

【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24年8月15日

【計算期間】 第11期（自平成23年5月17日 至平成24年5月15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 該当ありません。
所】

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
	海外	不動産投信 その他資産 ()	特殊型
追加型	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	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225
	年2回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米			アジア
	年6回 (隔月)	欧州			
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア	オセアニア	中近東 (中東)	エマージング
	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	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。

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

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

上記以外の各区分の定義の詳細については、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

ます。)が算出している日本の株式市場の全体を表す指数です。同指数は、東京証券取引所の知的財産であり、関連するすべての権利は、東京証券取引所が有します。

2 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（以下野村證券といいます。）が算出している国内債券市場の全体を表す指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利は、野村證券に帰属しています。

3 M S C I コクサイ指数は、M S C I I n c . が算出している日本を除く世界の主要株式市場の動きを表す指数です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利は、M S C I I n c . に帰属します。

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（以下「C G M I」といいます。）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。同指数は、C G M Iの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、C G M Iが有しています。

ファンドの特色

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

マザーファンド名	ベンチマーク	主な投資対象
日立国内株式T O P I X インデックスマザー ファンド	T O P I X（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	M S C I 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。

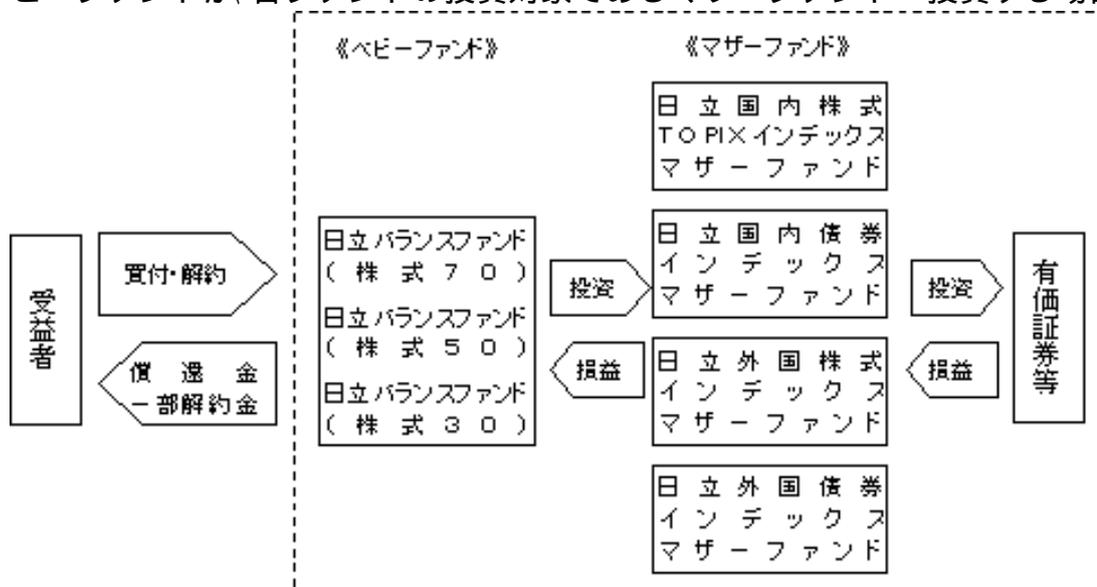
マザーファンド名	設定日
日立国内株式T O P I Xインデックスマザーファンド	平成13年 6月22日
日立国内債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立国内債券マザーファンドN」）	平成12年 4月28日
日立外国株式インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国株式マザーファンドS」）	平成12年 4月 3日
日立外国債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国債券マザーファンドU」）	平成13年 3月29日

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

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

2. 受託者（受託会社）：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

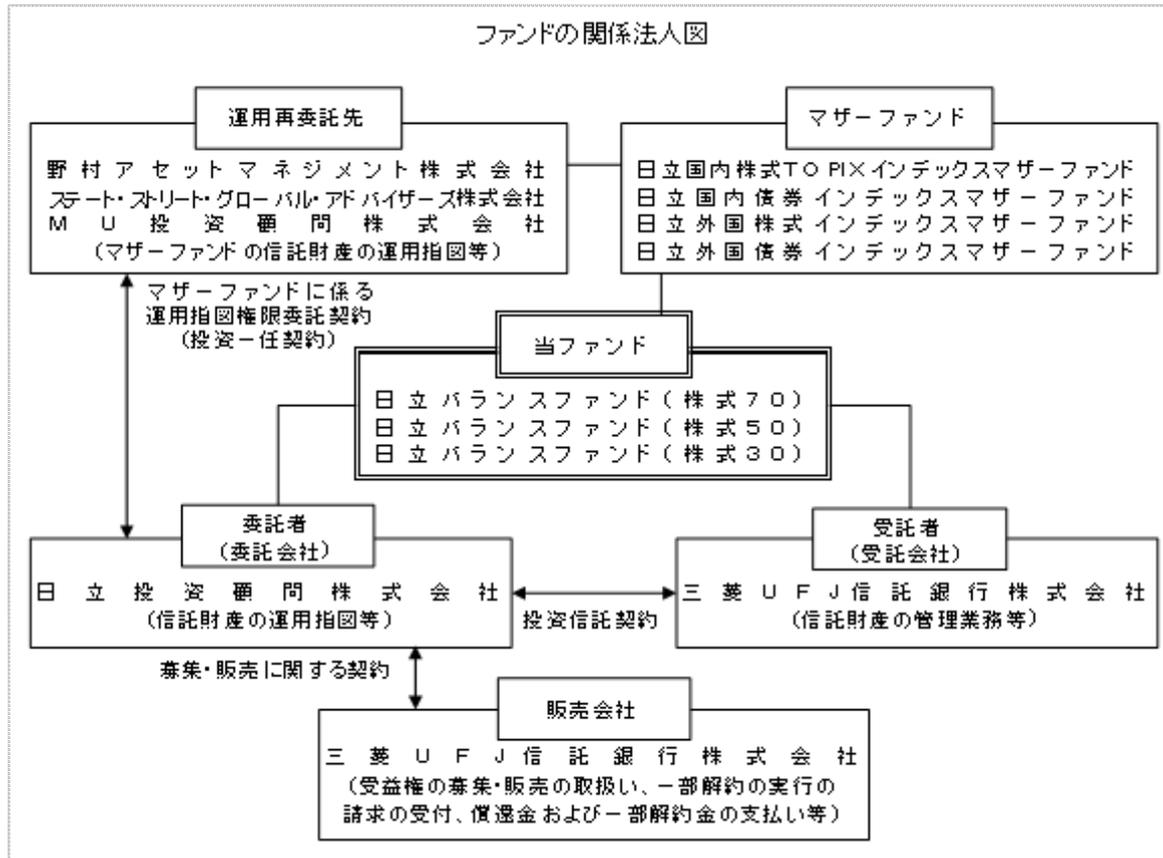
3. 販売会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

金の支払い等を行います。

4. 運用再委託先：野村アセットマネジメント株式会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社、MU投資顧問株式会社

委託者との投資一任契約に基づき、当ファンドの主たる投資対象であるマザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

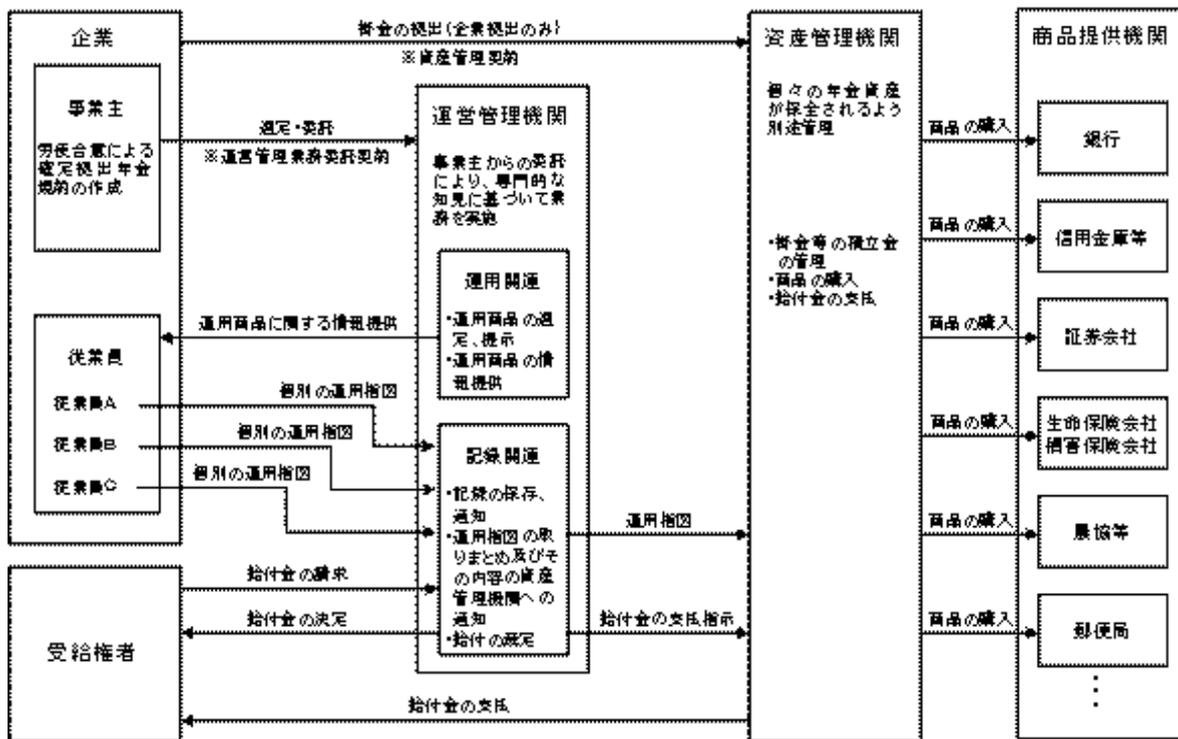


(ご参考)

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

制度の詳細は関係法令等によりご確認下さい。

確定拠出年金（企業型年金）制度のイメージ図



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

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

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

委託会社の概況（平成24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券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 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せん。）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】

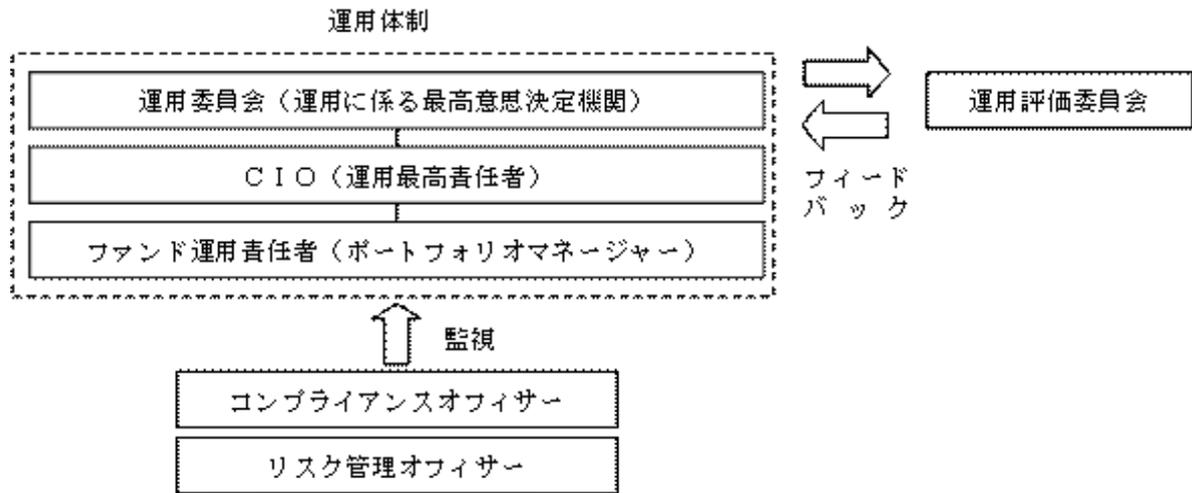
運用委員会は、当社の運用方針策定のための最高意思決定機関で、当ファンドに関する運用方針を策定します。平成24年6月末現在10名程度出席。

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24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24年6月末現在12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24年6月末現在コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーは各1名在籍。

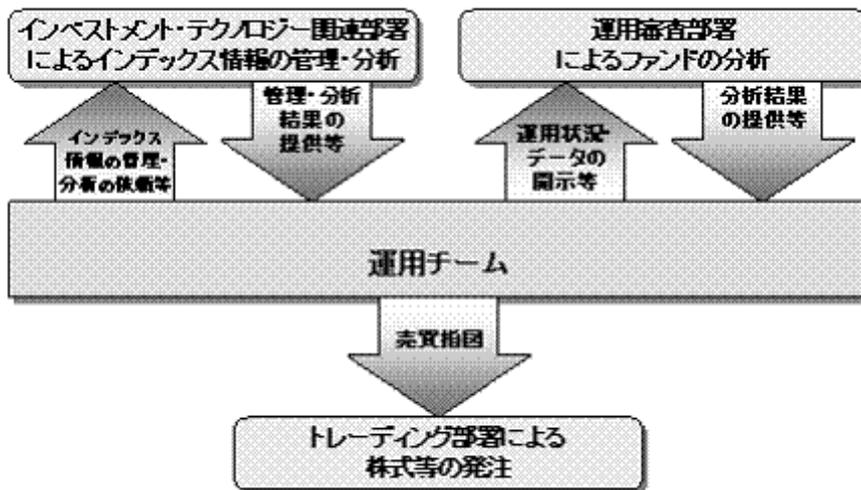
運用体制図



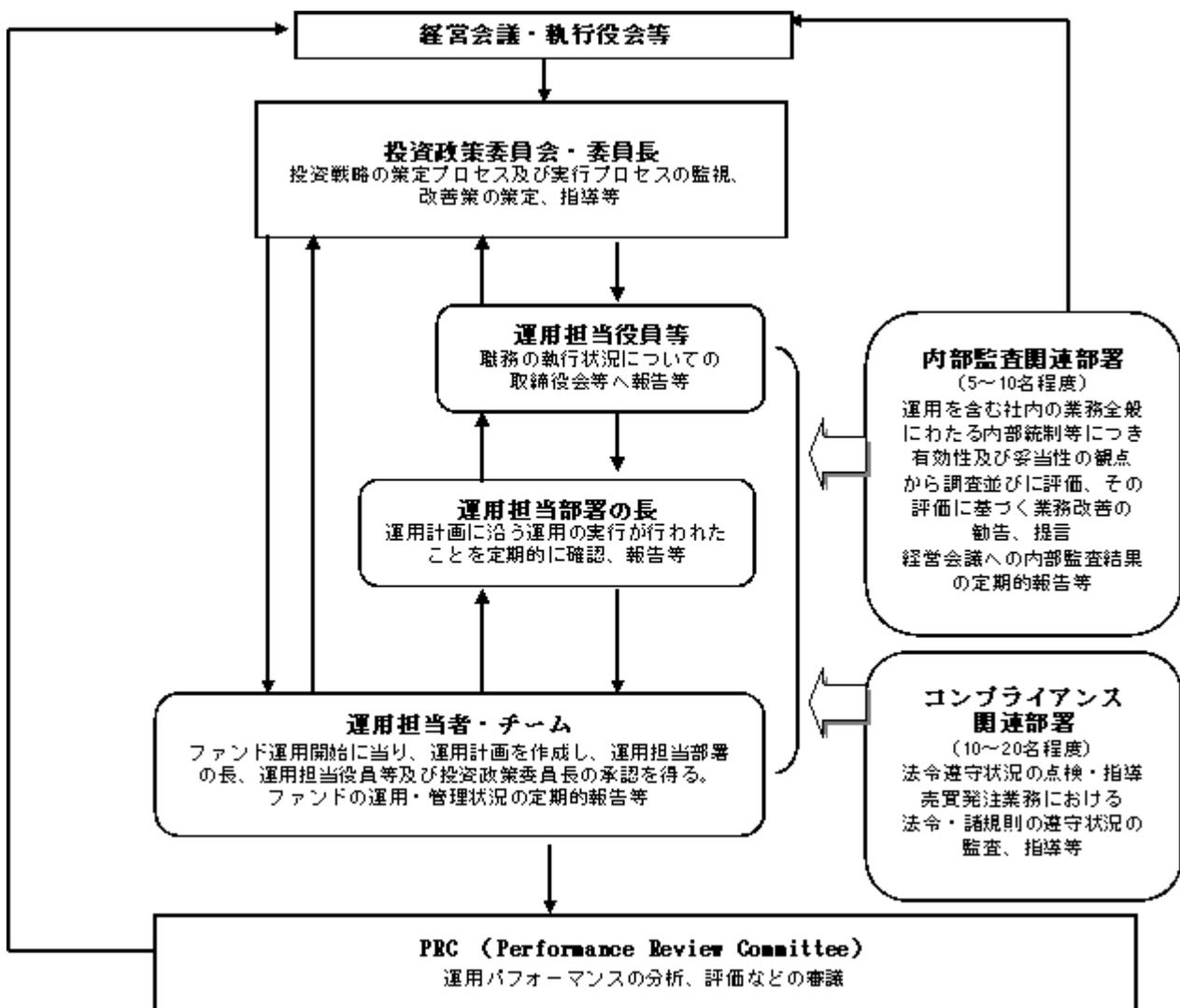
（ご参考）

「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」の運用体制

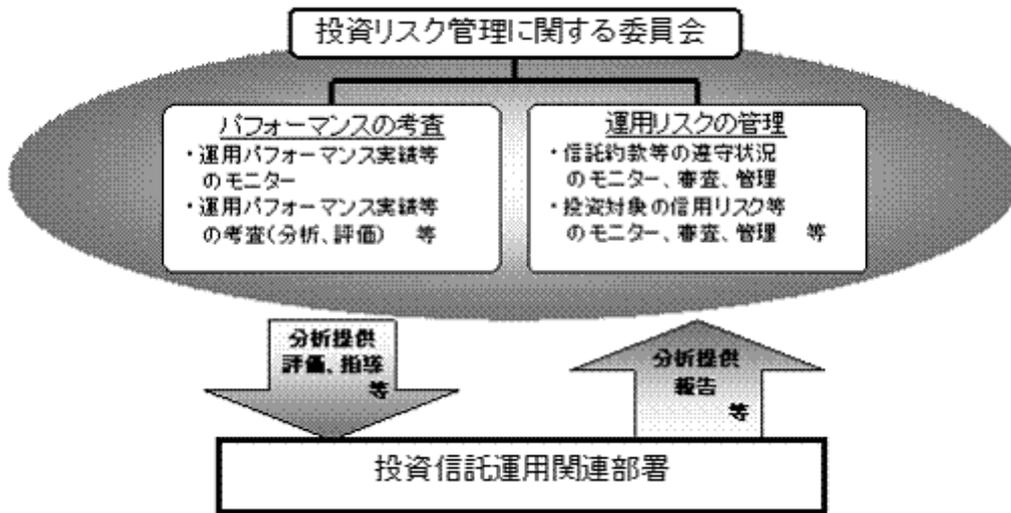
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（平成24年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。

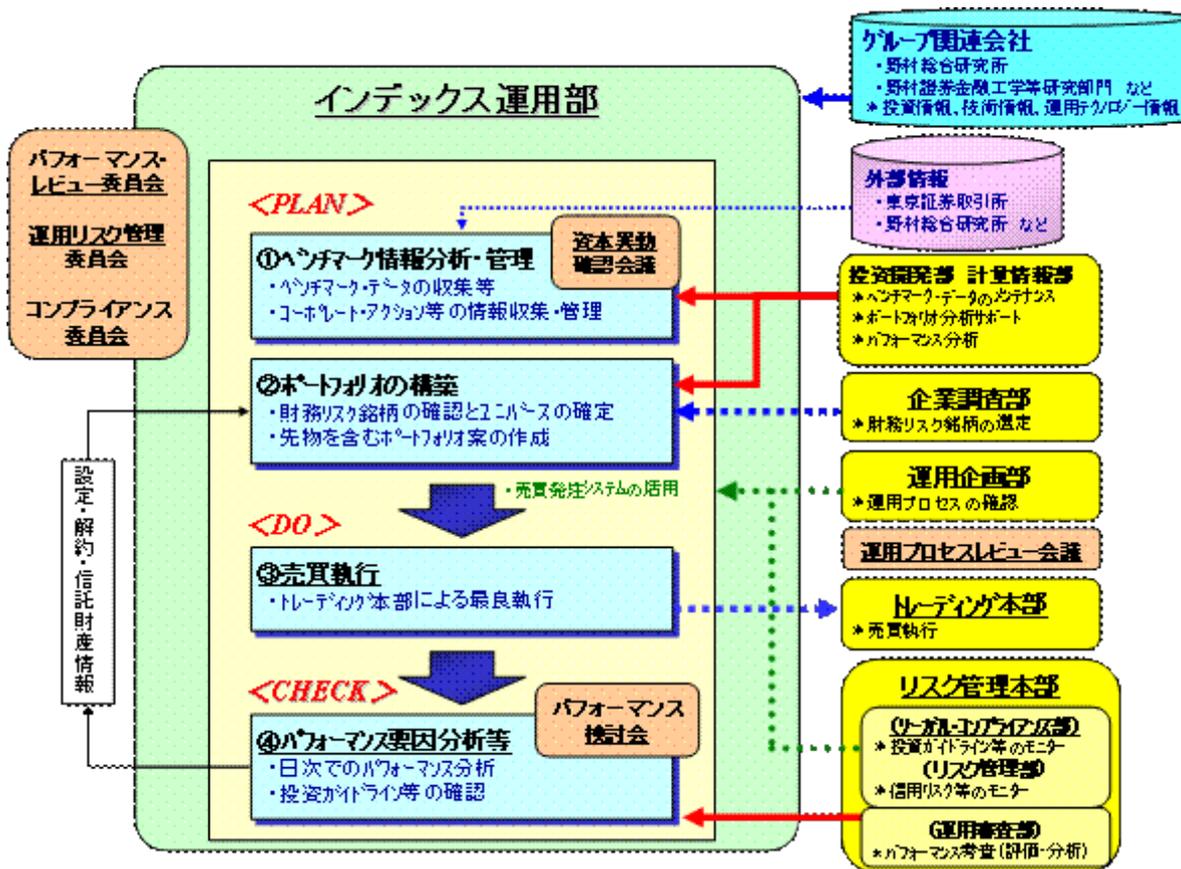


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

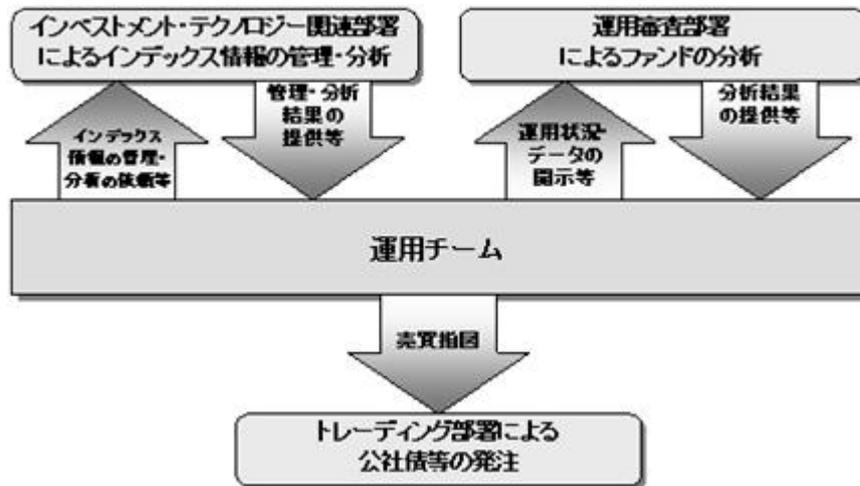
基本的には、東京証券取引所第1部の銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れますが、一部財務リスクの高い銘柄を除外しています。



