,000	283.00	26,036,000
NSユナイテッド海運	11,000	161.00	1,771,000
乾汽船	3,500	407.00	1,424,500
明治海運	2,700	264.00	712,800
飯野海運	14,300	353.00	5,047,900
共栄タンカー	2,000	154.00	308,000
第一中央汽船	19,000	151.00	2,869,000
全日本空輸	396,000	235.00	93,060,000
パスコ	3,000	272.00	816,000
国際航業ホールディングス	2,000	289.00	578,000
日新	11,000	204.00	2,244,000
三菱倉庫	21,000	873.00	18,333,000
三井倉庫	14,000	301.00	4,214,000
住友倉庫	22,000	356.00	7,832,000
澁澤倉庫	8,000	262.00	2,096,000
東陽倉庫	5,000	171.00	855,000
日本トランスシティ	6,000	255.00	1,530,000
ケイヒン	5,000	92.00	460,000
安田倉庫	2,500	451.00	1,127,500
東洋埠頭	9,000	132.00	1,188,000
宇徳	2,100	206.00	432,600
上組	33,000	681.00	22,473,000
サンリツ	800	585.00	468,000
キムラユニティー	700	658.00	460,600
キューソー流通システム	900	849.00	764,100

郵船ロジスティクス	2,300	1,435.00	3,300,500
近鉄エクスプレス	2,700	2,801.00	7,562,700
東海運	1,600	188.00	300,800
バンテック	3	127,900.00	383,700
システナ	29	70,100.00	2,032,900
新日鉄ソリューションズ	2,400	1,504.00	3,609,600
コア	1,100	615.00	676,500
デジタルハーツ	2	152,200.00	304,400
ITホールディングス	9,700	715.00	6,935,500
グリー	12,700	1,521.00	19,316,700
コーエーテックホールディングス	5,800	616.00	3,572,800
三菱総合研究所	1,100	1,541.00	1,695,100
ドワンゴ	15	192,300.00	2,884,500
ベリサーブ	2	112,900.00	225,800
マクロミル	3,600	819.00	2,948,400
ティーガイア	24	136,800.00	3,283,200
GMOペイメントゲートウェイ	6	263,000.00	1,578,000
ザッパラス	16	107,700.00	1,723,200
インターネットイニシアティブ	17	265,000.00	4,505,000
ソネットエンタテインメント	16	297,200.00	4,755,200
SRAホールディングス	1,500	735.00	1,102,500
JBI Sホールディングス	3,000	275.00	825,000
朝日ネット	2,000	314.00	628,000
パナソニック電工インフォメーションシステ	600	2,136.00	1,281,600
フェイス	99	12,470.00	1,234,530
野村総合研究所	16,600	1,636.00	27,157,600
サイバネットシステム	24	20,560.00	493,440
インテージ	900	1,675.00	1,507,500
シンプレクス・ホールディングス	49	33,500.00	1,641,500
クレスコ	900	530.00	477,000
フジ・メディア・ホールディングス	305	101,100.00	30,835,500
オービック	1,010	14,610.00	14,756,100
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	600	697.00	418,200
ヤフー	2,146	27,620.00	59,272,520
トレンドマイクロ	12,900	2,351.00	30,327,900
日本オラクル	4,700	3,560.00	16,732,000
アルファシステムズ	800	1,205.00	964,000
フューチャーアーキテクト	35	33,400.00	1,169,000
シーエーシー	1,800	634.00	1,141,200
ソフトバンク・テクノロジー	700	600.00	420,000
トーセ	700	499.00	349,300
オービックビジネスコンサルタント	750	4,635.00	3,476,250
日立ビジネスソリューション	900	680.00	612,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,200	2,724.00	11,440,800
アイティフォー	3,300	242.00	798,600
東計電算	500	1,027.00	513,500
エクスネット	3	123,600.00	370,800
大塚商会	2,300	5,020.00	11,546,000
サイボウズ	39	16,260.00	634,140
ソフトブレイン	43	9,100.00	391,300
アグレックス	700	740.00	518,000
電通国際情報サービス	1,800	518.00	932,400

ウェザーニューズ	900	1,751.00	1,575,900
C I J	2,900	271.00	785,900
WOWOW	9	149,700.00	1,347,300
日本コロムビア	24,000	36.00	864,000
ネットワンシステムズ	71	141,400.00	10,039,400
アルゴグラフィックス	1,100	984.00	1,082,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	5,500	1,012.00	5,566,000
日本ユニシス	8,100	450.00	3,645,000
兼松エレクトロニクス	1,800	820.00	1,476,000
東京放送ホールディングス	15,800	938.00	14,820,400
日本テレビ放送網	2,570	10,990.00	28,244,300
テレビ朝日	74	116,900.00	8,650,600
スカパーJ S A Tホールディングス	222	31,300.00	6,948,600
テレビ東京ホールディングス	1,300	990.00	1,287,000
アイ・ティー・シーネットワーク	2,500	463.00	1,157,500
イー・アクセス	160	36,850.00	5,896,000
N E Cモバイリング	1,100	2,583.00	2,841,300
日本電信電話	110,100	3,795.00	417,829,500
K D D I	455	555,000.00	252,525,000
光通信	3,800	1,788.00	6,794,400
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,415	146,100.00	352,831,500
G M Oインターネット	8,300	347.00	2,880,100
学研ホールディングス	9,000	134.00	1,206,000
ゼンリン	4,200	751.00	3,154,200
昭文社	1,800	581.00	1,045,800
角川グループホールディングス	2,800	2,140.00	5,992,000
インプレスホールディングス	2,400	122.00	292,800
アイネット	1,400	416.00	582,400
松竹	18,000	582.00	10,476,000
東宝	19,200	1,246.00	23,923,200
東映	12,000	342.00	4,104,000
葵プロモーション	1,500	422.00	633,000
エヌ・ティ・ティ・データ	207	258,200.00	53,447,400
D T S	2,800	805.00	2,254,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,600	1,343.00	12,892,800
シーイーシー	1,900	382.00	725,800
カプコン	6,200	1,565.00	9,703,000
ジャステック	1,700	468.00	795,600
住商情報システム	3,000	1,067.00	3,201,000
C S K	12,400	244.00	3,025,600
日本システムウエア	1,100	312.00	343,200
アイネス	4,000	494.00	1,976,000
T K C	2,500	1,673.00	4,182,500
富士ソフト	4,000	1,122.00	4,488,000
N S D	5,700	711.00	4,052,700
コナミ	13,500	1,537.00	20,749,500
福井コンピュータ	600	431.00	258,600
J B C Cホールディングス	2,400	498.00	1,195,200
ソフトバンク	129,800	2,980.00	386,804,000
ハウスイ	2,000	89.00	178,000
インターニクス	1,200	336.00	403,200
高千穂交易	1,200	844.00	1,012,800

伊藤忠食品	700	2,783.00	1,948,100
エレマテック	2,300	993.00	2,283,900
JALUX	800	671.00	536,800
トーメンデバイス	400	1,868.00	747,200
東京エレクトロン デバイス	6	149,000.00	894,000
双日	196,200	142.00	27,860,400
アルフレッサ ホールディングス	7,700	2,860.00	22,022,000
横浜冷凍	6,800	537.00	3,651,600
神栄	4,000	130.00	520,000
山下医科器械	200	1,097.00	219,400
ラサ商事	1,300	330.00	429,000
アルコニックス	600	2,061.00	1,236,600
あい ホールディングス	5,200	331.00	1,721,200
ダイワボウホールディングス	27,000	161.00	4,347,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,500	667.00	3,668,500
UKCホールディングス	1,700	805.00	1,368,500
TOKAIホールディングス	14,300	365.00	5,219,500
日本コークス工業	25,000	135.00	3,375,000
ミタチ産業	700	420.00	294,000
JFE商事ホールディングス	20,000	338.00	6,760,000
シップヘルスケアホールディングス	3,800	1,101.00	4,183,800
ソフトクリエイト	300	1,139.00	341,700
富士興産	11,000	76.00	836,000
協栄産業	3,000	145.00	435,000
小野建	2,500	701.00	1,752,500
佐島電機	2,200	508.00	1,117,600
エコートレーディング	700	698.00	488,600
伯東	1,800	788.00	1,418,400
中山福	1,700	562.00	955,400
ナガイレーベン	1,900	2,229.00	4,235,100
菱食	2,800	1,669.00	4,673,200
松田産業	2,100	1,131.00	2,375,100
メディバルホールディングス	27,100	698.00	18,915,800
アドヴァン	1,700	676.00	1,149,200
SPK	600	1,212.00	727,200
アズワン	1,900	1,659.00	3,152,100
スズデン	900	455.00	409,500
尾家産業	900	753.00	677,700
シモジマ	2,000	870.00	1,740,000
ドウシシャ	1,400	1,752.00	2,452,800
高速	1,700	577.00	980,900
黒田電気	3,900	848.00	3,307,200
丸文	2,300	385.00	885,500
ハピネット	800	923.00	738,400
トーメンエレクトロニクス	1,200	1,029.00	1,234,800
エクセル	1,400	855.00	1,197,000
マルカキカイ	900	606.00	545,400
ガリバーインターナショナル	790	3,140.00	2,480,600
日本エム・ディ・エム	2,400	201.00	482,400
進和	1,700	861.00	1,463,700
エスケイジャパン	700	236.00	165,200
ダイトエレクトロン	1,200	650.00	780,000

シークス	1,900	1,190.00	2,261,000
田中商事	900	461.00	414,900
オーハシテクニカ	1,600	562.00	899,200
マクニカ	1,300	1,824.00	2,371,200
白銅	900	794.00	714,600
伊藤忠商事	204,600	827.00	169,204,200
丸紅	256,000	553.00	141,568,000
高島	5,000	207.00	1,035,000
F & A アクアホールディングス	2,300	725.00	1,667,500
長瀬産業	16,600	909.00	15,089,400
蝶理	20,000	99.00	1,980,000
豊田通商	32,600	1,306.00	42,575,600
三共生興	5,000	250.00	1,250,000
兼松	66,000	79.00	5,214,000
ツカモトコーポレーション	5,000	83.00	415,000
三井物産	253,000	1,347.00	340,791,000
日本紙パルプ商事	17,000	282.00	4,794,000
日立ハイテクノロジーズ	8,900	1,597.00	14,213,300
カメイ	3,000	305.00	915,000
東都水産	5,000	125.00	625,000
スターゼン	10,000	234.00	2,340,000
山善	11,200	481.00	5,387,200
椿本興業	3,000	195.00	585,000
住友商事	161,400	1,068.00	172,375,200
内田洋行	7,000	255.00	1,785,000
三菱商事	234,700	2,032.00	476,910,400
第一実業	6,000	330.00	1,980,000
キヤノンマーケティングジャパン	9,800	859.00	8,418,200
西華産業	11,000	209.00	2,299,000
佐藤商事	2,600	428.00	1,112,800
菱洋エレクトロ	3,600	830.00	2,988,000
東京産業	3,000	240.00	720,000
ユアサ商事	30,000	116.00	3,480,000
神鋼商事	7,000	193.00	1,351,000
阪和興業	27,000	334.00	9,018,000
カナデン	3,000	492.00	1,476,000
菱電商事	5,000	498.00	2,490,000
フルサト工業	1,700	571.00	970,700
岩谷産業	32,000	255.00	8,160,000
すてきなイスグループ	13,000	174.00	2,262,000
昭光通商	10,000	107.00	1,070,000
ニチモウ	4,000	145.00	580,000
極東貿易	4,000	168.00	672,000
イワキ	4,000	188.00	752,000
三愛石油	7,000	416.00	2,912,000
稲畑産業	7,800	461.00	3,595,800
G S I クレオス	8,000	115.00	920,000
明和産業	2,300	244.00	561,200
東邦ホールディングス	8,900	790.00	7,031,000
サンゲツ	5,200	1,898.00	9,869,600
ミツウロコ	4,700	508.00	2,387,600
シナネン	6,000	326.00	1,956,000

伊藤忠エネクス	6,500	418.00	2,717,000
サンリオ	8,200	2,884.00	23,648,800
サンワテクノス	1,400	792.00	1,108,800
リョーサン	4,800	1,788.00	8,582,400
新光商事	2,700	643.00	1,736,100
トーホー	6,000	303.00	1,818,000
三信電気	3,600	641.00	2,307,600
東陽テクニカ	4,200	823.00	3,456,600
モスフードサービス	3,800	1,488.00	5,654,400
加賀電子	2,900	891.00	2,583,900
ソーダニッカ	3,000	327.00	981,000
立花エレテック	1,800	743.00	1,337,400
P a l t a c	2,400	1,266.00	3,038,400
太平洋興発	10,000	74.00	740,000
ヤマタネ	15,000	114.00	1,710,000
丸紅建材リース	3,000	145.00	435,000
日鐵商事	7,000	218.00	1,526,000
トラスコ中山	3,700	1,429.00	5,287,300
オートバックスセブン	3,800	3,170.00	12,046,000
加藤産業	4,200	1,402.00	5,888,400
イノテック	1,800	516.00	928,800
イエローハット	2,800	790.00	2,212,000
富士エレクトロニクス	1,700	1,307.00	2,221,900
J Kホールディングス	2,700	385.00	1,039,500
日伝	1,200	2,339.00	2,806,800
北沢産業	2,500	169.00	422,500
杉本商事	1,600	731.00	1,169,600
因幡電機産業	3,500	2,043.00	7,150,500
住金物産	14,000	178.00	2,492,000
ミスミグループ本社	9,900	1,939.00	19,196,100
江守商事	600	831.00	498,600
アルテック	1,200	287.00	344,400
タキヒヨー	4,000	388.00	1,552,000
スズケン	12,100	1,837.00	22,227,700
ジェコス	2,000	360.00	720,000
ローソン	10,200	3,975.00	40,545,000
サンエー	1,000	3,090.00	3,090,000
キリン堂	1,300	412.00	535,600
ダイユーエイト	400	446.00	178,400
カワチ薬品	2,000	1,546.00	3,092,000
エービーシー・マート	3,500	3,045.00	10,657,500
ハードオフコーポレーション	1,400	395.00	553,000
アスクル	2,300	1,146.00	2,635,800
ゲオ	49	92,000.00	4,508,000
ポイント	2,470	3,555.00	8,780,850
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	101.00	202,000
くらコーポレーション	1,500	1,120.00	1,680,000
キャンドウ	12	75,700.00	908,400
バル	850	2,717.00	2,309,450
エディオン	10,700	657.00	7,029,900
サーラコーポレーション	3,000	362.00	1,086,000
バルス	14	75,700.00	1,059,800

あみやき亭	5	227,800.00	1,139,000	
ひらまつ	6	92,500.00	555,000	
ハニーズ	2,570	800.00	2,056,000	
アルペン	1,900	1,296.00	2,462,400	
ビックカメラ	111	38,250.00	4,245,750	
D C Mホールディングス	13,800	510.00	7,038,000	
M o n o t a R O	500	1,110.00	555,000	
ユニバース	500	1,196.00	598,000	
J . フロント リテイリング	69,000	315.00	21,735,000	
ドトール・日レスホールディングス	5,100	953.00	4,860,300	
マツモトキヨシホールディングス	5,400	1,628.00	8,791,200	
ココカラファイン	2,800	1,827.00	5,115,600	
三越伊勢丹ホールディングス	58,200	736.00	42,835,200	
クリエイト S Dホールディングス	1,200	1,872.00	2,246,400	
丸善 C H Iホールディングス	1,700	223.00	379,100	
ブックオフコーポレーション	1,800	673.00	1,211,400	
あさひ	1,200	1,551.00	1,861,200	
サークルKサンクス	6,400	1,209.00	7,737,600	
日本調剤	370	2,811.00	1,040,070	
コスモス薬品	1,500	3,250.00	4,875,000	
セブン&アイ・ホールディングス	122,600	2,028.00	248,632,800	
ツルハホールディングス	2,600	3,660.00	9,516,000	
サンマルクホールディングス	900	2,939.00	2,645,100	
フェリシモ	800	956.00	764,800	
トリドール	11	88,100.00	969,100	
クスリのアオキ	400	1,166.00	466,400	
メディカルシステムネットワーク	500	695.00	347,500	
総合メディカル	600	2,598.00	1,558,800	
はるやま商事	1,400	380.00	532,000	
カッパ・クリエイト	2,150	1,517.00	3,261,550	
ライトオン	2,200	398.00	875,600	
ジーンズメイト	900	222.00	199,800	
良品計画	3,400	3,645.00	12,393,000	
三城ホールディングス	3,600	816.00	2,937,600	
コナカ	3,400	403.00	1,370,200	
ハウス オブ ローゼ	300	1,199.00	359,700	
G - 7ホールディングス	700	400.00	280,000	
イオン北海道	2,100	325.00	682,500	
コジマ	3,600	460.00	1,656,000	
コーナン商事	2,900	1,269.00	3,680,100	
エコス	1,000	433.00	433,000	
ワタミ	3,500	1,417.00	4,959,500	
マルシェ	800	670.00	536,000	
ドン・キホーテ	5,700	2,790.00	15,903,000	
メガネトップ	3,100	842.00	2,610,200	
西松屋チェーン	6,400	675.00	4,320,000	
ゼンショー	11,200	914.00	10,236,800	
幸楽苑	1,800	1,075.00	1,935,000	
ハークスレイ	800	519.00	415,200	
サイゼリヤ	4,300	1,372.00	5,899,600	
ポプラ	800	426.00	340,800	
ユナイテッドアローズ	2,800	1,388.00	3,886,400	

ハイデイ日高	1,300	1,186.00	1,541,800
京都きもの友禅	1,900	870.00	1,653,000
コロワイド	9,500	442.00	4,199,000
壱番屋	1,200	2,448.00	2,937,600
トップカルチャー	1,100	332.00	365,200
スギホールディングス	4,700	1,900.00	8,930,000
スクロール	4,100	266.00	1,090,600
ファミリーマート	9,900	2,905.00	28,759,500
木曽路	3,300	1,599.00	5,276,700
千趣会	5,300	474.00	2,512,200
タカキュー	2,500	154.00	385,000
ケーヨー	5,500	400.00	2,200,000
上新電機	6,000	798.00	4,788,000
日本瓦斯	2,800	1,067.00	2,987,600
ベスト電器	9,000	212.00	1,908,000
マルエツ	6,000	297.00	1,782,000
ロイヤルホールディングス	4,500	831.00	3,739,500
東天紅	2,000	124.00	248,000
いなげや	3,000	851.00	2,553,000
島忠	6,600	1,809.00	11,939,400
チヨダ	3,800	1,070.00	4,066,000
鈴丹	700	146.00	102,200
ライフコーポレーション	1,800	1,219.00	2,194,200
カスミ	6,000	434.00	2,604,000
リンガーハット	2,200	1,043.00	2,294,600
さが美	2,000	100.00	200,000
Mr Max	2,900	281.00	814,900
テナアライド	2,000	231.00	462,000
AOKIホールディングス	2,700	1,196.00	3,229,200
オークワ	4,000	859.00	3,436,000
コメリ	4,000	2,125.00	8,500,000
青山商事	7,500	1,271.00	9,532,500
しまむら	3,100	7,490.00	23,219,000
CFSコーポレーション	3,000	343.00	1,029,000
高島屋	40,000	515.00	20,600,000
松屋	5,400	389.00	2,100,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	17,000	521.00	8,857,000
丸栄	5,000	85.00	425,000
ニッセンホールディングス	5,800	489.00	2,836,200
バルコ	7,600	656.00	4,985,600
丸井グループ	38,200	532.00	20,322,400
原信ナルスホールディングス	1,700	1,179.00	2,004,300
井筒屋	16,000	52.00	832,000
ダイエー	13,550	288.00	3,902,400
イズミヤ	10,000	337.00	3,370,000
イオン	103,300	943.00	97,411,900
ユニー	23,800	681.00	16,207,800
イズミ	8,000	1,104.00	8,832,000
東武ストア	4,000	239.00	956,000
平和堂	5,900	975.00	5,752,500
フジ	3,300	1,688.00	5,570,400
ヤオコー	1,300	2,431.00	3,160,300

ゼビオ	3,500	1,611.00	5,638,500
ケーズホールディングス	6,800	2,852.00	19,393,600
O l y m p i c	1,900	530.00	1,007,000
日産東京販売ホールディングス	4,000	104.00	416,000
アインファーマシーズ	1,600	3,060.00	4,896,000
元気寿司	900	896.00	806,400
ヤマダ電機	13,370	6,330.00	84,632,100
アークランドサカモト	1,700	1,085.00	1,844,500
ニトリホールディングス	5,800	7,020.00	40,716,000
グルメ杵屋	2,000	474.00	948,000
愛眼	2,300	421.00	968,300
吉野家ホールディングス	79	97,600.00	7,710,400
松屋フーズ	1,400	1,506.00	2,108,400
サガミチェーン	3,000	479.00	1,437,000
プレナス	3,700	1,236.00	4,573,200
ミニストップ	2,200	1,321.00	2,906,200
イメージホールディングス	300	310.00	93,000
アークス	3,800	1,211.00	4,601,800
パロー	5,800	1,000.00	5,800,000
ベルク	1,400	958.00	1,341,200
大庄	1,400	907.00	1,269,800
ファーストリテイリング	6,800	11,970.00	81,396,000
サンドラッグ	5,600	2,310.00	12,936,000
ヤマザワ	800	1,054.00	843,200
やまや	500	649.00	324,500
ベルーナ	3,650	544.00	1,985,600
新生銀行	203,000	92.00	18,676,000
あおぞら銀行	107,000	175.00	18,725,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,218,000	377.00	836,186,000
りそなホールディングス	180,900	369.00	66,752,100
三井住友トラスト・ホールディングス	559,000	285.00	159,315,000
三井住友フィナンシャルグループ	223,402	2,401.00	536,388,202
第四銀行	38,000	243.00	9,234,000
北越銀行	33,000	164.00	5,412,000
西日本シティ銀行	103,000	232.00	23,896,000
札幌北洋ホールディングス	44,200	350.00	15,470,000
千葉銀行	116,000	486.00	56,376,000
横浜銀行	201,000	398.00	79,998,000
常陽銀行	113,000	325.00	36,725,000
群馬銀行	67,000	427.00	28,609,000
武蔵野銀行	4,700	2,534.00	11,909,800
千葉興業銀行	5,600	427.00	2,391,200
筑波銀行	12,900	232.00	2,992,800
東京都民銀行	5,500	1,020.00	5,610,000
七十七銀行	49,000	354.00	17,346,000
青森銀行	23,000	245.00	5,635,000
秋田銀行	20,000	227.00	4,540,000
山形銀行	18,000	381.00	6,858,000
岩手銀行	2,000	3,080.00	6,160,000
東邦銀行	25,000	201.00	5,025,000
東北銀行	16,000	118.00	1,888,000
みちのく銀行	15,000	139.00	2,085,000

ふくおかフィナンシャルグループ	119,000	328.00	39,032,000
静岡銀行	88,000	746.00	65,648,000
十六銀行	37,000	234.00	8,658,000
スルガ銀行	31,000	666.00	20,646,000
八十二銀行	54,000	471.00	25,434,000
山梨中央銀行	18,000	329.00	5,922,000
大垣共立銀行	39,000	244.00	9,516,000
福井銀行	25,000	244.00	6,100,000
北國銀行	33,000	273.00	9,009,000
清水銀行	1,000	2,986.00	2,986,000
滋賀銀行	28,000	433.00	12,124,000
南都銀行	27,000	353.00	9,531,000
百五銀行	26,000	331.00	8,606,000
京都銀行	52,000	720.00	37,440,000
三重銀行	13,000	208.00	2,704,000
ほくほくフィナンシャルグループ	205,000	152.00	31,160,000
広島銀行	86,000	350.00	30,100,000
山陰合同銀行	17,000	570.00	9,690,000
中国銀行	24,000	936.00	22,464,000
鳥取銀行	9,000	156.00	1,404,000
伊予銀行	31,000	699.00	21,669,000
百十四銀行	34,000	285.00	9,690,000
四国銀行	21,000	235.00	4,935,000
阿波銀行	24,000	486.00	11,664,000
鹿児島銀行	19,000	530.00	10,070,000
大分銀行	19,000	245.00	4,655,000
宮崎銀行	20,000	176.00	3,520,000
肥後銀行	23,000	450.00	10,350,000
佐賀銀行	18,000	197.00	3,546,000
十八銀行	19,000	212.00	4,028,000
沖縄銀行	2,200	3,285.00	7,227,000
琉球銀行	6,200	972.00	6,026,400
みずほ信託銀行	278,000	69.00	19,182,000
八千代銀行	1,500	2,309.00	3,463,500
みずほフィナンシャルグループ	3,615,000	128.00	462,720,000
紀陽ホールディングス	116,000	112.00	12,992,000
山口フィナンシャルグループ	29,000	725.00	21,025,000
長野銀行	10,000	164.00	1,640,000
名古屋銀行	26,000	246.00	6,396,000
愛知銀行	1,000	4,490.00	4,490,000
第三銀行	18,000	185.00	3,330,000
中京銀行	12,000	184.00	2,208,000
東日本銀行	15,000	159.00	2,385,000
大光銀行	11,000	233.00	2,563,000
愛媛銀行	18,000	215.00	3,870,000
トマト銀行	11,000	146.00	1,606,000
みなと銀行	30,000	154.00	4,620,000
京葉銀行	24,000	392.00	9,408,000
関西アーバン銀行	41,000	147.00	6,027,000
栃木銀行	15,000	315.00	4,725,000
北日本銀行	900	1,864.00	1,677,600
東和銀行	31,000	92.00	2,852,000