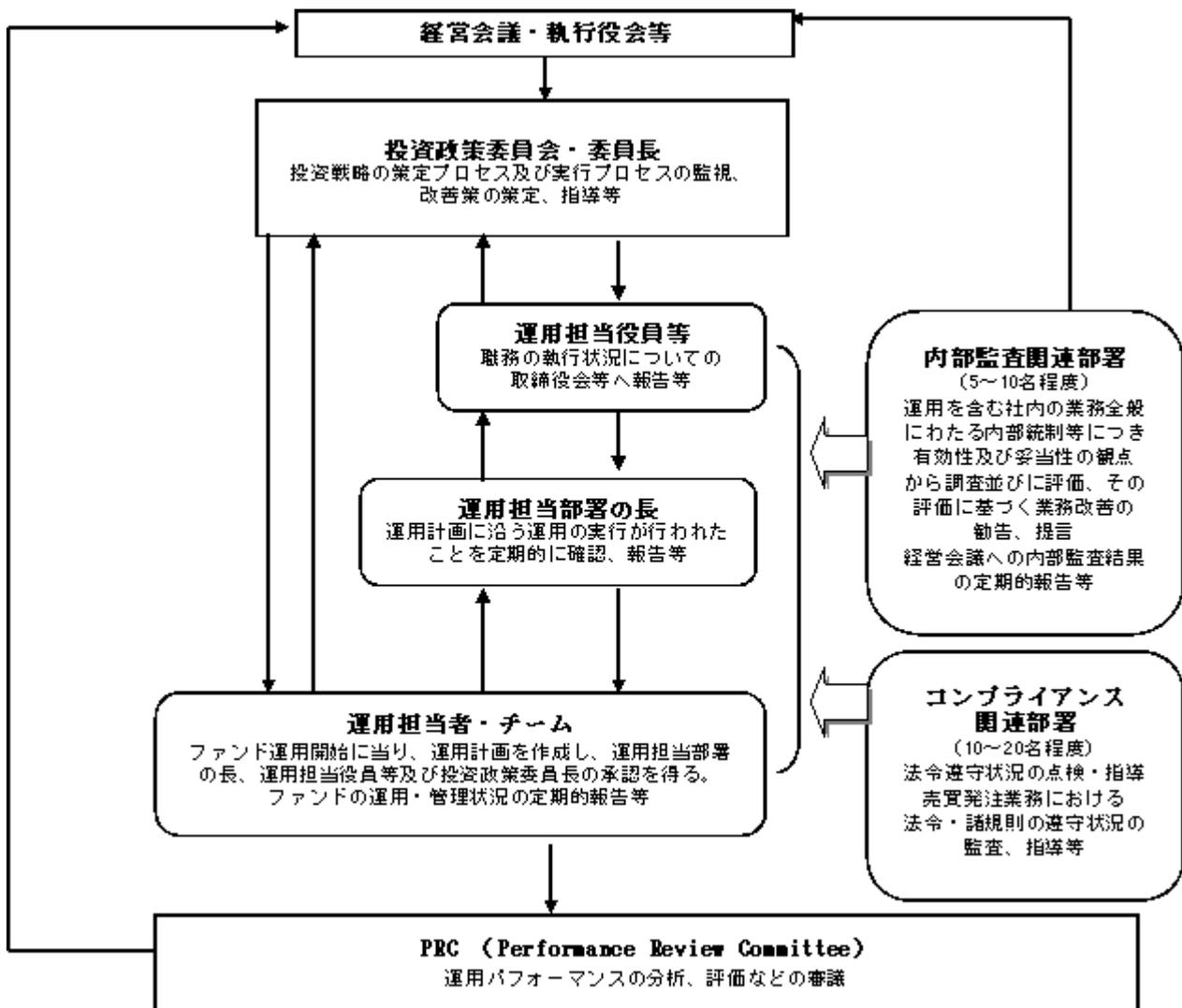
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

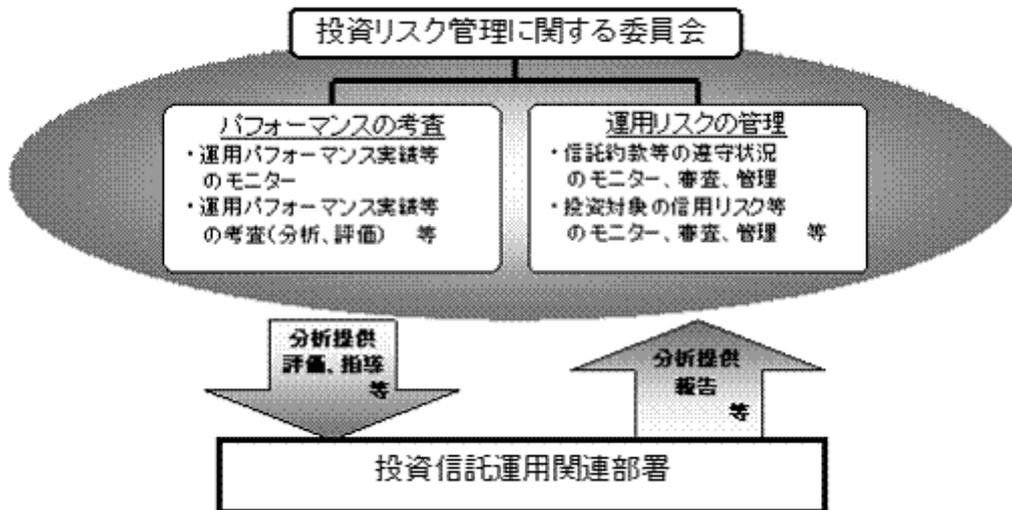
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（平成24年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。

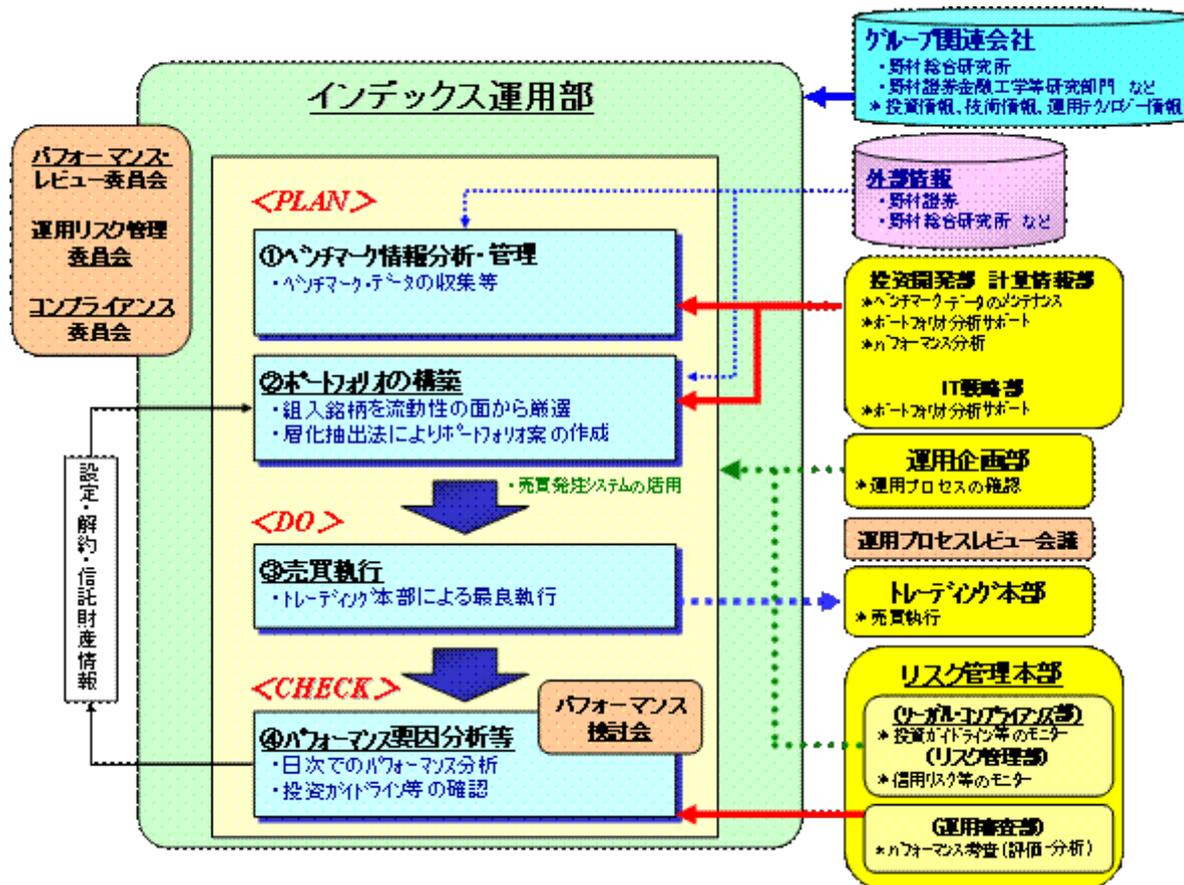


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

ベンチマーク・データ、信託財産情報、追加設定・解約等の資金流入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。

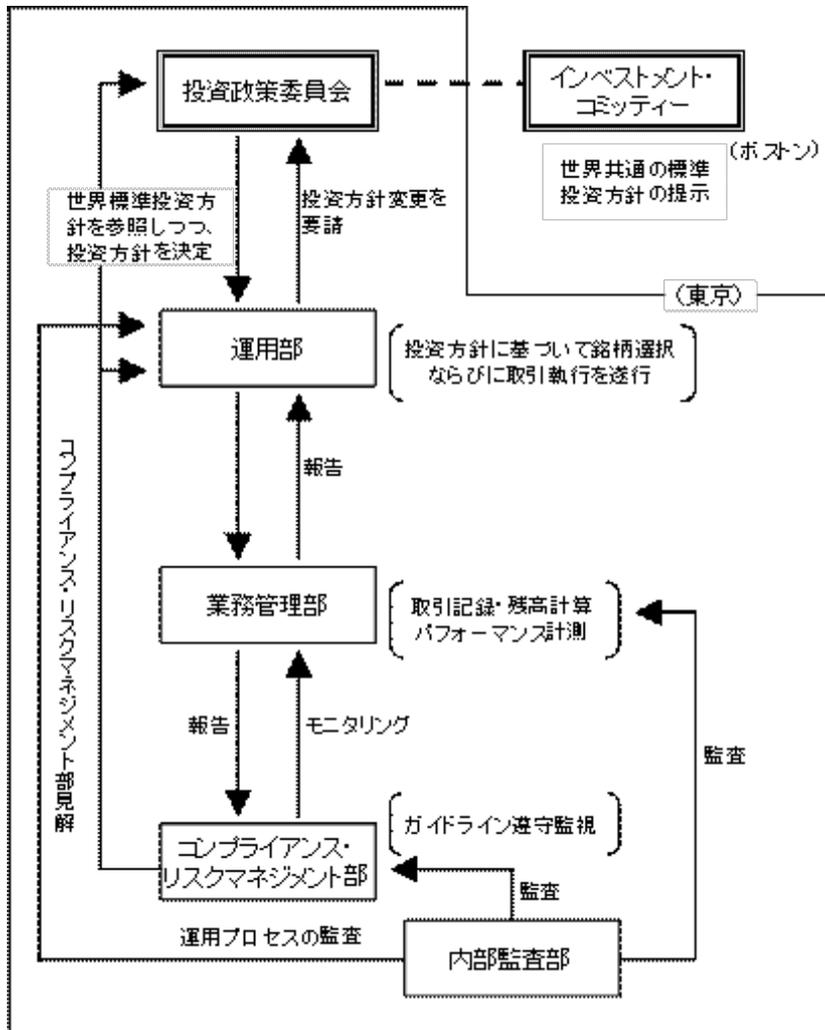


（ご参考）

「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24年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

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、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。運用担当者は、投資戦略別に毎月の投資行動を報告した上で、ガイドラインからの乖離やパフォーマンスの格差、発注取引先の集中等が生じている場合には、その理由及び顧客への説明状況について報告します。

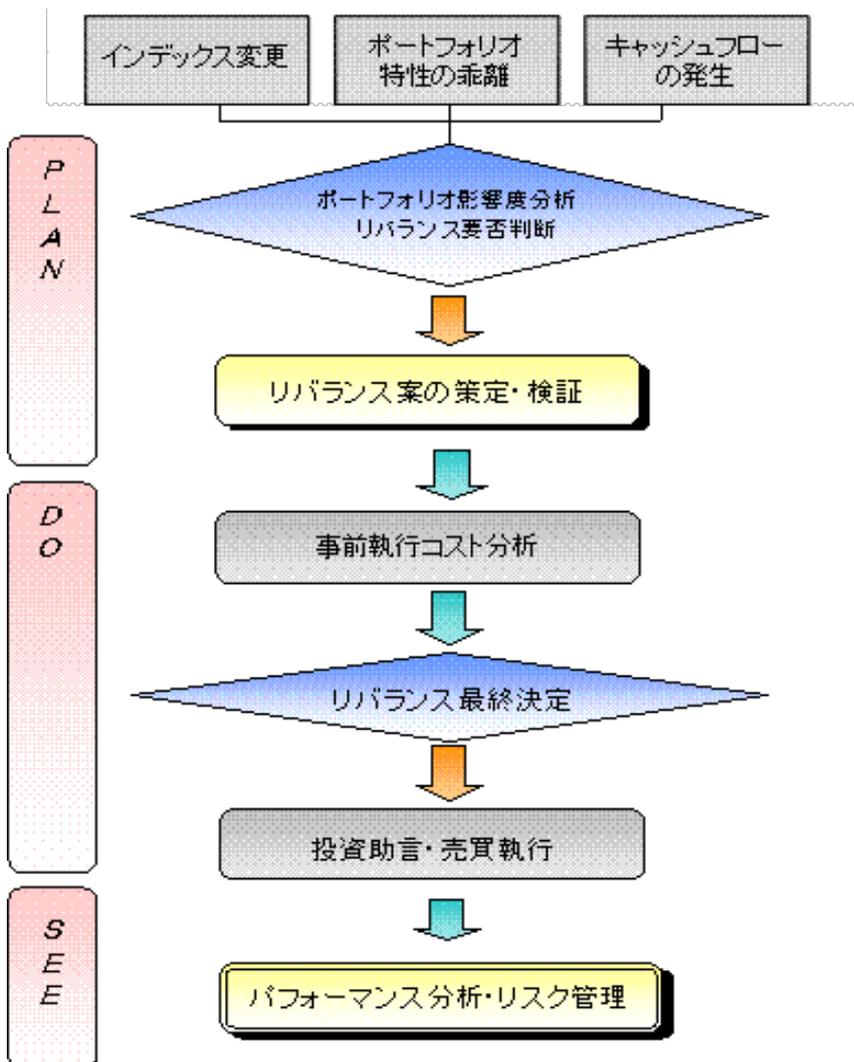
（ご参考）

「日立外国債券インデックスマザーファンド」の運用体制

当マザーファンドの運用は、MU投資顧問株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。
（平成24年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

債券運用部が、三菱UFJ信託銀行インデックス戦略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信託銀行のインデックス戦略運用部においては、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）【配分方針】

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ものとしします。

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。

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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

ニ．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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。

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。

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、市場動向などによっては、前記の運用が困難となり、前記と異なる運用を行う場合があります、また、目的が達成されない場合があります。

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

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

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

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

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

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

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲

）委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信

託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。))および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)
 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、)
 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、)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. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

ニ．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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ますものものとします。

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、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、市場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せん。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲

）委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信

託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

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。

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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

ニ．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

6．有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。

ロ．委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

7．公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

8．公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

ロ．イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

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

11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

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

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日まで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、市場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、）
 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、）
 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. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

ニ．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

6．有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。

ロ．委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

7．公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

8．公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）

イ．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

ロ．イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

委託者は、外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。

10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）

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

11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）

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

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

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

その他法令上の投資制限

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

[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せん。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲

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

- 1．株券または新株引受権証券
 - 2．国債証券
 - 3．地方債証券
 - 4．特別の法律により法人の発行する債券
 - 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6．特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - 8．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - 9．特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - 10．コマーシャル・ペーパー
 - 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
 - 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から11.までの証券または証書の性質を有するもの
 - 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）
 - 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、）
 - 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、）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ものとしします。

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。

ニ. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、

担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

5. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第21条）

イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

ニ. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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。）

3【投資リスク】

(1) 主なリスクおよび留意点

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

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

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

当ファンドは主として以下に挙げるリスクが想定されます。

有価証券に投資することによるリスク

有価証券には、次のリスクが単独でまたは同時にあるいは複合して存在するため、個々の有価証券の価格は、日常の企業活動、マクロ経済の状況、市場の需給、その他の予測出来ない要因により、日々刻々変化します。有価証券の価格変動により、当ファンドの基準価額は変動します。

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的に個々の有価証券に投資を行うため、個々の有価証券の性質に応じて以下のリスクが単独であるいは複合して基準価額等に影響を及ぼすことが想定されます。

1. 株式の価格変動リスク

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

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

2. 債券の価格変動リスク

債券の価格変動リスクは、金利変動リスクと信用リスクに大別されます。

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

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

3. 為替変動リスク

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

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24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TOP IX 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7 0）	6,164,554,703
	日立バランスファンド（株式5 0）	6,090,895,675
	日立バランスファンド（株式3 0）	1,607,269,822
	日立国内株式インデックスファン ド	10,393,688,863
	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）	35,932,200,070
	合計	60,188,609,133

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7 0）	1,599,772,371
	日立バランスファンド（株式5 0）	4,306,693,718
	日立バランスファンド（株式3 0）	2,583,109,163
	日立国内債券インデックスファン ド	9,359,562,752
	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）	57,706,965,436
	合計	75,556,103,440

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7 0）	3,577,048,982
	日立バランスファンド（株式5 0）	3,159,880,499
	日立バランスファンド（株式3 0）	627,836,998
	日立外国株式インデックスファン ド	11,636,553,234
	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）	45,864,584,317
	合計	64,865,904,030

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）	711,757,586
	日立バランスファンド（株式50）	943,265,678
	日立バランスファンド（株式30）	377,630,803
	日立外国債券インデックスファンド	7,068,417,678
	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）	6,577,100,022
	合計	15,678,171,767

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	
		委託会社	年率0.21%（税抜0.20%）
日立バランスファンド （株式70）	年率0.336% （税抜0.32%）	販売会社	年率0.0735%（税抜0.07%）
		受託会社	年率0.0525%（税抜0.05%）
		委託会社	年率0.1785%（税抜0.17%）
日立バランスファンド （株式50）	年率0.3045% （税抜0.29%）	販売会社	年率0.0735%（税抜0.07%）
		受託会社	年率0.0525%（税抜0.05%）
		委託会社	年率0.147%（税抜0.14%）
日立バランスファンド （株式30）	年率0.273% （税抜0.26%）	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は各販売会社毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

一部解約時および償還時の課税について

一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

個人、法人別の課税の取扱いについて

（注）所得税については、平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間、別途、所得税の額に対し、2.1%の率で復興特別所得税が課されます。

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。

期間ごとの税率は以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）

平成26年1月1日から 平成49年12月31日まで	20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)
------------------------------	--

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。

期間ごとの税率は以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	7% (所得税7%)
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147% (所得税7%および復興特別所得税0.147%)
平成26年1月1日から 平成49年12月31日まで	15.315% (所得税15%および復興特別所得税0.315%)

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。

- * 益金不算入制度の適用はありません。
- * 税制に関する記載は、平成24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24年6月末現在）

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	4,321,352,846	41.27
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	1,996,355,941	19.06
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	3,060,880,813	29.23
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	994,467,699	9.49
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		96,145,447	0.91
合計（純資産総額）		10,469,202,746	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	4,269,717,868	30.95
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	5,374,323,090	38.96
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	2,703,909,742	19.60
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	1,317,930,805	9.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		126,327,764	0.91
合計（純資産総額）		13,792,209,269	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	1,126,696,145	20.61
日立国内債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	3,223,461,924	58.97
日立外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	日本	537,240,119	9.82
日立外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	日本	527,625,757	9.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		51,052,981	0.93
合計（純資産総額）		5,466,076,926	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	41,594,461,540	98.57
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		600,579,071	1.42
合計（純資産総額）		42,195,040,611	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	71,488,470,100	75.82
地方債	日本	6,355,103,158	6.74
特殊債	日本	8,624,845,092	9.14
社債	日本	7,009,863,000	7.43
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		808,017,916	0.85
合計（純資産総額）		94,286,299,266	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	31,645,557,152	57.01
	カナダ	2,828,123,547	5.09
	ユーロ(ドイツ)	1,828,013,240	3.29
	ユーロ(イタリア)	458,063,131	0.82
	ユーロ(フランス)	2,027,822,660	3.65
	ユーロ(オランダ)	576,603,383	1.03
	ユーロ(スペイン)	615,966,181	1.10
	ユーロ(ベルギー)	253,241,727	0.45
	ユーロ(オーストリア)	62,658,026	0.11
	ユーロ(ルクセンブルク)	69,824,860	0.12
	ユーロ(フィンランド)	166,434,470	0.29
	ユーロ(アイルランド)	68,076,938	0.12
	ユーロ(ギリシャ)	10,372,567	0.01
	ユーロ(ポルトガル)	34,632,217	0.06
	イギリス	5,539,590,225	9.98
	スイス	2,000,407,520	3.60
	スウェーデン	717,725,247	1.29
	ノルウェー	214,169,204	0.38
	デンマーク	262,979,555	0.47
	オーストラリア	2,057,509,147	3.70
	ニュージーランド	27,189,524	0.04
	香港	717,475,998	1.29
	シンガポール	429,617,355	0.77
イスラエル	136,186,810	0.24	
小計	52,748,240,684	95.03	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,754,871,670	4.96
合計（純資産総額）		55,503,112,354	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	9,426,697,463	43.03
	カナダ	647,632,332	2.95
	メキシコ	205,690,650	0.93
	ユーロ(ドイツ)	1,962,177,253	8.95
	ユーロ(イタリア)	1,818,536,434	8.30
	ユーロ(フランス)	2,060,368,192	9.40
	ユーロ(オランダ)	577,318,501	2.63
	ユーロ(スペイン)	825,006,851	3.76
	ユーロ(ベルギー)	543,808,271	2.48
	ユーロ(オーストリア)	374,303,684	1.70
	ユーロ(フィンランド)	134,233,025	0.61
	ユーロ(アイルランド)	135,394,554	0.61
	イギリス	1,753,660,875	8.00
	スイス	91,188,233	0.41
	スウェーデン	125,805,125	0.57
	ノルウェー	49,518,177	0.22
	デンマーク	188,498,224	0.86
	ポーランド	148,950,447	0.67
	オーストラリア	319,514,265	1.45
	シンガポール	86,730,414	0.39
マレーシア	112,066,800	0.51	
	小計	21,587,099,770	98.54
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）	318,840,775	1.45
	合計（純資産総額）	21,905,940,545	100.00

(2) 【投資資産】（平成24年6月末現在）

【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	6,164,554,703	0.6776	4,177,102,267	0.7010	4,321,352,846	41.27
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	3,577,048,982	0.8746	3,128,487,040	0.8557	3,060,880,813	29.23
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	1,599,772,371	1.2453	1,992,232,464	1.2479	1,996,355,941	19.06
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	711,757,586	1.4259	1,014,895,142	1.3972	994,467,699	9.49

(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	4,306,693,718	1.2453	5,363,235,900	1.2479	5,374,323,090	38.96
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	6,090,895,675	0.6767	4,121,709,104	0.7010	4,269,717,868	30.95
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	3,159,880,499	0.8721	2,755,731,784	0.8557	2,703,909,742	19.60
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	943,265,678	1.4253	1,344,488,355	1.3972	1,317,930,805	9.55

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

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	2,583,109,163	1.2453	3,216,792,497	1.2479	3,223,461,924	58.97
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	1,607,269,822	0.6759	1,086,353,673	0.7010	1,126,696,145	20.61
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	627,836,998	0.8698	546,092,621	0.8557	537,240,119	9.82
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	377,630,803	1.4243	537,883,886	1.3972	527,625,757	9.65

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24年6月末現在)

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	513,400	3,430.23	1,761,084,095	3,190.00	1,637,746,000	3.88
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	2,958,300	403.25	1,192,938,768	378.00	1,118,237,400	2.65
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	334,000	3,040.27	1,015,450,457	2,749.00	918,166,000	2.17
日本	株式	キヤノン	電気機器	246,000	3,808.09	936,792,015	3,165.00	778,590,000	1.84
日本	株式	三井住友フィ ナンシャルグ ループ	銀行業	296,700	2,647.82	785,610,996	2,612.00	774,980,400	1.83
日本	株式	みずほフィ ナンシャルグ ループ	銀行業	5,026,400	130.00	653,441,200	134.00	673,537,600	1.59
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	180,000	3,664.25	659,565,756	3,700.00	666,000,000	1.57
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	155,300	3,513.32	545,619,340	3,615.00	561,409,500	1.33
日本	株式	ファナック	電気機器	41,200	14,488.02	596,906,700	12,950.00	533,540,000	1.26
日本	株式	ソフトバンク	情報・通 信業	177,000	2,434.42	430,892,800	2,953.00	522,681,000	1.23
日本	株式	日本たばこ産 業	食料品	196,700	2,276.82	447,850,610	2,361.00	464,408,700	1.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	284,600	1,842.05	524,248,705	1,596.00	454,221,600	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	912,000	526.93	480,566,890	487.00	444,144,000	1.05
日本	株式	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	情報・通 信業	3,220	134,115.19	431,850,915	132,700.00	427,294,000	1.01
日本	株式	三井物産	卸売業	337,300	1,289.90	435,085,110	1,174.00	395,990,200	0.93
日本	株式	セブン&アイ ・ホールディ ングス	小売業	163,500	2,427.21	396,850,090	2,397.00	391,909,500	0.92
日本	株式	三菱地所	不動産業	273,000	1,421.32	388,023,000	1,418.00	387,114,000	0.91
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	503,700	858.33	432,341,419	748.00	376,767,600	0.89
日本	株式	小松製作所	機械	193,400	2,260.46	437,173,020	1,878.00	363,205,200	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄 道	陸運業	68,800	5,092.92	350,393,300	5,000.00	344,000,000	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	74,400	4,608.59	342,879,100	4,360.00	324,384,000	0.76
日本	株式	アステラス製 薬	医薬品	92,000	3,315.84	305,057,800	3,465.00	318,780,000	0.75
日本	株式	KDDI	情報・通 信業	606	526,402.44	318,999,881	513,000.00	310,878,000	0.73
日本	株式	東京海上ホー ルディングス	保険業	148,400	2,146.70	318,571,672	1,986.00	294,722,400	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	452,400	705.99	319,393,052	643.00	290,893,200	0.68
日本	株式	ソニー	電気機器	247,000	1,549.94	382,835,908	1,123.00	277,381,000	0.65
日本	株式	三井不動産	不動産業	173,000	1,501.24	259,715,000	1,530.00	264,690,000	0.62
日本	株式	デンソー	輸送用機器	97,800	2,668.27	260,957,133	2,693.00	263,375,400	0.62
日本	株式	三菱電機	電気機器	396,000	700.46	277,385,550	660.00	261,360,000	0.61
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	311,700	897.82	279,850,505	832.00	259,334,400	0.61

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	0.64
		建設業	2.46
		食料品	3.89
		繊維製品	0.89
		パルプ・紙	0.32
		化学	5.70
		医薬品	5.12
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.63
		非鉄金属	1.09
		金属製品	0.70
		機械	4.85
		電気機器	12.67
		輸送用機器	10.40
		精密機器	1.44
		その他製品	1.46
		電気・ガス業	2.84
		陸運業	4.07
		海運業	0.37
		空運業	0.28
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.59
		卸売業	5.46
		小売業	4.30
		銀行業	9.68
		証券、商品先物取引業	1.08
		保険業	2.25
その他金融業	0.82		
不動産業	2.63		
サービス業	1.95		
		合計	98.57

投資不動産物件（平成24年6月末現在）

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24年6月末現在）

（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 (円)	評価額 (円)	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	76	日本円	538,456,830	584,440,000	1.38

(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24年6月末現在）

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102回利付国債(5年)	1,500,000,000	100.00	1,500,079,000	100.55	1,508,295,000	0.3	2016/12/20	1.59
日本	国債証券	第312回利付国債(2年)	1,500,000,000	99.98	1,499,730,000	100.00	1,500,000,000	0.1	2014/1/15	1.59
日本	国債証券	第310回利付国債(2年)	1,400,000,000	100.15	1,402,142,000	100.13	1,401,904,000	0.2	2013/11/15	1.48
日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	1,200,000,000	100.37	1,204,452,000	100.99	1,211,964,000	0.4	2016/12/20	1.28
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	1,100,000,000	100.93	1,110,230,000	100.98	1,110,813,000	0.5	2014/12/20	1.17
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	1,100,000,000	100.12	1,101,401,000	100.49	1,105,390,000	0.3	2017/3/20	1.17
日本	国債証券	第314回利付国債(2年)	1,100,000,000	99.98	1,099,815,000	100.00	1,100,000,000	0.1	2014/3/15	1.16
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,000,000,000	103.48	1,034,860,000	105.27	1,052,720,000	1.3	2021/3/20	1.11
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	940,000,000	102.83	966,677,200	104.58	983,061,400	1.2	2020/12/20	1.04
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	900,000,000	100.60	905,438,000	101.75	915,804,000	1	2022/3/20	0.97
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	900,000,000	100.98	908,820,000	101.08	909,729,000	0.5	2015/3/20	0.96
日本	国債証券	第91回利付国債(5年)	900,000,000	100.68	906,183,000	100.96	908,649,000	0.4	2015/9/20	0.96
日本	国債証券	第311回利付国債(2年)	900,000,000	100.16	901,440,000	100.14	901,296,000	0.2	2013/12/15	0.95
日本	国債証券	第311回利付国債(10年)	880,000,000	99.80	878,257,600	101.52	893,428,800	0.8	2020/9/20	0.94
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	820,000,000	106.09	869,954,400	107.09	878,170,800	1.5	2018/9/20	0.93
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	850,000,000	100.70	855,958,500	100.88	857,531,000	0.4	2015/6/20	0.90
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	800,000,000	100.13	801,056,000	102.02	816,232,000	1	2021/12/20	0.86
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	730,000,000	106.16	774,975,300	106.49	777,406,200	1.7	2016/9/20	0.82
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	700,000,000	101.06	707,441,000	102.95	720,692,000	1.1	2021/12/20	0.76
日本	国債証券	第80回利付国債(5年)	700,000,000	101.18	708,302,000	101.02	707,168,000	0.8	2013/12/20	0.75
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	700,000,000	100.44	703,080,000	101.00	707,035,000	0.4	2016/9/20	0.74
日本	国債証券	第100回利付国債(5年)	700,000,000	100.00	700,000,000	100.58	704,102,000	0.3	2016/9/20	0.74
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	630,000,000	105.39	664,001,100	106.53	671,183,100	1.4	2018/12/20	0.71
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	610,000,000	105.52	643,704,400	106.63	650,497,900	1.4	2019/9/20	0.68
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	610,000,000	103.33	630,337,400	103.09	628,885,600	1.5	2014/9/20	0.66
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	570,000,000	107.03	610,082,400	107.60	613,342,800	1.7	2017/9/20	0.65
日本	国債証券	第86回利付国債(5年)	600,000,000	101.12	606,762,000	101.10	606,630,000	0.6	2014/9/20	0.64
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	600,000,000	100.70	604,229,000	100.85	605,130,000	0.9	2022/3/20	0.64
日本	国債証券	第132回利付国債(20年)	600,000,000	98.90	593,424,000	100.81	604,860,000	1.7	2031/12/20	0.64

日本	国債証券	第90回利付国債（5年）	600,000,000	100.45	602,724,000	100.59	603,546,000	0.3	2015/6/20	0.64
----	------	--------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	-----	-----------	------

□ 種類別投資比率

国内 / 外国	種類	投資比率（％）
国内	国債証券	75.82
	地方債証券	6.74
	特殊債証券	9.14
	社債証券	7.43
	合計	99.14

投資不動産物件（平成24年6月末現在）

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24年6月末現在）

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24年6月末現在)

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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	29,770	47,330.30	1,409,023,142	45,131.35	1,343,560,453	2.42
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	150,522	6,858.78	1,032,397,832	6,590.66	992,039,475	1.78
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	241,256	2,544.51	613,878,681	2,372.16	572,298,339	1.03
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	338,102	1,586.35	536,349,560	1,602.06	541,660,366	0.97
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	35,205	16,543.12	582,400,699	15,179.93	534,409,576	0.96
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	189,494	2,490.20	471,879,191	2,806.78	531,868,139	0.95
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	63,203	8,467.30	535,159,017	8,205.41	518,606,692	0.93
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	87,807	5,205.11	457,045,559	5,309.01	466,168,363	0.83
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	240,969	1,796.66	432,941,198	1,786.85	430,576,493	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	88,018	5,309.07	467,294,585	4,781.59	420,866,859	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	160,138	2,692.44	431,162,022	2,575.98	412,513,694	0.74
アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	65,114	5,872.40	382,376,003	6,072.76	395,422,130	0.71
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	55,062	7,008.70	385,913,188	6,790.52	373,899,733	0.67
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	8,290	50,675.05	420,096,190	44,755.42	371,022,482	0.66
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	121,518	3,571.06	433,948,532	2,845.64	345,796,821	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	159,757	2,221.22	354,856,618	2,048.57	327,274,563	0.58
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	60,262	4,863.21	293,066,889	5,416.87	326,431,600	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	90,698	3,049.96	276,625,766	3,487.26	316,287,570	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	97,392	3,041.06	296,175,847	3,226.33	314,218,809	0.56
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	128,656	2,297.12	295,538,563	2,234.16	287,438,436	0.51
アメリカ	株式	PEPCICO INC	食品・飲料・タバコ	50,238	5,271.99	264,854,338	5,519.97	277,312,554	0.49
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	575,578	679.39	391,043,179	687.25	395,569,341	0.71
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,593,336	211.52	337,035,318	222.60	354,678,122	0.63
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	118,743	2,669.63	317,000,801	2,613.83	310,374,918	0.55
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	606,925	563.79	342,184,170	507.74	308,164,275	0.55
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	161,472	1,720.36	277,791,137	1,780.31	287,471,055	0.51

スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	105,463	4,655.57	490,991,066	4,599.64	485,092,835	0.87
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	73,560	4,101.82	301,730,497	4,336.57	318,998,640	0.57
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	22,469	12,888.67	289,595,624	13,392.00	300,905,050	0.54
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	103,140	2,741.83	282,792,528	2,447.64	252,450,053	0.45

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	10.77
		素材	6.48
		資本財	7.04
		商業・専門サービス	0.77
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.09
		耐久消費財・アパレル	1.24
		消費者サービス	1.61
		メディア	2.79
		小売	3.23
		食品・生活必需品小売り	2.17
		食品・飲料・タバコ	7.02
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	2.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.54
		銀行	7.27
		各種金融	4.01
		保険	3.59
		不動産	2.52
		ソフトウェア・サービス	4.78
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.57		
電気通信サービス	4.04		
公益事業	3.77		
半導体・半導体製造装置	1.52		
	合計	95.03	

投資不動産物件（平成24年6月末現在）

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24年6月末現在）

（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	313	ドル	20,705,731.74	20,695,560	1,641,364,863	2.95
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE 601209	買建	17	カナダドル	2,213,840	2,217,820	170,262,041	0.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 1209	買建	155	ユーロ	3,381,560	3,332,500	329,051,050	0.59
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 1209	買建	18	オーストラリアドル	1,841,800	1,809,000	144,086,850	0.25
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1209	買建	49	ポンド	2,676,625	2,668,295	328,520,480	0.59
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI 1209	買建	22	スイスフラン	1,306,260	1,314,500	108,065,045	0.19

(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。

（為替予約）

資産の種類			数量	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	ドル	48,000.00	3,816,000	3,806,400	0.00
		ポンド	10,000.00	1,239,100	1,231,100	0.00
		ユーロ	10,000.00	993,200	987,300	0.00

(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。

[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24年6月末現在）

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	1,420,000	8,992.39	127,691,950	9,375.30	133,129,394	3.625	2020/2/15	0.60
アメリカ	国債 証券	3.50% US TREASURY N/B	1,400,000	8,922.37	124,913,250	9,312.72	130,378,204	3.5	2020/5/15	0.59
アメリカ	国債 証券	2.625% US TREASURY N/B	1,440,000	8,361.00	120,398,528	8,775.52	126,367,597	2.625	2020/8/15	0.57
アメリカ	国債 証券	2.625% US TREASURY N/B	1,390,000	8,340.56	115,933,809	8,764.37	121,824,807	2.625	2020/11/15	0.55
アメリカ	国債 証券	3.625% US TREASURY N/B	1,270,000	8,978.75	114,030,245	9,411.86	119,530,703	3.625	2021/2/15	0.54
アメリカ	国債 証券	3.125% US TREASURY N/B	1,160,000	8,633.01	100,143,001	9,082.23	105,353,916	3.125	2021/5/15	0.48
アメリカ	国債 証券	0.25% US TREASURY N/B	1,300,000	7,882.67	102,474,715	7,911.79	102,853,297	0.25	2014/12/15	0.46
アメリカ	国債 証券	4.25% US TREASURY N/B	920,000	9,336.89	85,899,421	10,566.81	97,214,728	4.25	2040/11/15	0.44
アメリカ	国債 証券	4.75% US TREASURY N/B	840,000	10,106.44	84,894,167	11,404.53	95,798,053	4.75	2041/2/15	0.43
アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,130,000	7,988.90	90,274,645	8,393.22	94,843,480	2.125	2021/8/15	0.43
アメリカ	国債 証券	0.875% US TREASURY N/B	1,180,000	7,897.54	93,190,984	8,022.70	94,667,885	0.875	2016/11/30	0.43
アメリカ	国債 証券	3.375% US TREASURY N/B	1,020,000	8,853.59	90,306,703	9,219.78	94,041,832	3.375	2019/11/15	0.42
アメリカ	国債 証券	4.375% US TREASURY N/B	870,000	9,532.69	82,934,405	10,785.54	93,834,201	4.375	2041/5/15	0.42
アメリカ	国債 証券	3.875% US TREASURY N/B	900,000	8,771.80	78,946,289	9,942.87	89,485,844	3.875	2040/8/15	0.40
アメリカ	国債 証券	3.750% US TREASURY N/B	910,000	9,067.98	82,518,647	9,325.12	84,858,601	3.75	2018/11/15	0.38
アメリカ	国債 証券	3.125% US TREASURY N/B	930,000	8,733.61	81,222,639	9,054.97	84,211,233	3.125	2019/5/15	0.38
アメリカ	国債 証券	2.75% US TREASURY N/B	970,000	8,691.66	84,309,123	8,663.99	84,040,779	2.75	2016/11/30	0.38
アメリカ	国債 証券	4.375% US TREASURY N/B	770,000	9,528.97	73,373,088	10,757.03	82,829,195	4.375	2040/5/15	0.37
アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	990,000	8,274.88	81,921,342	8,267.44	81,847,734	2.125	2014/11/30	0.37
アメリカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	910,000	8,544.41	77,754,160	8,835.62	80,404,229	2.75	2019/2/15	0.36
アメリカ	国債 証券	3.750% US TREASURY N/B	820,000	8,573.53	70,302,986	9,743.97	79,900,611	3.75	2041/8/15	0.36
アメリカ	国債 証券	4.625% US TREASURY N/B	700,000	9,906.31	69,344,202	11,169.69	78,187,887	4.625	2040/2/15	0.35
アメリカ	国債 証券	3.625% US TREASURY N/B	820,000	8,997.96	73,783,331	9,344.32	76,623,497	3.625	2019/8/15	0.34
アメリカ	国債 証券	4.375% US TREASURY N/B	710,000	9,529.59	67,660,104	10,748.98	76,317,782	4.375	2039/11/15	0.34
フランス	国債 証券	4.25% FRANCE GOV'T	730,000	10,960.95	80,014,946	11,197.11	81,738,946	4.25	2023/10/25	0.37
フランス	国債 証券	3.00% FRANCE GOV'T	740,000	10,508.89	77,765,846	10,541.48	78,006,969	3	2015/10/25	0.35
フランス	国債 証券	3.75% FRANCE GOV'T	710,000	10,671.81	75,769,916	10,879.17	77,242,129	3.75	2021/4/25	0.35
イギリス	国債 証券	4.50% UK TREASURY	540,000	14,727.49	79,528,452	15,034.18	81,184,589	4.5	2019/3/7	0.37
イギリス	国債 証券	2.00% UK TREASURY	600,000	12,876.13	77,256,815	12,958.87	77,753,234	2	2016/1/22	0.35
イギリス	国債 証券	3.75% UK TREASURY	530,000	14,106.47	74,764,312	14,469.55	76,688,640	3.75	2019/9/7	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	98.54
	合計	98.54

投資不動産物件（平成24年6月末現在）

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24年6月末現在）

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成24年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

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
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)
11期	(平成24年5月15日)	10,201,481,825	(同左)	1.0393	(同左)
	平成23年6月末日	10,320,419,970	(同左)	1.0925	(同左)
	平成23年7月末日	10,192,037,267	(同左)	1.0722	(同左)
	平成23年8月末日	9,610,524,569	(同左)	1.0078	(同左)
	平成23年9月末日	9,416,594,741	(同左)	0.9858	(同左)
	平成23年10月末日	9,868,824,312	(同左)	1.0287	(同左)
	平成23年11月末日	9,345,906,456	(同左)	0.9807	(同左)
	平成23年12月末日	9,560,976,966	(同左)	0.9932	(同左)
	平成24年1月末日	9,831,226,091	(同左)	1.0178	(同左)
	平成24年2月末日	10,734,809,800	(同左)	1.1025	(同左)
	平成24年3月末日	11,010,102,618	(同左)	1.1255	(同左)
	平成24年4月末日	10,682,970,809	(同左)	1.0928	(同左)
	平成24年5月末日	9,828,735,338	(同左)	1.0075	(同左)
	平成24年6月末日	10,469,202,746	(同左)	1.0434	(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
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)
11期	(平成24年5月15日)	13,374,729,464	(同左)	1.0956	(同左)
	平成23年 6月末日	13,352,766,035	(同左)	1.1258	(同左)
	平成23年 7月末日	13,267,391,705	(同左)	1.1116	(同左)
	平成23年 8月末日	12,759,557,642	(同左)	1.0659	(同左)
	平成23年 9月末日	12,564,905,127	(同左)	1.0504	(同左)
	平成23年10月末日	12,981,983,304	(同左)	1.0812	(同左)
	平成23年11月末日	12,481,753,453	(同左)	1.0449	(同左)
	平成23年12月末日	12,706,321,186	(同左)	1.0556	(同左)
	平成24年 1月末日	12,982,954,247	(同左)	1.0747	(同左)
	平成24年 2月末日	13,815,220,533	(同左)	1.1406	(同左)
	平成24年 3月末日	14,064,710,510	(同左)	1.1583	(同左)
	平成24年 4月末日	13,807,845,894	(同左)	1.1347	(同左)
	平成24年 5月末日	13,033,144,104	(同左)	1.0720	(同左)
	平成24年 6月末日	13,792,209,269	(同左)	1.1003	(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
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)
11期	(平成24年5月15日)	5,288,769,335	(同左)	1.1350	(同左)
	平成23年 6月末日	5,226,148,717	(同左)	1.1431	(同左)
	平成23年 7月末日	5,202,934,505	(同左)	1.1353	(同左)
	平成23年 8月末日	5,085,053,816	(同左)	1.1101	(同左)
	平成23年 9月末日	5,038,316,592	(同左)	1.1020	(同左)
	平成23年10月末日	5,126,618,725	(同左)	1.1184	(同左)
	平成23年11月末日	5,013,897,181	(同左)	1.0953	(同左)
	平成23年12月末日	5,091,193,584	(同左)	1.1038	(同左)
	平成24年 1月末日	5,160,330,480	(同左)	1.1165	(同左)
	平成24年 2月末日	5,388,414,416	(同左)	1.1607	(同左)
	平成24年 3月末日	5,436,300,508	(同左)	1.1722	(同左)
	平成24年 4月末日	5,381,051,068	(同左)	1.1586	(同左)
	平成24年 5月末日	5,207,910,407	(同左)	1.1206	(同左)
	平成24年 6月末日	5,466,076,926	(同左)	1.1396	(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）
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
11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）
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
11期	4.30	2.13	0.18

（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）
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
11期	1,417,633,235	793,915,348	9,815,285,943

(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）
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
11期	1,501,118,637	741,217,518	12,207,701,086

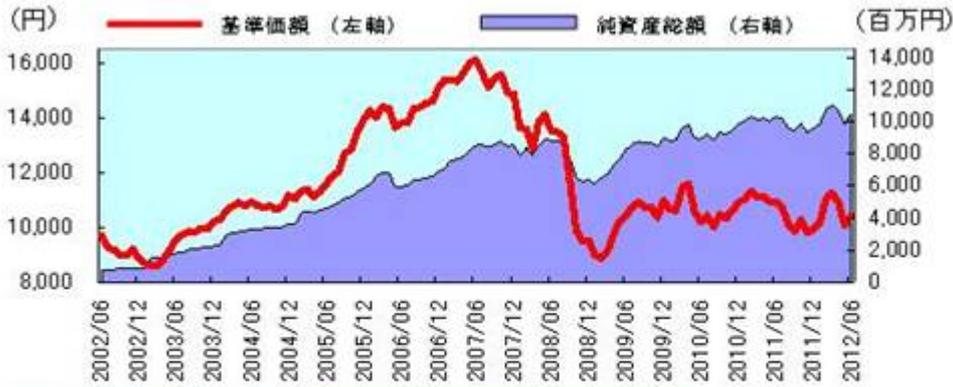
日立バランスファンド（株式３０）

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
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
11期	674,454,849	428,086,598	4,659,769,080

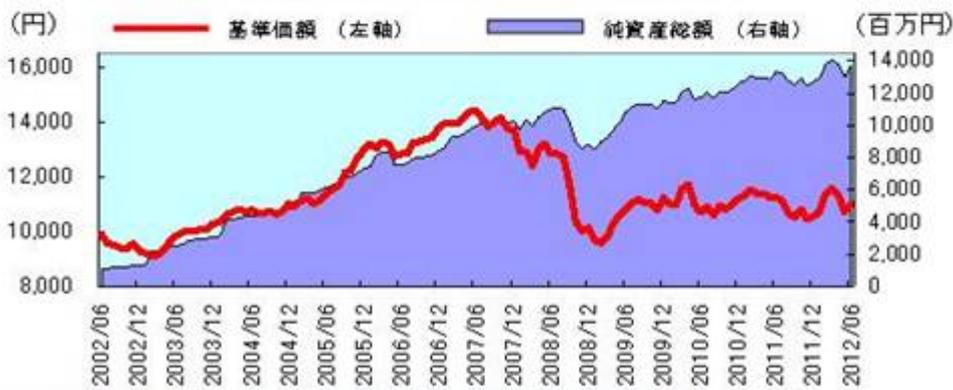
<参考情報> 運用実績 2012年6月末現在

◆ 基準価額・純資産の推移（2002年6月末～2012年6月末）

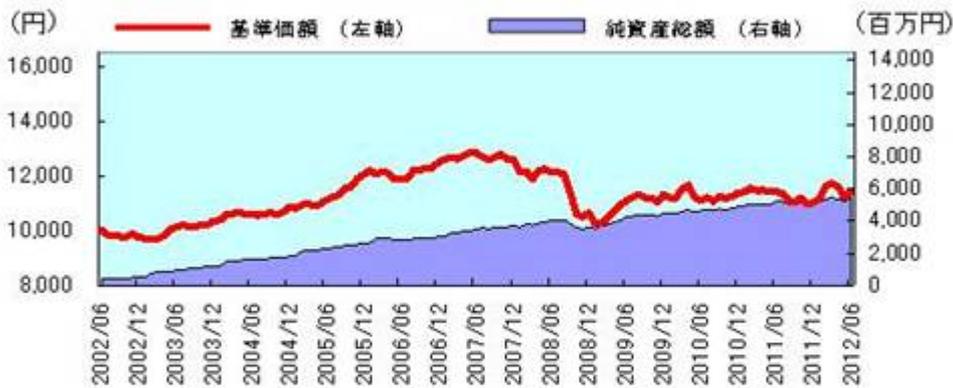
日立バランスファンド(株式70)