福島銀行	36,000	43.00	1,548,000
大東銀行	19,000	47.00	893,000
トモニホールディングス	22,500	257.00	5,782,500
フィデアホールディングス	16,900	194.00	3,278,600
池田泉州ホールディングス	109,900	110.00	12,089,000
S B Iホールディングス	3,494	8,000.00	27,952,000
日本アジア投資	20,000	86.00	1,720,000
ジャフコ	4,000	1,919.00	7,676,000
大和証券グループ本社	290,000	330.00	95,700,000
野村ホールディングス	617,200	388.00	239,473,600
みずほ証券	75,000	187.00	14,025,000
みずほインベスターズ証券	68,000	71.00	4,828,000
岡三証券グループ	25,000	261.00	6,525,000
丸三証券	9,200	314.00	2,888,800
東洋証券	11,000	113.00	1,243,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	34,000	216.00	7,344,000
光世証券	7,000	69.00	483,000
水戸証券	8,000	109.00	872,000
いちよし証券	6,600	469.00	3,095,400
松井証券	17,400	362.00	6,298,800
だいら証券ビジネス	1,600	261.00	417,600
マネックスグループ	173	14,740.00	2,550,020
カブドットコム証券	11,900	237.00	2,820,300
極東証券	3,900	508.00	1,981,200
岩井コスモホールディングス	2,800	384.00	1,075,200
小林洋行	800	196.00	156,800
N K S Jホールディングス	245,000	496.00	121,520,000
M S & A Dインシュアランスグループホール	87,600	1,862.00	163,111,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	28,100	1,402.00	39,396,200
第一生命保険	1,567	119,600.00	187,413,200
富士火災海上保険	6,000	144.00	864,000
東京海上ホールディングス	111,300	2,177.00	242,300,100
T & Dホールディングス	53,400	1,835.00	97,989,000
クレディセゾン	22,200	1,235.00	27,417,000
フィデック	18	11,410.00	205,380
芙蓉総合リース	2,800	2,422.00	6,781,600
興銀リース	4,100	1,877.00	7,695,700
東京センチュリーリース	6,900	1,309.00	9,032,100
日本証券金融	12,100	446.00	5,396,600
大阪証券金融	3,400	148.00	503,200
ポケットカード	2,800	247.00	691,600
リコーリース	2,000	1,734.00	3,468,000
イオンクレジットサービス	13,000	1,014.00	13,182,000
アコム	5,890	1,228.00	7,232,920
プロミス	14,900	639.00	9,521,100
ジャックス	19,000	207.00	3,933,000
オリエントコーポレーション	40,000	94.00	3,760,000
日立キャピタル	6,900	1,048.00	7,231,200
オリックス	15,250	7,730.00	117,882,500
三菱UFJリース	7,430	3,050.00	22,661,500
アサックス	4	121,000.00	484,000
N E Cキャピタルソリューション	800	1,095.00	876,000

日本駐車場開発	318	3,670.00	1,167,060
昭栄	5,300	737.00	3,906,100
東京建物不動産販売	800	243.00	194,400
野村不動産ホールディングス	12,300	1,256.00	15,448,800
常和ホールディングス	500	1,217.00	608,500
ヒューリック	8,300	691.00	5,735,300
パーク24	13,700	821.00	11,247,700
三井不動産	138,000	1,366.00	188,508,000
三菱地所	205,000	1,373.00	281,465,000
平和不動産	26,500	175.00	4,637,500
東京建物	60,000	288.00	17,280,000
ダイビル	8,600	610.00	5,246,000
サンケイビル	5,700	446.00	2,542,200
東急不動産	59,000	346.00	20,414,000
京阪神不動産	3,500	381.00	1,333,500
住友不動産	70,000	1,638.00	114,660,000
東宝不動産	3,100	438.00	1,357,800
大京	49,000	132.00	6,468,000
テーオーシー	11,400	321.00	3,659,400
東京楽天地	5,000	266.00	1,330,000
レオパレス21	17,700	107.00	1,893,900
フジ住宅	3,100	349.00	1,081,900
空港施設	3,000	308.00	924,000
明和地所	1,700	420.00	714,000
住友不動産販売	1,050	3,425.00	3,596,250
ゴールドクレスト	2,640	1,649.00	4,353,360
東栄住宅	2,200	889.00	1,955,800
日本エスリード	1,300	692.00	899,600
東急リパブル	3,100	701.00	2,173,100
飯田産業	3,300	713.00	2,352,900
日神不動産	1,700	449.00	763,300
アーネストワン	5,500	745.00	4,097,500
タカラレーベン	2,800	506.00	1,416,800
サンヨーハウジング名古屋	12	74,000.00	888,000
イオンモール	13,400	1,906.00	25,540,400
フージャースコーポレーション	45	32,600.00	1,467,000
タクトホーム	16	72,000.00	1,152,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	212	68,800.00	14,585,600
サンフロンティア不動産	27	8,330.00	224,910
ランドビジネス	20	14,000.00	280,000
日本空港ビルデング	9,300	919.00	8,546,700
日本工営	10,000	270.00	2,700,000
ネクスト	10	57,000.00	570,000
日本M&Aセンター	7	383,000.00	2,681,000
ノバレーゼ	5	55,300.00	276,500
アコーディア・ゴルフ	87	52,500.00	4,567,500
パソナグループ	31	72,000.00	2,232,000
リンクアンドモチベーション	6	45,350.00	272,100
テンブホールディングス	4,200	707.00	2,969,400
学情	1,000	272.00	272,000
スタジオアリス	1,300	855.00	1,111,500
シミック	1,000	1,278.00	1,278,000

NECフィールドディング	2,500	893.00	2,232,500
総合警備保障	11,300	871.00	9,842,300
カカクコム	21	476,500.00	10,006,500
ルネサンス	1,400	297.00	415,800
新日本科学	1,900	294.00	558,600
エムスリー	12	538,000.00	6,456,000
ベストブライダル	5	65,600.00	328,000
ディー・エヌ・エー	12,100	2,783.00	33,674,300
博報堂DYホールディングス	4,300	4,075.00	17,522,500
ぐるなび	2,200	881.00	1,938,200
一休	22	34,150.00	751,300
ジャパンベストレスキューシステム	4	71,200.00	284,800
ジェイコムホールディングス	3	183,000.00	549,000
PGMホールディングス	65	43,050.00	2,798,250
イーピーエス	17	174,300.00	2,963,100
アミューズ	900	878.00	790,200
ドリームインキュベータ	9	69,000.00	621,000
TAC	1,700	252.00	428,400
ケネディクス	350	12,920.00	4,522,000
電通	28,200	2,156.00	60,799,200
テイクアンドグヴ・ニーズ	155	5,150.00	798,250
びあ	900	803.00	722,700
イオンファンタジー	1,000	861.00	861,000
ネクシィーズ	124	2,502.00	310,248
みらかホールディングス	7,500	3,060.00	22,950,000
アルプス技研	1,300	602.00	782,600
ダイオーズ	600	485.00	291,000
日本空調サービス	800	687.00	549,600
オリエンタルランド	8,400	6,880.00	57,792,000
ダスキン	8,700	1,559.00	13,563,300
明光ネットワークジャパン	2,800	746.00	2,088,800
ファルコSDホールディングス	1,600	704.00	1,126,400
秀英予備校	500	289.00	144,500
田谷	500	628.00	314,000
ラウンドワン	7,900	435.00	3,436,500
リゾートトラスト	4,800	968.00	4,646,400
ビー・エム・エル	1,800	2,114.00	3,805,200
ワタベウェディング	900	682.00	613,800
もしもしホットライン	1,900	1,361.00	2,585,900
東急コミュニティー	800	2,380.00	1,904,000
リソー教育	315	4,000.00	1,260,000
ウェアハウス	700	250.00	175,000
ユー・エス・エス	4,040	6,230.00	25,169,200
東京個別指導学院	2,200	167.00	367,400
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	3,600	595.00	2,142,000
テー・オー・ダブリュー	900	450.00	405,000
セントラルスポーツ	1,000	893.00	893,000
フルキャストホールディングス	26	22,060.00	573,560
リゾートソリューション	3,000	135.00	405,000
エイチ・アイ・エス	3,200	1,932.00	6,182,400
共立メンテナンス	1,400	1,055.00	1,477,000
イチネンホールディングス	3,200	375.00	1,200,000

建設技術研究所	1,800	540.00	972,000	
燦ホールディングス	600	1,233.00	739,800	
スバル興業	2,000	242.00	484,000	
東京テアトル	12,000	106.00	1,272,000	
ホリプロ	1,000	697.00	697,000	
よみうりランド	7,000	265.00	1,855,000	
東京都競馬	21,000	103.00	2,163,000	
常磐興産	10,000	80.00	800,000	
カナモト	4,000	579.00	2,316,000	
東京ドーム	23,000	164.00	3,772,000	
トランス・コスモス	4,000	780.00	3,120,000	
乃村工藝社	6,000	240.00	1,440,000	
藤田観光	8,000	300.00	2,400,000	
近畿日本ツーリスト	10,000	84.00	840,000	
日本管財	1,100	1,325.00	1,457,500	
トーカイ	1,400	1,486.00	2,080,400	
白洋舎	3,000	190.00	570,000	
セコム	32,300	3,870.00	125,001,000	
セントラル警備保障	1,400	767.00	1,073,800	
丹青社	3,000	273.00	819,000	
メイテック	4,500	1,585.00	7,132,500	
アサツー ディ・ケイ	5,000	2,057.00	10,285,000	
応用地質	3,000	754.00	2,262,000	
船井総合研究所	3,200	509.00	1,628,800	
進学会	1,700	296.00	503,200	
ベネッセホールディングス	9,800	3,255.00	31,899,000	
イオンディライト	3,500	1,421.00	4,973,500	
ナック	700	1,335.00	934,500	
ニチイ学館	5,400	624.00	3,369,600	
ダイセキ	4,600	1,571.00	7,226,600	
小計	銘柄数：1,660		33,176,605,870	
	組入時価比率：92.8%		100.0%	
合計			33,176,605,870	

(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。

(口) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引契約額等、時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりです。

第3 不動産等明細表

該当事項はありません。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第5 借入金明細表

該当事項はありません。

[次△](#)

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。

(1) 貸借対照表

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	249,296,199	363,799,550
国債証券	53,957,563,600	55,040,314,200
地方債証券	4,140,432,302	4,931,348,665
特殊債券	8,361,638,425	7,522,275,452
社債券	5,860,502,000	6,300,741,000
未収入金	308,270,000	-
未収利息	282,065,712	244,009,992
前払費用	10,214,684	21,721,276
流動資産合計	73,169,982,922	74,424,210,135
資産合計	73,169,982,922	74,424,210,135
負債の部		
流動負債		
未払解約金	301,200,000	700,000
流動負債合計	301,200,000	700,000
負債合計	301,200,000	700,000
純資産の部		
元本等		
元本	61,265,852,004	61,461,850,809
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,602,930,918	12,961,659,326
元本等合計	72,868,782,922	74,423,510,135
純資産合計	72,868,782,922	74,423,510,135
負債・純資産合計	73,169,982,922	74,424,210,135

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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、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売買参考統計値で評価しております。	同左
2. 収益及び費用の計上基準	受取利息、有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	同左

貸借対照表に関する注記

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	61,265,852,004口	61,461,850,809口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1894円 (11,894円)	1.2109円 (12,109円)

金融商品に関する注記

(金融商品の状況に関する注記)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日

<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>
---	---

関連当事者との取引に関する注記

(自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日)

該当事項はありません。

(自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日)

該当事項はありません。

その他の注記

(貸借対照表関係)

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1.期首元本額	46,937,511,614円	61,265,852,004円
期中追加設定元本額	30,807,146,676円	17,388,256,190円
期中一部解約元本額	16,478,806,286円	17,192,257,385円
期末元本額	61,265,852,004円	61,461,850,809円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド(株式70)	1,566,006,484円	1,672,630,430円
日立バランスファンド(株式50)	4,026,527,622円	4,265,143,588円
日立バランスファンド(株式30)	2,345,024,195円	2,502,562,129円
日立国内債券特化型ファンドN	46,367,965,129円	45,214,329,874円
日立国内債券インデックスファンド	6,960,328,574円	7,807,184,788円

(注) *は当該親投資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。

(有価証券関係)

売買目的有価証券

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
種類	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
国内国債証券	359,926,800	423,415,650
国内地方債証券	36,618,909	43,370,173
国内特殊債証券	52,931,052	53,387,133
国内一般社債証券	31,484,500	29,476,000
合計	480,961,261	549,648,956

(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。

(デリバティブ取引関係)

(自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日)

該当事項はありません。

（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表(平成23年5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(イ) 株式 該当する事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券(債券)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債 証券	日本円	第297回利付国債(2年)	550,000,000	549,571,000	
		第298回利付国債(2年)	600,000,000	599,460,000	
		第299回利付国債(2年)	880,000,000	880,545,600	
		第300回利付国債(2年)	1,500,000,000	1,500,990,000	
		第301回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,550,930,000	
		第302回利付国債(2年)	700,000,000	700,441,000	
		第64回利付国債(5年)	360,000,000	365,274,000	
		第65回利付国債(5年)	420,000,000	425,699,400	
		第66回利付国債(5年)	270,000,000	273,391,200	
		第68回利付国債(5年)	270,000,000	273,998,700	
		第70回利付国債(5年)	230,000,000	232,649,600	
		第72回利付国債(5年)	130,000,000	133,568,500	
		第80回利付国債(5年)	700,000,000	710,542,000	
		第81回利付国債(5年)	500,000,000	507,955,000	
		第82回利付国債(5年)	550,000,000	560,378,500	
		第83回利付国債(5年)	450,000,000	458,887,500	
		第84回利付国債(5年)	300,000,000	304,089,000	
		第86回利付国債(5年)	400,000,000	404,300,000	
		第87回利付国債(5年)	500,000,000	503,460,000	
		第88回利付国債(5年)	900,000,000	905,616,000	
		第89回利付国債(5年)	1,050,000,000	1,051,690,500	
		第90回利付国債(5年)	400,000,000	399,032,000	
		第91回利付国債(5年)	100,000,000	100,064,000	
		第92回利付国債(5年)	400,000,000	398,548,000	
		第93回利付国債(5年)	450,000,000	451,926,000	
		第94回利付国債(5年)	700,000,000	706,146,000	
		第95回利付国債(5年)	500,000,000	504,025,000	
		第96回利付国債(5年)	150,000,000	150,496,500	
		第1回利付国債(40年)	100,000,000	105,464,000	
		第2回利付国債(40年)	40,000,000	40,124,000	
		第3回利付国債(40年)	210,000,000	210,218,400	
		第239回利付国債(10年)	400,000,000	405,404,000	
		第240回利付国債(10年)	250,000,000	253,107,500	
		第241回利付国債(10年)	160,000,000	162,438,400	
		第242回利付国債(10年)	410,000,000	415,699,000	
		第244回利付国債(10年)	600,000,000	607,938,000	
		第245回利付国債(10年)	580,000,000	586,751,200	
		第247回利付国債(10年)	310,000,000	313,571,200	
		第250回利付国債(10年)	230,000,000	231,506,500	
		第253回利付国債(10年)	280,000,000	289,161,600	
		第254回利付国債(10年)	480,000,000	493,411,200	
		第256回利付国債(10年)	30,000,000	30,915,300	
		第258回利付国債(10年)	350,000,000	360,496,500	
第259回利付国債(10年)	260,000,000	269,263,800			
第260回利付国債(10年)	320,000,000	333,184,000			
第261回利付国債(10年)	145,000,000	151,862,850			
第262回利付国債(10年)	330,000,000	346,628,700			
第263回利付国債(10年)	260,000,000	271,398,400			
第264回利付国債(10年)	10,000,000	10,405,300			
第265回利付国債(10年)	110,000,000	114,686,000			
第266回利付国債(10年)	20,000,000	20,781,000			
第267回利付国債(10年)	50,000,000	51,775,000			

第268回利付国債(10年)	70,000,000	73,115,700	
第269回利付国債(10年)	120,000,000	124,408,800	
第271回利付国債(10年)	450,000,000	465,318,000	
第272回利付国債(10年)	210,000,000	219,189,600	
第273回利付国債(10年)	200,000,000	209,608,000	
第274回利付国債(10年)	240,000,000	251,952,000	
第275回利付国債(10年)	130,000,000	135,887,700	
第276回利付国債(10年)	110,000,000	115,974,100	
第277回利付国債(10年)	310,000,000	327,335,200	
第278回利付国債(10年)	330,000,000	351,582,000	
第279回利付国債(10年)	300,000,000	322,464,000	
第280回利付国債(10年)	270,000,000	289,542,600	
第282回利付国債(10年)	230,000,000	244,736,100	
第283回利付国債(10年)	450,000,000	481,171,500	
第284回利付国債(10年)	420,000,000	447,522,600	
第285回利付国債(10年)	390,000,000	415,946,700	
第286回利付国債(10年)	300,000,000	321,993,000	
第287回利付国債(10年)	490,000,000	528,808,000	
第288回利付国債(10年)	370,000,000	395,097,100	
第289回利付国債(10年)	450,000,000	474,763,500	
第290回利付国債(10年)	460,000,000	482,103,000	
第291回利付国債(10年)	400,000,000	416,468,000	
第292回利付国債(10年)	350,000,000	373,807,000	
第293回利付国債(10年)	450,000,000	483,750,000	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	427,152,000	
第295回利付国債(10年)	480,000,000	506,097,600	
第296回利付国債(10年)	420,000,000	442,066,800	
第297回利付国債(10年)	530,000,000	553,341,200	
第299回利付国債(10年)	380,000,000	393,136,600	
第300回利付国債(10年)	580,000,000	608,808,600	
第301回利付国債(10年)	360,000,000	377,276,400	
第303回利付国債(10年)	410,000,000	425,735,800	
第304回利付国債(10年)	250,000,000	257,557,500	
第305回利付国債(10年)	400,000,000	411,116,000	
第306回利付国債(10年)	400,000,000	413,660,000	
第307回利付国債(10年)	370,000,000	379,472,000	
第308回利付国債(10年)	210,000,000	214,888,800	
第309回利付国債(10年)	460,000,000	462,672,600	
第311回利付国債(10年)	880,000,000	859,091,200	
第312回利付国債(10年)	940,000,000	948,563,400	
第313回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,015,940,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	45,862,800	
第2回利付国債(30年)	30,000,000	32,455,800	
第4回利付国債(30年)	60,000,000	69,831,000	
第5回利付国債(30年)	5,000,000	5,236,350	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	75,611,200	
第7回利付国債(30年)	55,000,000	58,434,200	
第8回利付国債(30年)	45,000,000	43,810,650	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	25,356,900	
第11回利付国債(30年)	65,000,000	61,870,250	
第12回利付国債(30年)	90,000,000	92,100,600	
第13回利付国債(30年)	70,000,000	70,273,000	
第14回利付国債(30年)	30,000,000	32,337,300	
第15回利付国債(30年)	80,000,000	87,702,400	
第16回利付国債(30年)	70,000,000	76,728,400	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	53,852,500	
第18回利付国債(30年)	50,000,000	52,890,500	
第19回利付国債(30年)	90,000,000	95,162,400	
第20回利付国債(30年)	90,000,000	98,658,000	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	74,010,300	

第22回利付国債(30年)	80,000,000	87,728,800	
第23回利付国債(30年)	40,000,000	43,853,600	
第24回利付国債(30年)	80,000,000	87,759,200	
第25回利付国債(30年)	120,000,000	126,736,800	
第26回利付国債(30年)	160,000,000	172,220,800	
第27回利付国債(30年)	200,000,000	219,522,000	
第28回利付国債(30年)	220,000,000	241,315,800	
第29回利付国債(30年)	210,000,000	225,844,500	
第30回利付国債(30年)	180,000,000	189,824,400	
第31回利付国債(30年)	30,000,000	31,029,000	
第32回利付国債(30年)	110,000,000	116,141,300	
第33回利付国債(30年)	450,000,000	445,059,000	
第34回利付国債(30年)	330,000,000	341,055,000	
第20回利付国債(20年)	40,000,000	42,908,800	
第24回利付国債(20年)	380,000,000	428,032,000	
第25回利付国債(20年)	350,000,000	388,321,500	
第31回利付国債(20年)	10,000,000	11,471,400	
第33回利付国債(20年)	70,000,000	82,227,600	
第35回利付国債(20年)	495,000,000	573,422,850	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	80,407,600	
第38回利付国債(20年)	90,000,000	102,108,600	
第39回利付国債(20年)	150,000,000	169,143,000	
第40回利付国債(20年)	70,000,000	77,628,600	
第41回利付国債(20年)	40,000,000	41,940,800	
第42回利付国債(20年)	40,000,000	45,292,000	
第43回利付国債(20年)	30,000,000	34,762,200	
第45回利付国債(20年)	10,000,000	11,186,500	
第46回利付国債(20年)	60,000,000	66,138,600	
第47回利付国債(20年)	110,000,000	121,278,300	
第48回利付国債(20年)	70,000,000	78,982,400	
第49回利付国債(20年)	60,000,000	65,385,600	
第50回利付国債(20年)	40,000,000	42,841,200	
第51回利付国債(20年)	30,000,000	32,422,500	
第52回利付国債(20年)	65,000,000	70,903,950	
第53回利付国債(20年)	60,000,000	65,411,400	
第54回利付国債(20年)	160,000,000	176,024,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	107,931,000	
第57回利付国債(20年)	130,000,000	138,972,600	
第58回利付国債(20年)	130,000,000	138,804,900	
第59回利付国債(20年)	90,000,000	94,099,500	
第61回利付国債(20年)	40,000,000	38,650,000	
第62回利付国債(20年)	130,000,000	122,062,200	
第63回利付国債(20年)	130,000,000	136,646,900	
第64回利付国債(20年)	10,000,000	10,598,500	
第65回利付国債(20年)	80,000,000	84,643,200	
第66回利付国債(20年)	80,000,000	83,692,800	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	137,221,500	
第68回利付国債(20年)	125,000,000	136,325,000	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	129,490,800	
第71回利付国債(20年)	130,000,000	141,581,700	
第72回利付国債(20年)	140,000,000	150,507,000	
第73回利付国債(20年)	100,000,000	106,063,000	
第74回利付国債(20年)	120,000,000	128,781,600	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	139,256,000	
第76回利付国債(20年)	110,000,000	115,041,300	
第77回利付国債(20年)	110,000,000	116,435,000	
第78回利付国債(20年)	90,000,000	93,913,200	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	105,692,000	
第80回利付国債(20年)	130,000,000	139,071,400	
第81回利付国債(20年)	70,000,000	73,825,500	

第82回利付国債(20年)	180,000,000	192,177,000	
第83回利付国債(20年)	140,000,000	149,161,600	
第84回利付国債(20年)	90,000,000	94,706,100	
第85回利付国債(20年)	430,000,000	457,145,900	
第86回利付国債(20年)	80,000,000	87,132,000	
第87回利付国債(20年)	80,000,000	86,064,000	
第88回利付国債(20年)	180,000,000	195,669,000	
第89回利付国債(20年)	100,000,000	107,357,000	
第90回利付国債(20年)	130,000,000	139,434,100	
第91回利付国債(20年)	160,000,000	173,793,600	
第92回利付国債(20年)	100,000,000	105,645,000	
第93回利付国債(20年)	100,000,000	104,002,000	
第94回利付国債(20年)	170,000,000	179,154,500	
第95回利付国債(20年)	200,000,000	215,976,000	
第96回利付国債(20年)	90,000,000	94,666,500	
第97回利付国債(20年)	200,000,000	212,786,000	
第98回利付国債(20年)	180,000,000	188,964,000	
第99回利付国債(20年)	200,000,000	209,538,000	
第100回利付国債(20年)	200,000,000	212,116,000	
第102回利付国債(20年)	180,000,000	196,034,400	
第103回利付国債(20年)	150,000,000	161,169,000	
第104回利付国債(20年)	200,000,000	208,932,000	
第105回利付国債(20年)	230,000,000	239,910,700	
第106回利付国債(20年)	200,000,000	211,550,000	
第107回利付国債(20年)	250,000,000	260,192,500	
第108回利付国債(20年)	100,000,000	101,065,000	
第109回利付国債(20年)	220,000,000	221,771,000	
第110回利付国債(20年)	270,000,000	280,368,000	
第111回利付国債(20年)	130,000,000	136,908,200	
第112回利付国債(20年)	120,000,000	124,402,800	
第113回利付国債(20年)	200,000,000	207,130,000	
第114回利付国債(20年)	70,000,000	72,370,200	
第115回利付国債(20年)	70,000,000	73,490,200	
第116回利付国債(20年)	50,000,000	52,481,000	
第117回利付国債(20年)	80,000,000	82,677,600	
第118回利付国債(20年)	50,000,000	50,807,000	
第119回利付国債(20年)	70,000,000	68,874,400	
第120回利付国債(20年)	100,000,000	95,197,000	
第121回利付国債(20年)	120,000,000	119,829,600	
第122回利付国債(20年)	390,000,000	383,397,300	
第123回利付国債(20年)	300,000,000	309,225,000	
第124回利付国債(20年)	260,000,000	263,710,200	
第125回利付国債(20年)	550,000,000	575,839,000	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	50,683,500	
計	銘柄数: 216 組入時価比率: 74.0%	53,160,000,000	55,040,314,200 74.6%
小計			55,040,314,200
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	101,912,000
	第600回東京都公募公債	100,000,000	101,444,000
	第619回東京都公募公債	130,000,000	135,548,400
	第646回東京都公募公債	100,000,000	108,014,000
	第656回東京都公募公債	100,000,000	105,015,000
	平成17年度第9回北海道公募公債	137,000,000	142,843,050
	第28回1号宮城県公募公債	30,000,000	30,237,000
	第3回神奈川県公募公債	100,000,000	105,624,000
	第46回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,447,000
	第69回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,045,000
	第304回大阪府公募公債(10年)	150,200,000	161,547,610
	第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,043,000
	平成15年度第2回京都府公募公債	160,000,000	164,968,000

第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	103,443,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	107,717,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,702,000	
平成21年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,390,000	
平成22年度第9回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,024,000	
平成22年度第6回広島県公募公債	100,000,000	100,697,000	
平成17年度第7回埼玉県公募公債	200,000,000	209,284,000	
平成21年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,307,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,129,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	106,702,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,485,000	
第9回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,121,000	
第16回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,593,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,652,000	
第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,153,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,474,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,326,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,985,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,504,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,376,000	
平成17年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	104,905,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	104,415,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	105,079,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	110,019,000	
平成15年度第2回横浜市公募公債	144,500,000	145,495,605	
平成16年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	207,240,000	
平成17年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	103,647,000	
平成21年度第4回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	101,105,000	
第3回川崎市公募公債	100,000,000	105,661,000	
平成17年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	105,030,000	
計	銘柄数: 43	4,751,700,000	4,931,348,665
	組入時価比率: 6.6%		6.7%
小計			4,931,348,665
特殊 債券	日本円		
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	101,000,000	106,653,980
	第34回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,198,000
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,929,000
	第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,509,000
	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	106,686,000
	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,240,000
	第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,894,000
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,221,000
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	213,876,060
	第37回道路債券	100,000,000	103,989,000
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,687,000
	第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,158,000
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,470,000
	第55回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,089,000
	第87回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,458,000
	第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,466,000
	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	103,827,000
	第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,350,000
	第317回政府保証道路債券	100,000,000	100,555,000
	第329回政府保証道路債券	109,000,000	113,320,760
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	104,253,000
	第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,577,000
	第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,403,000
	第1回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,288,000
	第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,455,000
	第7回地方公共団体金融機構	134,000,000	139,051,800
	第13回公営企業債券	100,000,000	104,275,000

第840回政府保証公営企業債券	80,000,000	83,152,000	
第844回政府保証公営企業債券	274,000,000	285,776,520	
第849回政府保証公営企業債券	300,000,000	312,699,000	
第871回政府保証公営企業債券	101,000,000	107,914,460	
第10回首都高速道路債券	100,000,000	104,353,000	
第143回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,417,000	
第3回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,585,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	103,474,000	
第31回都市再生債券	100,000,000	100,969,000	
第3回関西国際空港株式会社債(一般担保付)	100,000,000	104,785,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,402,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,062,000	40,549,554	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,514,000	42,690,506	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	99,136,000	104,128,488	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,092,000	76,417,006	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,588,000	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,878,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	80,133,000	82,408,777	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,264,000	109,505,086	
第23回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,824,000	54,896,712	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,738,000	88,269,900	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,707,000	86,846,485	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,609,000	87,010,214	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,379,000	70,969,626	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,539,000	99,374,610	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,623,000	73,952,168	
第15回政府保証国民生活債券	100,000,000	104,208,000	
い第695号商工債	100,000,000	101,710,000	
い第697号商工債	100,000,000	102,468,000	
い第689号農林債	200,000,000	203,310,000	
い第707号農林債	200,000,000	205,302,000	
い第714号農林債	100,000,000	101,406,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,531,000	
第235回信金中金債(5年)	200,000,000	204,520,000	
第2号商工債券(10年)	100,000,000	105,686,000	
第2回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,688,000	
第5回政府保証中日本高速道路債券	153,000,000	164,257,740	
第4回東京都住宅供給公社債券	100,000,000	106,297,000	
計	銘柄数:65	7,239,620,000	7,522,275,452
	組入時価比率:10.1%		10.2%
小計			7,522,275,452
社債券	日本円		
	第326回東京交通債券	100,000,000	113,453,000
	第7回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	102,346,000
	第22回シティグループ・インク円貨社債(2007)	100,000,000	102,940,000
	第5回アフラック・インコーポレーテッド円貨社債(2	100,000,000	100,786,000
	第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨	100,000,000	100,856,000
	第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円	100,000,000	101,319,000
	貨社債(
	第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(20	100,000,000	102,959,000
	09)		
	第2回キリンホールディングス株式会社無担保社債(社債	100,000,000	102,800,000
	間限定同		
	第21回サントリー株式会社無担保社債(社債間限定同順	100,000,000	102,683,000
	位特約付		
	第39回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位	100,000,000	101,421,000
	特約付)		
	第1回JXホールディングス株式会社無担保社債(社債間	100,000,000	100,032,000
	限定同順		
	第13回ジェイエフイーホールディングス株式会社無	100,000,000	101,388,000
	担保社		

第12回株式会社日立製作所無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	100,542,000	
第10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	100,487,000	
第25回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	102,433,000	
第15回三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	101,045,000	
第1回 日本生命2010基金	100,000,000	99,587,000	
第6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	101,361,000	
第10回アイシン精機株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	102,071,000	
第54回伊藤忠商事株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,908,000	
第58回三井物産株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	106,421,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	104,574,000	
第66回三菱商事株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約)	100,000,000	107,415,000	
第1回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣)	100,000,000	103,772,000	
第24回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(特定社債間)	100,000,000	99,873,000	
第3回2号株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣)	100,000,000	101,619,000	
第6回株式会社東京三菱銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,820,000	
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	100,592,000	
第109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	101,161,000	
第10回株式会社広島銀行無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	103,367,000	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	102,515,000	
第50回株式会社三井住友銀行無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	99,972,000	
第2回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,381,000	
第36回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	101,831,000	
第13回株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	101,514,000	
第40回トヨタファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同等)	100,000,000	103,107,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特)	100,000,000	100,839,000	
第25回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	105,447,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,304,000	
第53回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	100,000,000	105,225,000	
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	104,339,000	
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	111,961,000	
第47回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保)	100,000,000	100,990,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保)	100,000,000	107,138,000	
第8回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,384,000	
第428回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	211,772,000	
第540回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	93,327,000	
第546回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	97,049,000	
第462回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,768,000	
第492回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,648,000	
第442回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,225,000	
第448回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,147,000	
第354回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,390,000	
第294回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,916,000	

	第450回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,355,000	
	第393回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,041,000	
	第258回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,197,000	
	第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,448,000	
	第24回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債 (社債間限)	100,000,000	100,480,000	
計	銘柄数:59	6,100,000,000	6,300,741,000	
	組入時価比率:8.5%		8.5%	
小計			6,300,741,000	
合計			73,794,679,317	
株式以外計			73,794,679,317	

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

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引契約額等、時価の状況表

該当事項はありません。

第3 不動産等明細表

該当事項はありません。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第5 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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。

(1) 貸借対照表

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,135,187,686	1,298,213,510
コール・ローン	26,737,683	27,255,042
株式	51,195,620,763	65,420,151,008
派生商品評価勘定	587,216	22,742,791
未収入金	31,307	1,209,967
未収配当金	98,031,132	119,388,718
未収利息	36	37
差入委託証拠金	274,985,239	280,264,869
流動資産合計	52,731,181,062	67,169,225,942
資産合計	52,731,181,062	67,169,225,942
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	84,102,784	8,984,226
未払金	2,162,350	-
未払解約金	-	1,300,000
流動負債合計	86,265,134	10,284,226
負債合計	86,265,134	10,284,226
純資産の部		
元本等		
元本	60,737,527,298	71,027,564,899
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,092,611,370	3,868,623,183
元本等合計	52,644,915,928	67,158,941,716
純資産合計	52,644,915,928	67,158,941,716
負債・純資産合計	52,731,181,062	67,169,225,942

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。	同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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、計算日に知りう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。	同左

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	同左
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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は、入金日基準で計上しております。 受取利息、有価証券売買等損益、派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。	同左

貸借対照表に関する注記

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	60,737,527,298口	71,027,564,899口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8668円 (8,668円)	0.9455円 (9,455円)

金融商品に関する注記

(金融商品の状況に関する注記)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
----------------------------	----------------------------

<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
--	---

(金融商品の時価等に関する事項)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

関連当事者との取引に関する注記

(自平成21年5月16日 至 平成22年5月17日)

該当事項はありません。

（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

その他の注記

（貸借対照表関係）

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 期首元本額	73,828,838,854円	60,737,527,298円
期中追加設定元本額	8,916,548,407円	18,411,615,847円
期中一部解約元本額	22,007,859,963円	8,121,578,246円
期末元本額	60,737,527,298円	71,027,564,899円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド（株式70）	3,124,533,337円	3,113,918,321円
日立バランスファンド（株式50）	2,642,798,845円	2,681,618,304円
日立バランスファンド（株式30）	490,280,159円	512,086,556円
日立外国株式特化型ファンド	45,475,280,209円	54,320,124,795円
日立外国株式インデックスファンド	9,004,634,748円	10,399,816,923円
2. 投資信託財産計算規則55条の6第1項第10号に規定する額		
元本の欠損	8,092,611,370円	3,868,623,183円

（注）*は当該親投資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。

（有価証券関係）

売買目的有価証券

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
種類	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
外国株式証券	2,399,660,008円	15,100,198円
合計	2,399,660,008円	15,100,198円

（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。

（デリバティブ取引関係）

取引の状況に関する事項

	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 取引の内容 利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引等、有価証券関連では有価証券先物取引等であります。		同左
2. 取引に対する取組方針 デリバティブ取引は、将来の為替・価額の変動によるリスクを回避する目的で行います。		同左
3. 取引の利用目的 デリバティブ取引は、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、また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。		同左
4. 取引に係るリスクの内容 為替予約取引等は為替相場の変動によるリスクを、有価証券先物取引等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。		同左

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。	同左
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。	同左

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(平成22年5月17日現在)

区分	種類		契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益 （円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 （外国・買建）	ドル	14,453,920	-	14,387,880	66,040
		ポンド	5,008,320	-	4,927,290	81,030
		オーストラリアドル	3,174,600	-	3,174,990	390
		計	22,636,840	-	22,490,160	146,680

(平成23年5月16日現在)

区分	種類		契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益 （円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 （外国・買建）	ドル	6,478,400	-	6,472,000	6,400
		オーストラリアドル	1,726,400	-	1,707,200	19,200
		計	8,204,800	-	8,179,200	25,600

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

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の対顧客先物相場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相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの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。

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。

株式関連

(平成22年5月17日現在)

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 （外国・買建）	1,519,338,671	-	1,435,969,779	83,299,053
	合計	1,519,338,671	-	1,435,969,779	83,299,053

銘柄明細

区分	種類		契約額等 （円）	契約額等 うち一年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引	株価指数先物取引 （外国・買建）	S&P500 EMINI	859,728,685	-	816,816,558	42,912,119
		S&PTSE601006	101,199,077	-	100,668,760	530,318
		EURX50 1006	233,064,554	-	213,082,647	19,981,904
		FTSE100 1006	180,496,671	-	167,583,054	12,809,176
		SMI 1006	65,962,828	-	62,731,080	3,231,748
		SPI200 1006	78,886,856	-	75,087,680	3,833,788

(平成23年5月16日現在)

区分	種類	契約額等（円）	契約額等 うち一年超	時価（円）	評価損益（円）
----	----	---------	---------------	-------	---------

市場取引	株価指数先物取引 (外国・買建)	1,678,326,118	-	1,692,110,293	1,024,302
合計		1,678,326,118	-	1,692,110,293	1,024,302

銘柄明細

区分	種類		契約額等 (円)	契約額等 うち一年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 (外国・買建)	S&P500 EMINI	914,946,077	-	928,231,884	6,268,874
		S&PTSE601106	119,269,380	-	114,197,599	5,378,652
		EURX50 1106	258,592,932	-	261,309,209	586,534
		FTSE100 1106	208,335,082	-	208,668,528	1,073,355
		SMI 1106	85,776,651	-	89,163,990	2,749,302
		SPI200 1106	91,405,996	-	90,539,083	2,128,401

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引について

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

[次へ](#)

（ 3 ） 附属明細表(平成23年5月16日現在)

第 1 有価証券明細表

（イ）株式

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
株式	ドル	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,716	24.24	453,675.84	
		RAYONIER INC	2,700	66.25	178,875.00	
		JM SMUCKER CO/THE COM	4,055	75.44	305,909.20	
		HUMAN GENOME SCIENCES INC	6,300	27.22	171,486.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	22,857	16.97	387,883.29	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,000	59.16	591,600.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	10,269	115.27	1,183,707.63	
		ALPHA NATURAL RESOURCES INC	4,300	48.44	208,292.00	
		ANADAECO PETROLEUM CORP	17,300	74.06	1,281,238.00	
		APACHE CORP	13,328	124.25	1,656,004.00	
		ARCH COAL INC	5,800	29.11	168,838.00	
		BAKER HUGHES INC	15,061	69.27	1,043,275.47	
		CABOT OIL & GAS CORP	3,500	52.94	185,290.00	
		CALPINE CORP	12,600	16.36	206,136.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,300	49.65	412,095.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	22,900	29.78	681,962.00	
		CHEVRON CORP	70,303	102.39	7,198,324.17	
		CIMAREX ENERGY CO	2,900	92.62	268,598.00	
		CONCHO RESOURCES INC	3,300	90.53	298,749.00	
		CONOCOPHILLIPS	48,800	71.43	3,485,784.00	
		CONSOL ENERGY INC	7,800	47.27	368,706.00	
		DENBURY RESOURCES INC	13,400	20.54	275,236.00	
		DEVON ENERGY CORPORATION	14,322	82.02	1,174,690.44	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,500	70.74	176,850.00	
		EL PASO CORPORATION	24,160	18.22	440,195.20	
		EOG RESOURCES INC	8,900	105.44	938,416.00	
		EXXON MOBIL CORPORATION	176,122	80.87	14,242,986.14	
		FMC TECHNOLOGIES INC	8,200	42.27	346,614.00	
		HALLIBURTON CO	31,852	46.00	1,465,192.00	
		HELMERICH & PAYNE	3,700	59.03	218,411.00	
		HESS CORP	10,600	75.78	803,268.00	
		KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	2,954	62.87	185,717.98	
		MARATHON OIL CORP	24,835	51.10	1,269,068.50	
		MURPHY OIL CORP	6,300	66.38	418,194.00	
		NABORS INDUSTRIES ITD	9,868	26.74	263,870.32	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	14,709	68.02	1,000,506.18	
		NEWFIELD EXPLORATION CO	4,600	70.07	322,322.00	
		NOBLE CORP	8,698	39.59	344,353.82	
		NOBLE ENERGY INC	6,100	87.63	534,543.00	
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,420	102.36	2,909,071.20	
		PEABODY ENERGY CORP	9,500	58.45	555,275.00	
		PETROHAWK ENERGY CORP	10,700	24.33	260,331.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,000	92.15	368,600.00	
		PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,650	34.18	158,937.00	
		PRIDE INTERNATIONAL INC	6,200	41.31	256,122.00	

QEP RESOURCES INC	6,200	40.40	250,480.00	
RANGE RESOURCES CORP	5,600	52.06	291,536.00	
ROWAN COMPANIES INC	4,400	38.04	167,376.00	
SCHLUMBERGER LTD	47,697	82.71	3,945,018.87	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	11,900	41.20	490,280.00	
SUNOCO INC	4,200	40.27	169,134.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,400	45.53	245,862.00	
VALERO ENERGY CORP	19,868	26.68	530,078.24	
WEATHERFORD INTL LTD	26,084	20.17	526,114.28	
WILLIAMS COS INC	20,484	30.26	619,845.84	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,490	90.66	679,043.40	
AIRGAS INC	2,800	67.13	187,964.00	
ALCOA INC	35,904	17.10	613,958.40	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	3,000	68.81	206,430.00	
BALL CORP	5,800	38.46	223,068.00	
CELANESE CORP-SERIES A	5,500	51.63	283,965.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,500	133.58	333,950.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	4,800	84.37	404,976.00	
DOW CHEMICAL	40,633	38.37	1,559,088.21	
DU PONT (E I) DE NEMOURS	31,899	52.91	1,687,776.09	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,600	104.55	271,830.00	
ECOLAB INC	8,000	52.07	416,560.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	32,894	48.27	1,587,793.38	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,285	31.37	448,120.45	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,836	62.91	178,412.76	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,700	39.68	384,896.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,540	86.47	133,163.80	
MEADWESTVACO CORP	5,728	33.36	191,086.08	
MONSANTO CO	18,816	63.79	1,200,272.64	
MOSAIC CO/THE	5,400	67.35	363,690.00	
NEWMONT MINING CORP	17,253	52.78	910,613.34	
NUCOR CORP	10,844	42.96	465,858.24	
OWENS-ILLINOIS INC	5,500	33.00	181,500.00	
PPG INDUSTRIES INC	5,678	88.47	502,332.66	
PRAXAIR INC	10,694	102.85	1,099,877.90	
SEALED AIR CORP	5,354	25.60	137,062.40	
SIGMA-ALDRICH	4,160	68.88	286,540.80	
UNITED STATES STEEL CORP	5,040	44.65	225,036.00	
VULCAN MATERIALS CO	4,551	39.98	181,948.98	
WEYERHAEUSER CO	18,396	21.91	403,056.36	
3M CO	23,776	96.01	2,282,733.76	
AGCO CORP	3,200	50.99	163,168.00	
AMETEK INC	5,400	43.57	235,278.00	
BOEING CO	24,376	79.03	1,926,435.28	
CATERPILLAR INC	22,220	106.33	2,362,652.60	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	5,572	62.85	350,200.20	
COVIDIEN PLC	17,387	55.84	970,890.08	
CUMMINS INC	6,600	110.29	727,914.00	
DANAHER CORP	19,516	53.86	1,051,131.76	
DEERE & CO	14,822	87.72	1,300,185.84	
DOVER CORP	6,400	64.33	411,712.00	
EATON CORP	11,208	51.92	581,919.36	

EMERSON ELECTRIC CO	26,346	53.53	1,410,301.38
FASTENAL CO	4,700	66.61	313,067.00
FIRST SOLAR INC	1,900	125.65	238,735.00
FLOWSERVE CORP	1,900	120.67	229,273.00
FLUOR CORP	6,294	69.00	434,286.00
FOSTER WHEELER AG	4,400	33.94	149,336.00
GENERAL DYNAMICS CORP	11,286	74.37	839,339.82
GENERAL ELECTRIC CO	372,202	19.89	7,403,097.78
GOODRICH CORP	4,300	90.77	390,311.00
GRAINGER (W W) INC	2,023	151.00	305,473.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	25,969	60.51	1,571,384.19
ILLINOIS TOOL WORKS	14,816	57.95	858,587.20
INGERSOLL-RAND PLC	11,341	50.12	568,410.92
ITT CORP	6,148	57.30	352,280.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,500	46.59	209,655.00
JOY GLOBAL INC	3,600	87.48	314,928.00
KBR INC	5,400	35.99	194,346.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,900	83.50	325,650.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	10,757	79.59	856,149.63
MASCO CORP	12,070	13.22	159,565.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,700	64.86	629,142.00
PACCAR INC	11,475	51.67	592,913.25
PALL CORP	3,900	55.37	215,943.00
PARKER HANNIFIN CORP	5,566	87.50	487,025.00
PENTAIR INC	3,300	39.41	130,053.00
PRECISION CASTPARTS CORP	5,000	155.15	775,750.00
QUANTA SERVICES INC	7,000	19.73	138,110.00
RAYTHEON COMPANY	12,822	49.19	630,714.18
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,031	82.54	415,258.74
ROCKWELL COLLINS	5,417	62.61	339,158.37
ROPER INDUSTRIES INC	3,300	82.67	272,811.00
SPX CORP	1,800	81.56	146,808.00
TE CONNECTIVITY LTD	15,587	36.69	571,887.03
TEXTRON INC	9,684	24.61	238,323.24
TYCO INTERNATIONAL LTD	17,187	50.78	872,755.86
UNITED TECHNOLOGIES CORP	30,658	88.98	2,727,948.84
DUN & BRADSTREET CORP	1,700	81.68	138,856.00
AVERY DENNISON CORP	3,398	41.80	142,036.40
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	2,600	91.26	237,276.00
CINTAS CORP	4,574	32.11	146,871.14
EQUIFAX INC	4,198	37.61	157,886.78
MANPOWERGROUP	2,826	62.91	177,783.66
PITNEY BOWES INC	6,914	24.58	169,946.12
REPUBLIC SERVICES INC	13,245	32.36	428,608.20
ROBERT HARF INTL INC	4,644	28.39	131,843.16
RR DONNELLEY & SONS CO	6,863	20.32	139,456.16
STERICYCLE INC	2,900	93.02	269,758.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5,958	18.99	113,142.42
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	4,400	34.50	151,800.00
WASTE MANAGEMENT INC	15,835	38.75	613,606.25
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,700	79.77	454,689.00
CSX CORP	13,062	74.75	976,384.50

DELTA AIR LINES INC	7,100	10.65	75,615.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,300	53.07	387,411.00
FEDEX CORPORATION	10,445	93.58	977,443.10
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,200	45.77	146,464.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	174,000	0.92	160,950.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,778	71.57	914,521.46
PROLOGIS	20,100	15.55	312,555.00
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	6,762	12.07	81,617.34
UNION PACIFIC CORP	17,262	100.46	1,734,140.52
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,600	25.58	66,508.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	25,515	74.14	1,891,682.10
AUTOLIV INC	3,000	76.52	229,560.00
BORGWARNER INC	4,000	73.82	295,280.00
FORD MOTOR COMPANY	107,145	15.08	1,615,746.60
GENERAL MOTORS CO	18,400	31.07	571,688.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	8,200	17.77	145,714.00
HARLEY-DAVIDSON INC	8,314	38.12	316,929.68
JOHNSON CONTROLS INC	23,616	38.62	912,049.92
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,500	55.74	195,090.00
COACH INC	10,400	59.99	623,896.00
DR HORTON INC	9,933	11.44	113,633.52
FORTUNE BRANDS INC	5,429	64.11	348,053.19
GARMIN LTD	4,000	35.12	140,480.00
HASBRO INC	4,100	48.05	197,005.00
LEGGETT & PLATT INC	5,000	25.97	129,850.00
MATTEL INC	12,341	26.55	327,653.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,000	67.50	135,000.00
NEWELL RUBBERMAID INC	10,350	18.47	191,164.50
NIKE INC -CL B	12,892	86.26	1,112,063.92
POLO RALPH LAUREN CORP	2,300	133.31	306,613.00
PULTE GROUP INC	11,600	7.60	88,160.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,383	74.06	398,664.98
TOLL BROTHERS INC	4,700	20.12	94,564.00
VF CORP	3,029	101.02	305,989.58
WHIRLPOOL CORP	2,660	86.66	230,515.60
APOLLO GOUPI INC CL A	4,700	42.59	200,173.00
CARNIVAL CORP	16,003	41.02	656,443.06
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,100	280.40	308,440.00
DARDEN RESTAURANTS INC	4,700	50.31	236,457.00
DEVRY INC	2,100	53.29	111,909.00
H&R BLOCK INC	10,924	15.82	172,817.68
INTL GAME TECHNOLOGY	10,508	18.34	192,716.72
LAS VEGAS SANDS CORP	12,000	42.60	511,200.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,996	36.50	364,854.00
MCDONALD'S CORPORATION	36,935	80.74	2,982,131.90
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,200	14.72	164,864.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,700	41.21	193,687.00
STARBUCKS CORP	25,958	36.15	938,381.70
STARWOOD HOTELS & RESORTS WO	6,517	58.14	378,898.38
WYNN RESORTS LTD	2,800	146.27	409,556.00
YUM! BRANDS INC	16,426	54.86	901,130.36
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,700	34.90	303,630.00