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	3.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.7%
本田技研工業	輸送用機器	2.2%
キヤノン	電気機器	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.8%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.6%
日本電信電話	情報・通信業	1.6%
武田薬品工業	医薬品	1.3%
ファナック	電気機器	1.3%
ソフトバンク	情報・通信業	1.2%
合計		19.4%

○組入上位10業種		
業種	組入比率	
電気機器	12.7%	
輸送用機器	10.4%	
銀行業	9.7%	
情報・通信業	6.6%	
化学	5.7%	
卸売業	5.5%	
医薬品	5.1%	
機械	4.9%	
小売業	4.3%	
陸運業	4.1%	
合計	69.0%	

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
APPLE INC	アメリカ	2.4%
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	1.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	1.0%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	1.0%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	1.0%
AT&T INC	アメリカ	1.0%
CHEVRON CORP	アメリカ	0.9%
NESTLE SA-REGISTERED	スイス	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
PFIZER INC	アメリカ	0.8%
合計		11.6%

○組入上位10ヶ国		
発行国	組入比率	
アメリカ	57.0%	
イギリス	10.0%	
カナダ	5.1%	
オーストラリア	3.7%	
フランス	3.7%	
スイス	3.6%	
ドイツ	3.3%	
スウェーデン	1.3%	
香港	1.3%	
スペイン	1.1%	
合計	90.1%	

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102回利付国債(5年)	4.5年	1.6%
第312回利付国債(2年)	1.5年	1.6%
第310回利付国債(2年)	1.4年	1.5%
第101回利付国債(5年)	4.5年	1.3%
第87回利付国債(5年)	2.5年	1.2%
第103回利付国債(5年)	4.7年	1.2%
第314回利付国債(2年)	1.7年	1.2%
第313回利付国債(10年)	8.7年	1.1%
第312回利付国債(10年)	8.5年	1.0%
第321回利付国債(10年)	9.7年	1.0%
合計		12.7%

○債券種別構成比		
債券種別	組入比率	
国債証券	75.8%	
地方債証券	6.7%	
特殊債券	9.1%	
社債券	7.4%	
合計	99.1%	

○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	24.3%	
3年以上7年未満	31.2%	
7年以上	43.6%	
合計	99.1%	

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%	7.6年	0.6%
米国債 3.500%	7.9年	0.6%
米国債 2.625%	8.1年	0.6%
米国債 2.625%	8.4年	0.6%
米国債 3.625%	8.6年	0.5%
米国債 3.125%	8.9年	0.5%
米国債 0.250%	2.5年	0.5%
米国債 4.250%	28.4年	0.4%
米国債 4.750%	28.6年	0.4%
米国債 2.125%	9.1年	0.4%
合計		5.1%

○組入上位6ヶ国		
発行国	組入比率	
アメリカ	43.0%	
フランス	9.4%	
ドイツ	9.0%	
イタリア	8.3%	
イギリス	8.0%	
合計	77.7%	

○残存年数別構成比		
残存年数	組入比率	
1年未満	1.2%	
1年以上3年未満	28.1%	
3年以上7年未満	31.8%	
7年以上	37.4%	
合計	98.5%	

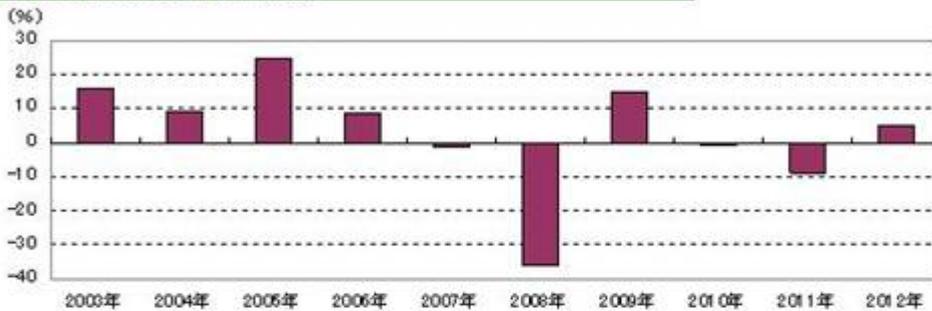
「ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。」

◆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。）

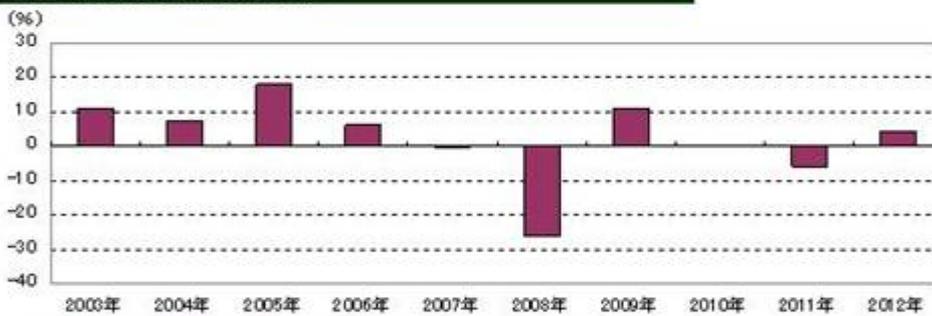
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド 株式(70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	41.3%	29.2%	19.1%	9.5%	0.9%
日立バランスファンド 株式(50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	31.0%	19.6%	39.0%	9.6%	0.9%
日立バランスファンド 株式(30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	20.6%	9.8%	59.0%	9.7%	0.9%

◆年間収益率の推移

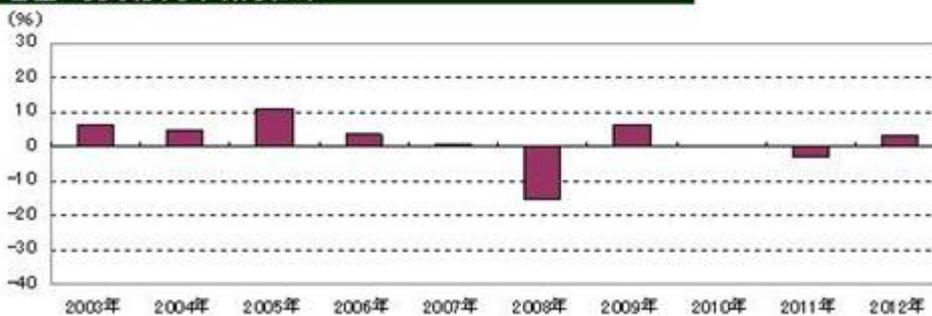
日立バランスファンド(株式70)



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)



※ 2012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行いません。）。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、
- (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。）

平成24年11月26日（月）から代表電話が03 - 4554 - 5100に変更となります。

（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いません。

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」といいます。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」といいます。）に基づいて作成しております。
2. 財務諸表に記載している金額については、円単位で表示しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間（平成23年5月17日から平成24年5月15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10期 (平成23年5月16日現在)	第11期 (平成24年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,725,238	112,355,922
親投資信託受益証券	9,879,455,804	10,097,196,316
未収入金	3,800,000	13,700,000
未収利息	168	153
流動資産合計	10,005,981,210	10,223,252,391
資産合計	10,005,981,210	10,223,252,391
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,556,040	4,842,905
未払受託者報酬	2,600,201	2,644,960
未払委託者報酬	14,041,020	14,282,701
流動負債合計	24,197,261	21,770,566
負債合計	24,197,261	21,770,566
純資産の部		
元本等		
元本	9,191,568,056	9,815,285,943
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	790,215,893	386,195,882
元本等合計	9,981,783,949	10,201,481,825
純資産合計	9,981,783,949	10,201,481,825
負債純資産合計	10,005,981,210	10,223,252,391

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第10期計算期間 自 平成22年 5月18日 至 平成23年 5月16日	第11期計算期間 自 平成23年 5月17日 至 平成24年 5月15日
営業収益		
受取利息	46,288	47,544
有価証券売買等損益	10,118,800	414,159,488
営業収益合計	10,165,088	414,111,944
営業費用		
受託者報酬	5,037,488	5,237,381
委託者報酬	27,202,290	28,281,706
営業費用合計	32,239,778	33,519,087
営業利益又は営業損失（ ）	22,074,690	447,631,031
経常利益又は経常損失（ ）	22,074,690	447,631,031
当期純利益又は当期純損失（ ）	22,074,690	447,631,031
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（ ）	11,775,380	32,055,776
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	763,827,151	790,215,893
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,489,691	77,773,586
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	100,489,691	77,773,586
剰余金減少額又は欠損金増加額	63,801,639	66,218,342
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	63,801,639	66,218,342
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	790,215,893	386,195,882

(3)【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 追加情報	第11期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	9,191,568,056口	9,815,285,943口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0860円 (10,860円)	1.0393円 (10,393円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第10期計算期間 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日	第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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る場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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 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>

関連当事者との取引に関する注記

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
期首元本額	8,461,774,880円	9,191,568,056円
期中追加設定元本額	1,463,693,183円	1,417,633,235円
期中一部解約元本額	733,900,007円	793,915,348円

（有価証券関係）
 売買目的有価証券

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15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	1,176,949円	389,701,273円
合計	1,176,949円	389,701,273円

（デリバティブ取引関係）
 該当事項はありません。

（4）【附属明細表】（平成24年5月15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	1,696,162,161	2,112,230,739	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	5,801,553,630	3,944,476,313	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	715,737,654	1,020,570,320	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	3,441,895,310	3,019,918,944	
親投資信託 受益証券計	銘柄数：4	11,655,348,755	10,097,196,316	
	組入時価比率：99.0%		100.0%	
合計			10,097,196,316	

(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10期 (平成23年5月16日現在)	第11期 (平成24年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	151,306,225	132,809,791
親投資信託受益証券	12,685,322,413	13,239,016,963
未収入金	2,000,000	29,000,000
未収利息	207	181
流動資産合計	12,838,628,845	13,400,826,935
資産合計	12,838,628,845	13,400,826,935
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,121,365	6,051,294
未払受託者報酬	3,321,929	3,456,250
未払委託者報酬	15,945,195	16,589,927
流動負債合計	23,388,489	26,097,471
負債合計	23,388,489	26,097,471
純資産の部		
元本等		
元本	11,447,799,967	12,207,701,086
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,367,440,389	1,167,028,378
元本等合計	12,815,240,356	13,374,729,464
純資産合計	12,815,240,356	13,374,729,464
負債純資産合計	12,838,628,845	13,400,826,935

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第10期計算期間 自 平成22年 5月18日 至 平成23年 5月16日	第11期計算期間 自 平成23年 5月17日 至 平成24年 5月15日
営業収益		
受取利息	58,117	60,881
有価証券売買等損益	54,411,059	247,375,450
営業収益合計	54,469,176	247,314,569
営業費用		
受託者報酬	6,502,858	6,862,028
委託者報酬	31,213,572	32,937,585
営業費用合計	37,716,430	39,799,613
営業利益又は営業損失（ ）	16,752,746	287,114,182
経常利益又は経常損失（ ）	16,752,746	287,114,182
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,752,746	287,114,182
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（ ）	5,940,011	22,173,158
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,264,028,826	1,367,440,389
剰余金増加額又は欠損金減少額	156,779,272	152,093,184
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	156,779,272	152,093,184
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,060,466	87,564,171
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,060,466	87,564,171
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,367,440,389	1,167,028,378

(3)【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 追加情報	第11期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	11,447,799,967口	12,207,701,086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)	1.0956円 (10,956円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第10期計算期間 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日	第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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事項)

第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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る場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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 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>

関連当事者との取引に関する注記
該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記
該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
期首元本額	10,579,431,901円	11,447,799,967円
期中追加設定元本額	1,516,114,802円	1,501,118,637円
期中一部解約元本額	647,746,736円	741,217,518円

（有価証券関係）
売買目的有価証券

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15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	42,379,977円	240,053,011円
合計	42,379,977円	240,053,011円

（デリバティブ取引関係）
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】（平成24年5月15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	4,436,941,512	5,525,323,264	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	5,652,891,578	3,843,400,983	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	930,281,475	1,326,488,355	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	2,899,252,749	2,543,804,361	
親投資信託 受益証券計	銘柄数：4	13,919,367,314	13,239,016,963	
	組入時価比率：99.0%		100.0%	
合計			13,239,016,963	

(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10期 (平成23年5月16日現在)	第11期 (平成24年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	60,241,223	54,732,374
親投資信託受益証券	4,967,932,046	5,235,454,738
未収入金	-	13,100,000
未収利息	82	74
流動資産合計	5,028,173,351	5,303,287,186
資産合計	5,028,173,351	5,303,287,186
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,851,053	7,432,716
未払受託者報酬	1,289,065	1,362,533
未払委託者報酬	5,414,024	5,722,602
流動負債合計	9,554,142	14,517,851
負債合計	9,554,142	14,517,851
純資産の部		
元本等		
元本	4,413,400,829	4,659,769,080
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	605,218,380	629,000,255
元本等合計	5,018,619,209	5,288,769,335
純資産合計	5,018,619,209	5,288,769,335
負債純資産合計	5,028,173,351	5,303,287,186

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第10期計算期間	第11期計算期間
	自 平成22年 5月18日 至 平成23年 5月16日	自 平成23年 5月17日 至 平成24年 5月15日
営業収益		
受取利息	23,051	24,858
有価証券売買等損益	27,819,590	3,872,692
営業収益合計	27,842,641	3,897,550
営業費用		
受託者報酬	2,536,105	2,711,424
委託者報酬	10,651,525	11,387,871
営業費用合計	13,187,630	14,099,295
営業利益又は営業損失（ ）	14,655,011	10,201,745
経常利益又は経常損失（ ）	14,655,011	10,201,745
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,655,011	10,201,745
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（ ）	669,800	3,938,438
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	543,789,048	605,218,380
剰余金増加額又は欠損金減少額	84,194,614	88,452,870
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	84,194,614	88,452,870
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,090,093	58,407,688
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,090,093	58,407,688
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	605,218,380	629,000,255

(3)【注記表】

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 追加情報	第11期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	4,413,400,829口	4,659,769,080口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1371円 (11,371円)	1.1350円 (11,350円)

損益及び剰余金計算書に関する注記

区分	第10期計算期間 自平成22年5月18日 至平成23年5月16日	第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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る場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(金融商品の時価等に関する事項)

第11期計算期間 自平成23年5月17日 至平成24年5月15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 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>

関連当事者との取引に関する注記

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15日現在
期首元本額	4,041,863,602円	4,413,400,829円
期中追加設定元本額	656,838,408円	674,454,849円
期中一部解約元本額	285,301,181円	428,086,598円

（有価証券関係）
 売買目的有価証券

区分	第10期 平成23年5月16日現在	第11期 平成24年5月15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	22,721,829円	1,771,256円
合計	22,721,829円	1,771,256円

（デリバティブ取引関係）
 該当事項はありません。

（4）【附属明細表】（平成24年5月15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	2,602,652,805	3,241,083,538	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	1,457,764,925	991,134,372	
	日立外国債券インデックスマザーファンド	362,987,507	517,583,886	
	日立外国株式インデックスマザーファンド	553,513,725	485,652,942	
親投資信託 受益証券計	銘柄数:4	4,976,918,962	5,235,454,738	
	組入時価比率:99.0%		100.0%	
合計			5,235,454,738	

(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。

(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23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	248,528,255	224,673,114
株式	33,176,605,870	29,566,344,910
派生商品評価勘定	19,657,950	-
未収入金	1,896,736,781	-
未収配当金	402,555,938	401,004,292
未収利息	340	307
差入委託証拠金	48,412,000	92,160,000
流動資産合計	35,792,497,134	30,284,182,623
資産合計	35,792,497,134	30,284,182,623
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,579,980	85,572,290
未払金	11,262,550	8,570,200
未払解約金	3,800,000	1,700,000
流動負債合計	33,642,530	95,842,490
負債合計	33,642,530	95,842,490
純資産の部		
元本等		
元本	48,500,902,900	44,399,272,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,742,048,296	14,210,931,950
元本等合計	35,758,854,604	30,188,340,133
純資産合計	35,758,854,604	30,188,340,133
負債純資産合計	35,792,497,134	30,284,182,623

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。
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。
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。
4. 追加情報	当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	48,500,902,900口	44,399,272,083口
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	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は12,742,048,296円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は14,210,931,950円であります。
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7373円 (7,373円)	0.6799円 (6,799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23年5月17日 至平成24年5月15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>

（金融商品の時価等に関する事項）

自平成23年5月17日 至平成24年5月15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ぬ。</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>

関連当事者との取引に関する注記
該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
期首元本額	49,774,656,907円	48,500,902,900円
期中追加設定元本額	7,092,609,078円	9,141,573,562円
期中一部解約元本額	8,366,363,085円	13,243,204,379円
期末元本額	48,500,902,900円	44,399,272,083円
元本の内訳*		
日立バランスファンド(株式70)	5,332,646,834円	5,801,553,630円
日立バランスファンド(株式50)	5,076,356,352円	5,652,891,578円
日立バランスファンド(株式30)	1,312,768,600円	1,457,764,925円
日立国内株式TOPIXインデックスファンド	28,073,313,404円	21,709,610,776円
日立国内株式インデックスファンド	8,705,817,710円	9,777,451,174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23年5月16日現在	平成24年5月15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	1,574,024,821円	4,259,875,933円
合計	1,574,024,821円	4,259,875,933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23年5月17日 至平成24年5月15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。
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。
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。
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。
5. 取引に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(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

(平成24年5月15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)	706,360,000	-	620,840,000	89,640,000
合計		706,360,000	-	620,840,000	89,640,000

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)	706,360,000	-	620,840,000	89,640,000

(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24年5月15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	176.00	2,288,000	
		日本水産	37,400	237.00	8,863,800	
		マルハニチロホールディングス	64,000	125.00	8,000,000	
		サカタのタネ	4,800	1,086.00	5,212,800	
		ホクト	3,300	1,642.00	5,418,600	
		住石ホールディングス	9,500	73.00	693,500	
		日鉄鉱業	8,000	302.00	2,416,000	
		三井松島産業	21,000	132.00	2,772,000	
		国際石油開発帝石	395	462,000.00	182,490,000	
		日本海洋掘削	800	2,235.00	1,788,000	
		関東天然瓦斯開発	3,000	390.00	1,170,000	
		石油資源開発	4,600	3,105.00	14,283,000	
		ショーボンドホールディングス	2,900	1,930.00	5,597,000	
		ミライト・ホールディングス	9,200	533.00	4,903,600	
		ダイセキ環境ソリューション	3	131,500.00	394,500	
		間組	11,700	181.00	2,117,700	
		東急建設	11,530	164.00	1,890,920	
		コムシスホールディングス	15,800	795.00	12,561,000	
		ミサワホーム	3,100	951.00	2,948,100	
		高松コンストラクショングループ	2,400	1,274.00	3,057,600	
		東建コーポレーション	1,210	2,694.00	3,259,740	
		ヤマウラ	1,500	234.00	351,000	
		大成建設	164,000	188.00	30,832,000	
		大林組	97,000	316.00	30,652,000	
		清水建設	99,000	275.00	27,225,000	
		飛鳥建設	19,900	72.00	1,432,800	
		長谷工コーポレーション	203,000	51.00	10,353,000	
		松井建設	4,000	317.00	1,268,000	
		鹿島建設	152,000	211.00	32,072,000	
		不動テトラ	22,900	108.00	2,473,200	
		大末建設	12,000	43.00	516,000	
		鉄建建設	18,000	97.00	1,746,000	
		安藤建設	11,000	96.00	1,056,000	
		太平工業	6,000	379.00	2,274,000	
		西松建設	43,000	134.00	5,762,000	
		三井住友建設	20,800	54.00	1,123,200	
		大豊建設	8,000	90.00	720,000	
		前田建設工業	20,000	306.00	6,120,000	
		佐田建設	11,000	55.00	605,000	
		ナカノフドー建設	2,500	143.00	357,500	
		奥村組	31,000	261.00	8,091,000	
		大和小田急建設	1,500	182.00	273,000	
		東鉄工業	4,000	804.00	3,216,000	
		イチケン	4,000	130.00	520,000	
		浅沼組	10,000	54.00	540,000	
		戸田建設	35,000	235.00	8,225,000	
		熊谷組	23,000	72.00	1,656,000	
		青木あすなる建設	2,000	419.00	838,000	
		北野建設	7,000	165.00	1,155,000	
		植木組	4,000	143.00	572,000	
		三井ホーム	4,000	407.00	1,628,000	
		矢作建設工業	4,000	345.00	1,380,000	
		ピーエス三菱	2,000	309.00	618,000	
		大東建託	12,300	7,010.00	86,223,000	
		新日本建設	3,900	194.00	756,600	
		N I P P O	8,000	767.00	6,136,000	
		東亜道路工業	6,000	211.00	1,266,000	

前田道路	9,000	880.00	7,920,000
日本道路	10,000	275.00	2,750,000
東亜建設工業	28,000	118.00	3,304,000
若築建設	17,000	78.00	1,326,000
東洋建設	50,000	64.00	3,200,000
五洋建設	41,000	200.00	8,200,000
大林道路	4,000	207.00	828,000
世紀東急工業	8,000	49.00	392,000
福田組	5,000	245.00	1,225,000
住友林業	22,300	681.00	15,186,300
日本基礎技術	3,600	274.00	986,400
日成ビルド工業	10,000	119.00	1,190,000
エス・バイ・エル	17,000	144.00	2,448,000
巴コーポレーション	4,000	273.00	1,092,000
パナホーム	12,000	500.00	6,000,000
大和ハウス工業	81,000	993.00	80,433,000
ライト工業	6,800	339.00	2,305,200
積水ハウス	91,000	692.00	62,972,000
日特建設	8,000	83.00	664,000
北陸電気工事	2,000	215.00	430,000
ユアテック	4,000	310.00	1,240,000
西部電気工業	3,000	331.00	993,000
四電工	3,000	311.00	933,000
中電工	4,700	785.00	3,689,500
関電工	15,000	322.00	4,830,000
きんでん	22,000	550.00	12,100,000
東京エネシス	3,000	344.00	1,032,000
トーエネック	5,000	437.00	2,185,000
住友電設	2,200	552.00	1,214,400
日本電設工業	6,000	727.00	4,362,000
協和エクシオ	10,600	727.00	7,706,200
新日本空調	2,500	422.00	1,055,000
日本電話施設	5,000	247.00	1,235,000
九電工	6,000	441.00	2,646,000
三機工業	7,000	409.00	2,863,000
日揮	30,000	2,266.00	67,980,000
中外炉工業	10,000	232.00	2,320,000
ヤマト	3,000	297.00	891,000
太平電業	4,000	520.00	2,080,000
高砂熱学工業	9,300	621.00	5,775,300
三晃金属工業	4,000	225.00	900,000
朝日工業社	3,000	316.00	948,000
大気社	5,000	1,513.00	7,565,000
ダイダン	4,000	465.00	1,860,000
日比谷総合設備	4,000	828.00	3,312,000
東芝プラントシステム	5,000	853.00	4,265,000
東洋エンジニアリング	17,000	356.00	6,052,000
千代田化工建設	26,000	982.00	25,532,000
新興プランテック	6,700	600.00	4,020,000
日本製粉	20,000	345.00	6,900,000
日清製粉グループ本社	29,500	945.00	27,877,500
日東富士製粉	3,000	281.00	843,000
昭和産業	13,000	239.00	3,107,000
鳥越製粉	2,800	653.00	1,828,400
協同飼料	11,000	84.00	924,000
中部飼料	2,900	493.00	1,429,700
日本配合飼料	10,000	95.00	950,000
東洋精糖	5,000	85.00	425,000
日本甜菜製糖	18,000	160.00	2,880,000
三井製糖	11,000	235.00	2,585,000
森永製菓	32,000	177.00	5,664,000
中村屋	8,000	375.00	3,000,000
江崎グリコ	12,000	905.00	10,860,000
名糖産業	1,400	1,002.00	1,402,800

不二家	19,000	180.00	3,420,000
山崎製パン	24,000	1,117.00	26,808,000
第一屋製パン	4,000	75.00	300,000
モロゾフ	5,000	275.00	1,375,000
カルビー	2,300	4,465.00	10,269,500
森永乳業	27,000	299.00	8,073,000
ヤクルト本社	17,400	2,886.00	50,216,400
明治ホールディングス	9,600	3,510.00	33,696,000
雪印メグミルク	7,000	1,378.00	9,646,000
プリマハム	18,000	130.00	2,340,000
日本ハム	25,000	998.00	24,950,000
伊藤ハム	18,000	311.00	5,598,000
林兼産業	10,000	66.00	660,000
丸大食品	16,000	294.00	4,704,000
米久	2,900	831.00	2,409,900
S Foods	2,000	670.00	1,340,000
サッポロホールディングス	53,000	247.00	13,091,000
アサヒグループホールディングス	60,900	1,721.00	104,808,900
キリンホールディングス	130,000	914.00	118,820,000
宝ホールディングス	27,000	503.00	13,581,000
オエノンホールディングス	8,000	183.00	1,464,000
養命酒製造	2,000	725.00	1,450,000
三国コカ・コーラボトリング	3,400	700.00	2,380,000
コカ・コーラウエスト	11,000	1,377.00	15,147,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,600	1,007.00	3,625,200
ダイドードリンコ	1,500	3,250.00	4,875,000
伊藤園	9,000	1,377.00	12,393,000
キーコーヒー	2,800	1,424.00	3,987,200
ユニカフェ	700	363.00	254,100
ジャパンフーズ	400	830.00	332,000
日清オイリオグループ	12,000	317.00	3,804,000
不二製油	7,900	1,041.00	8,223,900
J・オイルミルズ	12,000	219.00	2,628,000
キッコーマン	27,000	951.00	25,677,000
味の素	86,000	1,087.00	93,482,000
キューピー	16,500	1,171.00	19,321,500
ハウス食品	11,500	1,313.00	15,099,500
カゴメ	12,500	1,556.00	19,450,000
焼津水産化学工業	1,500	705.00	1,057,500
アリアケジャパン	3,000	1,617.00	4,851,000
ニチレイ	36,000	351.00	12,636,000
東洋水産	14,000	2,022.00	28,308,000
日清食品ホールディングス	12,700	2,937.00	37,299,900
永谷園	3,000	875.00	2,625,000
フジッコ	3,000	968.00	2,904,000
ロック・フィールド	1,700	1,412.00	2,400,400
日本たばこ産業	720	415,000.00	298,800,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	600.00	600,000
わらべや日洋	1,800	1,233.00	2,219,400
なとり	1,500	843.00	1,264,500
ミヨシ油脂	10,000	95.00	950,000
片倉工業	3,800	705.00	2,679,000
グンゼ	23,000	206.00	4,738,000
東洋紡績	128,000	103.00	13,184,000
ユニチカ	68,000	41.00	2,788,000
富士紡ホールディングス	13,000	148.00	1,924,000
日清紡ホールディングス	19,000	672.00	12,768,000
倉敷紡績	31,000	139.00	4,309,000
シキボウ	20,000	90.00	1,800,000
日本毛織	10,000	569.00	5,690,000
大東紡織	5,000	58.00	290,000
トーア紡コーポレーション	14,000	51.00	714,000
ダイドーリミテッド	3,700	564.00	2,086,800
帝国繊維	3,000	591.00	1,773,000

帝人	124,000	245.00	30,380,000
東レ	220,000	565.00	124,300,000
サカイオーベックス	9,000	111.00	999,000
住江織物	8,000	139.00	1,112,000
日本フェルト	1,700	388.00	659,600
イチカワ	2,000	143.00	286,000
日本バイリーン	4,000	344.00	1,376,000
日東製網	4,000	128.00	512,000
芦森工業	7,000	93.00	651,000
アツギ	24,000	93.00	2,232,000
ダイニック	6,000	142.00	852,000
セーレン	7,600	587.00	4,461,200
東海染工	4,000	80.00	320,000
小松精練	5,000	369.00	1,845,000
ワコールホールディングス	18,000	854.00	15,372,000
ホギメディカル	1,900	3,485.00	6,621,500
レナウン	6,600	111.00	732,600
クラウディア	300	945.00	283,500
T S Iホールディングス	13,500	356.00	4,806,000
三陽商会	15,000	247.00	3,705,000
ナイガイ	8,000	43.00	344,000
オンワードホールディングス	19,000	564.00	10,716,000
ルック	5,000	293.00	1,465,000
ゴールドウイン	7,000	483.00	3,381,000
デサント	8,000	397.00	3,176,000
ヤマトインターナショナル	1,800	364.00	655,200
特種東海製紙	19,000	189.00	3,591,000
王子製紙	134,000	315.00	42,210,000
三菱製紙	43,000	71.00	3,053,000
北越紀州製紙	19,000	437.00	8,303,000
中越パルプ工業	12,000	137.00	1,644,000
巴川製紙所	5,000	151.00	755,000
大王製紙	13,000	407.00	5,291,000
日本製紙グループ本社	14,600	1,354.00	19,768,400
レンゴー	24,000	554.00	13,296,000
トーモク	10,000	235.00	2,350,000
ザ・バック	1,800	1,289.00	2,320,200
クラレ	48,200	1,075.00	51,815,000
旭化成	177,000	462.00	81,774,000
共和レザー	1,800	270.00	486,000
コープケミカル	5,000	89.00	445,000
昭和電工	189,000	170.00	32,130,000
住友化学	209,000	282.00	58,938,000
日本化成	6,000	112.00	672,000
住友精化	6,000	308.00	1,848,000
日産化学工業	23,100	704.00	16,262,400
ラサ工業	12,000	91.00	1,092,000
クレハ	20,000	350.00	7,000,000
テイカ	5,000	237.00	1,185,000
石原産業	51,000	70.00	3,570,000
片倉チッカリン	2,000	205.00	410,000
日本曹達	18,000	322.00	5,796,000
東ソー	81,000	204.00	16,524,000
トクヤマ	47,000	206.00	9,682,000
セントラル硝子	29,000	302.00	8,758,000
東亜合成	38,000	308.00	11,704,000
ダイソー	12,000	222.00	2,664,000
関東電化工業	7,000	221.00	1,547,000
電気化学工業	64,000	290.00	18,560,000
信越化学工業	54,400	4,145.00	225,488,000
日本カーバイド工業	10,000	110.00	1,100,000
堺化学工業	9,000	246.00	2,214,000
エア・ウォーター	25,000	955.00	23,875,000
大陽日酸	40,000	487.00	19,480,000

日本化学工業	12,000	115.00	1,380,000
日本パーカラライジング	7,000	1,150.00	8,050,000
高圧ガス工業	5,000	469.00	2,345,000
チタン工業	3,000	246.00	738,000
四国化成工業	4,000	420.00	1,680,000
戸田工業	4,000	414.00	1,656,000
ステラ ケミファ	1,400	1,621.00	2,269,400
保土谷化学工業	6,000	238.00	1,428,000
日本触媒	22,000	878.00	19,316,000
大日精化工業	11,000	327.00	3,597,000
カネカ	38,000	459.00	17,442,000
三菱瓦斯化学	52,000	517.00	26,884,000
三井化学	129,000	207.00	26,703,000
J S R	27,600	1,488.00	41,068,800
東京応化工業	5,500	1,760.00	9,680,000
大阪有機化学工業	1,900	361.00	685,900
三菱ケミカルホールディングス	189,500	368.00	69,736,000
日本合成化学工業	6,000	458.00	2,748,000
ダイセル	39,000	503.00	19,617,000
住友ベークライト	26,000	420.00	10,920,000
積水化学工業	63,000	717.00	45,171,000
日本ゼオン	28,000	654.00	18,312,000
アイカ工業	7,900	1,166.00	9,211,400
宇部興産	127,000	200.00	25,400,000
積水樹脂	4,000	792.00	3,168,000
タキロン	7,000	262.00	1,834,000
旭有機材工業	11,000	194.00	2,134,000
日立化成工業	13,100	1,336.00	17,501,600
ニチバン	3,000	245.00	735,000
リケンテクノス	5,000	215.00	1,075,000
大倉工業	7,000	207.00	1,449,000
積水化成品工業	8,000	256.00	2,048,000
群栄化学工業	8,000	199.00	1,592,000
タイガースポリマー	1,500	315.00	472,500
日本カーリット	2,400	398.00	955,200

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		日本化薬	21,000	756.00	15,876,000	
		日本精化	2,500	503.00	1,257,500	
		A D E K A	13,100	685.00	8,973,500	
		日油	24,000	369.00	8,856,000	
		ハリマ化成	2,600	421.00	1,094,600	
		花王	80,500	2,107.00	169,613,500	
		第一工業製薬	5,000	213.00	1,065,000	
		三洋化成工業	10,000	485.00	4,850,000	
		大日本塗料	17,000	80.00	1,360,000	
		日本ペイント	29,000	622.00	18,038,000	
		関西ペイント	34,000	809.00	27,506,000	
		トウベ	3,000	70.00	210,000	
		中国塗料	9,000	399.00	3,591,000	
		日本特殊塗料	2,300	306.00	703,800	
		藤倉化成	3,800	400.00	1,520,000	
		太陽ホールディングス	2,500	1,993.00	4,982,500	
		D I C	116,000	155.00	17,980,000	
		サカタインクス	6,000	380.00	2,280,000	
		東洋インキS Cホールディングス	27,000	286.00	7,722,000	
		富士フイルムホールディングス	64,800	1,592.00	103,161,600	
		資生堂	50,400	1,290.00	65,016,000	
		ライオン	35,000	448.00	15,680,000	
		高砂香料工業	10,000	377.00	3,770,000	
		マンダム	3,000	2,088.00	6,264,000	
		ミルボン	1,600	2,296.00	3,673,600	
		ファンケル	7,600	991.00	7,531,600	
		コーセー	4,900	1,779.00	8,717,100	
		ドクターシーラボ	21	323,500.00	6,793,500	
		ポーラ・オルビスホールディングス	3,100	2,291.00	7,102,100	
		エステー	1,900	919.00	1,746,100	
		コニシ	2,200	1,048.00	2,305,600	
		長谷川香料	3,800	1,066.00	4,050,800	
		星光P M C	1,200	297.00	356,400	
		小林製薬	4,200	4,290.00	18,018,000	
		荒川化学工業	2,400	650.00	1,560,000	
		メック	2,200	262.00	576,400	
		日本高純度化学	9	198,400.00	1,785,600	
		荏原ユーザライト	400	2,285.00	914,000	
		アース製薬	2,200	2,859.00	6,289,800	
		イハラケミカル工業	5,000	298.00	1,490,000	
		北興化学工業	3,000	222.00	666,000	
		大成ラミック	900	2,395.00	2,155,500	
		クミアイ化学工業	7,000	318.00	2,226,000	
		日本農薬	7,000	322.00	2,254,000	
		アキレス	25,000	100.00	2,500,000	
		有沢製作所	5,000	256.00	1,280,000	
		日東電工	25,000	3,105.00	77,625,000	
		レック	900	988.00	889,200	
		きもと	2,500	417.00	1,042,500	
		藤森工業	2,200	1,412.00	3,106,400	
		前澤化成工業	2,100	764.00	1,604,400	
		J S P	2,000	1,043.00	2,086,000	
		エフビコ	1,300	4,905.00	6,376,500	
		天馬	2,400	809.00	1,941,600	
		信越ポリマー	5,900	368.00	2,171,200	
		東リ	8,000	146.00	1,168,000	
		ニフコ	6,800	1,976.00	13,436,800	
		日本バルカー工業	12,000	208.00	2,496,000	
		ユニ・チャーム	16,800	4,470.00	75,096,000	
		協和発酵キリン	41,000	821.00	33,661,000	
		武田薬品工業	113,700	3,315.00	376,915,500	

アステラス製薬	67,400	3,190.00	215,006,000
大日本住友製薬	21,500	781.00	16,791,500
塩野義製薬	47,400	998.00	47,305,200
田辺三菱製薬	30,300	1,103.00	33,420,900
わかもと製薬	3,000	198.00	594,000
あすか製薬	4,000	454.00	1,816,000
日本新薬	6,000	926.00	5,556,000
中外製薬	35,300	1,441.00	50,867,300
科研製薬	12,000	981.00	11,772,000
エーザイ	37,400	3,205.00	119,867,000
ロート製薬	13,000	945.00	12,285,000
小野薬品工業	14,800	4,390.00	64,972,000
久光製薬	9,400	3,525.00	33,135,000
有機合成薬品工業	2,000	189.00	378,000
持田製薬	10,000	906.00	9,060,000
参天製薬	10,200	2,982.00	30,416,400
扶桑薬品工業	10,000	212.00	2,120,000
日本ケミファ	5,000	419.00	2,095,000
ツムラ	8,300	1,974.00	16,384,200
日医工	5,100	1,561.00	7,961,100
キッセイ薬品工業	5,600	1,389.00	7,778,400
生化学工業	5,800	803.00	4,657,400
栄研化学	2,400	1,071.00	2,570,400
日水製薬	1,200	721.00	865,200
鳥居薬品	2,100	1,542.00	3,238,200
東和薬品	1,500	3,840.00	5,760,000
沢井製薬	2,000	8,250.00	16,500,000
ゼリア新薬工業	4,000	1,456.00	5,824,000
第一三共	102,100	1,306.00	133,342,600
キョーリン製薬ホールディングス	7,000	1,599.00	11,193,000
大幸薬品	1,400	715.00	1,001,000
ダイト	800	1,121.00	896,800
大塚ホールディングス	60,200	2,364.00	142,312,800
大正製薬ホールディングス	7,300	6,430.00	46,939,000
日本コークス工業	24,500	98.00	2,401,000
昭和シェル石油	27,100	458.00	12,411,800
コスモ石油	84,000	213.00	17,892,000
ニチレキ	4,000	353.00	1,412,000
東燃ゼネラル石油	46,000	723.00	33,258,000
ユシロ化学工業	1,600	764.00	1,222,400
ビービー・カストロール	1,200	330.00	396,000
AOCホールディングス	7,000	373.00	2,611,000
MORESCO	600	840.00	504,000
出光興産	3,600	7,390.00	26,604,000
JXホールディングス	336,800	419.00	141,119,200
横浜ゴム	37,000	558.00	20,646,000
東洋ゴム工業	23,000	247.00	5,681,000
ブリヂストン	95,100	1,754.00	166,805,400
住友ゴム工業	23,700	1,002.00	23,747,400
藤倉ゴム工業	1,900	275.00	522,500
オカモト	11,000	309.00	3,399,000
フコク	1,300	793.00	1,030,900
ニッタ	3,000	1,456.00	4,368,000
東海ゴム工業	5,600	806.00	4,513,600
三ツ星ベルト	8,000	382.00	3,056,000
バンドー化学	10,000	292.00	2,920,000
日東紡績	22,000	253.00	5,566,000
旭硝子	149,000	565.00	84,185,000
日本板硝子	130,000	93.00	12,090,000
石塚硝子	4,000	131.00	524,000
日本山村硝子	12,000	174.00	2,088,000
日本電気硝子	58,000	541.00	31,378,000
オハラ	1,100	836.00	919,600
住友大阪セメント	62,000	221.00	13,702,000

太平洋セメント	178,000	168.00	29,904,000
デイ・シイ	2,800	279.00	781,200
日本ヒューム	3,000	324.00	972,000
日本コンクリート工業	5,000	238.00	1,190,000
東海カーボン	26,000	373.00	9,698,000
日本カーボン	14,000	190.00	2,660,000
東洋炭素	1,500	2,546.00	3,819,000
ノリタケカンパニーリミテド	16,000	210.00	3,360,000
TOTO	47,000	548.00	25,756,000
日本碍子	39,000	891.00	34,749,000
日本特殊陶業	26,000	1,068.00	27,768,000
ダントーホールディングス	4,000	79.00	316,000
MARUWA	900	2,791.00	2,511,900
品川リフラクトリーズ	8,000	186.00	1,488,000
黒崎播磨	7,000	199.00	1,393,000
東京窯業	4,000	176.00	704,000
ニッカトー	1,100	466.00	512,600
フジミインコーポレーテッド	2,800	1,079.00	3,021,200
エーアンドエーマテリアル	6,000	72.00	432,000
ニチアス	14,000	381.00	5,334,000
ニチハ	3,400	947.00	3,219,800
新日本製鐵	796,000	181.00	144,076,000
住友金属工業	562,000	130.00	73,060,000
神戸製鋼所	420,000	100.00	42,000,000
日新製鋼	107,000	108.00	11,556,000
中山製鋼所	15,000	54.00	810,000
合同製鐵	17,000	160.00	2,720,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	71,900	1,287.00	92,535,300
東京製鐵	15,300	516.00	7,894,800
共英製鋼	3,200	1,355.00	4,336,000
大和工業	6,900	2,075.00	14,317,500
東京鐵鋼	6,000	219.00	1,314,000
大阪製鐵	1,900	1,285.00	2,441,500
淀川製鋼所	22,000	289.00	6,358,000
東洋鋼鈹	7,000	271.00	1,897,000
住友鋼管	1,800	673.00	1,211,400
丸一鋼管	9,300	1,701.00	15,819,300
モリ工業	5,000	249.00	1,245,000
大同特殊鋼	51,000	493.00	25,143,000
日本高周波鋼業	12,000	86.00	1,032,000
日本金属工業	23,000	60.00	1,380,000
日本冶金工業	22,500	105.00	2,362,500
山陽特殊製鋼	15,000	321.00	4,815,000
愛知製鋼	16,000	334.00	5,344,000
日立金属	20,000	927.00	18,540,000
日本金属	7,000	135.00	945,000
大平洋金属	21,000	349.00	7,329,000
日本電工	11,000	307.00	3,377,000
栗本鐵工所	14,000	165.00	2,310,000
旭テック	6,000	33.00	198,000
日本鑄鉄管	3,000	146.00	438,000
三菱製鋼	18,000	211.00	3,798,000
日亜鋼業	5,000	187.00	935,000
日本精線	2,000	354.00	708,000
シンニッタン	2,600	427.00	1,110,200
新家工業	7,000	108.00	756,000
日本軽金属	69,000	106.00	7,314,000
大紀アルミニウム工業所	5,000	239.00	1,195,000
三井金属鉱業	82,000	177.00	14,514,000
東邦亜鉛	17,000	303.00	5,151,000
三菱マテリアル	189,000	224.00	42,336,000
住友金属鉱山	78,000	949.00	74,022,000
DOWAホールディングス	36,000	485.00	17,460,000
古河機械金属	51,000	66.00	3,366,000

大阪チタニウムテクノロジーズ	3,000	2,374.00	7,122,000
東邦チタニウム	4,900	1,000.00	4,900,000
住友軽金属工業	73,000	81.00	5,913,000
古河スカイ	12,000	218.00	2,616,000
古河電気工業	95,000	174.00	16,530,000
住友電気工業	107,200	957.00	102,590,400
フジクラ	45,000	216.00	9,720,000
昭和電線ホールディングス	39,000	68.00	2,652,000
東京特殊電線	4,000	74.00	296,000
タツタ電線	6,000	433.00	2,598,000
日立電線	24,000	175.00	4,200,000
沖電線	3,000	141.00	423,000
カナレ電気	400	1,300.00	520,000
平河ヒューテック	600	729.00	437,400
リョービ	17,000	258.00	4,386,000
アサヒホールディングス	4,200	1,554.00	6,526,800
稲葉製作所	1,300	981.00	1,275,300
宮地エンジニアリンググループ	9,000	116.00	1,044,000
三協・立山ホールディングス	41,000	140.00	5,740,000
トーカロ	1,700	1,204.00	2,046,800
アルファC O	1,000	929.00	929,000
SUMCO	18,600	694.00	12,908,400
川田テクノロジーズ	700	1,070.00	749,000
東洋製罐	21,400	1,001.00	21,421,400
ホッカンホールディングス	7,000	230.00	1,610,000
コロナ	1,400	1,000.00	1,400,000
横河ブリッジホールディングス	6,000	485.00	2,910,000
日本橋梁	1,100	252.00	277,200
駒井ハルテック	6,000	218.00	1,308,000
高田機工	3,000	165.00	495,000
三和ホールディングス	30,000	315.00	9,450,000
文化シャッター	8,000	305.00	2,440,000
東洋シャッター	900	389.00	350,100
住生活グループ	39,400	1,464.00	57,681,600
日本フィルコン	2,200	381.00	838,200
ノーリツ	5,900	1,335.00	7,876,500
長府製作所	2,900	1,781.00	5,164,900
リンナイ	4,900	5,500.00	26,950,000
ダイニチ工業	1,500	659.00	988,500
日東精工	4,000	220.00	880,000
三洋工業	4,000	149.00	596,000
岡部	6,000	485.00	2,910,000
中国工業	5,000	85.00	425,000
東プレ	5,800	675.00	3,915,000
高周波熱錬	4,000	642.00	2,568,000
東京製綱	19,000	130.00	2,470,000
パイオラックス	1,300	1,833.00	2,382,900
日本発條	22,000	868.00	19,096,000
中央発條	4,000	267.00	1,068,000
アドバネクス	6,000	72.00	432,000
三益半導体工業	2,600	676.00	1,757,600
アタカ大機	2,000	239.00	478,000
日本製鋼所	47,000	448.00	21,056,000
日立ツール	1,700	759.00	1,290,300
三浦工業	4,500	1,992.00	8,964,000
タクマ	10,000	317.00	3,170,000
ツガミ	8,000	738.00	5,904,000
オークマ	18,000	556.00	10,008,000
東芝機械	17,000	410.00	6,970,000
アマダ	43,000	502.00	21,586,000
アイダエンジニアリング	7,800	428.00	3,338,400
牧野フライス製作所	15,000	482.00	7,230,000
オーエスジー	13,400	1,149.00	15,396,600
ダイジェット工業	4,000	152.00	608,000

旭ダイヤモンド工業	7,500	770.00	5,775,000
森精機製作所	16,000	708.00	11,328,000
ディスコ	3,100	4,900.00	15,190,000
日東工器	1,800	1,761.00	3,169,800
豊和工業	16,000	71.00	1,136,000
大阪機工	12,000	96.00	1,152,000
東洋機械金属	2,200	212.00	466,400
津田駒工業	7,000	145.00	1,015,000
エンシュウ	7,000	72.00	504,000
島精機製作所	4,000	1,298.00	5,192,000
日阪製作所	4,000	842.00	3,368,000
やまびこ	1,200	1,069.00	1,282,800
ペガサスミシン製造	2,800	166.00	464,800
ナプテスコ	12,600	1,754.00	22,100,400
三井海洋開発	2,500	1,557.00	3,892,500
レオン自動機	3,000	179.00	537,000
S M C	9,100	13,190.00	120,029,000
新川	2,300	366.00	841,800
ホソカワミクロン	5,000	444.00	2,220,000
ユニオンツール	1,700	1,321.00	2,245,700
オイレス工業	3,200	1,634.00	5,228,800
サトーホールディングス	3,200	1,124.00	3,596,800
日本エアーテック	900	370.00	333,000
日精樹脂工業	2,400	333.00	799,200
ワイエイシイ	1,200	580.00	696,000
小松製作所	141,500	2,010.00	284,415,000
住友重機械工業	77,000	367.00	28,259,000
日立建機	15,500	1,566.00	24,273,000
日工	4,000	275.00	1,100,000
巴工業	1,100	1,697.00	1,866,700
井関農機	31,000	178.00	5,518,000
T O W A	2,700	426.00	1,150,200
丸山製作所	7,000	143.00	1,001,000
北川鉄工所	14,000	126.00	1,764,000
クボタ	139,000	714.00	99,246,000