CBS CORP-CL B	22,126	25.94	573,948.44	
COMCAST CORP-CL A	72,410	25.13	1,819,663.30	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	25,615	23.66	606,050.90	
DIRECTV-CLASS A	29,133	49.73	1,448,784.09	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,707	44.27	208,378.89	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,707	39.55	186,161.85	
DISH NETWORK CORP-A	7,000	28.81	201,670.00	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	17,298	11.56	199,964.88	
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,017	45.52	182,853.84	
LIBERTY GLOBAL INC-C W/I	3,917	43.86	171,799.62	
LIBERTY MEDIA INTERACTIVE-A	20,062	17.93	359,711.66	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	10,490	42.08	441,419.20	
NEWS CORP CLASS B	15,553	18.10	281,509.30	
NEWS CORP INC-CL A	63,994	17.45	1,116,695.30	
OMNICOM GROUP	10,340	47.96	495,906.40	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,200	50.77	162,464.00	
THE WALT DISNEY CO	62,907	41.52	2,611,898.64	
TIME WARNER CABLE	12,435	77.26	960,728.10	
TIME WARNER INC	38,842	35.99	1,397,923.58	
VIACOM INC-CL B	19,526	49.92	974,737.92	
VIRGIN MEDIA INC	10,800	31.81	343,548.00	
WASHINGTON POST-CL B	178	416.52	74,140.56	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,000	74.26	222,780.00	
ADVANCE AUTO PARTS	2,800	72.16	202,048.00	
AMAZON COM INC	12,544	202.56	2,540,912.64	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	6,650	14.69	97,688.50	
AUTOZONE INC	970	286.30	277,711.00	
BED BATH & NEYOND INC	8,901	55.65	495,340.65	
BEST BUY COMPANY INC	11,931	32.31	385,490.61	
CARMAX INC	7,974	30.93	246,635.82	
DOLLAR GENERAL CORP	3,600	33.39	120,204.00	
DOLLAR TREE INC	4,450	61.03	271,583.50	
EBAY INC	41,036	33.57	1,377,578.52	
EXPEDIA INC	7,200	25.17	181,224.00	
FAMILY DOLLAR STORES	4,200	51.94	218,148.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,100	26.72	136,272.00	
GAP INC	15,263	23.05	351,812.15	
GENUINE PARTS CO	5,610	55.48	311,242.80	
HOME DEPOT INC	58,258	37.01	2,156,128.58	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	7,500	38.44	288,300.00	
KOHL'S CORP	10,321	55.17	569,409.57	
LIMITED BRANDS INC	9,505	41.84	397,689.20	
LOWE'S COMPANIES	48,350	25.76	1,245,496.00	
MACY'S	14,514	28.46	413,068.44	
NETFLIX INC	1,600	246.52	394,432.00	
NORDSTROM INC	6,200	47.63	295,306.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,900	60.90	298,410.00	
PETSMART INC	4,100	44.11	180,851.00	
PRICELINE.COM INC	1,700	520.61	885,037.00	
ROSS STORES INC	4,300	82.64	355,352.00	
SEARS HOLDINGS CORP	1,560	77.03	120,166.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,135	86.20	270,237.00	

STAPLES INC	25,395	20.25	514,248.75	
TARGET CORP	23,526	51.52	1,212,059.52	
TIFFANY & CO	4,321	68.95	297,932.95	
TJX COMPANIES INC	13,881	54.57	757,486.17	
URBAN OUTFITTERS INC	4,400	32.62	143,528.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	15,089	82.72	1,248,162.08	
CVS CAREMARK CORP	47,521	38.13	1,811,975.73	
KROGER CO	21,329	25.03	533,864.87	
SAFEWAY INC	12,878	25.00	321,950.00	
SYSCO CORP	20,529	31.78	652,411.62	
WAL-MART STORES INC	68,462	55.72	3,814,702.64	
WALGREEN CO	32,354	44.97	1,454,959.38	
WHOLE FOODS MARKET INC	5,100	62.49	318,699.00	
ALTRIA GROUP INC	73,062	27.31	1,995,323.22	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,369	32.20	720,281.80	
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	2,875	72.08	207,230.00	
BUNGE LIMITED	4,700	73.00	343,100.00	
CAMPBELL SOUP CO	7,147	35.19	251,502.93	
COCA-COLA COMPANY	73,014	68.18	4,978,094.52	
COCA-COLA ENTERPRISES	11,900	28.96	344,624.00	
CONAGRA FOODS INC	15,081	25.52	384,867.12	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	22.71	152,157.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	8,014	41.78	334,824.92	
GENERAL MILLS INC	22,464	39.72	892,270.08	
HANSEN NATURAL CORPORATION	2,500	66.50	166,250.00	
HEINZ (H J) CO	11,266	52.50	591,465.00	
HERSHEY CO/THE	5,600	57.34	321,104.00	
HORMEL FOODS CORP	5,200	29.84	155,168.00	
KELLOGG CO	9,100	57.56	523,796.00	
KRAFT FOODS INC-A	61,042	34.89	2,129,755.38	
LORILLARD INC	5,292	111.51	590,110.92	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,200	49.69	208,698.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,183	68.30	490,598.90	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,700	46.02	262,314.00	
PEPCICO INC	55,338	70.56	3,904,649.28	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	63,362	68.31	4,328,258.22	
RALCORP HOLDINGS INC	1,800	90.25	162,450.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	12,000	38.69	464,280.00	
SARA LEE CORP	20,908	19.26	402,688.08	
TYSON FOODS INC-CL A	10,400	18.53	192,712.00	
AVON PRODUCTS INC	14,726	30.18	444,430.68	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,400	82.68	198,432.00	
CLOROX COMPANY	4,774	70.94	338,667.56	
COLGATE-PALMOLIVE CO	16,900	86.55	1,462,695.00	
CROWN HOLDINGS INC	5,400	40.95	221,130.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC-W/I	2,300	76.90	176,870.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,900	100.17	390,663.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,338	68.29	979,142.02	
PROCTER & GAMBLE CO	97,818	66.86	6,540,111.48	
AETNA INC-NEW	14,004	43.85	614,075.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,500	42.04	399,380.00	
BARD (C.R.) INC	3,300	109.56	361,548.00	

BAXTER INTERNATIONAL INC	20,425	59.23	1,209,772.75	
BECKMAN COULTER INC	2,300	82.99	190,877.00	
BECTON DICKINSON & CO	8,042	88.11	708,580.62	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,247	6.84	357,369.48	
CARDINAL HEALTH INC	12,214	44.45	542,912.30	
CAREFUSION CORP	7,607	29.82	226,840.74	
CIGNA CORP	9,312	48.69	453,401.28	
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,250	34.35	180,337.50	
DAVITA INC	3,300	85.59	282,447.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,700	38.68	181,796.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	17,500	59.92	1,048,600.00	
HENRY SCHEIN INC	3,300	72.37	238,821.00	
HOLOGIC INC	9,244	21.69	200,502.36	
HOSPIRA INC	5,902	55.49	327,501.98	
HUMANA INC	5,800	78.33	454,314.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,350	356.00	480,600.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,600	99.73	359,028.00	
MCKESSON CORP	8,852	84.24	745,692.48	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	14,874	64.67	961,901.58	
MEDTRONIC INC	37,736	42.03	1,586,044.08	
OMNICARE INC	4,000	31.65	126,600.00	
PATTERSON COS INC	3,100	35.64	110,484.00	
QUEST DIAGNOSTICS	5,738	57.40	329,361.20	
ST JUDE MEDICAL INC	12,016	51.97	624,471.52	
STRYKER CORP	10,476	63.28	662,921.28	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13,928	61.91	862,282.48	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,504	49.95	1,923,274.80	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,200	69.09	290,178.00	
WATERS CORPORATION	3,274	97.70	319,869.80	
WELLPOINT INC	13,776	80.25	1,105,524.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	6,793	68.89	467,969.77	
ABBOTT LABORATORIES	54,024	53.49	2,889,743.76	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	3,100	99.53	308,543.00	
ALLERGAN INC	10,800	80.70	871,560.00	
AMGEN INC	33,027	60.47	1,997,142.69	
BIOGEN IDEC INC	8,310	96.61	802,829.10	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	59,903	28.81	1,725,805.43	
CELGENE CORP	16,500	59.94	989,010.00	
CEPHALON INC	2,700	79.70	215,190.00	
COVANCE INC	2,300	61.23	140,829.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,000	88.25	353,000.00	
FMC CORP	2,300	83.71	192,533.00	
FOREST LABORATORIES INC	10,100	34.23	345,723.00	
GILEAD SCIENCES INC	28,400	41.20	1,170,080.00	
ILLUMINA INC	4,300	76.26	327,918.00	
JOHNSON & JOHNSON	95,961	66.62	6,392,921.82	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,468	55.71	360,332.28	
LILLY (ELI) & CO	36,349	38.95	1,415,793.55	
LUBRIZOL CORP	2,300	134.22	308,706.00	
MERCK & CO. INC.	107,692	37.08	3,993,219.36	
MYLAN INC	15,000	24.09	361,350.00	
PERRIGO CO	2,900	86.60	251,140.00	

PFIZER INC	279,869	20.92	5,854,859.48
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	3,900	28.70	111,930.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,000	57.48	402,360.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	5,000	25.73	128,650.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,700	62.96	295,912.00
BANK OF AMERICA CORP	352,436	11.93	4,204,561.48
BB&T CORPORATION	24,300	26.63	647,109.00
CIT GROUP INC	6,500	42.65	277,225.00
COMERICA INC	5,958	36.39	216,811.62
FIFTH THIRD BANCORP	31,472	12.49	393,085.28
KEYCORP	32,893	8.27	272,025.11
M & T BANK CORP	3,000	86.39	259,170.00
MARSHALL & ILSLEY CORP	16,698	7.81	130,411.38
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	14,200	16.26	230,892.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	12,300	13.16	161,868.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	18,367	61.80	1,135,080.60
REGIONS FINANCIAL CORP	44,284	7.05	312,202.20
SUNTRUST BANKS INC	18,367	27.47	504,541.49
US BANCORP	67,094	25.02	1,678,691.88
WELLS FARGO COMPANY	174,238	27.93	4,866,467.34
AMERICAN EXPRESS COMPANY	37,922	49.49	1,876,759.78
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,524	62.40	531,897.60
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	43,460	28.07	1,219,922.20
BLACKROCK INC	3,100	194.24	602,144.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,985	52.34	836,654.90
CITIGROUP INC	101,505	41.53	4,215,502.65
CME GROUP INC	2,360	294.36	694,689.60
EATON VANCE CORP	3,900	32.44	126,516.00
FRANKLIN RESOURCES INC	5,400	127.27	687,258.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,008	141.46	2,405,951.68
HUDSON CITY BANCORP INC	16,700	9.26	154,642.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,100	118.32	248,472.00
INVESCO LTD	15,880	25.01	397,158.80
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	4,900	22.82	111,818.00
JPMORGAN CHASE & CO	136,518	43.15	5,890,751.70
LEGG MASON INC	5,250	33.97	178,342.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	6,900	35.79	246,951.00
MOODY'S CORP	6,736	38.14	256,911.04
MORGAN STANLEY	47,633	24.13	1,149,384.29
NASDAQ OMX GROUP/THE	4,300	26.91	115,713.00
NORTHERN TRUST CORP	7,521	48.24	362,813.04
NYSE EURONEXT INC	9,000	40.89	368,010.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	35,652	17.64	628,901.28
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,500	22.93	103,185.00
SLM CORP	17,200	15.87	272,964.00
STATE STREET CORP	17,624	45.55	802,773.20
T ROWE PRICE GROUP INC	9,000	62.00	558,000.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,900	20.87	164,873.00
ACE LTD	11,900	67.80	806,820.00
AFLAC INC	16,519	54.02	892,356.38
ALLSTATE CORP	17,985	32.38	582,354.30
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,925	30.42	88,978.50

AON CORP	10,415	52.84	550,328.60	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,100	34.24	174,624.00	
ASSURANT INC	3,800	38.56	146,528.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,200	33.61	141,162.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	30,850	79.65	2,457,202.50	
CHUBB CORP	10,670	64.87	692,162.90	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,540	30.91	171,241.40	
EVEREST RE GROUP LTD	2,000	90.13	180,260.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL-A	7,396	15.78	116,708.88	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	16,800	11.22	188,496.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,532	27.57	400,647.24	
LINCOLN NATIONAL CORP	10,951	29.79	326,230.29	
LOEWS CORP	11,696	41.65	487,138.40	
MARSH & MCLENNAN COS	19,133	29.74	569,015.42	
METLIFE INC	36,926	44.41	1,639,883.66	
OLD REPUBLIC INTL	8,762	12.47	109,262.14	
PARTNERRE LTD	2,400	76.59	183,816.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,000	31.02	341,220.00	
PROGRESSIVE CORP	21,636	21.15	457,601.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,924	63.13	1,068,412.12	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	2,000	70.10	140,200.00	
TORCHMARK CORP	2,700	65.99	178,173.00	
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	2,200	47.75	105,050.00	
TRAVELERS COS INC/THE	16,132	62.33	1,005,507.56	
UNUM GROUP	11,183	26.22	293,218.26	
VALIDUS HOLDINGS LTD	1,960	31.95	62,622.00	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	260	349.01	90,742.60	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	5,800	40.82	236,756.00	
WR BERKLEY CORP	4,500	32.25	145,125.00	
XL GROUP PLC	11,400	23.00	262,200.00	
*RTS-BROOKFIELD PROPERTIES-RTS-WI	8,375	0.05	418.75	
AMB PROPERTY CORP	6,000	34.85	209,100.00	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	27,200	17.67	480,624.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,931	126.93	372,031.83	
BOSTON PROPERTIES INC	4,800	103.01	494,448.00	
CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	10,000	25.94	259,400.00	
DUKE REALTY CORP	8,200	14.42	118,244.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,200	85.27	187,594.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	15,303	16.12	246,684.36	
HCP INC	14,100	36.80	518,880.00	
HEALTH CARE REIT INC	5,900	50.65	298,835.00	
KIMCO REALTY CORP	14,400	18.98	273,312.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,800	34.90	132,620.00	
MACERICH CO/THE	4,500	50.66	227,970.00	
PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	5,700	40.80	232,560.00	
PUBLIC STORAGE	5,000	116.33	581,650.00	
REGENCY CENTERS CORP	2,700	45.26	122,202.00	
VENTAS INC	5,500	54.15	297,825.00	
VORNADO REALTY TRUST	5,727	94.78	542,805.06	
*NEW CA INC	14,084	22.90	322,523.60	
ACCENTURE PLC-CL A	22,200	55.74	1,237,428.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,200	11.51	220,992.00	

ADOBE SYSTEMS INC	17,900	35.33	632,407.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	6,400	33.95	217,280.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,800	91.78	165,204.00	
AUTODESK INC	7,800	45.57	355,446.00	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,285	54.01	933,562.85	
BMC SOFTWARE INC	6,228	54.47	339,239.16	
CERNER CORP	2,500	119.28	298,200.00	
CITRIX SYSTEMS INC	6,598	83.73	552,450.54	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	10,600	76.47	810,582.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	5,236	44.66	233,839.76	
ELECTRONIC ARTS INC	11,712	23.70	277,574.40	
F5 NETWORKS INC	2,900	104.64	303,456.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	9,027	32.23	290,940.21	
FISERV INC	5,221	62.00	323,702.00	
GOOGLE INC-CL A	8,690	529.55	4,601,789.50	
IHS INC-CLASS A	1,400	87.53	122,542.00	
INTUIT INC	10,216	55.35	565,455.60	
IRON MOUNTAIN INC	6,150	32.43	199,444.50	
LENDER PROCESSING SERVICES	3,300	29.50	97,350.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	3,820	280.00	1,069,600.00	
MICROSOFT CORP	268,956	25.03	6,731,968.68	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	8,400	21.96	184,464.00	
ORACLE CORPORATION	140,556	35.19	4,946,165.64	
PAYCHEX INC	11,157	32.42	361,709.94	
RED HAT INC	6,600	46.87	309,342.00	
SAIC INC	9,900	17.40	172,260.00	
SALESFORCE.COM INC	4,200	134.91	566,622.00	
SYMANTEC CORP	27,300	20.06	547,638.00	
SYNOPSYS INC	4,900	27.61	135,289.00	
VERISIGN INC	6,126	36.53	223,782.78	
VISA INC-CLASS A SHARES	17,410	79.91	1,391,233.10	
VMWARE INC-CLASS A	2,600	93.94	244,244.00	
WESTERN UNION CO	23,060	20.70	477,342.00	
YAHOO! INC	43,382	16.55	717,972.10	
*NEW-MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	9,358	24.02	224,779.16	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,196	52.58	641,265.68	
AMPHENOL CORP-CL A	6,000	55.04	330,240.00	
APPLE INC	32,070	340.50	10,919,835.00	
ARROW ELECTRONICS INC	4,000	45.86	183,440.00	
AVNET INC	5,100	37.21	189,771.00	
CISCO SYSTEMS INC	193,739	16.88	3,270,314.32	
CORNING INC	54,760	20.73	1,135,174.80	
DELL INC	61,321	16.37	1,003,824.77	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	1,800	48.60	87,480.00	
EMC CORP/MASS	72,025	27.60	1,987,890.00	
FLEXTRONICS INTL LTD	26,662	6.96	185,567.52	
FLIR SYSTEMS INC	5,600	36.11	202,216.00	
HARRIS CORP	4,300	48.88	210,184.00	
HEWLETT-PACKARD CO.	79,267	40.41	3,203,179.47	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,405	169.92	7,375,377.60	
JUNIPER NETWORKS INC	18,300	39.63	725,229.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,195	46.65	522,246.75	

NETAPP INC	12,498	53.99	674,767.02
QUALCOMM INC	56,536	57.12	3,229,336.32
SANDISK CORP	8,100	46.49	376,569.00
SEAGATE TECHNOLOGY	16,700	17.14	286,238.00
TERADATA CORP	5,900	53.31	314,529.00
WESTERN DIGITAL CORP	8,100	37.49	303,669.00
XEROX CORP	48,799	10.21	498,237.79
ALLIANT ENERGY CORP	3,700	40.74	150,738.00
AMERICAN TOWER CORP-CL A	14,000	52.94	741,160.00
AT&T INC	206,494	31.41	6,485,976.54
CENTURYLINK INC	21,003	42.42	890,947.26
CROWN CASTLE INTL CORP	10,000	41.90	419,000.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	35,158	8.66	304,468.28
METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,800	17.85	157,080.00
NII HOLDINGS INC	5,700	43.40	247,380.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,700	38.66	143,042.00
SPRINT NEXTEL CORP	101,163	5.10	515,931.30
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	1,700	34.59	58,803.00
VERIZON COMMUNICATIONS	98,798	37.26	3,681,213.48
WINDSTREAM CORP	17,100	13.30	227,430.00
*NEW SPECTRA ENERGY CORP	22,777	27.28	621,356.56
AES CORPORATION	23,600	12.44	293,584.00
AMEREN CORPORATION	8,172	29.69	242,626.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,877	37.58	634,237.66
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,200	29.37	182,094.00
CENTRPOINT ENERGY INC	14,200	18.73	265,966.00
CONSOLIDATED EDISON INC	10,238	54.12	554,080.56
CONSTELLATION ENERGY GROUP	6,764	36.89	249,523.96
DOMINION RESOURCES INC/VA	20,326	47.99	975,444.74
DTE ENERGY COMPANY	5,727	52.54	300,896.58
DUKE ENERGY CORP	46,455	19.22	892,865.10
EDISON INTERNATIONAL	10,579	39.55	418,399.45
ENERGEN CORP	2,300	57.32	131,836.00
ENTERGY CORP	6,219	68.99	429,048.81
EQT CORP	5,000	50.39	251,950.00
EXELON CORPORATION	23,162	41.74	966,781.88
FIRSTENERGY CORP	14,693	42.53	624,893.29
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,600	53.89	140,114.00
MDU RESOURCES GROUP INC	6,000	23.31	139,860.00
NEXTERA ENERGY INC	13,844	58.64	811,812.16
NISOURCE INC	9,914	20.36	201,849.04
NORTHEAST UTILITIES	5,900	35.93	211,987.00
NRG ENERGY INC	8,800	24.52	215,776.00
NSTAR	3,600	46.91	168,876.00
ONEOK INC	3,600	69.22	249,192.00
P G & E CORPORATION	13,809	46.02	635,490.18
PEPCO HOLDINGS INC	7,400	20.04	148,296.00
PINNACLE WEST CAPITAL	3,600	45.21	162,756.00
PPL CORPORATION	19,828	27.93	553,796.04
PROGRESS ENERGY INC	10,079	48.39	487,722.81
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17,766	33.45	594,272.70
SCANA CORP	4,300	41.93	180,299.00

SEMPRA ENERGY	7,865	55.11	433,440.15	
SOUTHERN CO	29,123	40.49	1,179,190.27	
URS CORP	2,800	44.39	124,292.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	8,000	31.55	252,400.00	
XCEL ENERGY INC	15,800	24.95	394,210.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	20,411	8.90	181,657.90	
ALTERA CORPORATION	11,000	48.30	531,300.00	
ANALOG DEVICES	10,236	40.79	417,526.44	
APPLIED MATERIALS INC	46,852	14.80	693,409.60	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,500	34.89	226,785.00	
BROADCOM CORP-CL A	16,033	34.45	552,336.85	
CREE INC	3,500	42.02	147,070.00	
INTEL CORP	194,957	23.41	4,563,943.37	
KLA-TENCOR CORPORATION	5,870	44.43	260,804.10	
LAM RESEARCH CORP	4,200	47.46	199,332.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,670	34.82	267,069.40	
LSI CORP	22,000	7.62	167,640.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	19,500	14.60	284,700.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	10,000	27.79	277,900.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	8,100	11.01	89,181.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,400	40.87	261,568.00	
MICRON TECHNOLOGY	30,827	10.40	320,600.80	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	8,500	24.40	207,400.00	
NVIDIA CORP	19,700	18.26	359,722.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	41,109	35.18	1,446,214.62	
XILINX INC	9,126	35.95	328,079.70	
計	銘柄数：591		442,956,254.71	
			(35,839,590,568)	
	組入時価比率：53.4%		54.8%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	10,000	23.94	239,400.00
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	6,618	16.20	107,211.60
	BAYTEX ENERGY CORP	4,000	53.20	212,800.00
	CAMECO CORP	13,506	25.44	343,592.64
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	38,064	39.41	1,500,102.24
	CANADIAN OIL SANDS LTD	17,000	30.98	526,660.00
	CENOVUS ENERGY INC	26,366	32.90	867,441.40
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	8,200	44.58	365,556.00
	ENBRIDGE INC	12,734	60.54	770,916.36
	ENCANA CORP	25,766	31.65	815,493.90
	ENERPLUS CORP	6,300	29.21	184,023.00
	FRANCO-NEVADA CORP	4,500	35.05	157,725.00
	HUSKY ENERGY INC	9,028	27.78	250,797.84
	IMPERIAL OIL LTD	10,412	45.15	470,101.80
	MEG ENERGY CORP	1,700	48.21	81,957.00
	NEXEN INC	18,052	21.70	391,728.40
	NIKO RESOURCES LTD	1,600	74.77	119,632.00
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	8,600	27.30	234,780.00
	PENGROWTH ENERGY CORP	11,600	12.51	145,116.00
	PENN WEST PETROLEUM LTD	15,636	25.14	393,089.04
	PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,600	16.26	42,276.00
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	6,400	13.01	83,264.00
	SUNCOR ENERGY INC	54,643	38.57	2,107,580.51