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		荏原実業	700	1,224.00	856,800	
		三菱化工機	9,000	135.00	1,215,000	
		月島機械	5,000	622.00	3,110,000	
		帝国電機製作所	1,000	1,386.00	1,386,000	
		東京機械製作所	10,000	47.00	470,000	
		新東工業	6,600	797.00	5,260,200	
		澁谷工業	1,900	919.00	1,746,100	
		アイチ コーポレーション	5,000	319.00	1,595,000	
		小森コーポレーション	8,600	648.00	5,572,800	
		鶴見製作所	2,000	635.00	1,270,000	
		住友精密工業	4,000	333.00	1,332,000	
		酒井重工業	6,000	266.00	1,596,000	
		荏原製作所	49,000	319.00	15,631,000	
		石井鐵工所	4,000	150.00	600,000	
		西島製作所	3,500	815.00	2,852,500	
		ダイキン工業	36,900	2,050.00	75,645,000	
		オルガノ	6,000	491.00	2,946,000	
		トーヨーカネツ	16,000	164.00	2,624,000	
		栗田工業	16,700	1,790.00	29,893,000	
		椿本チエイン	15,000	453.00	6,795,000	
		大同工業	6,000	147.00	882,000	
		日本コンベヤ	9,000	72.00	648,000	
		木村化工機	2,800	284.00	795,200	
		アネスト岩田	5,000	375.00	1,875,000	
		ダイフク	13,500	429.00	5,791,500	
		加藤製作所	7,000	347.00	2,429,000	
		油研工業	5,000	152.00	760,000	
		タダノ	14,000	564.00	7,896,000	
		フジテック	8,000	513.00	4,104,000	
		シーケーディ	8,100	582.00	4,714,200	
		キトー	12	60,300.00	723,600	
		平和	6,300	1,527.00	9,620,100	
		理想科学工業	2,100	1,150.00	2,415,000	
		SANKYO	8,800	3,885.00	34,188,000	
		日本金銭機械	2,700	637.00	1,719,900	
		マースエンジニアリング	1,600	1,547.00	2,475,200	
		福島工業	800	1,045.00	836,000	
		オーイズミ	1,000	211.00	211,000	
		ダイコク電機	1,300	1,236.00	1,606,800	
		アマノ	8,800	655.00	5,764,000	
		JUKI	17,000	133.00	2,261,000	
		サンデン	15,000	285.00	4,275,000	
		蛇の目ミシン工業	28,000	62.00	1,736,000	
		マックス	5,000	957.00	4,785,000	
		グローリー	8,600	1,582.00	13,605,200	
		大和冷機工業	4,000	405.00	1,620,000	
		セガサミーホールディングス	31,100	1,477.00	45,934,700	
		日本ピストンリング	11,000	160.00	1,760,000	
		リケン	11,000	321.00	3,531,000	
		T P R	3,200	1,179.00	3,772,800	
		ホシザキ電機	5,800	1,872.00	10,857,600	
		大豊工業	2,000	893.00	1,786,000	
		日本精工	64,000	510.00	32,640,000	
		N T N	67,000	275.00	18,425,000	
		ジェイテクト	27,700	785.00	21,744,500	
		不二越	29,000	359.00	10,411,000	
		日本トムソン	9,000	405.00	3,645,000	
		T H K	19,300	1,511.00	29,162,300	
		ユーシン精機	1,400	1,675.00	2,345,000	
		前澤給装工業	1,100	1,047.00	1,151,700	
		イーグル工業	4,000	787.00	3,148,000	

前澤工業	2,100	205.00	430,500
日本ビラー工業	3,000	643.00	1,929,000
キッツ	11,900	312.00	3,712,800
日立工機	7,800	664.00	5,179,200
マキタ	18,900	2,945.00	55,660,500
日立造船	114,500	97.00	11,106,500
三菱重工業	486,000	328.00	159,408,000
I H I	198,000	167.00	33,066,000
イビデン	19,000	1,473.00	27,987,000
コニカミノルタホールディングス	76,500	620.00	47,430,000
ブラザー工業	37,500	933.00	34,987,500
ミネベア	43,000	332.00	14,276,000
日立製作所	668,000	480.00	320,640,000
東芝	610,000	309.00	188,490,000
三菱電機	290,000	625.00	181,250,000
富士電機	87,000	194.00	16,878,000
東洋電機製造	6,000	261.00	1,566,000
安川電機	34,000	633.00	21,522,000
シンフォニアテクノロジー	17,000	144.00	2,448,000
明電舎	29,000	267.00	7,743,000
オリジン電気	4,000	329.00	1,316,000
デンヨー	2,600	988.00	2,568,800
東芝テック	18,000	297.00	5,346,000
芝浦メカトロニクス	5,000	177.00	885,000
マブチモーター	3,900	3,145.00	12,265,500
日本電産	15,700	6,400.00	100,480,000
高岳製作所	11,000	159.00	1,749,000
ダイヘン	17,000	241.00	4,097,000
ヤーマン	200	1,084.00	216,800
JVCケンウッド	17,500	276.00	4,830,000
第一精工	900	1,658.00	1,492,200
日新電機	6,000	431.00	2,586,000
大崎電気工業	4,000	770.00	3,080,000
オムロン	32,300	1,677.00	54,167,100
日東工業	4,300	1,104.00	4,747,200
I D E C	3,800	714.00	2,713,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	56,000	359.00	20,104,000
サクサホールディングス	7,000	143.00	1,001,000
メルコホールディングス	1,600	1,746.00	2,793,600
テクノメディカ	2	354,500.00	709,000
日本電気	398,000	120.00	47,760,000
富士通	279,000	377.00	105,183,000
沖電気工業	112,000	110.00	12,320,000
岩崎通信機	13,000	66.00	858,000
電気興業	9,000	340.00	3,060,000
サンケン電気	15,000	319.00	4,785,000
ナカヨ通信機	3,000	279.00	837,000
アイホン	1,700	1,489.00	2,531,300
ルネサスエレクトロニクス	7,500	316.00	2,370,000
セイコーエプソン	19,800	885.00	17,523,000
ワコム	57	172,200.00	9,815,400
アルバック	5,800	472.00	2,737,600
アクセル	1,300	1,510.00	1,963,000
ピクセラ	1,200	152.00	182,400
ナナオ	2,500	1,593.00	3,982,500
日本信号	6,700	481.00	3,222,700
京三製作所	6,000	312.00	1,872,000
能美防災	4,000	491.00	1,964,000
ホーチキ	3,000	365.00	1,095,000
日本無線	6,000	157.00	942,000
パナソニック	331,100	560.00	185,416,000
シャープ	140,000	379.00	53,060,000
アンリツ	15,000	895.00	13,425,000
富士通ゼネラル	7,000	654.00	4,578,000

日立国際電気	7,000	728.00	5,096,000
ソニー	180,800	1,128.00	203,942,400
T D K	15,200	3,725.00	56,620,000
帝国通信工業	7,000	122.00	854,000
ミツミ電機	10,200	574.00	5,854,800
タムラ製作所	10,000	199.00	1,990,000
アルプス電気	22,900	633.00	14,495,700
池上通信機	9,000	53.00	477,000
パイオニア	41,100	342.00	14,056,200
日本電波工業	2,200	945.00	2,079,000
日本トリム	350	1,880.00	658,000
ローランド ディー . ジー .	1,300	836.00	1,086,800
フォスター電機	2,700	1,251.00	3,377,700
クラリオン	18,000	178.00	3,204,000
S M K	9,000	250.00	2,250,000
ヨコオ	2,300	435.00	1,000,500
東光	13,000	220.00	2,860,000
ティアック	16,000	27.00	432,000
ホシデン	7,900	505.00	3,989,500
ヒロセ電機	5,000	7,680.00	38,400,000
日本航空電子工業	7,000	657.00	4,599,000
T O A	3,000	604.00	1,812,000
ユニデン	9,000	246.00	2,214,000
アルパイン	5,700	900.00	5,130,000
スミダコーポレーション	1,800	404.00	727,200
アイコム	1,600	1,751.00	2,801,600
リオン	600	571.00	342,600
船井電機	2,600	1,300.00	3,380,000
横河電機	31,400	729.00	22,890,600
新電元工業	10,000	299.00	2,990,000
アズビル	7,400	1,595.00	11,803,000
日本光電工業	5,800	2,248.00	13,038,400
チノー	5,000	202.00	1,010,000
共和電業	3,000	246.00	738,000
日本電子材料	1,100	359.00	394,900
堀場製作所	5,400	2,755.00	14,877,000
アドバンテスト	21,500	1,294.00	27,821,000
小野測器	3,000	295.00	885,000
エスベック	3,000	677.00	2,031,000
パナソニック電工 S U N X	2,500	366.00	915,000
キーエンス	7,100	17,910.00	127,161,000
日置電機	1,400	1,409.00	1,972,600
シスメックス	10,200	3,030.00	30,906,000
メガチップス	2,400	1,684.00	4,041,600
O B A R A G R O U P	2,100	900.00	1,890,000
日本電産コパル電子	3,000	421.00	1,263,000
ミヤチテクノス	1,300	556.00	722,800
東京電波	800	344.00	275,200
澤藤電機	2,000	220.00	440,000
コーセル	4,200	1,104.00	4,636,800
日立メディコ	2,000	1,106.00	2,212,000
新日本無線	2,000	196.00	392,000
オプテックス	2,000	979.00	1,958,000
千代田インテグレ	1,400	949.00	1,328,600
東光電気	2,000	296.00	592,000
スタンレー電気	19,400	1,202.00	23,318,800
岩崎電気	11,000	139.00	1,529,000
ウシオ電機	17,600	958.00	16,860,800
岡谷電機産業	1,500	298.00	447,000
ヘリオス テクノ ホールディング	2,500	142.00	355,000
日本セラミック	1,900	1,225.00	2,327,500
日本デジタル研究所	2,400	834.00	2,001,600
古河電池	2,000	433.00	866,000
双信電機	1,400	319.00	446,600

山一電機	2,900	172.00	498,800
図研	1,900	560.00	1,064,000
日本電子	11,000	206.00	2,266,000
カシオ計算機	27,600	472.00	13,027,200
ファナック	30,200	13,390.00	404,378,000
日本シイエムケイ	6,200	314.00	1,946,800
エンブラス	1,500	1,950.00	2,925,000
ローム	14,300	3,280.00	46,904,000
浜松ホトニクス	11,300	2,935.00	33,165,500
三井ハイテック	3,800	415.00	1,577,000
新光電気工業	9,700	680.00	6,596,000
京セラ	24,100	7,290.00	175,689,000
太陽誘電	13,000	787.00	10,231,000
村田製作所	30,400	4,295.00	130,568,000
ユーシン	4,000	530.00	2,120,000
双葉電子工業	5,000	1,185.00	5,925,000
北陸電気工業	12,000	91.00	1,092,000
ニチコン	9,100	793.00	7,216,300
日本ケミコン	17,000	243.00	4,131,000
K O A	3,600	704.00	2,534,400
市光工業	7,000	135.00	945,000
小糸製作所	14,000	1,101.00	15,414,000
ミツバ	5,000	562.00	2,810,000
スター精密	4,700	795.00	3,736,500
大日本スクリーン製造	27,000	656.00	17,712,000
キヤノン電子	2,700	1,851.00	4,997,700
キヤノン	180,000	3,410.00	613,800,000
リコー	87,000	628.00	54,636,000
日本電産サンキョー	7,000	439.00	3,073,000
M U T O Hホールディングス	3,000	216.00	648,000
東京エレクトロン	24,400	4,055.00	98,942,000
トヨタ紡織	10,100	956.00	9,655,600
鬼怒川ゴム工業	7,000	512.00	3,584,000
ユニプレス	4,600	2,285.00	10,511,000
豊田自動織機	26,400	2,211.00	58,370,400
モリタホールディングス	5,000	523.00	2,615,000
三櫻工業	3,700	634.00	2,345,800
デンソー	71,600	2,534.00	181,434,400
東海理化電機製作所	6,800	1,363.00	9,268,400

[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	三井造船	112,000	108.00	12,096,000	
		佐世保重工業	19,000	107.00	2,033,000	
		川崎重工業	211,000	209.00	44,099,000	
		日本車輛製造	11,000	276.00	3,036,000	
		日本輸送機	4,000	242.00	968,000	
		近畿車輛	4,000	260.00	1,040,000	
		日産自動車	368,700	769.00	283,530,300	
		いすゞ自動車	183,000	440.00	80,520,000	
		トヨタ自動車	375,800	3,165.00	1,189,407,000	
		日野自動車	41,000	544.00	22,304,000	
		三菱自動車工業	648,000	79.00	51,192,000	
		エフテック	1,000	1,271.00	1,271,000	
		武蔵精密工業	2,800	1,723.00	4,824,400	
		日産車体	8,000	793.00	6,344,000	
		新明和工業	13,000	343.00	4,459,000	
		極東開発工業	5,000	671.00	3,355,000	
		日信工業	5,300	1,192.00	6,317,600	
		トピー工業	22,000	222.00	4,884,000	
		ティラド	11,000	271.00	2,981,000	
		曙ブレーキ工業	14,700	354.00	5,203,800	
		タチエス	3,800	1,394.00	5,297,200	
		NOK	14,000	1,614.00	22,596,000	
		フタバ産業	8,200	374.00	3,066,800	
		カヤバ工業	20,000	398.00	7,960,000	
		シロキ工業	6,000	220.00	1,320,000	
		大同メタル工業	4,000	880.00	3,520,000	
		プレス工業	13,000	420.00	5,460,000	
		カルソニックカンセイ	17,000	482.00	8,194,000	
		太平洋工業	6,000	478.00	2,868,000	
		ケーヒン	6,000	1,291.00	7,746,000	
		河西工業	4,000	449.00	1,796,000	
		アイシン精機	23,900	2,670.00	63,813,000	
		富士機工	3,000	249.00	747,000	
		マツダ	389,000	107.00	41,623,000	
		ダイハツ工業	27,000	1,432.00	38,664,000	
		今仙電機製作所	2,100	1,080.00	2,268,000	
		本田技研工業	244,500	2,655.00	649,147,500	
		スズキ	60,600	1,750.00	106,050,000	
		富士重工業	92,000	621.00	57,132,000	
		ヤマハ発動機	47,200	810.00	38,232,000	
		ショーワ	6,200	644.00	3,992,800	
		T B K	3,000	445.00	1,335,000	
		エクセディ	3,900	1,970.00	7,683,000	
		豊田合成	8,200	1,620.00	13,284,000	
		愛三工業	3,000	722.00	2,166,000	
		ヨロズ	1,700	1,388.00	2,359,600	
		エフ・シー・シー	4,700	1,560.00	7,332,000	
		シマノ	10,800	4,815.00	52,002,000	
		タカタ	5,200	1,726.00	8,975,200	
		テイ・エス テック	6,100	1,513.00	9,229,300	
日本電産トーソク	1,400	683.00	956,200			
テルモ	20,500	3,145.00	64,472,500			
クリエートメディック	900	800.00	720,000			
日機装	9,000	784.00	7,056,000			
島津製作所	35,000	674.00	23,590,000			
J M S	4,000	263.00	1,052,000			
クボテック	6	17,740.00	106,440			
モリテックス	600	258.00	154,800			
長野計器	2,000	640.00	1,280,000			
ブイ・テクノロジー	5	198,000.00	990,000			
東京計器	10,000	142.00	1,420,000			

愛知時計電機	3,000	285.00	855,000
東京精密	5,200	1,430.00	7,436,000
ニコン	50,500	2,401.00	121,250,500
トプコン	6,700	577.00	3,865,900
オリンパス	34,200	1,085.00	37,107,000
理研計器	2,300	524.00	1,205,200
タムロン	2,500	2,420.00	6,050,000
H O Y A	70,500	1,747.00	123,163,500
ノーリツ鋼機	2,600	380.00	988,000
エー・アンド・デイ	2,800	311.00	870,800
日本電産コバル	2,300	863.00	1,984,900
シチズンホールディングス	34,700	478.00	16,586,600
リズム時計工業	13,000	121.00	1,573,000
大研医器	400	859.00	343,600
松風	1,400	874.00	1,223,600
セイコーホールディングス	17,000	203.00	3,451,000
ニプロ	15,000	488.00	7,320,000
パラマウントベッドホールディングス	2,500	2,415.00	6,037,500
S H O - B I	600	457.00	274,200
永大産業	4,000	320.00	1,280,000
ダンロップスポーツ	1,800	926.00	1,666,800
バンダイナムコホールディングス	30,000	955.00	28,650,000
共立印刷	3,400	216.00	734,400
フランスベッドホールディングス	19,000	143.00	2,717,000
パイロットコーポレーション	25	149,600.00	3,740,000
トッパン・フォームズ	6,200	635.00	3,937,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,524.00	4,876,800
タカラトミー	9,500	531.00	5,044,500
廣済堂	2,500	326.00	815,000
アーク	9,800	73.00	715,400
タカノ	1,100	410.00	451,000
プロネクス	3,200	454.00	1,452,800
ホクシン	2,000	203.00	406,000
ウッドワン	5,000	255.00	1,275,000
大建工業	12,000	225.00	2,700,000
凸版印刷	88,000	491.00	43,208,000
大日本印刷	88,000	620.00	54,560,000
図書印刷	5,000	129.00	645,000
共同印刷	10,000	188.00	1,880,000
日本写真印刷	4,900	857.00	4,199,300
光村印刷	3,000	249.00	747,000
宝印刷	1,600	607.00	971,200
アシックス	27,000	787.00	21,249,000
ツツミ	1,400	2,291.00	3,207,400
ローランド	3,000	680.00	2,040,000
小松ウオール工業	1,100	973.00	1,070,300
ヤマハ	21,300	719.00	15,314,700
河合楽器製作所	11,000	172.00	1,892,000
クリナップ	3,400	487.00	1,655,800
ビジョン	2,600	3,115.00	8,099,000
兼松日産農林	4,000	129.00	516,000
キングジム	2,400	643.00	1,543,200
リンテック	5,500	1,409.00	7,749,500
T A S A K I	600	305.00	183,000
イトーキ	6,100	449.00	2,738,900
任天堂	16,600	9,470.00	157,202,000
三菱鉛筆	2,400	1,374.00	3,297,600
タカラスタンダード	13,000	572.00	7,436,000
コクヨ	15,100	566.00	8,546,600
ナカバヤシ	6,000	175.00	1,050,000
グローブライド	14,000	83.00	1,162,000
岡村製作所	10,000	549.00	5,490,000
美津濃	14,000	397.00	5,558,000
アデランス	3,600	818.00	2,944,800

東京電力	231,300	179.00	41,402,700
中部電力	95,500	1,239.00	118,324,500
関西電力	118,200	1,087.00	128,483,400
中国電力	40,100	1,307.00	52,410,700
北陸電力	28,400	1,251.00	35,528,400
東北電力	72,400	751.00	54,372,400
四国電力	26,100	1,964.00	51,260,400
九州電力	64,000	971.00	62,144,000
北海道電力	27,100	1,016.00	27,533,600
沖縄電力	1,700	2,962.00	5,035,400
電源開発	18,000	2,096.00	37,728,000
東京瓦斯	350,000	390.00	136,500,000
大阪瓦斯	281,000	320.00	89,920,000
東邦瓦斯	74,000	465.00	34,410,000
北海道瓦斯	5,000	250.00	1,250,000
西部瓦斯	33,000	198.00	6,534,000
静岡瓦斯	7,500	527.00	3,952,500
東武鉄道	165,000	396.00	65,340,000
相鉄ホールディングス	46,000	246.00	11,316,000
東京急行電鉄	171,000	354.00	60,534,000
京浜急行電鉄	74,000	670.00	49,580,000
小田急電鉄	93,000	731.00	67,983,000
京王電鉄	81,000	558.00	45,198,000
京成電鉄	47,000	632.00	29,704,000
富士急行	8,000	456.00	3,648,000
新京成電鉄	4,000	348.00	1,392,000
東日本旅客鉄道	50,400	4,880.00	245,952,000
西日本旅客鉄道	25,200	3,210.00	80,892,000
東海旅客鉄道	251	648,000.00	162,648,000
西日本鉄道	37,000	371.00	13,727,000
ハマキョウレックス	800	2,669.00	2,135,200
サカイ引越センター	500	1,628.00	814,000
近畿日本鉄道	262,000	275.00	72,050,000
阪急阪神ホールディングス	194,000	355.00	68,870,000
南海電気鉄道	60,000	330.00	19,800,000
京阪電気鉄道	65,000	362.00	23,530,000
名糖運輸	1,200	581.00	697,200
名古屋鉄道	101,000	210.00	21,210,000
日本通運	115,000	307.00	35,305,000
ヤマトホールディングス	59,000	1,223.00	72,157,000
山九	35,000	274.00	9,590,000
丸運	1,600	190.00	304,000
丸全昭和運輸	10,000	238.00	2,380,000
センコー	12,000	334.00	4,008,000
トナミホールディングス	6,000	166.00	996,000
日本梱包運輸倉庫	8,700	966.00	8,404,200
日本石油輸送	3,000	182.00	546,000
福山通運	18,000	417.00	7,506,000
セイノーホールディングス	22,000	515.00	11,330,000
神奈川中央交通	3,000	423.00	1,269,000
日立物流	6,000	1,446.00	8,676,000
日本郵船	230,000	197.00	45,310,000
商船三井	152,000	264.00	40,128,000
川崎汽船	90,000	130.00	11,700,000
N S ユナイテッド海運	12,000	107.00	1,284,000
乾汽船	3,200	249.00	796,800
明治海運	2,600	274.00	712,400
飯野海運	14,000	372.00	5,208,000
共栄タンカー	2,000	170.00	340,000
第一中央汽船	19,000	91.00	1,729,000
全日本空輸	386,000	215.00	82,990,000
パスコ	3,000	232.00	696,000
日新	11,000	201.00	2,211,000
三菱倉庫	21,000	794.00	16,674,000

三井倉庫	13,000	307.00	3,991,000
住友倉庫	21,000	351.00	7,371,000
澁澤倉庫	7,000	230.00	1,610,000
東陽倉庫	5,000	176.00	880,000
日本トランスシティ	6,000	269.00	1,614,000
ケイヒン	5,000	91.00	455,000
安田倉庫	2,300	478.00	1,099,400
東洋埠頭	8,000	128.00	1,024,000
宇徳	2,000	242.00	484,000
上組	32,000	625.00	20,000,000
サンリツ	800	497.00	397,600
キムラユニティー	700	711.00	497,700
キューソー流通システム	900	855.00	769,500
郵船ロジスティクス	2,300	1,056.00	2,428,800
近鉄エクスプレス	2,600	2,607.00	6,778,200
東海運	1,800	202.00	363,600
エーアイティー	200	1,099.00	219,800
N E C ネットエスアイ	2,700	1,239.00	3,345,300
システム	30	56,700.00	1,701,000
新日鉄ソリューションズ	1,900	1,580.00	3,002,000
コア	1,100	664.00	730,400
ソフトクリエイト	300	1,121.00	336,300
デジタルハーツ	3	154,000.00	462,000
I T ホールディングス	8,700	1,002.00	8,717,400
プライムワークス	6	54,100.00	324,600
グリー	14,700	1,409.00	20,712,300
コーエーテックモホールディングス	5,700	647.00	3,687,900
三菱総合研究所	1,100	1,670.00	1,837,000
ボルテージ	400	848.00	339,200
ネクソン	19,500	1,427.00	27,826,500
ドワンゴ	15	104,200.00	1,563,000
ベリサーブ	2	129,000.00	258,000
マクロミル	2,800	819.00	2,293,200
ティーガイア	18	139,300.00	2,507,400
GMO ペイメントゲートウェイ	5	264,900.00	1,324,500
ザッパラス	16	71,800.00	1,148,800
インターネットイニシアティブ	17	295,600.00	5,025,200
ソネットエンタテインメント	16	307,500.00	4,920,000
S R A ホールディングス	1,500	840.00	1,260,000
J B I S ホールディングス	1,800	308.00	554,400
朝日ネット	2,000	360.00	720,000
パナソニック電工インフォメーションシステム	700	1,921.00	1,344,700
フェイス	97	8,170.00	792,490
野村総合研究所	16,200	1,740.00	28,188,000
サイバネットシステム	23	19,430.00	446,890
インテージ	800	1,647.00	1,317,600
シンプレクス・ホールディングス	48	26,380.00	1,266,240
クレスコ	600	613.00	367,800
フジ・メディア・ホールディングス	298	130,800.00	38,978,400
オービック	900	15,940.00	14,346,000
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	600	726.00	435,600
ヤフー	2,094	23,620.00	49,460,280
トレンドマイクロ	12,600	2,290.00	28,854,000
日本オラクル	5,700	2,993.00	17,060,100
アルファシステムズ	900	1,130.00	1,017,000
フューチャーアーキテクト	34	32,500.00	1,105,000
シーエーシー	1,900	651.00	1,236,900
ソフトバンク・テクノロジー	700	757.00	529,900
トーセ	700	530.00	371,000
オービックビジネスコンサルタント	750	3,800.00	2,850,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,400	3,900.00	13,260,000
アイティフォー	3,200	281.00	899,200
東計電算	500	1,047.00	523,500
エクスネット	3	115,000.00	345,000