TALISMAN ENERGY INC	35,732	20.45	730,719.40
TRANSCANADA CORPORATION	24,343	41.24	1,003,905.32
VERMILION ENERGY INC	2,900	48.50	140,650.00
AGNCIO-EAGLE MINES LTD	5,800	59.44	344,752.00
AGRIUM INC	5,503	78.00	429,234.00
BARRICK GOLD CORP	34,504	43.63	1,505,409.52
CENTERRA GOLD INC	5,400	19.15	103,410.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	18,900	14.65	276,885.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	3,000	123.10	369,300.00
GOLDCORP INC	27,742	46.28	1,283,899.76
IAMGOLD CORP	12,500	18.21	227,625.00
INMET MINING CORPORATION	1,800	63.36	114,048.00
IVANHOE MINES LTD	10,800	23.30	251,640.00
KINROSS GOLD CORP	39,669	13.81	547,828.89
OSISKO MINING CORP	12,200	12.89	157,258.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	3,500	31.13	108,955.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	31,268	49.92	1,560,898.56
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	10,600	7.44	78,864.00
SILVER WHEATON CORP	11,300	33.03	373,239.00
SINO-FOREST CORPORATION	8,700	19.20	167,040.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,275	44.85	909,333.75
YAMANA GOLD INC	25,558	11.46	292,894.68
BOMBARDIER INC 'B'	49,450	6.85	338,732.50
CAE INC	8,706	12.88	112,133.28
FINNING INTERNATIONAL INC	5,700	28.14	160,398.00
SNC-LAVALIN GROUP	5,300	54.24	287,472.00
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	3,200	27.00	86,400.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,170	73.31	1,185,422.70
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,828	59.75	348,223.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,530	48.49	365,129.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,900	35.10	136,890.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,164	35.82	543,174.48
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,386	20.00	247,720.00
THOMSON REUTERS CORP	13,186	37.78	498,167.08
YELLOW MEDIA INC	17,000	4.42	75,140.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,605	62.38	162,499.90
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	4,200	25.72	108,024.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	54.45	54,450.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,970	41.02	162,849.40
METRO INC -A	3,600	47.15	169,740.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	7,500	42.04	315,300.00
VITERRA INC	13,000	11.05	143,650.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,727	71.03	122,668.81
SAPUTO INC	5,100	45.64	232,764.00
TIM HORTONS INC	6,060	46.40	281,184.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	10,024	48.59	487,066.16
BANK OF MONTREAL	19,855	60.72	1,205,595.60
BANK OF NOVA SCOTIA	37,592	57.45	2,159,660.40
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	13,800	82.50	1,138,500.00
NATIONAL BANK OF CANADA	5,608	79.27	444,546.16
ROYAL BANK OF CANADA	49,786	58.45	2,909,991.70
TORONTO-DOMINION BANK	30,586	81.70	2,498,876.20

	BONAVISTA ENERGY CORP	4,700	28.07	131,929.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	19,538	31.28	611,148.64	
	CI FINANCIAL CORP	5,396	22.94	123,784.24	
	IGM FINANCIAL INC	4,146	48.77	202,200.42	
	POWER CORP OF CANADA	11,930	28.36	338,334.80	
	POWER FINANCIAL CORP	8,766	31.40	275,252.40	
	TMX GROUP INC	2,500	41.75	104,375.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	728	393.93	286,781.04	
	GREAT-WEST LIFECO INC	10,018	26.65	266,979.70	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,000	40.42	121,260.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,800	51.46	195,548.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	62,042	17.25	1,070,224.50	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	20,113	30.18	607,010.34	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	8,375	18.49	154,853.75	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,400	26.10	114,840.00	
	CGI GROUP INC	8,418	20.70	174,252.60	
	OPEN TEXT CORP	2,000	60.03	120,060.00	
	ONEX CORPORATION	3,406	37.31	127,077.86	
	RESEARCH IN MOTION	16,500	41.92	691,680.00	
	BCE INC	8,599	37.87	325,644.13	
	FORTIS INC	5,900	32.66	192,694.00	
	TELUS CORP	2,000	51.59	103,180.00	
	TELUS CORPORATION	5,169	49.61	256,434.09	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	3,100	57.62	178,622.00	
	TRANSALTA CORP	7,892	21.07	166,284.44	
計	銘柄数：100			45,311,854.63	
				(3,778,555,557)	
	組入時価比率：5.6%			5.8%	

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
株式	ユーロ	FIAT INDUSTRIAL	26,271	10.14	266,387.94	
		LANXESS	2,943	60.38	177,698.34	
		ALSTOM	7,062	41.72	294,626.64	
		ZARDOYA OTIS SA	4,670	11.56	53,985.20	
		VOPAK	2,367	31.87	75,436.29	
		POHJOLA BANK PLC	4,700	9.72	45,707.50	
		RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,608	37.05	59,576.40	
		VIENNA INSURANCE GROUP WIENER STAEDTICHE	1,288	39.78	51,236.64	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,217	151.75	488,179.75	
		CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,834	22.99	111,157.83	
		ENEL GREEN POWER SPA	62,240	1.90	118,629.44	
		ENI SPA	91,031	17.20	1,565,733.20	
		FUGRO NV-CVA	2,419	56.77	137,326.63	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	7,741	14.47	112,012.27	
		IBERDROLA RENOVABLES	28,377	3.04	86,521.47	
		NESTE OIL OYJ	4,613	12.39	57,155.07	
		OMV AG	5,309	29.85	158,500.19	
		REPSOL SA	25,672	22.62	580,700.64	
		SAIPEM	9,304	36.43	338,944.72	
		SBM OFFSHORE NV	5,751	18.20	104,668.20	
		TECHNIP S.A.	3,383	70.28	237,757.24	
		TENARIS SA	16,217	16.93	274,553.81	
		TOTAL SA	73,850	40.69	3,005,325.75	
		ACERINOX SA	3,116	13.65	42,533.40	
		AIR LIQUIDE	9,911	94.78	939,364.58	
		AKZO NOBEL	8,132	51.76	420,912.32	
		ARCELORMITTAL	30,065	23.92	719,154.80	
		BASF SE	32,103	64.06	2,056,518.18	
		BAYER AG	28,913	58.21	1,683,025.73	
		CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL	6,568	4.88	32,051.84	
		CRH PLC	24,896	16.08	400,327.68	
		ENSO OY-R SHS	20,582	8.00	164,758.91	
		ERAMET	181	238.85	43,231.85	
		HEIDELBERGCEMENT AG	4,837	49.00	237,013.00	
		IMERYS	1,325	50.82	67,336.50	
		K+S AG	4,931	52.05	256,658.55	
		KONINKLIJKE DSM NV	5,312	46.81	248,681.28	
		LAFARGE	7,049	47.67	336,061.07	
		LINDE AG	5,922	119.65	708,567.30	
		OUTOKUMPU OYJ	4,525	10.96	49,594.00	
		RAUTARUUKKI OYJ	3,000	17.00	51,000.00	
		SALZGITTER AG	1,418	52.60	74,586.80	
		SOLVAY SA	2,094	106.35	222,696.90	
THYSSENKRUPP AG	11,751	33.47	393,305.97			
UMICORE	4,043	36.00	145,548.00			
UPM-KYMMENE OYJ	17,871	13.32	238,041.72			
VOESTALPINE AG	3,690	33.61	124,039.35			
WACKER CHEMIE AG	560	167.50	93,800.00			
ACCIONA S.A.	847	75.33	63,804.51			

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,013	32.66	163,749.64
BEKAERT NV	1,291	77.50	100,052.50
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,323	34.37	79,853.12
BRENTAG AG	1,196	82.93	99,184.28
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	13,948	45.15	629,821.94
EIFFAGE	1,354	45.11	61,085.71
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	14,003	23.09	323,329.27
FINMECCANICA SPA	13,505	9.41	127,149.57
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	1,867	21.33	39,823.11
GEA GROUP AG	5,868	23.76	139,423.68
HOCHTIEF AG	1,516	57.40	87,018.40
KONE OYJ	5,364	42.76	229,364.64
LEGRAND SA	5,589	29.69	165,937.41
MAN SE	3,716	98.15	364,725.40
METSO OYJ	4,519	40.02	180,850.38
PIRELLI & C.	8,009	7.03	56,343.31
PRYSMIAN SPA	7,267	14.96	108,714.32
SAFRAN SA	5,916	27.57	163,104.12
SCHNEIDER ELECTRIC SA	8,506	112.25	954,798.50
SIEMENS AG	28,751	93.30	2,682,468.30
THALES SA	3,008	29.62	89,096.96
VALLOUREC	3,892	89.18	347,088.56
VINCI SA	15,471	43.86	678,558.06
WARTSILA OYJ	5,596	25.41	142,194.36
BIC	962	65.55	63,059.10
BUREAU VERITAS SA	1,703	58.49	99,608.47
EDENRED	5,629	21.37	120,319.87
RANDSTAD HOLDING NV	3,917	36.52	143,068.42
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	10,463	15.75	164,792.25
ADP	1,065	65.00	69,225.00
AIR FRANCE-KLM	4,530	12.19	55,243.35
ATLANTIA SPA	10,620	16.40	174,168.00
BRISA	6,241	4.46	27,878.54
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	7,674	15.54	119,253.96
DEUTSCHE POST AG	29,725	13.76	409,016.00
FERROVIAL SA	15,611	8.93	139,468.67
FRAPORT AG	1,319	54.43	71,793.17
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	33,721	2.76	93,103.68
RYANAIR HOLDINGS PLC	3,762	3.56	13,392.72
TNT NV	13,278	16.30	216,431.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,597	61.50	713,215.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,868	40.83	76,270.44
CONTINENTAL AG	1,681	67.00	112,627.00
DAIMLER AG	31,552	50.50	1,593,376.00
FIAT SPA	27,024	7.11	192,140.64
MICHELIN (CGDE)-B	6,199	65.33	404,980.67
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,630	33.46	121,459.80
PEUGEOT SA	5,389	30.62	165,011.18
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	5,273	47.86	252,392.14
RENAULT SA	6,611	40.78	269,596.58
VOLKSWAGEN AG	994	117.53	116,824.82
VOLKSWAGEN AG PFD	5,960	128.30	764,668.00

ADIDAS AG	7,351	51.67	379,826.17
CHRISTIAN DIOR	2,191	110.20	241,448.20
LUXOTTICA GROUP SPA	3,907	22.85	89,274.95
LVMH	8,572	120.75	1,035,069.00
PHILIPS ELECTRONICS NV	34,542	20.52	708,974.55
PUMA AG	164	227.50	37,310.00
ACCOR SA	5,201	30.50	158,630.50
AUTOGRILL SPA	3,619	9.53	34,507.16
GREEK ORG OF FOOTBALL PROGNO	7,501	14.50	108,764.50
SODEXO	3,335	53.66	178,956.10
TUI AG	4,782	8.25	39,470.62
*NEW WOLTERS KLUWER	10,086	16.17	163,141.05
AXEL SPRINGER AG	486	106.70	51,856.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,318	30.23	100,303.14
GESTEVISION TELECINCO SA	6,059	6.53	39,619.80
JC DECAUX SA	2,230	23.38	52,137.40
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,775	43.15	76,600.12
LAGARDERE S C A	3,948	29.07	114,768.36
M6-METROPOLE TELEVISION	2,219	16.86	37,412.34
MEDIASET SPA	25,258	4.24	107,245.46
PAGESJAUNES GROUPE SA	4,354	7.61	33,160.06
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,504	18.55	46,461.72
PUBLICIS GROUPE	4,410	38.52	169,895.25
REED ELSEVIER NV	24,266	9.47	230,017.41
SANOMA OYJ	2,710	13.71	37,154.10
SES	10,593	18.24	193,216.32
TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	4,016	12.72	51,083.52
VIVENDI SA	43,283	19.40	839,906.61
INDITEX	7,655	61.70	472,313.50
PPR	2,605	121.85	317,419.25
CARREFOUR SA	20,993	30.60	642,490.76
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,960	75.30	147,588.00
COLRUYT SA	2,525	39.70	100,242.50
DELHAIZE GROUP	3,579	58.32	208,727.28
JERONIMO MARTINS	7,707	12.81	98,726.67
KESKO OYJ-B SHS	2,300	35.63	81,949.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	41,849	9.74	407,609.26
METRO AG	4,574	46.66	213,422.84
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	25,267	42.00	1,061,214.00
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,511	18.02	117,328.22
DANONE	20,406	49.88	1,017,851.28
HEINEKEN HOLDING NV	4,086	37.31	152,448.66
HEINEKEN NV	9,106	42.25	384,774.03
KERRY GROUP PLC-A	4,984	29.80	148,523.20
PARMALAT SPA	61,481	2.63	161,940.95
PERNOD-RICARD SA	6,953	69.48	483,094.44
SUEDZUCKER AG	2,289	21.88	50,083.32
UNILEVER NV-CVA	56,976	22.98	1,309,308.48
BEIERSDORF AG	3,570	45.70	163,149.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,118	48.86	298,956.07
HENKEL AG + CO KGAA	4,595	40.72	187,131.37
L OREAL	8,395	85.27	715,841.65

BIOMERIEUX	378	78.06	29,506.68
CELESION AG NAMON	2,779	17.52	48,688.08
ESSILOR INTERNATIONAL	7,101	56.61	401,987.61
FRESENIUS MEDICAL CARE	6,807	50.43	343,277.01
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,747	72.99	273,493.53
ELAN CORPORATION PLC	16,493	5.90	97,325.19
GRIFOLS SA	4,981	13.69	68,189.89
MERCK KGAA	2,290	78.07	178,780.30
ORION OYJ	3,352	17.91	60,034.32
QIAGEN N.V.	8,042	14.64	117,775.09
SANOFI	36,660	56.26	2,062,491.60
UCB SA	3,381	33.22	112,333.72
ALPHA BANK A.E	13,601	3.54	48,147.54
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	9,736	0.21	2,112.71
BANCA CARIGE SPA	17,845	1.62	28,908.90
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	77,491	0.92	71,407.95
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	149,230	8.04	1,200,107.66
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	98,896	0.55	54,887.28
BANCO DE SABADELL SA	39,594	2.92	115,654.07
BANCO DE VALENCIA SA	7,770	2.54	19,735.80
BANCO ESPRITO SANTO-REG	17,463	2.93	51,323.75
BANCO POPOLARE SPA	52,091	1.93	100,848.17
BANCO POPULAR ESPANOL	31,774	3.96	126,047.45
BANCO SANTANDER SA	291,087	8.01	2,332,771.21
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	28,219	2.30	64,903.70
BANK OF IRELAND	114,347	0.23	27,100.23
BANKINTER SA	9,501	4.97	47,295.97
BNP PARIBAS	33,511	53.62	1,796,859.82
COMMERZBANK AG	30,008	3.99	119,971.98
CREDIT AGRICOLE	33,750	11.07	373,612.50
DEXIA	18,153	2.60	47,270.41
EFG EUROBANK ERGASIAS	9,178	3.33	30,562.74
ERSTE GROUP BANK AG	6,666	33.65	224,310.90
INTESA SANPAOLO	269,960	2.05	554,497.84
INTESA SANPAOLO-RNC	33,474	1.81	60,621.41
KBC GROUP	5,709	29.05	165,846.45
NATIONAL BANK OF GREECE	33,800	4.81	162,578.00
NATIXIS	30,128	3.83	115,480.62
SOCIETE GENERAL-A	22,204	42.20	937,008.80
UNICREDIT SPA	472,389	1.66	788,417.24
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	20,903	5.76	120,401.28
AGEAS	79,096	2.01	159,615.72
CRITERIA CAIXACORP SA	29,804	4.95	147,708.62
DEUTSCHE BANK AG -REG	32,509	41.95	1,363,752.55
DEUTSCHE BOERSE AG	6,849	54.20	371,215.80
EURAZEO	920	57.43	52,835.60
EXOR SPA	2,336	24.41	57,021.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,851	65.65	187,168.15
ING GROEP N V	134,006	8.62	1,155,935.75
MEDIOBANCA SPA	15,846	7.75	122,885.73
AEGON NV	58,948	4.96	292,853.66
ALLIANZ SE-REG	15,870	98.40	1,561,608.00

ASSICURAZIONI GENERALI	40,915	15.78	645,638.70
AXA	60,117	14.62	878,910.54
CNP ASSURANCES	4,887	14.14	69,126.61
DELTA LLOYD NV	2,739	17.37	47,576.43
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	2,104	37.33	78,552.84
MAPFRE SA	25,093	2.70	67,776.19
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,601	111.13	733,569.13
SAMPO OYJ-A SHS	14,769	22.52	332,597.88
SCOR SE	6,016	20.65	124,230.40
*NEW-IMMOEAST AG-TEMP	12,296	-	-
CORIO NV	1,959	47.92	93,885.07
FONCIERE DES REGIONS	959	71.75	68,808.25
GECINA SA	628	100.05	62,831.40
ICADE	774	88.28	68,328.72
IMMOFINANZ AG	33,423	3.16	105,616.68
KLEPIERRE	3,173	27.61	87,622.39
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,133	13.58	56,126.14
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	6,698	13.90	93,102.20
ATOS ORIGIN	1,629	41.84	68,165.50
CAP GEMINI SA	5,221	41.03	214,243.73
DASSAULT SYSTEMES SA	2,108	57.54	121,294.32
INDRA SISTEMAS SA	3,295	15.29	50,397.02
SAP AG	30,030	44.41	1,333,632.30
ALCATEL-LUCENT	81,487	4.32	352,594.24
NEOPOST SA	1,138	63.88	72,695.44
NOKIA OYJ	131,135	6.02	789,432.70
BELGACOM SA	5,394	25.45	137,304.27
BOUYGUES	7,942	33.89	269,154.38
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	99,184	10.49	1,040,936.08
ELISA CORPORATION CLASS A	4,627	16.31	75,466.37
FRANCE TELECOM SA	64,883	15.55	1,009,255.06
HELLNIC TELECOMMUN ORGANIZA	8,180	7.00	57,260.00
ILIAD SA	561	87.03	48,823.83
KONINKLIJKE KPN NV	55,118	10.40	573,502.79
MOBISTAR SA	982	52.68	51,731.76
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	20,622	8.68	179,040.20
TELECOM ITALIA SPA	330,007	0.98	325,386.90
TELECOM ITALIA-RNC	213,103	0.86	184,334.09
TELEFONICA SA	143,546	16.84	2,417,314.64
TELEKOM AUSTRIA AG	11,822	10.00	118,279.11
A2A SPA	37,508	1.19	44,672.02
E.ON AG	62,980	20.67	1,302,111.50
EDP RENOVAVEIS SA	7,494	4.77	35,768.86
ELECTRICITE DE FRANCE	8,902	29.25	260,383.50
ENAGAS	6,021	16.28	98,021.88
ENEL SPA	230,308	4.74	1,093,502.38
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	67,447	2.62	176,846.03
FORTUM OYJ	15,607	22.66	353,654.62
GAS NATURAL SDG-E	11,430	13.28	151,790.40
GDF SUEZ	43,284	25.85	1,119,107.82
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	18,965	7.40	140,341.00
IBERDROLA SA	132,504	6.12	810,924.48

	PUBLIC POWER CORP	3,885	10.37	40,287.45	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,832	42.12	161,423.00	
	RWE AG	14,672	42.80	627,961.60	
	RWE AG-NON VTG PFD	1,366	40.31	55,070.29	
	SNAM RETE GAS	50,410	4.17	210,512.16	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	9,557	15.41	147,273.37	
	TERNA SPA	46,162	3.38	156,027.56	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,967	22.14	265,009.21	
	VERBUND AG	2,451	31.33	76,789.83	
	ASML HOLDING NV	15,139	28.04	424,573.25	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,319	8.18	305,530.65	
	STMICROELECTRONS NV	22,524	7.99	180,146.95	
計	銘柄数：269			87,686,351.50	
				(9,986,598,572)	
	組入時価比率：14.9%			15.3%	
ポンド	OLD MUTUAL PLC	187,277	1.29	243,085.54	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,885	21.50	2,663,527.50	
	BG GROUP PLC	118,340	13.22	1,564,454.80	
	BP PLC	656,586	4.42	2,903,423.29	
	CAIRN ENERGY PLC	48,147	4.29	206,695.07	
	ESSAR ENERGY PLC	10,723	4.15	44,511.17	
	PETROFAC LTD	9,184	14.79	135,831.36	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	94,213	21.48	2,023,695.24	
	TULLOW OIL PLC	31,143	13.30	414,201.90	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,147	29.17	1,346,338.72	
	ANTOFAGASTA PLC	13,911	11.42	158,863.62	
	BHP BILLITON PLC	76,952	23.40	1,800,676.80	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	8,635	8.35	72,145.42	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,599	19.90	151,220.10	
	KAZAKHMYS PLC	7,181	12.13	87,105.53	
	LONMIN PLC	5,606	15.09	84,594.54	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	3,215	47.01	151,137.15	
	REXAM PLC	31,139	3.94	122,843.35	
	RIO TINTO PLC - REG	50,669	40.93	2,073,882.17	
	VEDANTA RESOURCES PLC	4,115	21.03	86,538.45	
	XSTRATA PLC	72,587	13.58	985,731.46	
	AMEC PLC	11,730	11.75	137,827.50	
	BAE SYSTEMS PLC	119,628	3.39	405,778.17	
	BALFOUR BEATTY PLC	23,106	3.28	75,995.63	
	BUNZL PLC	11,007	7.43	81,782.01	
	COBHAM PLC	41,190	2.32	95,849.13	
	FRESNILLO PLC	6,246	13.24	82,697.04	
	INVENSYS PLC	27,098	3.26	88,502.06	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	65,668	6.48	425,528.64	
	ROLLS-ROYCE GROUP-C SHRS ENT	5,813,568	-	5,813.56	
	SMITHS GROUP PLC	13,812	12.35	170,578.20	
	WEIR GROUP PLC/THE	7,465	19.20	143,328.00	
	WOLSELEY PLC	9,793	21.09	206,534.37	
	AGGREKO PLC	9,211	18.11	166,811.21	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	12,762	6.58	83,973.96	
	CAPITA GROUP PLC	21,665	7.28	157,829.52	
	G4S PLC	49,962	2.82	141,142.65	

INTERTEK GROUP PLC	5,516	20.55	113,353.80
SERCO GROUP PLC	17,031	5.66	96,480.61
STANDARD LIFE PLC	80,646	2.14	172,905.02
FIRSTGROUP PLC	16,796	3.58	60,213.66
*NEW WHITBREAD PLC	6,286	16.68	104,850.48
CARNIVAL PLC	6,447	26.33	169,749.51
COMPASS GROUP PLC	66,281	5.91	392,052.11
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	10,243	12.84	131,520.12
THOMAS COOK GROUP PLC	28,974	1.63	47,372.49
TUI TRAVEL PLC	19,022	2.50	47,555.00
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	40,018	8.40	336,351.29
ITV PLC	124,297	0.69	86,262.11
PEARSON PLC	28,546	11.71	334,273.66
REED ELSEVIER PLC	41,778	5.61	234,583.47
WPP PLC	44,314	7.66	339,666.81
BURBERRY GROUP PLC	15,365	13.63	209,424.95
EXPERIAN PLC	35,497	8.14	289,123.06
HOME RETAIL GROUP-W/I	29,483	2.27	67,103.30
KINGFISHER PLC	81,214	2.82	229,267.12
MARKS & SPENCER PLC	54,517	3.98	217,195.72
NEXT PLC	6,272	22.81	143,064.32
MORRISON (WM)SUPERMAKETS	73,176	3.04	222,674.56
SAINSBURY (J) PLC	41,459	3.62	150,413.25
TESCO PLC	280,806	4.19	1,176,717.54
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,630	10.65	134,509.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	69,795	27.04	1,887,256.80
DIAGEO PLC	87,540	12.96	1,134,518.40
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	35,654	22.31	795,440.74
SABMILLER PLC	33,307	22.49	749,240.96
UNILEVER PLC	44,913	19.86	891,972.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,592	34.35	741,685.20
SMITH & NEPHEW PLC	30,610	6.90	211,362.05
ASTRAZENECA PLC	49,442	31.93	1,578,930.27
GLAXOSMITHKLINE PLC	181,547	13.48	2,448,161.29
SHIRE PLC	19,736	19.61	387,022.96
BARCLAYS PLC	404,702	2.74	1,110,097.58
HSBC HOLDINGS PLC	617,808	6.47	4,000,306.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,429,409	0.54	781,886.72
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	597,200	0.42	255,362.72
STANDARD CHARTERED PLC	82,001	15.71	1,288,645.71
3I GROUP PLC	34,623	2.86	99,264.14
ICAP PLC	18,656	4.92	91,936.76
INVESTEC PLC	16,776	4.67	78,343.92
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	5,147	8.27	42,591.42
MAN GROUP PLC	63,052	2.45	154,918.76
SCHRODERS PLC	3,789	16.74	63,427.86
ADMIRAL GROUP PLC	7,154	17.51	125,266.54
AVIVA PLC	98,916	4.35	431,075.92
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	201,607	1.16	234,468.94
PRUDENTIAL PLC	89,144	7.35	655,208.40
RESOLUTION LTD	49,238	2.98	146,975.43
RSA INSURANCE GROUP PLC	123,313	1.37	169,185.43

	BRITISH LAND COMPANY PLC	31,234	5.84	182,562.73	
	CAPITAL SHOPPING CENTERS GRO	19,863	3.93	78,180.76	
	HAMMERSON PLC	25,112	4.73	118,804.87	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,421	7.61	201,195.91	
	SEGRO PLC	24,683	3.17	78,368.52	
	AUTONOMY CORP PLC	7,458	17.34	129,321.72	
	SAGE GROUP PLC (THE)	46,703	2.92	136,419.46	
	BT GROUP PLC	271,979	1.96	533,350.81	
	CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	86,916	0.53	46,108.93	
	INMARSAT PLC	14,550	6.18	89,991.75	
	VODAFONE GROUP PLC	1,823,851	1.67	3,055,862.35	
	*NEW SEVERN TRENT PLC	8,185	14.97	122,529.45	
	CENTRICA PLC	180,554	3.17	572,897.84	
	INTERNATIONAL POWER PLC	53,958	3.30	178,115.35	
	NATIONAL GRID PLC	122,390	6.19	758,206.05	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	32,678	13.35	436,251.30	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,120	6.22	150,026.40	
	ARM HOLDINGS PLC	45,327	5.84	264,936.31	
計	銘柄数：107			52,984,842.70	
				(6,934,656,212)	
	組入時価比率：10.3%			10.6%	
スイスフラン	SIKA FINANZ AG-BEARER	68	2,216.00	150,688.00	
	TRANSOCEAN LTD	11,183	61.40	686,636.20	
	GIVAUDAN-REG	293	932.00	273,076.00	
	HOLCIM LTD-REG	8,603	68.75	591,456.25	
	LONZA AG-REG	1,702	76.00	129,352.00	
	SYNGENTA AG	3,312	295.00	977,040.00	
	ABB LTD	76,641	23.19	1,777,304.79	
	GEBERIT AG-REG	1,374	210.00	288,540.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,723	108.30	186,600.90	
	ADECCO SA-REG	4,342	58.70	254,875.40	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	188	1,676.00	315,088.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,907	133.80	255,156.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	719	109.60	78,802.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	18,279	56.00	1,023,624.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,084	429.00	465,036.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,517	77.50	117,567.50	
	ARYZTA AG	2,932	48.30	141,615.60	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	29	2,810.00	81,490.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	32,370.00	129,480.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	121,035	54.75	6,626,666.25	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,580	90.60	143,148.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	249	232.40	57,867.60	
	SYNTHES INC	2,044	149.30	305,169.20	
	ACTELION LTD-REG	3,618	45.40	164,257.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	73,732	54.25	3,999,961.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	24,551	149.40	3,667,919.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	39,405	37.00	1,457,985.00	
	GAM HOLDING LTD	6,859	17.50	120,032.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,288	38.55	280,952.40	
	PARGESA HOLDING SA-BR	972	84.10	81,745.20	
	UBS AG-REG	127,241	16.39	2,085,479.99	

	BALOISE HOLDING AG	1,674	91.55	153,254.70	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,024	146.90	150,425.60	
	SWISS REINSURANCE-2ND LINE	12,353	50.30	621,355.90	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	5,097	230.60	1,175,368.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-R	6,362	11.46	72,908.52	
	SWISSCOM AG-REG	802	397.00	318,394.00	
計	銘柄数 : 37			29,406,320.30	
				(2,664,212,619)	
	組入時価比率 : 4.0%			4.1%	
スウェーデン クローネ	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	23,564	5.00	117,820.00	
	ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	13,431	5.00	67,155.00	
	BOLIDEN AB	9,697	116.00	1,124,852.00	
	HOLMEN AB	1,800	222.80	401,040.00	
	SSAB AB-A SHARES	6,560	106.40	697,984.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	20,232	95.40	1,930,132.80	
	ALFA LAVAL AB	11,935	135.00	1,611,225.00	
	ASSA ABLOY AB-B	11,007	179.50	1,975,756.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	23,564	164.80	3,883,347.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,431	149.60	2,009,277.60	
	HEXAGON AB-B SHS	8,990	162.90	1,464,471.00	
	SANDVIK AB	35,368	115.80	4,095,614.40	
	SCANIA AB-B SHS	11,309	154.80	1,750,633.20	
	SKANSKA AB-B SHS	14,103	115.10	1,623,255.30	
	SKF AB-B SHARES	13,383	186.40	2,494,591.20	
	VOLVO AB-B SHS	48,301	116.20	5,612,576.20	
	SECURITAS AB-B SHS	10,600	67.05	710,730.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,499	164.50	1,398,085.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	13,738	47.63	654,340.94	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,694	444.30	752,644.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	35,791	231.20	8,274,879.20	
	SWEDISH MATCH AB	8,159	218.10	1,779,477.90	
	GETINGE AB-B SHS	6,955	173.00	1,203,215.00	
	NORDEA BANK AB	92,029	70.50	6,488,044.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	49,592	56.90	2,821,784.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,180	209.00	3,590,620.00	
	SWEDBANK AB-A SHARES	25,110	115.50	2,900,205.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,800	113.80	432,440.00	
	INVESTOR AB-B SHS	15,658	151.40	2,370,621.20	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	7,275	158.50	1,153,087.50	
	RATOS AB-B SHS	7,000	129.20	904,400.00	
	ERICSSON LM-B SHS	105,405	94.65	9,976,583.25	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,687	695.00	1,867,465.00	
	TELE2 AB -B SHS	10,740	152.50	1,637,850.00	
	TELIASONERA	78,811	49.49	3,900,356.39	
計	銘柄数 : 35			83,676,561.78	
				(1,055,998,209)	
	組入時価比率 : 1.6%			1.6%	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	5,883	117.30	690,075.90	
	NORSK HYDRO ASA	31,500	42.83	1,349,145.00	
	SEADRILL LTD	9,766	182.80	1,785,224.80	
	STATOIL ASA	39,084	143.30	5,600,737.20	
	SUBSEA 7 SA	9,541	139.40	1,330,015.40	

	YARA INTERNATIONAL ASA	6,679	291.10	1,944,256.90	
	ORKLA ASA	27,274	51.25	1,397,792.50	
	DNB NOR ASA	34,318	80.00	2,745,440.00	
	TELENOR ASA	29,144	95.75	2,790,538.00	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	15,731	17.21	270,730.51	
計	銘柄数：10			19,903,956.21	
				(288,607,365)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
デンマーク	TRYG A/S	942	305.00	287,310.00	
クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,630	879.50	1,433,585.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,207	156.10	1,125,012.70	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	19	50,450.00	958,550.00	
	A.P.MOLLER MAERSK	46	51,950.00	2,389,700.00	
	DSV A/S	7,020	130.10	913,302.00	
	PANDORA A/S	1,937	258.60	500,908.20	
	CARLSBERG AS-B	3,763	617.50	2,323,652.50	
	COLOPLAST-B	768	727.00	558,336.00	
	WILLIAM DEMANT HDGS	725	468.70	339,807.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	14,642	654.50	9,583,189.00	
	DANSKE BANK A/S	21,286	110.20	2,345,717.20	
計	銘柄数：12			22,759,070.10	
				(347,758,591)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
オーストラ	CFS GANDEL RETAIL TRUST	75,677	1.81	137,353.75	
リアドル	GENERAL PROPERTY TRUST	62,520	3.12	195,062.40	
	MIRVAC GROUP	113,192	1.21	136,962.32	
	STOCKLAND	84,015	3.56	299,093.40	
	WESTFIELD GROUP	76,878	9.08	698,052.24	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,703	14.36	67,535.08	
	MACARTHUR COAL LTD	6,506	11.42	74,298.52	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	37,252	16.18	602,737.36	
	PALADIN ENERGY LIMITED	23,952	3.29	78,802.08	
	SANTOS LIMITED	29,351	14.36	421,480.36	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	21,855	45.07	985,004.85	
	WORLEYPARSONS LTD	6,799	28.62	194,587.38	
	ALUMINA LIMITED	86,451	2.35	203,159.85	
	AMCOR LIMITED	43,191	6.89	297,585.99	
	BHP BILLITON LTD	112,194	44.32	4,972,438.08	
	BLUESCOPE STEEL LTD	61,135	1.54	94,147.90	
	BORAL LIMITED	24,947	4.68	116,751.96	
	CSR LTD	17,706	3.01	53,295.06	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	43,937	6.28	275,924.36	
	INCITEC PIVOT LTD	57,613	3.70	213,168.10	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,682	5.50	80,751.00	
	NEWCREST MINING LTD	26,789	38.30	1,026,018.70	
	ONESTEEL LIMITED	43,714	1.96	85,898.01	
	ORICA LTD	12,454	26.68	332,272.72	
	OZ MINERALS LTD	115,117	1.43	165,192.89	
	RIO TINTO LIMITED	15,251	80.15	1,222,367.65	
	SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	5,703	18.03	102,825.09	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,003	22.87	114,418.61	
	WESFARMERS LIMITED	35,186	33.10	1,164,656.60	

	WESFARMERS LTD-PPS	5,393	33.36	179,910.48	
	BRAMBLES LTD	49,332	7.00	345,324.00	
	ASCIANO GROUP	104,034	1.59	165,934.23	
	MAP GROUP	20,756	2.96	61,437.76	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,807	2.12	82,270.84	
	QR NATIONAL LTD	60,531	3.41	206,410.71	
	TOLL HOLDINGS LTD	22,302	5.50	122,661.00	
	TRANSURBAN GROUP	43,946	5.44	239,066.24	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	6,932	6.58	45,612.56	
	CROWN LTD	15,184	8.51	129,215.84	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	24,308	7.89	191,790.12	
	TATTS GROUP LTD	43,035	2.32	99,841.20	
	FAIRFAX MEDIA LTD	73,912	1.09	80,564.08	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	18,163	2.65	48,131.95	
	METCASH LTD	26,679	4.00	106,716.00	
	WOOLWORTHS LIMITED	42,448	26.96	1,144,398.08	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	19,332	11.82	228,504.24	
	FOSTER'S GROUP LTD	66,295	4.32	286,394.40	
	GOODMAN FIELDER LTD	43,173	1.04	44,899.92	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	22,098	3.45	76,238.10	
	COCHLEAR LIMITED	2,015	80.78	162,771.70	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,282	17.98	76,990.36	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	13,126	12.32	161,712.32	
	CSL LIMITED	19,219	34.21	657,481.99	
	AUST&NZ BANKING GROUP LTD	89,558	22.46	2,011,472.68	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	12,971	9.09	117,906.39	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	54,137	51.75	2,801,589.75	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	74,751	26.89	2,010,054.39	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	104,508	23.73	2,479,974.84	
	ASX LTD	5,996	31.22	187,195.12	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	11,862	34.72	411,848.64	
	SUNCORP GROUP LTD	44,028	8.45	372,036.60	
	AMP LIMITED	98,888	5.25	519,162.00	
	INSURANSE AUSTRALIA GROUP LTD	73,432	3.57	262,152.24	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	36,878	17.99	663,435.22	
	DEXUS PROPERTY GROUP	172,437	0.85	147,433.63	
	GOODMAN GROUP	221,108	0.72	159,197.76	
	LEND LEASE CORP LIMITED	19,099	8.49	162,150.51	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	97,884	2.63	257,434.92	
	COMPUTERSHARE LIMITED	15,864	9.28	147,217.92	
	TELSTRA CORPORATION LTD	153,134	2.98	456,339.32	
	AGL ENERGY LTD	15,460	14.72	227,571.20	
	SP AUSNET	47,602	0.89	42,365.78	
計	銘柄数：72			32,792,659.34	
				(2,799,837,254)	
	組入時価比率：4.2%			4.3%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	24,139	8.92	215,319.88	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31,529	2.30	72,516.70	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LTD	18,591	3.71	68,972.61	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	63,926	2.30	147,349.43	
	*RTS-CONTACT ENERGY LTD-RIGHTS SH	1,288	0.91	1,181.09	
	CONTACT ENERGY LIMITED	11,593	5.99	69,442.07	

計	銘柄数：6			574,781.78	
				(36,510,138)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	74,800	87.45	6,541,260.00	
	NWS HOLDINGS LTD	47,500	11.60	551,000.00	
	SANDS CHINA LTD	85,600	21.40	1,831,840.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	19.28	790,480.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	19,000	23.85	453,150.00	
	MTR CORP	49,531	28.40	1,406,680.40	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	9,800	63.25	619,850.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	25,000	28.40	710,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	50,378	20.70	1,042,824.60	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	17.72	1,027,760.00	
	WYNN MACAU LTD	52,400	26.10	1,367,640.00	
	ESPRIT HOLDINGS LIMITED	39,367	30.65	1,206,598.55	
	LI & FUNG LTD	98,600	36.55	3,603,830.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	20,000	23.60	472,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,154	32.35	1,687,181.90	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	127,000	24.55	3,117,850.00	
	HANG SENG BANK	26,300	121.80	3,203,340.00	
	WING HANG BANK LIMITED	6,000	85.70	514,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	35,900	173.10	6,214,290.00	
	AIA GROUP LTD	274,200	26.75	7,334,850.00	
	CHEUNG KONG	49,000	117.90	5,777,100.00	
	HANG LUNG DEVELOPMENT CO	27,000	52.15	1,408,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	84,000	33.85	2,843,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	38,045	52.60	2,001,167.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	22,221	38.50	855,508.50	
	KERRY PROPERTIES LTD	25,500	39.25	1,000,875.00	
	LINK REIT	78,500	24.45	1,919,325.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	88,213	13.50	1,190,875.50	
	SINO LAND CO	88,977	13.62	1,211,866.74	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	50,000	121.70	6,085,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD A	26,500	117.80	3,121,700.00		
THE WHARF (HOLDINGS)	53,625	55.10	2,954,737.50		
WHELOCK & CO LTD	32,000	31.70	1,014,400.00		
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	73,000	4.26	310,980.00		
PCCW LTD	146,000	3.02	440,920.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	16,000	36.80	588,800.00		
CLP HOLDINGS LIMITED	67,400	64.15	4,323,710.00		
HONG KONG & CHINA GAS	147,739	19.54	2,886,820.06		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	48,000	54.25	2,604,000.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	117.50	763,750.00		
計	銘柄数：40			86,999,610.75	
				(905,665,947)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポ ールドル	FRASER & NEAVE LTD	35,200	6.24	219,648.00	
	KEPPEL CORP	48,400	11.64	563,376.00	
	NOBLE GROUP LTD	134,254	2.11	283,275.94	
	SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	33,160	5.25	174,090.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	29,400	5.48	161,112.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	60,000	3.08	184,800.00	

	CAPITAMALLS ASIA LTD	48,000	1.71	82,080.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	68,000	1.49	101,320.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	34,000	2.09	71,060.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES	30,750	1.90	58,425.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,600	14.66	272,676.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,000	1.76	121,440.00	
	CITY DEVELOPMENTS	19,000	11.46	217,740.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	209,800	2.10	440,580.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	54,750	3.91	214,072.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,800	38.56	146,528.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	42,000	2.89	121,380.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	232,680	0.67	155,895.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	68,000	5.35	363,800.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,500	14.76	892,980.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	88,000	9.47	833,360.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	43,000	19.50	838,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	30,000	7.62	228,600.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	64,000	2.01	128,640.00	
	CAPITALAND LIMITED	91,000	3.20	291,200.00	
	CAPITAMALL TRUST	75,000	1.92	144,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROP	54,000	1.97	106,380.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	24,000	4.04	96,960.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,600	4.90	81,340.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	279,490	3.16	883,188.40	
	STARHUB LTD	20,000	2.85	57,000.00	
計	銘柄数：31			8,535,447.44	
				(552,755,576)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
イスラエル シュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	15,662	56.00	877,072.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	83	3,881.00	322,123.00	
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES	7,680	19.07	146,457.60	
	DELEK GROUP LTD	129	820.00	105,780.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	732	179.80	131,613.60	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	32,750	172.50	5,649,375.00	
	BANK HAPOALIM BM	33,149	17.01	563,864.49	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	41,770	16.71	697,976.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	28,038	6.87	192,621.06	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,905	36.31	141,790.55	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	62,011	9.11	564,920.21	
	CELLCOM ISRAEL LTD	1,555	109.20	169,806.00	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	2,662	64.10	170,634.20	
	NICE SYSTEMS LTD	2,269	125.00	283,625.00	
計	銘柄数：14			10,017,659.41	
				(229,404,400)	
	組入時価比率：0.3%			0.4%	
合計				65,420,151,008	
				(65,420,151,008)	

(注)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)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(株式))

通貨	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591銘柄	100.0%	54.8%
カナダドル	株式100銘柄	100.0%	5.8%
ユーロ	株式269銘柄	100.0%	15.3%
ポンド	株式107銘柄	100.0%	10.6%
スイスフラン	株式37銘柄	100.0%	4.1%
スウェーデンクローナ	株式35銘柄	100.0%	1.6%
ノルウェークローネ	株式10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式12銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	株式72銘柄	100.0%	4.3%
ニュージーランドドル	株式6銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式40銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式31銘柄	100.0%	0.8%
イスラエルシケル	株式14銘柄	100.0%	0.4%

(口) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引契約額等、時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりです。

第3 不動産等明細表

該当事項はありません。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第5 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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。

(1) 貸借対照表

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	60,203,498	53,318,506
コール・ローン	28,010,655	1,023,930,775
国債証券	28,733,839,536	30,029,356,999
未収利息	385,410,949	363,756,927
前払費用	24,906,382	19,085,386
流動資産合計	29,232,371,020	31,489,448,593
資産合計	29,232,371,020	31,489,448,593
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	7,162,616
未払金	-	978,377,973
未払解約金	100,000	-
流動負債合計	100,000	985,540,589
負債合計	100,000	985,540,589
純資産の部		
元本等		
元本	20,192,009,848	21,908,664,285
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,040,261,172	8,595,243,719
元本等合計	29,232,271,020	30,503,908,004
純資産合計	29,232,271,020	30,503,908,004
負債・純資産合計	29,232,371,020	31,489,448,593

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

区分	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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、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。	同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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、計算日に知りう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。	同左
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。	同左

4. 収益及び費用の計上基準	受取利息、有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	同左
----------------	-----------------------------------	----

貸借対照表に関する注記

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 受益権の総数	20,192,009,848口	21,908,664,285口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4477円 (14,477円)	1.3923円 (13,923円)

金融商品に関する注記

(金融商品の状況に関する注記)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
<p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日

<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>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。</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>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>
--	---

関連当事者との取引に関する注記

（自 平成21年5月16日 至 平成22年5月17日）

該当事項はありません。

（自 平成22年5月18日 至 平成23年5月16日）

該当事項はありません。

その他の注記

（貸借対照表関係）

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
1. 期首元本額	15,760,596,836円	20,192,009,848円
期中追加設定元本額	9,117,902,584円	4,375,780,494円
期中一部解約元本額	4,686,489,572円	2,659,126,057円
期末元本額	20,192,009,848円	21,908,664,285円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド（株式70）	629,959,913円	702,504,730円
日立バランスファンド（株式50）	799,212,337円	892,330,963円
日立バランスファンド（株式30）	305,725,833円	348,701,744円
日立外国債券特化型ファンドU（為替ヘッジなし）	12,583,449,879円	13,477,254,287円
日立外国債券インデックスファンド	5,873,661,886円	6,487,872,561円

（注）*は当該親投資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。

（有価証券関係）

売買目的有価証券

区分	平成22年5月17日現在	平成23年5月16日現在
種類	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
外国国債証券	304,502,580円	299,076,674円
合計	304,502,580円	299,076,674円

（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。

（デリバティブ取引関係）

取引の状況に関する事項

	自平成21年5月16日 至平成22年5月17日	自平成22年5月18日 至平成23年5月16日
1. 取引の内容 利用しているデリバティブ取引は、通貨関連で為替予約取引等であります。		同左
2. 取引に対する取組方針 デリバティブ取引は、将来の為替の変動によるリスクを回避する目的で行います。		同左

3.取引の利用目的 デリバティブ取引は、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。	同左
4.取引に係るリスクの内容 為替予約取引等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。	同左
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。	同左
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。	同左

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成22年5月17日現在)

該当事項はありません。

(平成23年5月16日現在)

区分	種類	契約額等 (円)	契約額等 うち一年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引 以外の取引	為替予約取引 (外国・買建)	ドル	381,485,149	-	380,892,912	592,237
		カナダドル	34,474,984	-	34,191,077	283,907
		メキシコペソ	7,390,511	-	7,284,650	105,861
		ユーロ	437,637,543	-	432,676,647	4,960,896
		ポンド	76,421,542	-	75,878,885	542,657
		スイスフラン	3,029,307	-	3,000,340	28,967
		スウェーデンクローナ	4,247,651	-	4,168,979	78,672
		ノルウェークローネ	6,714,921	-	6,621,173	93,748
		デンマーククローネ	13,419,462	-	13,264,675	154,787
		ポーランドズロチ	4,489,823	-	4,401,462	88,361
		オーストラリアドル	7,252,837	-	7,169,331	83,506
		シンガポールドル	6,511,074	-	6,459,678	51,396
		マレーシアリングgit	11,368,430	-	11,270,809	97,621
			計	994,443,234	-	987,280,618

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

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の対顧客先物相場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相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの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。

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。

[次へ](#)

（ 3 ） 附属明細表(平成23年5月16日現在)

第 1 有価証券明細表

(イ) 株式 該当する事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券（債券）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債 証券	ドル	0.375% US TREASURY N/B	130,000.00	130,152.34	
		0.375% US TREASURY N/B	910,000.00	910,639.84	
		0.375% US TREASURY N/B	900,000.00	900,351.56	
		0.5% US TREASURY N/B	850,000.00	845,750.00	
		0.50% US TREASURY N/B	440,000.00	440,790.62	
		0.50% US TREASURY N/B	700,000.00	695,734.37	
		0.625% US TREASURY N/B	910,000.00	913,696.87	
		0.625% US TREASURY N/B	650,000.00	652,894.53	
		0.625% US TREASURY N/B	960,000.00	963,149.99	
		0.625% US TREASURY N/B	910,000.00	912,559.37	
		0.625% US TREASURY N/B	730,000.00	731,767.97	
		0.75% US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,195,113.28	
		0.75% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,071,671.87	
		0.750% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,005,234.38	
		0.750% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,172,650.78	
		0.750% US TREASURY N/B	240,000.00	239,793.75	
		1.0% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,208,906.25	
		1.0% US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,139,181.25	
		1.00% US TREASURY N/B	670,000.00	673,192.97	
		1.125% US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,355,075.00	
		1.125% US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,041,024.21	
		1.25% US TREASURY N/B	600,000.00	606,000.00	
		1.25% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,069,689.06	
		1.25% US TREASURY N/B	900,000.00	887,343.75	
		1.25% US TREASURY N/B	710,000.00	698,628.90	
		1.250% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,057,042.97	
		1.375% US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,041,828.91	
		1.375% US TREASURY N/B	930,000.00	943,078.12	
		1.375% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,318,890.62	
		1.375% US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,512,466.41	
		1.375% US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,147,479.68	
		1.375% US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,421,875.00	
		1.375% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,320,617.18	
		1.375% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,859.38	
		1.375% US TREASURY N/B	830,000.00	819,625.00	
		1.5% US TREASURY N/B	770,000.00	781,309.37	
		1.5% US TREASURY N/B	610,000.00	621,151.56	
		1.75% US TREASURY N/B	650,000.00	656,601.56	
		1.750% US TREASURY N/B	690,000.00	702,775.78	
		1.750% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,084,346.87	
		1.750% US TREASURY N/B	740,000.00	758,210.94	
		1.750% US TREASURY N/B	780,000.00	798,707.81	
		1.875% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,098,984.38	
		1.875% US TREASURY N/B	440,000.00	452,271.87	
		1.875% US TREASURY N/B	870,000.00	893,925.00	
1.875% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,718.75			
1.875% US TREASURY N/B	520,000.00	505,618.75			
1.875% US TREASURY N/B	500,000.00	484,453.12			
11.25% US TREASURY N/B	200,000.00	273,500.00			
2.00% US TREASURY N/B	670,000.00	690,780.47			
2.00% US TREASURY N/B	830,000.00	839,921.09			
2.125% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,249,419.53			
2.125% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,048,209.37			
2.125% US TREASURY N/B	810,000.00	825,377.34			
2.125% US TREASURY N/B	420,000.00	426,825.00			
2.25% US TREASURY N/B	860,000.00	893,056.25			
2.250% US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,128,916.41			