大塚商会	2,300	6,610.00	15,203,000
サイボウズ	52	22,550.00	1,172,600
ソフトブレーン	42	7,980.00	335,160
アグレックス	800	742.00	593,600
電通国際情報サービス	1,800	650.00	1,170,000
ウェザーニューズ	700	2,404.00	1,682,800
C I J	2,800	317.00	887,600
WOWOW	9	164,700.00	1,482,300
日本コロムビア	28,000	27.00	756,000
ネットワンシステムズ	12,900	1,101.00	14,202,900
アルゴグラフィックス	1,000	1,048.00	1,048,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	5,400	995.00	5,373,000
日本ユニシス	6,900	586.00	4,043,400
兼松エレクトロニクス	1,800	862.00	1,551,600
東京放送ホールディングス	17,100	955.00	16,330,500
日本テレビ放送網	2,510	11,660.00	29,266,600
テレビ朝日	72	110,800.00	7,977,600
スカパーJ S A Tホールディングス	217	32,450.00	7,041,650
テレビ東京ホールディングス	1,800	975.00	1,755,000
アイ・ティー・シーネットワーク	2,400	514.00	1,233,600
イー・アクセス	218	13,460.00	2,934,280
N E Cモバイリング	1,000	2,930.00	2,930,000
日本電信電話	131,700	3,615.00	476,095,500
K D D I	444	507,000.00	225,108,000
光通信	2,600	2,470.00	6,422,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,356	130,600.00	307,693,600
GMOインターネット	8,500	389.00	3,306,500
学研ホールディングス	9,000	161.00	1,449,000
ゼンリン	4,100	752.00	3,083,200
昭文社	1,600	551.00	881,600
角川グループホールディングス	2,700	2,027.00	5,472,900
インプレスホールディングス	2,400	100.00	240,000
アイネット	1,200	488.00	585,600
松竹	19,000	750.00	14,250,000
東宝	20,400	1,340.00	27,336,000

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		東映	12,000	362.00	4,344,000	
		葵プロモーション	1,500	499.00	748,500	
		エヌ・ティ・ティ・データ	177	239,100.00	42,320,700	
		D T S	3,000	996.00	2,988,000	
		スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,300	1,431.00	13,308,300	
		シーイーシー	1,700	396.00	673,200	
		カブコン	5,500	1,702.00	9,361,000	
		ジャステック	1,800	457.00	822,600	
		S C S K	5,800	1,190.00	6,902,000	
		日本システムウエア	900	299.00	269,100	
		アイネス	3,500	569.00	1,991,500	
		T K C	2,600	1,610.00	4,186,000	
		富士ソフト	3,800	1,343.00	5,103,400	
		N S D	5,200	641.00	3,333,200	
		コナミ	12,900	1,885.00	24,316,500	
		福井コンピュータ	400	402.00	160,800	
		J B C Cホールディングス	2,200	520.00	1,144,000	
		ソフトバンク	129,600	2,422.00	313,891,200	
		ハウスイ	2,000	98.00	196,000	
		インターニックス	1,200	342.00	410,400	
		高千穂交易	1,200	825.00	990,000	
		伊藤忠食品	700	2,882.00	2,017,400	
		エレマテック	1,900	1,041.00	1,977,900	
		J A L U X	800	803.00	642,400	
		あらた	6,000	373.00	2,238,000	
		トーメンデバイス	400	1,960.00	784,000	
		東京エレクトロン デバイス	6	139,500.00	837,000	
		双日	191,400	120.00	22,968,000	
		アルフレッサ ホールディングス	7,500	3,790.00	28,425,000	
		横浜冷凍	7,100	578.00	4,103,800	
		神栄	4,000	110.00	440,000	
		山下医科器械	200	1,039.00	207,800	
		ラサ商事	1,200	407.00	488,400	
		アルコニックス	700	1,662.00	1,163,400	
		あい ホールディングス	4,600	476.00	2,189,600	
		ダイワボウホールディングス	28,000	142.00	3,976,000	
		バイタルケーエスケー・ホールディングス	5,400	683.00	3,688,200	
		八洲電機	1,900	346.00	657,400	
		U K Cホールディングス	1,700	1,019.00	1,732,300	
		T O K A Iホールディングス	14,000	333.00	4,662,000	
		ミタチ産業	700	405.00	283,500	
		シップヘルスケアホールディングス	3,700	1,968.00	7,281,600	
		富士興産	10,000	59.00	590,000	
		協栄産業	3,000	135.00	405,000	
		小野建	2,500	615.00	1,537,500	
		佐島電機	2,100	466.00	978,600	
		エコートレーディング	700	707.00	494,900	
		伯東	1,700	737.00	1,252,900	
		コンドーテック	2,000	471.00	942,000	
		中山福	1,600	597.00	955,200	
		ナガイレーベン	3,800	1,202.00	4,567,600	
		三菱食品	2,600	1,904.00	4,950,400	
		松田産業	2,100	1,166.00	2,448,600	
		メディバルホールディングス	30,800	955.00	29,414,000	
		アドヴァン	1,700	773.00	1,314,100	
		S P K	700	1,350.00	945,000	
		アズワン	1,900	1,622.00	3,081,800	
		スズデン	900	485.00	436,500	
		尾家産業	900	780.00	702,000	
		シモジマ	1,700	963.00	1,637,100	
		ドウシシャ	1,300	2,168.00	2,818,400	

高速	1,700	665.00	1,130,500
黒田電気	3,500	814.00	2,849,000
丸文	2,300	346.00	795,800
ハピネット	1,500	766.00	1,149,000
トーメンエレクトロニクス	1,300	1,096.00	1,424,800
エクセル	1,300	713.00	926,900
マルカキカイ	900	820.00	738,000
ガリバーインターナショナル	870	2,682.00	2,333,340
日本エム・ディ・エム	2,400	212.00	508,800
進和	1,700	929.00	1,579,300
エスケイジャパン	700	243.00	170,100
ダイトエレクトロン	1,300	358.00	465,400
シークス	1,800	1,188.00	2,138,400
田中商事	900	450.00	405,000
オーハシテクニカ	1,600	557.00	891,200
マクニカ	1,500	1,769.00	2,653,500
白銅	900	691.00	621,900
伊藤忠商事	228,200	869.00	198,305,800
丸紅	250,000	530.00	132,500,000
高島	5,000	250.00	1,250,000
F & A アクアホールディングス	2,200	857.00	1,885,400
長瀬産業	16,200	967.00	15,665,400
蝶理	18,000	97.00	1,746,000
豊田通商	31,900	1,517.00	48,392,300
三共生興	4,900	267.00	1,308,300
兼松	61,000	88.00	5,368,000
ツカモトコーポレーション	5,000	122.00	610,000
三井物産	246,900	1,115.00	275,293,500
日本紙パルプ商事	15,000	261.00	3,915,000
日立ハイテクノロジーズ	8,700	1,860.00	16,182,000
カメイ	4,000	753.00	3,012,000
東都水産	5,000	123.00	615,000
スターゼン	9,000	227.00	2,043,000
山善	11,000	673.00	7,403,000
椿本興業	3,000	223.00	669,000
住友商事	168,800	1,078.00	181,966,400
内田洋行	6,000	220.00	1,320,000
三菱商事	208,300	1,629.00	339,320,700
第一実業	6,000	379.00	2,274,000
キャノンマーケティングジャパン	9,500	947.00	8,996,500
西華産業	10,000	219.00	2,190,000
佐藤商事	2,500	553.00	1,382,500
菱洋エレクトロ	3,100	884.00	2,740,400
東京産業	3,000	260.00	780,000
ユアサ商事	29,000	126.00	3,654,000
神鋼商事	7,000	174.00	1,218,000
阪和興業	29,000	302.00	8,758,000
カナデン	3,000	500.00	1,500,000
菱電商事	4,000	454.00	1,816,000
フルサト工業	1,700	716.00	1,217,200
岩谷産業	32,000	288.00	9,216,000
すてきナイスグループ	12,000	206.00	2,472,000
昭光通商	10,000	115.00	1,150,000
ニチモウ	4,000	204.00	816,000
極東貿易	3,000	145.00	435,000
イワキ	4,000	180.00	720,000
三愛石油	7,000	347.00	2,429,000
稲畑産業	7,600	478.00	3,632,800
G S イクレオス	7,000	102.00	714,000
明和産業	2,300	706.00	1,623,800
J F E 商事	19,200	341.00	6,547,200
東邦ホールディングス	9,200	1,468.00	13,505,600
サンゲツ	5,100	1,918.00	9,781,800
ミツウロコグループホールディングス	4,600	473.00	2,175,800

シナネン	6,000	336.00	2,016,000
伊藤忠エネクス	6,300	446.00	2,809,800
サンリオ	7,200	3,195.00	23,004,000
サンワテクノス	1,400	646.00	904,400
リョーサン	4,700	1,439.00	6,763,300
新光商事	3,100	644.00	1,996,400
トーホー	6,000	309.00	1,854,000
三信電気	4,100	523.00	2,144,300
東陽テクニカ	4,100	846.00	3,468,600
モスフードサービス	3,700	1,530.00	5,661,000
加賀電子	3,100	786.00	2,436,600
ソーダニッカ	3,000	328.00	984,000
立花エレテック	1,700	676.00	1,149,200
Paltaac	3,000	1,107.00	3,321,000
太平洋興発	10,000	73.00	730,000
ヤマタネ	14,000	104.00	1,456,000
丸紅建材リース	3,000	133.00	399,000
日鐵商事	6,000	219.00	1,314,000
トラスコ中山	3,600	1,717.00	6,181,200
オートバックスセブン	3,400	3,900.00	13,260,000
加藤産業	4,100	1,550.00	6,355,000
イノテック	2,300	405.00	931,500
イエローハット	2,700	1,258.00	3,396,600
富士エレクトロニクス	1,500	1,096.00	1,644,000
J Kホールディングス	2,400	325.00	780,000
日伝	1,200	2,070.00	2,484,000
北沢産業	2,500	171.00	427,500
杉本商事	1,500	732.00	1,098,000
因幡電機産業	3,400	2,301.00	7,823,400
住金物産	13,000	194.00	2,522,000
ミスミグループ本社	10,600	1,775.00	18,815,000
江守商事	600	931.00	558,600
アルテック	1,400	201.00	281,400
タキヒヨー	4,000	447.00	1,788,000
スズケン	11,000	2,401.00	26,411,000
ジェコス	2,000	350.00	700,000
ローソン	9,000	5,360.00	48,240,000
サンエー	1,000	3,020.00	3,020,000
キリン堂	1,200	519.00	622,800
ダイユーエイト	500	577.00	288,500
カワチ薬品	2,000	1,738.00	3,476,000
エービーシー・マート	4,100	2,810.00	11,521,000
ハードオフコーポレーション	1,400	498.00	697,200
アスクル	2,000	960.00	1,920,000
ゲオホールディングス	44	90,400.00	3,977,600
ポイント	2,410	2,969.00	7,155,290
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	176.00	352,000
くらコーポレーション	1,500	1,026.00	1,539,000
キャンドゥ	15	99,000.00	1,485,000
バル	850	3,805.00	3,234,250
エディオン	11,400	411.00	4,685,400
サーラコーポレーション	2,500	471.00	1,177,500
あみやき亭	4	202,000.00	808,000
ひらまつ	10	72,900.00	729,000
ゲンキー	300	2,053.00	615,900
ハニーズ	2,510	1,458.00	3,659,580
アルペン	2,200	1,505.00	3,311,000
ビックカメラ	109	38,600.00	4,207,400
D C Mホールディングス	14,800	566.00	8,376,800
MonotaRO	1,600	1,243.00	1,988,800
J . フロント リテイリング	68,000	380.00	25,840,000
ドトール・日レスホールディングス	4,600	996.00	4,581,600
マツモトキヨシホールディングス	5,300	1,734.00	9,190,200
スタートトゥデイ	5,200	1,153.00	5,995,600

物語コーポレーション	400	1,417.00	566,800
ココカラファイン	3,000	2,449.00	7,347,000
三越伊勢丹ホールディングス	56,800	814.00	46,235,200
クリエイトSDホールディングス	1,200	2,126.00	2,551,200
丸善CHIホールディングス	800	204.00	163,200
ブックオフコーポレーション	1,600	664.00	1,062,400
あさひ	1,700	1,457.00	2,476,900
サークルKサンクス	800	1,767.00	1,413,600
日本調剤	360	2,923.00	1,052,280
コスモス薬品	1,300	4,455.00	5,791,500
セブン&アイ・ホールディングス	119,600	2,400.00	287,040,000
ツルハホールディングス	2,300	4,635.00	10,660,500
サンマルクホールディングス	800	2,922.00	2,337,600
フェリシモ	800	1,035.00	828,000
トリドール	2,500	894.00	2,235,000
クスリのアオキ	400	1,873.00	749,200
メディカルシステムネットワーク	900	1,102.00	991,800
総合メディカル	700	2,820.00	1,974,000
はるやま商事	1,200	461.00	553,200
カッパ・クリエイト	2,100	1,698.00	3,565,800
ライトオン	2,100	627.00	1,316,700
ジーンズメイト	900	182.00	163,800
良品計画	3,000	4,155.00	12,465,000
三城ホールディングス	3,500	410.00	1,435,000
コナカ	3,400	889.00	3,022,600
ハウス オブ ローゼ	300	1,229.00	368,700
G-7ホールディングス	800	400.00	320,000
イオン北海道	1,800	353.00	635,400
コジマ	3,900	323.00	1,259,700
コーナン商事	3,100	1,059.00	3,282,900
エコス	1,000	493.00	493,000
ワタミ	3,400	1,580.00	5,372,000
マルシェ	700	722.00	505,400
ドン・キホーテ	7,600	2,817.00	21,409,200
メガネトップ	4,100	862.00	3,534,200
西松屋チェーン	6,300	642.00	4,044,600
ゼンショーホールディングス	10,900	1,003.00	10,932,700
幸楽苑	1,800	1,201.00	2,161,800
ハークスレイ	700	458.00	320,600
サイゼリヤ	4,200	1,199.00	5,035,800
ポプラ	700	478.00	334,600
ユナイテッドアローズ	3,100	1,773.00	5,496,300
ハイデイ日高	1,500	1,179.00	1,768,500
京都きもの友禅	1,900	966.00	1,835,400
コロワイド	9,500	573.00	5,443,500
壱番屋	1,100	2,387.00	2,625,700
トップカルチャー	1,000	365.00	365,000
スギホールディングス	5,100	2,495.00	12,724,500
スクロール	3,700	287.00	1,061,900
ファミリーマート	8,800	3,515.00	30,932,000
木曽路	3,300	1,529.00	5,045,700
千趣会	5,100	520.00	2,652,000
タカキュー	2,000	164.00	328,000
ケーヨー	5,400	468.00	2,527,200
上新電機	6,000	759.00	4,554,000
日本瓦斯	2,700	1,178.00	3,180,600
ベスト電器	9,000	162.00	1,458,000
マルエツ	6,000	297.00	1,782,000
ロイヤルホールディングス	4,800	918.00	4,406,400
東天紅	2,000	124.00	248,000
いなげや	3,200	913.00	2,921,600
島忠	6,500	1,716.00	11,154,000
チヨダ	3,700	1,733.00	6,412,100
ライフコーポレーション	1,800	1,251.00	2,251,800

カスミ	5,800	534.00	3,097,200
リンガーハット	2,600	1,049.00	2,727,400
さが美	2,000	96.00	192,000
MrMax	2,900	294.00	852,600
テンアライド	2,200	259.00	569,800
AOKIホールディングス	2,500	1,616.00	4,040,000
オークワ	4,000	1,029.00	4,116,000
コメリ	3,900	2,098.00	8,182,200
青山商事	7,900	1,694.00	13,382,600
しまむら	3,300	9,100.00	30,030,000
CFSコーポレーション	1,900	356.00	676,400
高島屋	39,000	568.00	22,152,000
松屋	5,800	602.00	3,491,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	15,000	660.00	9,900,000
丸栄	5,000	90.00	450,000
ニッセンホールディングス	5,700	364.00	2,074,800
パルコ	5,200	726.00	3,775,200
丸井グループ	37,300	572.00	21,335,600
原信ナルスホールディングス	1,600	1,340.00	2,144,000
井筒屋	15,000	46.00	690,000
ダイエー	17,650	236.00	4,165,400
イズミヤ	10,000	392.00	3,920,000
イオン	100,800	995.00	100,296,000
ユニー	21,400	868.00	18,575,200
イズミ	8,600	1,596.00	13,725,600
東武ストア	4,000	258.00	1,032,000
平和堂	5,300	1,111.00	5,888,300
フジ	3,200	1,732.00	5,542,400
ヤオコー	1,300	2,742.00	3,564,600
ゼビオ	3,400	1,982.00	6,738,800
ケーズホールディングス	7,100	1,955.00	13,880,500
Olympic	1,900	783.00	1,487,700
日産東京販売ホールディングス	4,000	207.00	828,000
アインファーマシーズ	1,600	4,115.00	6,584,000
元気寿司	900	949.00	854,100

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		ヤマダ電機	13,910	4,185.00	58,213,350	
		アークランドサカモト	1,900	1,204.00	2,287,600	
		ニトリホールディングス	5,650	7,120.00	40,228,000	
		グルメ杵屋	2,000	449.00	898,000	
		愛眼	2,300	328.00	754,400	
		吉野家ホールディングス	77	101,100.00	7,784,700	
		松屋フーズ	1,400	1,483.00	2,076,200	
		サガミチェーン	3,000	598.00	1,794,000	
		ブレナス	3,200	1,473.00	4,713,600	
		ミニストップ	2,100	1,347.00	2,828,700	
		アークス	3,900	1,660.00	6,474,000	
		パロー	5,700	1,311.00	7,472,700	
		ベルク	1,400	1,145.00	1,603,000	
		大庄	1,300	998.00	1,297,400	
		ファーストリテイリング	5,700	16,980.00	96,786,000	
		サンドラッグ	5,400	2,447.00	13,213,800	
		東京デリカ	900	756.00	680,400	
		ヤマザワ	700	1,331.00	931,700	
		やまや	500	1,340.00	670,000	
		ベルーナ	3,550	551.00	1,956,050	
		島根銀行	600	1,045.00	627,000	
		新生銀行	223,000	92.00	20,516,000	
		あおぞら銀行	89,000	190.00	16,910,000	
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,165,000	349.00	755,585,000	
		りそなホールディングス	248,900	307.00	76,412,300	
		三井住友トラスト・ホールディングス	561,000	222.00	124,542,000	
		三井住友フィナンシャルグループ	217,200	2,350.00	510,420,000	
		第四銀行	37,000	241.00	8,917,000	
		北越銀行	29,000	151.00	4,379,000	
		西日本シティ銀行	100,000	194.00	19,400,000	
		札幌北洋ホールディングス	43,100	254.00	10,947,400	
		千葉銀行	113,000	483.00	54,579,000	
		横浜銀行	184,000	384.00	70,656,000	
		常陽銀行	109,000	343.00	37,387,000	
		群馬銀行	65,000	381.00	24,765,000	
		武蔵野銀行	4,600	2,426.00	11,159,600	
		千葉興業銀行	5,500	371.00	2,040,500	
		筑波銀行	11,900	246.00	2,927,400	
		東京都民銀行	5,400	828.00	4,471,200	
		七十七銀行	45,000	306.00	13,770,000	
		青森銀行	21,000	230.00	4,830,000	
		秋田銀行	20,000	241.00	4,820,000	
		山形銀行	17,000	346.00	5,882,000	
		岩手銀行	1,900	3,275.00	6,222,500	
		東邦銀行	24,000	243.00	5,832,000	
		東北銀行	15,000	117.00	1,755,000	
		みちのく銀行	14,000	144.00	2,016,000	
		ふくおかフィナンシャルグループ	116,000	313.00	36,308,000	
		静岡銀行	86,000	827.00	71,122,000	
		十六銀行	36,000	235.00	8,460,000	
		スルガ銀行	28,000	778.00	21,784,000	
		八十二銀行	53,000	401.00	21,253,000	
		山梨中央銀行	17,000	308.00	5,236,000	
		大垣共立銀行	38,000	256.00	9,728,000	
		福井銀行	25,000	231.00	5,775,000	
		北國銀行	33,000	293.00	9,669,000	
		清水銀行	1,000	2,652.00	2,652,000	
		滋賀銀行	27,000	427.00	11,529,000	
		南都銀行	27,000	354.00	9,558,000	
		百五銀行	26,000	313.00	8,138,000	
		京都銀行	51,000	657.00	33,507,000	

三重銀行	12,000	170.00	2,040,000
ほくほくフィナンシャルグループ	200,000	132.00	26,400,000
広島銀行	84,000	308.00	25,872,000
山陰合同銀行	17,000	543.00	9,231,000
中国銀行	22,000	984.00	21,648,000
鳥取銀行	9,000	146.00	1,314,000
伊予銀行	31,000	619.00	19,189,000
百十四銀行	31,000	318.00	9,858,000
四国銀行	21,000	257.00	5,397,000
阿波銀行	25,000	471.00	11,775,000
鹿児島銀行	18,000	468.00	8,424,000
大分銀行	19,000	229.00	4,351,000
宮崎銀行	19,000	185.00	3,515,000
肥後銀行	22,000	431.00	9,482,000
佐賀銀行	17,000	197.00	3,349,000
十八銀行	18,000	200.00	3,600,000
沖縄銀行	2,200	3,345.00	7,359,000
琉球銀行	6,000	1,007.00	6,042,000
八千代銀行	1,500	1,664.00	2,496,000
セブン銀行	107,200	183.00	19,617,600
みずほフィナンシャルグループ	3,678,300	114.00	419,326,200
紀陽ホールディングス	114,000	112.00	12,768,000
山口フィナンシャルグループ	29,000	647.00	18,763,000
長野銀行	9,000	144.00	1,296,000
名古屋銀行	26,000	238.00	6,188,000
愛知銀行	1,000	4,095.00	4,095,000
第三銀行	16,000	148.00	2,368,000
中京銀行	12,000	181.00	2,172,000
東日本銀行	14,000	161.00	2,254,000
大光銀行	10,000	198.00	1,980,000
愛媛銀行	18,000	221.00	3,978,000
トマト銀行	11,000	125.00	1,375,000
みなと銀行	26,000	147.00	3,822,000
京葉銀行	24,000	370.00	8,880,000
関西アーバン銀行	40,000	110.00	4,400,000
栃木銀行	14,000	255.00	3,570,000
北日本銀行	900	1,960.00	1,764,000
東和銀行	29,000	75.00	2,175,000
福島銀行	33,000	58.00	1,914,000
大東銀行	18,000	59.00	1,062,000
トモニホールディングス	21,900	338.00	7,402,200
フィデアホールディングス	16,500	169.00	2,788,500
池田泉州ホールディングス	118,000	105.00	12,390,000
SBIホールディングス	3,030	5,450.00	16,513,500
日本アジア投資	21,000	52.00	1,092,000
ジャフコ	3,500	1,532.00	5,362,000
大和証券グループ本社	283,000	264.00	74,712,000
野村ホールディングス	619,100	273.00	169,014,300
岡三証券グループ	24,000	284.00	6,816,000
丸三証券	9,600	257.00	2,467,200
東洋証券	11,000	147.00	1,617,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	33,000	252.00	8,316,000
光世証券	7,000	66.00	462,000
水戸証券	8,000	168.00	1,344,000
いちよし証券	6,400	396.00	2,534,400
松井証券	17,000	429.00	7,293,000
だいこう証券ビジネス	1,600	258.00	412,800
マネックスグループ	216	13,730.00	2,965,680
カブドットコム証券	11,700	224.00	2,620,800
極東証券	3,800	664.00	2,523,200
岩井コスモホールディングス	2,700	275.00	742,500
小林洋行	700	168.00	117,600
NKSJホールディングス	59,800	1,499.00	89,640,200
M&A Dインシュアランスグループホール	85,500	1,317.00	112,603,500