2.250% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,020,546.88
2.250% US TREASURY N/B	360,000.00	356,625.00
2.375% US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,166,900.00
2.375% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,197,886.72
2.375% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,249,687.50
2.375% US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,164,450.00
2.375% US TREASURY N/B	640,000.00	656,900.00
2.375% US TREASURY N/B	850,000.00	853,718.75
2.5% US TREASURY N/B	530,000.00	549,916.40
2.5% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,357,281.25
2.5% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,147,523.44
2.5% US TREASURY N/B	850,000.00	861,156.25
2.625% US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,133,325.00
2.625% US TREASURY N/B	960,000.00	1,007,625.00
2.625% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,122,998.43
2.625% US TREASURY N/B	380,000.00	394,962.50
2.625% US TREASURY N/B	500,000.00	518,281.25
2.625% US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,310,374.99
2.75% US TREASURY N/B	440,000.00	458,046.87
2.75% US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,468.75
2.75% US TREASURY N/B	820,000.00	843,959.37
2.75% US TREASURY N/B	760,000.00	773,181.25
2.750% US TREASURY N/B	700,000.00	734,343.75
2.750% US TREASURY N/B	1,680,000.00	1,683,150.00
2.875% US TREASURY N/B	270,000.00	281,390.62
2.875% US TREASURY N/B	950,000.00	972,710.93
3.00% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,072,753.12
3.00% US TREASURY N/B	670,000.00	704,442.18
3.00% US TREASURY N/B	820,000.00	858,053.12
3.125% US TREASURY N/B	550,000.00	578,015.62
3.125% US TREASURY N/B	630,000.00	665,240.62
3.125% US TREASURY N/B	750,000.00	792,890.62
3.125% US TREASURY N/B	610,000.00	644,312.50
3.125% US TREASURY N/B	930,000.00	980,423.43
3.125% US TREASURY N/B	900,000.00	946,265.62
3.125% US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,845,562.50
3.250% US TREASURY N/B	650,000.00	692,960.93
3.250% US TREASURY N/B	270,000.00	287,803.12
3.250% US TREASURY N/B	750,000.00	798,984.37
3.250% US TREASURY N/B	950,000.00	1,008,335.93
3.250% US TREASURY N/B	980,000.00	1,038,646.87
3.375% US TREASURY N/B	210,000.00	219,778.12
3.375% US TREASURY N/B	560,000.00	592,725.00
3.375% US TREASURY N/B	570,000.00	604,467.18
3.375% US TREASURY N/B	1,960,000.00	2,030,743.75
3.50% US TREASURY N/B	500,000.00	530,039.06
3.50% US TREASURY N/B	930,000.00	991,321.87
3.50% US TREASURY N/B	2,080,000.00	2,158,975.00
3.50% US TREASURY N/B	1,010,000.00	875,070.31
3.625% US TREASURY N/B	400,000.00	421,281.25
3.625% US TREASURY N/B	430,000.00	456,471.87
3.625% US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,853,085.93
3.625% US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,397,206.24
3.750% US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,645,945.31
3.875% US TREASURY N/B	280,000.00	294,459.37
3.875% US TREASURY N/B	650,000.00	689,304.68
3.875% US TREASURY N/B	770,000.00	837,976.56
3.875% US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,359,290.62
4.00% US TREASURY N/B	510,000.00	538,050.00
4.00% US TREASURY N/B	590,000.00	641,348.43
4.00% US TREASURY N/B	810,000.00	891,253.12
4.00% US TREASURY N/B	850,000.00	931,148.43
4.125% US TREASURY N/B	390,000.00	409,469.53
4.125% US TREASURY N/B	740,000.00	819,087.50
4.25% US TREASURY N/B	300,000.00	316,359.37

4.25%	US TREASURY N/B	810,000.00	875,685.93
4.25%	US TREASURY N/B	770,000.00	837,856.25
4.25%	US TREASURY N/B	650,000.00	723,937.50
4.25%	US TREASURY N/B	600,000.00	668,812.50
4.25%	US TREASURY N/B	1,000,000.00	990,156.25
4.25%	US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,312,335.93
4.250%	US TREASURY N/B	570,000.00	629,137.50
4.250%	US TREASURY N/B	610,000.00	675,384.37
4.375%	US TREASURY N/B	720,000.00	757,125.00
4.375%	US TREASURY N/B	490,000.00	497,426.56
4.375%	US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,110,656.25
4.375%	US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,119,539.06
4.50%	US TREASURY N/B	390,000.00	405,996.09
4.50%	US TREASURY N/B	520,000.00	587,518.75
4.50%	US TREASURY N/B	670,000.00	693,450.00
4.50%	US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,124,403.12
4.500%	US TREASURY N/B	590,000.00	664,303.12
4.500%	US TREASURY N/B	600,000.00	675,750.00
4.500%	US TREASURY N/B	710,000.00	739,509.37
4.625%	US TREASURY N/B	590,000.00	669,926.56
4.625%	US TREASURY N/B	630,000.00	715,739.06
4.625%	US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,145,862.50
4.75%	US TREASURY N/B	490,000.00	513,198.43
4.75%	US TREASURY N/B	560,000.00	600,337.49
4.750%	US TREASURY N/B	770,000.00	857,707.81
4.750%	US TREASURY N/B	270,000.00	309,192.18
4.750%	US TREASURY N/B	440,000.00	474,856.25
4.875%	US TREASURY N/B	500,000.00	526,093.75
4.875%	US TREASURY N/B	620,000.00	711,353.12
5.00%	US TREASURY N/B	400,000.00	448,125.00
5.125%	US TREASURY N/B	620,000.00	717,746.87
5.250%	US TREASURY N/B	300,000.00	348,937.50
5.250%	US TREASURY N/B	280,000.00	325,762.50
5.375%	US TREASURY N/B	410,000.00	484,889.05
5.50%	US TREASURY N/B	300,000.00	358,875.00
6.00%	US TREASURY N/B	310,000.00	388,178.12
6.125%	US TREASURY N/B	490,000.00	624,290.62
6.125%	US TREASURY N/B	240,000.00	307,237.50
6.25%	US TREASURY N/B	490,000.00	623,448.43
6.25%	US TREASURY N/B	420,000.00	546,065.62
6.375%	US TREASURY N/B	120,000.00	156,506.25
6.50%	US TREASURY N/B	140,000.00	184,231.25
6.625%	US TREASURY N/B	190,000.00	253,264.06
6.750%	US TREASURY N/B	170,000.00	228,437.50
6.875%	US TREASURY N/B	330,000.00	445,964.06
7.125%	US TREASURY N/B	270,000.00	366,525.00
7.25%	US TREASURY N/B	450,000.00	567,000.00
7.25%	US TREASURY N/B	240,000.00	327,825.00
7.50%	US TREASURY N/B	520,000.00	669,093.75
7.500%	US TREASURY N/B	120,000.00	169,875.00
7.625%	US TREASURY N/B	170,000.00	243,392.18
7.875%	US TREASURY N/B	450,000.00	632,109.37
8.00%	US TREASURY N/B	470,000.00	670,264.06
8.125%	US TREASURY N/B	360,000.00	503,662.50
8.125%	US TREASURY N/B	190,000.00	272,560.93
8.75%	US TREASURY N/B	300,000.00	411,750.00
8.75%	US TREASURY N/B	330,000.00	484,429.68
8.875%	US TREASURY N/B	210,000.00	291,768.75
8.875%	US TREASURY N/B	40,000.00	57,625.00
計	銘柄数：181	137,400,000.00	144,285,888.60
			(11,674,171,246)
	組入時価比率：38.3%		38.9%
カナダドル	1.50% CANADA GOV'T	220,000.00	220,200.20
	1.50% CANADA GOV'T	230,000.00	229,659.60
	1.75% CANADA GOV'T	350,000.00	350,350.00

	2.00% CANADA GOV'T	660,000.00	664,118.40
	2.00% CANADA GOV'T	380,000.00	379,734.00
	2.00% CANADA GOV'T	440,000.00	436,814.40
	2.50% CANADA GOV'T	180,000.00	182,518.20
	2.50% CANADA GOV'T	300,000.00	302,043.00
	3.00% CANADA GOV'T	510,000.00	523,596.60
	3.00% CANADA GOV'T	220,000.00	225,196.40
	3.25% CANADA GOV'T	170,000.00	170,680.00
	3.50% CANADA GOV'T	490,000.00	506,792.30
	3.50% CANADA GOV'T	390,000.00	402,023.70
	3.75% CANADA GOV'T	100,000.00	102,408.00
	3.75% CANADA GOV'T	540,000.00	569,565.00
	4.00% CANADA GOV'T	320,000.00	342,246.40
	4.00% CANADA GOV'T	440,000.00	471,292.80
	4.00% CANADA GOV'T	470,000.00	505,015.00
	4.25% CANADA GOV'T	350,000.00	381,069.50
	4.50% CANADA GOV'T	370,000.00	400,969.00
	5.00% CANADA GOV'T	470,000.00	510,194.40
	5.00% CANADA GOV'T	390,000.00	478,935.60
	5.25% CANADA GOV'T	480,000.00	498,974.40
	5.25% CANADA GOV'T	260,000.00	278,002.40
	5.75% CANADA GOV'T	460,000.00	593,492.00
	5.75% CANADA GOV'T	440,000.00	581,671.20
	8.00% CANADA GOV'T	100,000.00	146,493.00
	8.00% CANADA GOV'T	180,000.00	279,837.00
	9.00% CANADA GOV'T	80,000.00	130,033.60
計	銘柄数：29	9,990,000.00	10,863,926.10
			(905,942,797)
	組入時価比率：3.0%		3.0%
メキシコペソ	6.00% MEX BONOS DESARR F	6,280,000.00	6,221,344.80
	7.25% MEX BONOS DESARR F	1,000,000.00	1,033,300.00
	7.50% MEX BONOS DESARR F	1,370,000.00	1,340,558.70
	7.75% MEX BONOS DESARR F	800,000.00	845,896.00
	8.00% MEX BONOS DESARR F	3,000,000.00	3,196,530.00
	8.00% MEX BONOS DESARR F	4,200,000.00	4,470,102.00
	8.00% MEX BONOS DESARR F	1,620,000.00	1,708,014.60
	8.50% MEX BONOS DESARR F	6,400,000.00	6,795,072.00
	8.50% MEX BONOS DESARR F	3,800,000.00	3,945,958.00
	9.00% MEX BONOS DESARR F	12,120,000.00	12,817,506.00
計	銘柄数：10	40,590,000.00	42,374,282.10
			(291,111,318)
	組入時価比率：1.0%		1.0%
ユーロ	0.50% DEUTSCHLAND REP	720,000.00	712,548.00
	0.75% DEUTSCHLAND REP	210,000.00	207,774.00
	0.75% FRANCE GOV'T	350,000.00	345,975.00
	1.00% DEUTSCHLAND REP	380,000.00	376,086.00
	1.00% NETHERLANDS GOVT	170,000.00	165,325.00
	1.5% DEUTSCHLAND REP	360,000.00	358,596.00
	1.75% BUNDESobligation	640,000.00	625,184.00
	1.75% FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	114,888.00
	1.75% NETHERLANDS GOVT	520,000.00	520,260.00
	2.00% BUONI POLIENNALI	670,000.00	665,310.00
	2.00% BUONI POLIENNALI	500,000.00	491,500.00
	2.00% DEUTSCHLAND REP	600,000.00	588,120.00
	2.00% FRANCE GOV'T	530,000.00	516,591.00
	2.25% BUONI POLIENNALI	360,000.00	352,908.00
	2.25% DEUTSCHLAND REP	570,000.00	575,073.00
	2.25% DEUTSCHLAND REP	560,000.00	560,000.00
	2.25% DEUTSCHLAND REP	580,000.00	544,620.00
	2.25% FRANCE GOV'T	390,000.00	381,810.00
	2.30% SPANISH GOV'T	610,000.00	599,630.00
	2.50% BUONI POLIENNALI	430,000.00	431,057.80
	2.50% DEUTSCHLAND REP	510,000.00	517,038.00
	2.50% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	535,273.50
	2.50% DEUTSCHLAND REP	470,000.00	446,829.00

2.50% FRANCE GOV'T	820,000.00	827,298.00
2.50% FRANCE GOV'T	580,000.00	581,276.00
2.50% FRANCE GOV'T	880,000.00	814,528.00
2.50% SPANISH GOV'T	500,000.00	486,000.00
2.75% BELGIUM KINGDOM	360,000.00	349,128.00
2.75% NETHERLANDS GOVT	350,000.00	354,760.00
2.75% SPANISH GOV'T	80,000.00	80,224.00
3.00% BUONI POLIENNALI	170,000.00	168,691.00
3.00% BUONI POLIENNALI	580,000.00	568,748.00
3.00% BUONI POLIENNALI	590,000.00	576,489.00
3.00% BUONI POLIENNALI	490,000.00	475,888.00
3.00% DEUTSCHLAND REP	610,000.00	608,963.00
3.00% FRANCE GOV'T	640,000.00	654,208.00
3.00% FRANCE GOV'T	900,000.00	913,320.00
3.00% SPANISH GOV'T	380,000.00	361,038.00
3.125%FINNISH GOV'T	160,000.00	164,512.00
3.15% SPANISH GOV'T	490,000.00	464,863.00
3.20% REP OF AUSTRIA	230,000.00	231,840.00
3.25% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	364,561.00
3.25% DEUTSCHLAND REP	640,000.00	663,904.00
3.25% DEUTSCHLAND REP	660,000.00	673,200.00
3.25% DEUTSCHLAND REP	260,000.00	241,930.00
3.25% FRANCE GOV'T	910,000.00	931,112.00
3.25% NETHERLANDS GOVT	390,000.00	401,934.00
3.25% NETHERLANDS GOVT	180,000.00	178,254.00
3.25% SPANISH GOV'T	360,000.00	340,218.00
3.30% SPANISH GOV'T	400,000.00	391,320.00
3.35% PORTUGUESE OT'S	290,000.00	223,213.00
3.375%FINNISH GOV'T	220,000.00	220,638.00
3.40% REP OF AUSTRIA	340,000.00	349,860.00
3.5% DEUTSCHLAND REP	520,000.00	537,238.00
3.5% DEUTSCHLAND REP	640,000.00	670,816.00
3.5% DEUTSCHLAND REP	730,000.00	757,959.00
3.50% BELGIUM KINGDOM	260,000.00	263,224.00
3.50% BUONI POLIENNALI	600,000.00	603,660.00
3.50% FINNISH GOV'T	120,000.00	120,528.00
3.50% FRANCE GOV'T	580,000.00	601,460.00
3.50% FRANCE GOV'T	780,000.00	788,502.00
3.50% FRANCE GOV'T	650,000.00	624,520.00
3.50% NETHERLANDS GOVT	430,000.00	438,213.00
3.50% REP OF AUSTRIA	350,000.00	360,850.00
3.50% REP OF AUSTRIA	310,000.00	308,450.00
3.60% PORTUGUESE OT'S	340,000.00	274,890.00
3.65% REP OF AUSTRIA	50,000.00	50,300.00
3.75% BELGIUM KINGDOM	330,000.00	336,105.00
3.75% BELGIUM KINGDOM	620,000.00	603,260.00
3.75% BUONI POLIENNALI	680,000.00	689,792.00
3.75% BUONI POLIENNALI	750,000.00	755,025.00
3.75% BUONI POLIENNALI	130,000.00	129,597.00
3.75% BUONI POLIENNALI	860,000.00	860,860.00
3.75% BUONI POLIENNALI	760,000.00	712,576.00
3.75% BUONI POLIENNALI	780,000.00	736,554.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	770,000.00	801,300.50
3.75% DEUTSCHLAND REP	700,000.00	737,870.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	610,000.00	646,478.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	670,000.00	708,190.00
3.75% FRANCE GOV'T	840,000.00	867,132.00
3.75% FRANCE GOV'T	750,000.00	783,525.00
3.75% FRANCE GOV'T	630,000.00	650,979.00
3.75% FRANCE GOV'T	940,000.00	960,210.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	490,000.00	512,981.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	250,000.00	256,625.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	330,000.00	332,970.00
3.80% REP OF AUSTRIA	470,000.00	489,035.00
3.80% SPANISH GOV'T	380,000.00	363,660.00

3.85% PORTUGUESE OT'S	420,000.00	279,384.00
3.875%FINNISH GOV'T	240,000.00	252,120.00
3.90% REP OF AUSTRIA	390,000.00	404,586.00
3.90% SPANISH GOV'T	500,000.00	505,250.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	381,618.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	350,000.00	362,320.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	330,000.00	333,366.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	360,000.00	364,428.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	260,000.00	260,988.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	363,710.00
4.00% BUONI POLIENNALI	680,000.00	684,556.00
4.00% BUONI POLIENNALI	720,000.00	694,440.00
4.00% BUONI POLIENNALI	710,000.00	583,620.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	520,000.00	545,766.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	690,000.00	739,128.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	680,000.00	729,912.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	640,000.00	670,848.00
4.00% FINNISH GOV'T	170,000.00	175,355.00
4.00% FRANCE GOV'T	610,000.00	634,583.00
4.00% FRANCE GOV'T	910,000.00	952,133.00
4.00% FRANCE GOV'T	610,000.00	640,805.00
4.00% FRANCE GOV'T	550,000.00	579,700.00
4.00% FRANCE GOV'T	640,000.00	672,320.00
4.00% FRANCE GOV'T	800,000.00	796,880.00
4.00% FRANCE GOV'T	290,000.00	282,982.00
4.00% FRANCE GOV'T	130,000.00	128,661.00
4.00% IRISH GOV'T	460,000.00	370,438.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	410,000.00	435,338.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	430,000.00	455,499.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	410,000.00	434,149.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	360,000.00	375,588.00
4.00% REP OF AUSTRIA	370,000.00	388,500.00
4.00% SPANISH GOV'T	480,000.00	444,336.00
4.10% PORTUGUESE OT'S	220,000.00	134,015.20
4.10% SPANISH GOV'T	550,000.00	523,655.00
4.15% REP OF AUSTRIA	310,000.00	312,790.00
4.20% PORTUGUESE OT'S	260,000.00	194,870.00
4.20% SPANISH GOV'T	470,000.00	476,768.00
4.20% SPANISH GOV'T	540,000.00	422,712.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	480,000.00	499,584.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	410,000.00	426,974.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	120,000.00	120,456.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	186,240.00
4.25% BUONI POLIENNALI	690,000.00	706,704.90
4.25% BUONI POLIENNALI	500,000.00	513,445.00
4.25% BUONI POLIENNALI	750,000.00	771,075.00
4.25% BUONI POLIENNALI	800,000.00	821,360.00
4.25% BUONI POLIENNALI	610,000.00	626,104.00
4.25% BUONI POLIENNALI	420,000.00	419,664.00
4.25% BUONI POLIENNALI	760,000.00	755,896.00
4.25% BUONI POLIENNALI	670,000.00	661,558.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	570,000.00	590,748.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	810,000.00	858,114.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	710,000.00	756,292.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	560,000.00	609,140.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	620,000.00	675,924.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	451,656.00
4.25% FINNISH GOV'T	150,000.00	155,145.00
4.25% FINNISH GOV'T	190,000.00	202,872.50
4.25% FRANCE GOV'T	590,000.00	632,480.00
4.25% FRANCE GOV'T	590,000.00	631,772.00
4.25% FRANCE GOV'T	900,000.00	963,810.00
4.25% FRANCE GOV'T	910,000.00	962,962.00
4.25% NETHERLANDS GOVT	470,000.00	493,594.00
4.25% SPANISH GOV'T	400,000.00	404,920.00

4.30% REP OF AUSTRIA	310,000.00	327,964.50
4.30% REP OF AUSTRIA	300,000.00	319,800.00
4.30% SPANISH GOV'T	450,000.00	426,555.00
4.35% PORTUGUESE OT'S	90,000.00	64,980.00
4.35% REP OF AUSTRIA	350,000.00	373,800.00
4.375%FINNISH GOV'T	160,000.00	173,440.00
4.375%PORTUGUESE OT'S	260,000.00	214,084.00
4.40% IRISH GOV'T	380,000.00	253,460.00
4.40% SPANISH GOV'T	570,000.00	576,327.00
4.45% PORTUGUESE OT'S	290,000.00	206,018.90
4.50% BUONI POLIENNALI	780,000.00	797,862.00
4.50% BUONI POLIENNALI	680,000.00	692,512.00
4.50% BUONI POLIENNALI	690,000.00	698,763.00
4.50% BUONI POLIENNALI	640,000.00	646,144.00
4.50% BUONI POLIENNALI D	370,000.00	350,353.00
4.50% DEUTSCHLAND REP	700,000.00	731,955.00
4.50% FRANCE GOV'T	660,000.00	682,044.00
4.50% FRANCE GOV'T	630,000.00	663,957.00
4.50% FRANCE GOV'T	600,000.00	646,320.00
4.50% IRISH GOV'T	140,000.00	95,200.00
4.50% IRISH GOV'T	250,000.00	166,852.50
4.50% NETHERLANDS GOVT	520,000.00	566,228.00
4.6% IRISH GOV'T	210,000.00	155,087.10
4.60% SPANISH GOV'T	420,000.00	409,290.00
4.65% REP OF AUSTRIA	210,000.00	228,774.00
4.65% SPANISH GOV'T	510,000.00	463,539.00
4.70% SPANISH GOV'T	150,000.00	125,280.00
4.75% BUONI POLIENNALI	680,000.00	702,990.80
4.75% BUONI POLIENNALI	310,000.00	312,170.00
4.75% BUONI POLIENNALI	560,000.00	558,320.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	364,480.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	630,000.00	729,225.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	548,780.00
4.75% FRANCE GOV'T	620,000.00	646,784.00
4.75% FRANCE GOV'T	600,000.00	666,360.00
4.75% PORTUGUESE OT'S	150,000.00	105,450.00
4.75% SPANISH GOV'T	510,000.00	522,372.60
4.80% PORTUGUESE OT'S	110,000.00	78,100.00
4.80% SPANISH GOV'T	620,000.00	585,280.00
4.85% REP OF AUSTRIA	290,000.00	321,610.00
4.85% SPANISH GOV'T	310,000.00	303,025.00
4.90% SPANISH GOV'T	430,000.00	372,294.00
4.95% PORTUGUESE OT'S	20,000.00	13,260.00
5.0% BELGIUM KINGDOM	400,000.00	421,600.00
5.0% DEUTSCHLAND REP	800,000.00	831,120.00
5.0% NETHERLANDS GOVT	320,000.00	332,544.00
5.00% BELGIUM KINGDOM	420,000.00	436,716.00
5.00% BUONI POLIENNALI	660,000.00	664,950.00
5.00% BUONI POLIENNALI	630,000.00	602,910.00
5.00% BUONI POLIENNALI	660,000.00	622,710.00
5.00% BUONI POLIENNALI	440,000.00	413,820.00
5.00% FRANCE GOV'T	720,000.00	797,976.00
5.00% IRISH GOV'T	180,000.00	158,320.80
5.00% PORTUGUESE OT'S	170,000.00	160,922.00
5.00% REP OF AUSTRIA	190,000.00	197,410.00
5.00% SPANISH GOV'T	320,000.00	328,320.00
5.25% BUONI POLIENNALI	640,000.00	684,032.00
5.25% BUONI POLIENNALI	930,000.00	938,463.00
5.375%FINNISH GOV'T	200,000.00	214,500.00
5.40% IRISH GOV'T	420,000.00	285,163.20
5.45% PORTUGUESE OT'S	400,000.00	353,704.00
5.5% DEUTSCHLAND REP	510,000.00	636,429.00
5.5% NETHERLANDS GOVT	300,000.00	367,320.00
5.50% BELGIUM KINGDOM	260,000.00	285,625.60
5.50% BELGIUM KINGDOM	470,000.00	519,350.00

	5.50% FRANCE GOV'T	720,000.00	862,632.00
	5.50% SPANISH GOV'T	470,000.00	489,693.00
	5.50% SPANISH GOV'T	350,000.00	356,615.00
	5.625%DEUTSCHLAND REP	440,000.00	547,448.00
	5.75% BUONI POLIENNALI	470,000.00	494,346.00
	5.75% FRANCE GOV'T	600,000.00	749,400.00
	5.75% SPANISH GOV'T	390,000.00	388,050.00
	5.90% IRISH GOV'T	240,000.00	172,800.00
	5.90% SPANISH GOV'T	220,000.00	223,894.00
	6.00% BUONI POLIENNALI	910,000.00	984,256.00
	6.00% FRANCE GOV'T	350,000.00	437,801.00
	6.00% SPANISH GOV'T	200,000.00	204,960.00
	6.15% SPANISH GOV'T	380,000.00	398,240.00
	6.25% DEUTSCHLAND REP	260,000.00	338,078.00
	6.25% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	404,610.00
	6.25% REP OF AUSTRIA	240,000.00	309,216.00
	6.40% PORTUGUESE OT'S	30,000.00	24,648.30
	6.5% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	472,850.00
	6.50% BUONI POLIENNALI	790,000.00	902,259.00
	7.25% BUONI POLIENNALI	320,000.00	392,320.00
	7.50% NETHERLANDS GOVT	150,000.00	208,065.00
	8.00% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	185,504.00
	8.00% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	199,597.00
	8.50% FRANCE GOV'T	260,000.00	360,815.00
	8.50% FRANCE GOV'T	270,000.00	399,168.00
	9.00% BUONI POLIENNALI	210,000.00	288,960.00
計	銘柄数：244	113,450,000.00	115,453,478.70
			(13,148,996,689)
	組入時価比率：43.1%		43.8%
ポンド	2.00% UK TREASURY	630,000.00	622,944.00
	2.25% UK TREASURY	690,000.00	705,966.60
	2.75% UK TREASURY	950,000.00	979,830.00
	3.75% UK TREASURY	700,000.00	727,650.00
	3.75% UK TREASURY	780,000.00	801,996.00
	3.75% UK TREASURY	220,000.00	224,466.00
	4.00% UK TREASURY	660,000.00	713,440.20
	4.00% UK TREASURY	400,000.00	415,080.00
	4.00% UK TREASURY	130,000.00	126,243.00
	4.25% UK TREASURY	440,000.00	452,276.00
	4.25% UK TREASURY	500,000.00	505,440.00
	4.25% UK TREASURY	500,000.00	503,625.00
	4.25% UK TREASURY	470,000.00	475,029.00
	4.25% UK TREASURY	420,000.00	423,318.00
	4.25% UK TREASURY	730,000.00	742,410.00
	4.25% UK TREASURY	640,000.00	652,128.00
	4.25% UK TREASURY	350,000.00	357,619.50
	4.50% UK TREASURY	1,000,000.00	1,062,600.00
	4.50% UK TREASURY	540,000.00	591,948.00
	4.50% UK TREASURY	320,000.00	334,016.00
	4.50% UK TREASURY	820,000.00	866,075.80
	4.75% UK TREASURY	450,000.00	499,815.00
	4.75% UK TREASURY	580,000.00	644,960.00
	4.75% UK TREASURY	500,000.00	541,550.00
	4.75% UK TREASURY	500,000.00	546,242.50
	5.00% UK TREASURY	640,000.00	708,032.00
	5.00% UK TREASURY	390,000.00	443,063.40
	5.00% UK TREASURY	470,000.00	528,092.00
	5.25% UK TREASURY	700,000.00	733,096.00
	6.00% UK TREASURY	370,000.00	462,052.30
	8.00% UK TREASURY	250,000.00	290,375.00
	8.00% UK TREASURY	150,000.00	188,250.00
	8.00% UK TREASURY	240,000.00	334,536.00
	8.75% UK TREASURY	180,000.00	244,927.80
計	銘柄数：34	17,310,000.00	18,449,093.10
			(2,414,617,304)

	組入時価比率：7.9%		8.0%
スイスフラン	2.50% SWITZERLAND	160,000.00	169,664.00
	2.75% SWITZERLAND	320,000.00	327,795.20
	3.00% SWITZERLAND	230,000.00	251,620.00
	3.00% SWITZERLAND	30,000.00	32,940.00
	4.00% SWITZERLAND	100,000.00	105,910.00
	4.00% SWITZERLAND	230,000.00	288,420.00
	4.00% SWITZERLAND	20,000.00	24,100.00
	4.25% SWITZERLAND	190,000.00	207,157.00
	4.25% SWITZERLAND	290,000.00	336,835.00
計	銘柄数：9	1,570,000.00	1,744,441.20
			(158,046,372)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
スウェーデン クローナ	3.00% SWEDEN GOV'T	1,210,000.00	1,212,662.00
	3.5% SWEDEN GOV'T	1,580,000.00	1,613,195.80
	3.75% SWEDEN GOV'T	1,740,000.00	1,815,342.00
	4.25% SWEDEN GOV'T	2,740,000.00	2,963,392.20
	4.50% SWEDEN GOV'T	1,740,000.00	1,855,884.00
	5.00% SWEDEN GOV'T	2,100,000.00	2,429,952.00
	5.50% SWEDEN GOV'T	2,160,000.00	2,254,478.40
	6.75% SWEDEN GOV'T	1,940,000.00	2,163,876.00
計	銘柄数：8	15,210,000.00	16,308,782.40
			(205,816,833)
	組入時価比率：0.7%		0.7%
ノルウェー クローネ	4.25% NORWEGIAN GOV'T	970,000.00	1,032,080.00
	4.50% NORWEGIAN GOV'T	890,000.00	964,760.00
	5.00% NORWEGIAN GOV'T	1,700,000.00	1,841,950.00
	6.50% NORWEGIAN GOV'T	1,560,000.00	1,678,950.00
計	銘柄数：4	5,120,000.00	5,517,740.00
			(80,007,230)
	組入時価比率：0.3%		0.3%
デンマーク クローネ	4.00% KINGDOM OF DENMARK	1,780,000.00	1,842,122.00
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	2,290,000.00	2,431,980.00
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	1,970,000.00	2,104,551.00
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	2,670,000.00	2,846,220.00
	4.50% KINGDOM OF DENMARK	2,850,000.00	3,291,750.00
	5.00% KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,896,290.00
	7.00% KINGDOM OF DENMARK	890,000.00	1,221,792.00
計	銘柄数：7	15,150,000.00	16,634,705.00
			(254,178,292)
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ポーランドズロチ	0.00% POLAND GOV'T	750,000.00	690,750.00
	0.00% POLAND GOVT BOND	100,000.00	93,410.00
	5.00% POLAND GOV'T	1,030,000.00	1,026,910.00
	5.00% POLAND GOV'T	40,000.00	38,680.00
	5.25% POLAND GOV'T	1,070,000.00	1,074,922.00
	5.25% POLAND GOV'T	720,000.00	700,128.00
	5.25% POLAND GOV'T	510,000.00	477,615.00
	5.5% POLAND GOV'T	840,000.00	840,000.00
	5.5% POLAND GOV'T	800,000.00	774,400.00
	5.75% POLAND GOV'T	1,160,000.00	1,177,980.00
	5.75% POLAND GOV'T	1,120,000.00	1,075,200.00
	6.25% POLAND GOV'T	1,150,000.00	1,180,475.00
	計	銘柄数：12	9,290,000.00
			(263,808,050)
	組入時価比率：0.9%		0.9%
オーストラリア ドル	4.50% AUSTRALIAN GOV'T	390,000.00	382,757.70
	4.50% AUSTRALIAN GOV'T	250,000.00	235,202.50
	4.75% AUSTRALIAN GOV'T	310,000.00	309,051.40
	5.25% AUSTRALIAN GOV'T	540,000.00	537,462.00
	5.75% AUSTRALIAN GOV'T	310,000.00	318,980.70
	5.75% AUSTRALIAN GOV'T	220,000.00	226,206.20
	6.00% AUSTRALIAN GOV'T	720,000.00	746,344.80
	6.25% AUSTRALIAN GOV'T	420,000.00	434,015.40
	6.25% AUSTRALIAN GOV'T	370,000.00	384,637.20

	6.50% AUSTRALIAN GOV'T	450,000.00	462,942.00
計	銘柄数：10	3,980,000.00	4,037,599.90
			(344,730,279)
	組入時価比率：1.1%		1.1%
シンガポールドル	1.625% SINGAPORE GOV'T	180,000.00	184,010.40
	2.25% SINGAPORE GOV'T	130,000.00	134,998.50
	2.50% SINGAPORE GOV'T	170,000.00	174,877.30
	2.50% SINGAPORE GOV'T	100,000.00	102,888.00
	2.875% SINGAPORE GOV'T	100,000.00	99,052.00
	3.125% SINGAPORE GOV'T	100,000.00	105,441.00
	3.25% SINGAPORE GOV'T	160,000.00	172,427.20
	3.50% SINGAPORE GOV'T	220,000.00	238,389.80
	3.625% SINGAPORE GOV'T	230,000.00	251,537.20
	3.75% SINGAPORE GOV'T	200,000.00	225,192.00
	4.00% SINGAPORE GOV'T	130,000.00	148,553.60
計	銘柄数：11	1,720,000.00	1,837,367.00
			(118,987,886)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
マレーシア リンギット	2.509% MALAYSIAN GOV'T	580,000.00	576,743.30
	3.502% MALAYSIAN GOV'T	530,000.00	478,141.62
	3.718% MALAYSIAN GOV'T	1,190,000.00	1,200,386.32
	3.741% MALAYSIAN GOV'T	570,000.00	574,822.20
	3.835% MALAYSIAN GOV'T	400,000.00	406,050.00
	4.012% MALAYSIAN GOV'T	110,000.00	111,599.62
	4.16% MALAYSIAN GOV'T	750,000.00	760,250.25
	4.24% MALAYSIAN GOV'T	680,000.00	697,396.44
	4.262% MALAYSIAN GOV'T	390,000.00	403,290.81
	4.378% MALAYSIAN GOV'T	330,000.00	340,395.00
	5.094% MALAYSIAN GOV'T	750,000.00	785,484.00
計	銘柄数：11	6,280,000.00	6,334,559.56
			(168,942,703)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
小計			30,029,356,999
			(30,029,356,999)
公社債合計			30,029,356,999
			(30,029,356,999)
合計			30,029,356,999
			(30,029,356,999)

(注)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注)小計・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)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の各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(株式以外))

通貨	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181銘柄	100.0%	38.9%
カナダドル	国債証券29銘柄	100.0%	3.0%
メキシコペソ	国債証券10銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券244銘柄	100.0%	43.8%
債券	国債証券34銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券9銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券8銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券7銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券12銘柄	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	国債証券10銘柄	100.0%	1.1%
シンガポールドル	国債証券11銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券11銘柄	100.0%	0.6%

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引契約額等、時価の状況表
注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりです。

第3 不動産等明細表
該当事項はありません。

第4 その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

第5 借入金明細表
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】

以下のファンドの現況は、平成23年6月30日現在です。

日立バランスファンド（株式70）

資産総額	10,325,332,820円
負債総額	4,912,850円
純資産総額（ - ）	10,320,419,970円
発行済口数	9,447,021,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0925円

日立バランスファンド（株式50）

資産総額	13,361,250,350円
負債総額	8,484,315円
純資産総額（ - ）	13,352,766,035円
発行済口数	11,860,744,071口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1258円

日立バランスファンド（株式30）

資産総額	5,229,952,607円
負債総額	3,803,890円
純資産総額（ - ）	5,226,148,717円
発行済口数	4,571,897,142口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1431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	32,441,418,555円
負債総額	247,216,257円
純資産総額（ - ）	32,194,202,298円
発行済口数	42,621,588,891口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7553円

（ご参考）日立国内債券インデックスマザーファンド

資産総額	77,471,342,865円
負債総額	859,722,500円
純資産総額（ - ）	76,611,620,365円
発行済口数	63,164,380,530口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2129円

（ご参考）日立外国株式インデックスマザーファンド

資産総額	66,913,478,882円
負債総額	39,414,850円
純資産総額（ - ）	66,874,064,032円
発行済口数	71,989,939,919口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9289円

（ご参考）日立外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	29,103,821,541円
負債総額	3,700,000円
純資産総額（ - ）	29,100,121,541円
発行済口数	20,604,114,314口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4123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）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け、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。

第二部 【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（平成23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、運用グループ長（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、運用グループ長（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平成11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。

平成23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、13本であり、その純資産総額の合計は240,852百万円です。（なお、親投資信託12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	65,312
	私募	6	175,540
合計		13	240,852

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」といいます。）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。
なお、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正前の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に基づき作成しております。また、当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）は、改正後の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に基づき作成しております。
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、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）及び当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、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)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)		当事業年度 (平成23年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		853		674
未収委託者報酬		213,574		220,309
未収運用受託報酬		35,118		3,729
関係会社預け金	1	569,443	1	612,715
前払費用		92		21,894
繰延税金資産		17,992		18,077
流動資産合計		837,074		877,400
固定資産				
無形固定資産				
ソフトウェア		13,205		9,692
無形固定資産合計		13,205		9,692
投資その他の資産				
長期前払費用		69		-
繰延税金資産		20,105		23,463
投資その他の資産合計		20,174		23,463
固定資産合計		33,380		33,156
資産合計		870,454		910,556

(単位：千円)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)		当事業年度 (平成23年3月31日現在)			
負債の部						
流動負債						
未払金	1	3	87,447	1	3	80,292
未払費用		1	129,736		1	143,038
未払法人税等		2	8,339		2	9,544
預り金			356			117
賞与引当金			29,102			27,135
その他流動負債			-			2
流動負債合計			254,983			260,130
固定負債						
退職給付引当金			49,410			57,664
固定負債合計			49,410			57,664
負債合計			304,393			317,794
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			191,060			217,762
利益剰余金合計			266,060			292,762
株主資本合計			566,060			592,762
純資産合計			566,060			592,762
負債・純資産合計			870,454			910,556

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
--	-------	-------

（自 平成21年4月 1日 （自 平成22年4月 1日
至 平成22年3月31日） 至 平成23年3月31日）

営業収益				
委託者報酬		466,698		468,371
運用受託報酬		557,816		541,141
営業収益計	1	1,024,514		1,009,512
営業費用				
支払手数料		288,658		270,339
委託計算費		21,465		21,639
調査費		176,727		156,962
営業雑経費				
通信費		4,094		4,072
印刷費		3,440		3,791
諸会費		2,776		3,047
営業雑経費計		10,312		10,911
営業費用計		497,164		459,852
一般管理費				
給料				
役員報酬	2	16,289	2	18,934
給料・手当		208,339		214,346
賞与		-		2,728
給料計		224,629		236,009
交際費		16,477		16,650
旅費交通費		11,714		14,912
租税公課		57		105
不動産賃借料		76,577		76,577
賞与引当金繰入額		57,398		56,820
退職給付費用		9,961		9,671
その他の人件費		32,610		36,156
その他の不動産関係費		647		761
減価償却費		4,263		3,893
諸雑費		7,490		7,516
一般管理費計	1	441,826	1	459,075
営業利益		85,524		90,584
営業外収益				
受取利息		1,595		1,013
訴訟和解金		7,085		6,003
その他		64		294
営業外収益計	1	8,745	1	7,310
営業外費用				
為替差損		39		6
その他		30		13
営業外費用計		69		19
経常利益		94,199		97,875
税引前当期純利益		94,199		97,875
法人税等	3	51,378	3	49,416
法人税等調整額		6,804		3,442
法人税等合計		44,574		45,973
当期純利益		49,624		51,901

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）		（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	
株主資本				
資本金				
前期末残高		300,000		300,000

当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	75,000	75,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	75,000	75,000
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	177,435	191,060
当期変動額		
剰余金の配当	36,000	25,200
当期純利益	49,624	51,901
当期変動額合計	13,624	26,701
当期末残高	191,060	217,762
利益剰余金合計		
前期末残高	252,435	266,060
当期変動額		
剰余金の配当	36,000	25,200
当期純利益	49,624	51,901
当期変動額合計	13,624	26,701
当期末残高	266,060	292,762
株主資本合計		
前期末残高	552,435	566,060
当期変動額		
剰余金の配当	36,000	25,200
当期純利益	49,624	51,901
当期変動額合計	13,624	26,701
当期末残高	566,060	592,762
純資産合計		
前期末残高	552,435	566,060
当期変動額		
剰余金の配当	36,000	25,200
当期純利益	49,624	51,901
当期変動額合計	13,624	26,701
当期末残高	566,060	592,762

重要な会計方針

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
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。	1. 固定資産の減価償却の方法 (1)無形固定資産 同左
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、支給見込み額のうち、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、当期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。 なお、会計基準変更時差異は発生しておりません。	2. 引当金の計上基準 (1)賞与引当金 同左 (2)退職給付引当金 同左
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の適用を受けております。	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 同左 (2)連結納税制度の適用 同左

重要な会計方針の変更

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
-	(資産除去債務に関する会計基準等) 当事業年度から、「資産除去債務に関する会計基準 (企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産 除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会 計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用し ております。これにより、営業利益、経常利益及び税 引前当期純利益に影響はありません。

表示方法の変更

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
前事業年度まで営業外費用の「その他」に含めて 表示しておりました「為替差損」は、金額的重要性 が増したため区分掲記しております。 なお、前事業年度における「為替差損」の金額は3 千円であります。	-

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23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 569,443千円 未払金 36,220千円 未払費用 7,881千円	1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 612,715千円 未払金 35,553千円 未払費用 7,276千円
2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 3,265千円 未払事業税 5,074千円	2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 3,777千円 未払事業税 5,767千円
3. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、 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)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
1. 関係会社との取引高 営業収益 84千円 一般管理費 91,031千円 営業外収益 1,594千円	1. 関係会社との取引高 一般管理費 87,314千円 営業外収益 1,013千円
2. 役員報酬の範囲額 取締役 年間40,000千円 監査役 年間 2,000千円	2. 役員報酬の範囲額 同左
3. 法人税等には、住民税及び事業税を含んでおり ます。	3. 同左

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)

<p>1. 発行済株式に関する事項</p> <p>(1)株式の種類 普通株式</p> <p>(2)前事業年度末株式数 6,000株</p> <p>(3)当事業年度増加株式数 -</p> <p>(4)当事業年度減少株式数 -</p> <p>(5)当事業年度末株式数 6,000株</p> <p>2. 自己株式に関する事項</p> <p>-</p> <p>3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項</p> <p>-</p> <p>4. 配当に関する事項</p> <p>(1)当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 平成21年5月29日 第10回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 36,000,000円 1株当たり配当額 6,000円 基準日 平成21年 3月31日 効力発生日 平成21年 6月 1日</p> <p>(2)当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 平成22年5月31日 第11回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 25,200,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 4,200円 基準日 平成22年 3月31日 効力発生日 平成22年 6月 1日</p>	<p>1. 発行済株式に関する事項</p> <p>(1)株式の種類 普通株式</p> <p>(2)前事業年度末株式数 6,000株</p> <p>(3)当事業年度増加株式数 -</p> <p>(4)当事業年度減少株式数 -</p> <p>(5)当事業年度末株式数 6,000株</p> <p>2. 自己株式に関する事項</p> <p>-</p> <p>3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項</p> <p>-</p> <p>4. 配当に関する事項</p> <p>(1)当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 平成22年5月31日 第11回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 25,200,000円 1株当たり配当額 4,200円 基準日 平成22年 3月31日 効力発生日 平成22年 6月 1日</p> <p>(2)当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 平成23年5月31日 第12回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 36,000,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 6,000円 基準日 平成23年 3月31日 効力発生日 平成23年 6月 1日</p>
---	---

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(金融商品関係)

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22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ありません。

(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

平成22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。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	853	853	-
未収委託者報酬	213,574	213,574	-
未収運用受託報酬	35,118	35,118	-
関係会社預け金	569,443	569,443	-
資産計	818,989	818,989	-
未払金	87,447	87,447	-
未払費用	129,736	129,736	-
負債計	217,184	217,184	-

(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) 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
現金及び預金	853	-	-	-
未収委託者報酬	213,574	-	-	-
未収運用受託報酬	35,118	-	-	-
関係会社預け金	569,443	-	-	-
合計	818,989	-	-	-

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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いません。

(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

平成23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。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	674	674	-
未収委託者報酬	220,309	220,309	-
未収運用受託報酬	3,729	3,729	-
関係会社預け金	612,715	612,715	-
資産計	837,428	837,428	-
未払金	80,292	80,292	-
未払費用	143,038	143,038	-
負債計	223,330	223,330	-

(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) 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
現金及び預金	674	-	-	-

未収委託者報酬	220,309	-	-	-
未収運用受託報酬	3,729	-	-	-
関係会社預け金	612,715	-	-	-
合計	837,428	-	-	-

(有価証券関係)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23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)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23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 49,410千円（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 57,664千円（退職給付引当金）
3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 9,961千円（退職給付費用）	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 9,671千円（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)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1. 繰延税金資産の発生的主要原因別内訳 (繰延税金資産) 賞与引当金 11,841 千円 退職給付引当金 20,105 未払事業税 3,240 一括償却資産超過(認容)額 148 その他 2,762 繰延税金資産合計 38,097	1. 繰延税金資産の発生的主要原因別内訳 (繰延税金資産) 賞与引当金 11,041 千円 退職給付引当金 23,463 未払事業税 2,346 その他 4,689 繰延税金資産合計 41,540
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 40.7 (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 6.4 その他 0.2 税効果会計適用後の法人税等の負担率 47.3	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 40.7 (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 6.1 その他 0.2 税効果会計適用後の法人税等の負担率 47.0

(ストックオプション等関係)

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23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)

前事業年度	当事業年度
-------	-------

(自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月 1日 至 平成23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)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
-	該当事項はありません。

(セグメント情報等)

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23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。

(3)主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	売上高
日立企業年金基金	271,213
日立国内株式特化型ファンド(注)	132,709

(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。

(追加情報)

当事業年度より「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(企業会計基準第17号 平成21年3月27日)及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日)を適用しております。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 関連当事者との取引

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)
						役員の兼任等	事業上の関係				
主要株主	(株)日立製作所	東京都千代田区	408,810 百万円	電機機器製造業	100.0%	兼任 4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	40,181	未払金	35,163
								預け金の利息	1,594	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,015,790	関係会社預け金	569,443
親会社に対する預け金の減少	1,126,596										

(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.役員の兼任4名の内訳は、当社代表取締役1名、当社非常勤取締役2名、当社非常勤監査役1名です。

2. 親会社に関する注記

株式会社日立製作所（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所、福岡証券取引所、札幌証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 関連当事者との取引

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	(株)日立製作所	東京都千代田区	409,129 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	35,163	未払金	34,694
								預け金の利息	1,013	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,068,094	関係会社 預け金	612,715
								親会社に対する預け金の減少	1,024,822		

(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。

2. 親会社に関する注記

株式会社日立製作所（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所、福岡証券取引所、札幌証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
1株当たり純資産額 94,343円47銭 1株当たり当期純利益 8,270円81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おりません。	1株当たり純資産額 98,793円72銭 1株当たり当期純利益 8,650円24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おりません。
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 49,624千円 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 49,624千円 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 51,901千円 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 51,901千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

(重要な後発事象)

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引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って、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】（平成23年6月末日現在）

(1) 受託者（受託会社）

名称	資本の額	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。
日立キャピタル証券株式会社	1,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の名称、資本の額及び事業の内容

名称	資本の額	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 （1985年6月18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 【参考情報】

当計算期間において、当ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下のとおり提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成22年 8月13日
有価証券報告書	平成22年 8月13日
半期報告書	平成23年 2月17日
有価証券届出書の訂正届出書	平成23年 2月17日

独立監査人の監査報告書

平成22年8月3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 福井 聡
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 関口 茂
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）の平成21年5月16日から平成22年5月17日までの第9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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成22年5月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年8月3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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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）の平成21年5月16日から平成22年5月17日までの第9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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成22年5月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年8月3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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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）の平成21年5月16日から平成22年5月17日までの第9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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成22年5月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年8月3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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第11期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成22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。

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）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。

独立監査人の監査報告書

平成23年7月29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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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）の平成22年5月18日から平成23年5月16日までの第10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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成23年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年7月29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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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）の平成22年5月18日から平成23年5月16日までの第10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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成23年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年7月29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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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）の平成22年5月18日から平成23年5月16日までの第10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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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）の平成23年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲には、XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年7月29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
業務執行社員 公認会計士 福井 聡

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 関口 茂

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平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第12期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成23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。

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）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。