ソニーフィナンシャルホールディングス	27,400	1,161.00	31,811,400
第一生命保険	1,530	85,900.00	131,427,000
東京海上ホールディングス	108,600	1,842.00	200,041,200
T & Dホールディングス	104,200	783.00	81,588,600
クレディセゾン	23,400	1,570.00	36,738,000
フィデック	16	9,670.00	154,720
芙蓉総合リース	2,700	2,310.00	6,237,000
興銀リース	4,000	1,917.00	7,668,000
東京センチュリーリース	7,700	1,505.00	11,588,500
日本証券金融	11,800	363.00	4,283,400
大阪証券金融	3,300	147.00	485,100
ポケットカード	2,900	325.00	942,500
リコーリース	2,000	1,845.00	3,690,000
イオンクレジットサービス	12,700	1,306.00	16,586,200
アコム	5,740	1,571.00	9,017,540
ジャックス	17,000	232.00	3,944,000
オリエントコーポレーション	55,000	101.00	5,555,000
日立キャピタル	5,600	1,207.00	6,759,200
オリックス	14,880	7,130.00	106,094,400
三菱UFJリース	7,250	3,150.00	22,837,500
アサックス	4	82,900.00	331,600
NECキャピタルソリューション	1,000	988.00	988,000
日本駐車場開発	310	3,945.00	1,222,950
昭栄	5,200	280.00	1,456,000
東京建物不動産販売	1,100	224.00	246,400
野村不動産ホールディングス	13,700	1,255.00	17,193,500
常和ホールディングス	500	1,315.00	657,500
ヒューリック	9,300	842.00	7,830,600
パーク24	14,900	1,148.00	17,105,200
三井不動産	127,000	1,261.00	160,147,000
三菱地所	200,000	1,235.00	247,000,000
平和不動産	27,000	178.00	4,806,000
東京建物	55,000	248.00	13,640,000
ダイビル	8,400	588.00	4,939,200
サンケイビル	600	736.00	441,600
東急不動産	58,000	343.00	19,894,000
京阪神ビルディング	3,400	339.00	1,152,600
住友不動産	69,000	1,693.00	116,817,000
東宝不動産	3,000	410.00	1,230,000
大京	44,000	170.00	7,480,000
テーオーシー	11,100	415.00	4,606,500
東京楽天地	5,000	299.00	1,495,000
レオバレス21	22,100	207.00	4,574,700
フジ住宅	3,600	370.00	1,332,000
空港施設	3,000	324.00	972,000
明和地所	1,400	396.00	554,400
住友不動産販売	1,030	3,395.00	3,496,850
ゴールドクレスト	2,580	1,153.00	2,974,740
東栄住宅	1,900	750.00	1,425,000
リロ・ホールディング	900	2,098.00	1,888,200
日本エスリード	1,100	649.00	713,900
東急リパブル	2,600	755.00	1,963,000
飯田産業	2,700	561.00	1,514,700
日神不動産	1,700	416.00	707,200
アーネストワン	4,700	885.00	4,159,500
タカラレーベン	3,300	607.00	2,003,100
サンヨーハウジング名古屋	15	74,400.00	1,116,000
イオンモール	13,000	1,573.00	20,449,000
フージャースコーポレーション	44	52,900.00	2,327,600
タクトホーム	15	68,900.00	1,033,500
トーセイ	37	25,900.00	958,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	178	56,900.00	10,128,200
サンフロンティア不動産	23	14,680.00	337,640
ランドビジネス	19	15,320.00	291,080

グランディハウス	600	476.00	285,600
日本空港ビルデング	9,100	948.00	8,626,800
日本工営	10,000	262.00	2,620,000
ネクスト	1,200	352.00	422,400
日本M&Aセンター	1,200	2,322.00	2,786,400
ノバレーゼ	8	50,900.00	407,200
アコーディア・ゴルフ	123	53,600.00	6,592,800
パソナグループ	30	70,600.00	2,118,000
リンクアンドモチベーション	6	62,300.00	373,800
エス・エム・エス	6	106,800.00	640,800
テンプホールディングス	4,100	784.00	3,214,400
クックパッド	600	2,180.00	1,308,000
学情	1,000	376.00	376,000
スタジオアリス	1,400	1,219.00	1,706,600
シミックホールディングス	1,100	1,269.00	1,395,900
N E Cフィールディング	2,500	946.00	2,365,000
総合警備保障	11,000	1,045.00	11,495,000
カカクコム	4,700	2,299.00	10,805,300
ルネサンス	1,300	438.00	569,400
新日本科学	1,900	196.00	372,400
ツクイ	900	936.00	842,400
エムスリー	24	344,500.00	8,268,000
ベストプライダル	7	85,100.00	595,700
ディー・エヌ・エー	13,600	1,934.00	26,302,400
博報堂D Yホールディングス	3,850	4,880.00	18,788,000
ぐるなび	2,100	818.00	1,717,800
一休	21	34,500.00	724,500
ジャパンベストレスキューシステム	4	74,500.00	298,000
ジェイコムホールディングス	500	700.00	350,000
P G Mホールディングス	43	58,400.00	2,511,200
J Pホールディングス	900	743.00	668,700
イービーエス	18	191,900.00	3,454,200
アミューズ	800	966.00	772,800
ドリームインキュベータ	9	67,000.00	603,000
T A C	1,700	150.00	255,000
ケネディクス	330	10,360.00	3,418,800
電通	27,500	2,390.00	65,725,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	129	7,030.00	906,870
びあ	900	866.00	779,400
イオンファンタジー	1,000	1,099.00	1,099,000
ネクシィーズ	109	1,900.00	207,100
みらかホールディングス	7,900	3,075.00	24,292,500
アルプス技研	1,300	601.00	781,300
ダイオーズ	500	495.00	247,500
日本空調サービス	700	719.00	503,300
オリエンタルランド	8,200	8,800.00	72,160,000
ダスキン	8,900	1,520.00	13,528,000
明光ネットワークジャパン	2,800	760.00	2,128,000
ファルコS Dホールディングス	1,600	904.00	1,446,400
秀英予備校	500	302.00	151,000
田谷	500	671.00	335,500
ラウンドワン	9,400	444.00	4,173,600
リゾートトラスト	4,700	1,265.00	5,945,500
ビー・エム・エル	2,000	2,057.00	4,114,000
ワタベウェディング	900	674.00	606,600
もしもしホットライン	5,000	754.00	3,770,000
東急コミュニティー	800	2,525.00	2,020,000
リソー教育	307	5,080.00	1,559,560
ウェアハウス	500	207.00	103,500
ユー・エス・エス	3,950	8,330.00	32,903,500
東京個別指導学院	1,500	142.00	213,000
テー・オー・ダブリュー	1,000	492.00	492,000
セントラルスポーツ	900	1,025.00	922,500
フルキャストホールディングス	29	14,450.00	419,050

リゾートソリューション	3,000	155.00	465,000
エイチ・アイ・エス	3,100	2,631.00	8,156,100
共立メンテナンス	1,500	1,620.00	2,430,000
イチネンホールディングス	3,200	419.00	1,340,800
建設技術研究所	1,700	491.00	834,700
燦ホールディングス	700	1,437.00	1,005,900
スバル興業	2,000	252.00	504,000
東京テアトル	12,000	103.00	1,236,000
よみうりランド	6,000	250.00	1,500,000
東京都競馬	23,000	107.00	2,461,000
常磐興産	9,000	83.00	747,000
カナモト	4,000	749.00	2,996,000
東京ドーム	24,000	227.00	5,448,000
トランス・コスモス	4,000	1,151.00	4,604,000
乃村工藝社	6,000	276.00	1,656,000
藤田観光	8,000	277.00	2,216,000
日本管財	1,100	1,431.00	1,574,100
トーカイ	1,200	1,714.00	2,056,800
白洋舎	3,000	212.00	636,000
セコム	29,400	3,600.00	105,840,000
セントラル警備保障	1,300	773.00	1,004,900
丹青社	3,000	215.00	645,000
メイテック	4,700	1,548.00	7,275,600
アサツー ディ・ケイ	5,000	2,346.00	11,730,000
応用地質	3,200	856.00	2,739,200
船井総合研究所	3,100	544.00	1,686,400
進学会	1,400	287.00	401,800
ベネッセホールディングス	9,400	3,680.00	34,592,000
イオンディライト	3,400	1,754.00	5,963,600
ナック	800	1,658.00	1,326,400
ニチイ学館	5,900	1,002.00	5,911,800
ダイセキ	4,900	1,312.00	6,428,800
小計	銘柄数：1,661		29,566,344,910
	組入時価比率：97.9%		100.0%
合計			29,566,344,910

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

(ロ) 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23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	363,799,550	1,495,304,722
国債証券	55,040,314,200	68,848,726,200
地方債証券	4,931,348,665	6,345,410,906
特殊債証券	7,522,275,452	8,627,696,221
社債証券	6,300,741,000	6,918,758,000
未収利息	244,009,992	273,685,019
前払費用	21,721,276	26,635,648
流動資産合計	74,424,210,135	92,536,216,716
資産合計	74,424,210,135	92,536,216,716
負債の部		
流動負債		
未払解約金	700,000	505,800,000
流動負債合計	700,000	505,800,000
負債合計	700,000	505,800,000
純資産の部		
元本等		
元本	61,461,850,809	73,899,622,937
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,961,659,326	18,130,793,779
元本等合計	74,423,510,135	92,030,416,716
純資産合計	74,423,510,135	92,030,416,716
負債純資産合計	74,424,210,135	92,536,216,716

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
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。
3. 追加情報	当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	61,461,850,809口	73,899,622,937口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2109円 (12,109円)	1.2453円 (12,453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23年5月17日 至平成24年5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。
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。
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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（金融商品の時価等に関する事項）

自平成23年5月17日 至平成24年5月15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>

関連当事者との取引に関する注記

該当事項はありません。

その他の注記

（元本の移動）

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
期首元本額	61,265,852,004円	61,461,850,809円
期中追加設定元本額	17,388,256,190円	28,177,758,766円
期中一部解約元本額	17,192,257,385円	15,739,986,638円
期末元本額	61,461,850,809円	73,899,622,937円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド（株式70）	1,672,630,430円	1,696,162,161円
日立バランスファンド（株式50）	4,265,143,588円	4,436,941,512円
日立バランスファンド（株式30）	2,502,562,129円	2,602,652,805円
日立国内債券特化型ファンドN	45,214,329,874円	56,217,268,660円
日立国内債券インデックスファンド	7,807,184,788円	8,946,597,799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23年5月16日現在	平成24年5月15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	423,415,650	593,389,600
国内地方債証券	43,370,173	44,781,396
国内特殊債証券	53,387,133	53,082,320
国内一般社債証券	29,476,000	40,020,000
合計	549,648,956	731,273,316

（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）

該当事項はありません。

[次へ](#)

（ 3 ） 附属明細表(平成24年5月15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 3 0 6 回利付国債（ 2 年 ）	300,000,000	300,348,000	
		第 3 0 9 回利付国債（ 2 年 ）	600,000,000	599,952,000	
		第 3 1 0 回利付国債（ 2 年 ）	1,400,000,000	1,401,988,000	
		第 3 1 1 回利付国債（ 2 年 ）	900,000,000	901,341,000	
		第 3 1 2 回利付国債（ 2 年 ）	1,500,000,000	1,499,865,000	
		第 3 1 4 回利付国債（ 2 年 ）	1,100,000,000	1,099,890,000	
		第 3 1 5 回利付国債（ 2 年 ）	500,000,000	499,950,000	
		第 7 2 回利付国債（ 5 年 ）	330,000,000	335,025,900	
		第 7 4 回利付国債（ 5 年 ）	300,000,000	302,931,000	
		第 8 0 回利付国債（ 5 年 ）	700,000,000	707,742,000	
		第 8 1 回利付国債（ 5 年 ）	500,000,000	506,385,000	
		第 8 2 回利付国債（ 5 年 ）	550,000,000	558,030,000	
		第 8 6 回利付国債（ 5 年 ）	600,000,000	606,948,000	
		第 8 7 回利付国債（ 5 年 ）	1,100,000,000	1,111,088,000	
		第 8 8 回利付国債（ 5 年 ）	900,000,000	909,810,000	
		第 8 9 回利付国債（ 5 年 ）	850,000,000	857,327,000	
		第 9 0 回利付国債（ 5 年 ）	400,000,000	402,216,000	
		第 9 1 回利付国債（ 5 年 ）	900,000,000	908,091,000	
		第 9 2 回利付国債（ 5 年 ）	200,000,000	201,132,000	
		第 9 3 回利付国債（ 5 年 ）	450,000,000	455,710,500	
		第 9 5 回利付国債（ 5 年 ）	500,000,000	508,300,000	
		第 9 6 回利付国債（ 5 年 ）	450,000,000	455,751,000	
		第 9 7 回利付国債（ 5 年 ）	500,000,000	504,365,000	
		第 9 8 回利付国債（ 5 年 ）	400,000,000	401,868,000	
		第 9 9 回利付国債（ 5 年 ）	700,000,000	705,873,000	
		第 1 0 0 回利付国債（ 5 年 ）	700,000,000	702,863,000	
		第 1 0 1 回利付国債（ 5 年 ）	1,200,000,000	1,209,540,000	
		第 1 0 2 回利付国債（ 5 年 ）	1,500,000,000	1,505,115,000	
		第 1 0 3 回利付国債（ 5 年 ）	800,000,000	802,104,000	
		第 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	100,000,000	111,732,000	
		第 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	140,000,000	148,457,400	
		第 3 回利付国債（ 4 0 年 ）	110,000,000	116,113,800	
		第 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	320,000,000	336,192,000	
		第 2 5 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	230,000,000	231,002,800	
		第 2 5 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	280,000,000	285,622,400	
		第 2 5 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	480,000,000	488,347,200	
		第 2 5 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	30,000,000	30,620,700	
		第 2 5 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	350,000,000	357,682,500	
		第 2 5 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	260,000,000	266,663,800	
		第 2 6 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	320,000,000	329,990,400	
		第 2 6 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	145,000,000	150,133,000	
		第 2 6 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	330,000,000	342,368,400	
		第 2 6 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	260,000,000	269,092,200	
		第 2 6 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	610,000,000	629,904,300	
		第 2 6 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	110,000,000	113,955,600	
第 2 6 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	220,000,000	227,341,400			
第 2 6 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	50,000,000	51,539,000			
第 2 6 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	70,000,000	72,745,400			
第 2 6 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	120,000,000	124,026,000			
第 2 7 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	450,000,000	464,976,000			
第 2 7 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	210,000,000	218,883,000			
第 2 7 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	200,000,000	209,126,000			

第274回利付国債(10年)	240,000,000	251,628,000	
第275回利付国債(10年)	130,000,000	135,833,100	
第276回利付国債(10年)	110,000,000	115,722,200	
第277回利付国債(10年)	310,000,000	326,978,700	
第278回利付国債(10年)	330,000,000	350,592,000	
第279回利付国債(10年)	300,000,000	321,012,000	
第280回利付国債(10年)	170,000,000	181,879,600	
第282回利付国債(10年)	730,000,000	777,165,300	
第283回利付国債(10年)	450,000,000	481,014,000	
第284回利付国債(10年)	520,000,000	555,001,200	
第285回利付国債(10年)	390,000,000	417,346,800	
第286回利付国債(10年)	300,000,000	323,304,000	
第287回利付国債(10年)	490,000,000	530,523,000	
第288回利付国債(10年)	570,000,000	612,624,600	
第289回利付国債(10年)	450,000,000	479,443,500	
第291回利付国債(10年)	500,000,000	527,640,000	
第293回利付国債(10年)	450,000,000	488,632,500	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	431,956,000	
第295回利付国債(10年)	280,000,000	298,942,000	
第296回利付国債(10年)	820,000,000	875,809,200	
第297回利付国債(10年)	630,000,000	669,186,000	
第299回利付国債(10年)	480,000,000	506,740,800	
第300回利付国債(10年)	400,000,000	427,732,000	
第301回利付国債(10年)	460,000,000	492,016,000	
第303回利付国債(10年)	410,000,000	435,678,300	
第305回利付国債(10年)	200,000,000	211,010,000	
第306回利付国債(10年)	400,000,000	424,600,000	
第307回利付国債(10年)	370,000,000	389,980,000	
第308回利付国債(10年)	210,000,000	221,004,000	
第309回利付国債(10年)	460,000,000	476,831,400	
第311回利付国債(10年)	880,000,000	889,389,600	
第312回利付国債(10年)	940,000,000	978,887,800	
第313回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,048,200,000	
第314回利付国債(10年)	350,000,000	360,902,500	
第315回利付国債(10年)	450,000,000	467,235,000	
第316回利付国債(10年)	200,000,000	205,870,000	
第317回利付国債(10年)	400,000,000	410,968,000	
第318回利付国債(10年)	500,000,000	509,135,000	
第319回利付国債(10年)	700,000,000	717,752,000	
第320回利付国債(10年)	800,000,000	812,808,000	
第321回利付国債(10年)	800,000,000	810,896,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	47,748,800	
第4回利付国債(30年)	60,000,000	72,591,000	
第5回利付国債(30年)	5,000,000	5,477,150	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	78,913,800	
第7回利付国債(30年)	55,000,000	61,066,500	
第8回利付国債(30年)	45,000,000	46,034,550	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	26,939,700	
第11回利付国債(30年)	65,000,000	65,151,450	
第12回利付国債(30年)	90,000,000	96,544,800	
第13回利付国債(30年)	70,000,000	73,841,600	
第14回利付国債(30年)	100,000,000	112,765,000	
第15回利付国債(30年)	80,000,000	91,752,000	
第16回利付国債(30年)	70,000,000	80,171,700	
第18回利付国債(30年)	50,000,000	55,391,000	
第19回利付国債(30年)	90,000,000	99,698,400	
第20回利付国債(30年)	90,000,000	103,153,500	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	77,464,100	
第22回利付国債(30年)	80,000,000	91,712,800	

第23回利付国債(30年)	140,000,000	160,514,200	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	114,663,000	
第25回利付国債(30年)	200,000,000	221,386,000	
第26回利付国債(30年)	160,000,000	180,347,200	
第27回利付国債(30年)	200,000,000	229,764,000	
第28回利付国債(30年)	220,000,000	252,731,600	
第29回利付国債(30年)	210,000,000	237,178,200	
第30回利付国債(30年)	180,000,000	199,353,600	
第31回利付国債(30年)	30,000,000	32,586,900	
第32回利付国債(30年)	300,000,000	332,442,000	
第33回利付国債(30年)	300,000,000	312,432,000	
第34回利付国債(30年)	510,000,000	553,457,100	
第35回利付国債(30年)	450,000,000	467,730,000	
第36回利付国債(30年)	300,000,000	311,343,000	
第24回利付国債(20年)	380,000,000	412,083,400	
第25回利付国債(20年)	350,000,000	375,690,000	
第31回利付国債(20年)	10,000,000	11,278,100	
第33回利付国債(20年)	70,000,000	80,872,400	
第35回利付国債(20年)	495,000,000	568,027,350	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	80,047,800	
第38回利付国債(20年)	90,000,000	102,222,900	
第39回利付国債(20年)	150,000,000	169,560,000	
第40回利付国債(20年)	70,000,000	78,302,700	
第41回利付国債(20年)	40,000,000	42,730,400	
第42回利付国債(20年)	40,000,000	45,722,800	
第43回利付国債(20年)	30,000,000	35,125,800	
第45回利付国債(20年)	10,000,000	11,386,300	
第46回利付国債(20年)	60,000,000	67,387,800	
第47回利付国債(20年)	110,000,000	123,696,100	
第48回利付国債(20年)	70,000,000	80,544,100	
第49回利付国債(20年)	60,000,000	67,081,200	
第50回利付国債(20年)	40,000,000	43,998,400	
第51回利付国債(20年)	30,000,000	33,249,600	
第52回利付国債(20年)	65,000,000	72,633,600	
第53回利付国債(20年)	60,000,000	67,069,200	
第54回利付国債(20年)	160,000,000	180,360,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	110,849,000	
第57回利付国債(20年)	130,000,000	142,688,000	
第58回利付国債(20年)	130,000,000	142,775,100	
第59回利付国債(20年)	90,000,000	96,963,300	
第60回利付国債(20年)	100,000,000	104,684,000	
第61回利付国債(20年)	40,000,000	40,156,800	
第62回利付国債(20年)	130,000,000	127,466,300	
第63回利付国債(20年)	130,000,000	141,159,200	
第64回利付国債(20年)	10,000,000	10,956,100	
第65回利付国債(20年)	80,000,000	87,571,200	
第66回利付国債(20年)	80,000,000	86,694,400	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	142,161,500	
第68回利付国債(20年)	125,000,000	140,880,000	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	133,904,400	
第71回利付国債(20年)	130,000,000	146,434,600	
第72回利付国債(20年)	140,000,000	155,979,600	
第73回利付国債(20年)	100,000,000	110,138,000	
第74回利付国債(20年)	120,000,000	133,569,600	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	144,545,700	
第76回利付国債(20年)	110,000,000	119,698,700	
第77回利付国債(20年)	110,000,000	121,002,200	
第78回利付国債(20年)	90,000,000	97,736,400	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	109,860,000	

第80回利付国債(20年)	130,000,000	144,381,900	
第81回利付国債(20年)	70,000,000	76,750,100	
第82回利付国債(20年)	180,000,000	199,551,600	
第83回利付国債(20年)	140,000,000	154,998,200	
第84回利付国債(20年)	190,000,000	208,008,200	
第85回利付国債(20年)	300,000,000	331,653,000	
第86回利付国債(20年)	80,000,000	90,444,800	
第87回利付国債(20年)	180,000,000	201,245,400	
第88回利付国債(20年)	380,000,000	429,092,200	
第89回利付国債(20年)	400,000,000	446,600,000	
第90回利付国債(20年)	500,000,000	557,775,000	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	293,384,000	
第92回利付国債(20年)	200,000,000	220,166,000	
第93回利付国債(20年)	200,000,000	217,146,000	
第94回利付国債(20年)	200,000,000	219,904,000	
第95回利付国債(20年)	200,000,000	225,092,000	
第96回利付国債(20年)	90,000,000	98,834,400	
第97回利付国債(20年)	200,000,000	222,032,000	
第98回利付国債(20年)	80,000,000	87,682,400	
第99回利付国債(20年)	200,000,000	219,040,000	
第100回利付国債(20年)	200,000,000	221,606,000	
第102回利付国債(20年)	180,000,000	204,310,800	
第103回利付国債(20年)	150,000,000	168,172,500	
第104回利付国債(20年)	200,000,000	218,530,000	
第105回利付国債(20年)	230,000,000	250,913,900	
第106回利付国債(20年)	200,000,000	221,134,000	
第107回利付国債(20年)	250,000,000	272,462,500	
第108回利付国債(20年)	100,000,000	106,019,000	
第109回利付国債(20年)	220,000,000	232,927,200	
第110回利付国債(20年)	270,000,000	293,951,700	
第111回利付国債(20年)	130,000,000	143,257,400	
第112回利付国債(20年)	120,000,000	130,416,000	
第113回利付国債(20年)	300,000,000	325,671,000	
第115回利付国債(20年)	70,000,000	76,927,900	
第116回利付国債(20年)	50,000,000	54,926,000	
第117回利付国債(20年)	80,000,000	86,633,600	
第118回利付国債(20年)	50,000,000	53,292,000	
第119回利付国債(20年)	70,000,000	72,370,200	
第120回利付国債(20年)	100,000,000	100,210,000	
第121回利付国債(20年)	120,000,000	125,818,800	
第122回利付国債(20年)	390,000,000	402,772,500	
第123回利付国債(20年)	300,000,000	323,814,000	
第124回利付国債(20年)	260,000,000	276,289,000	
第125回利付国債(20年)	550,000,000	602,129,000	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	53,126,000	
第127回利付国債(20年)	250,000,000	261,425,000	
第128回利付国債(20年)	350,000,000	365,890,000	
第130回利付国債(20年)	300,000,000	308,406,000	
第131回利付国債(20年)	150,000,000	151,654,500	
第132回利付国債(20年)	600,000,000	605,784,000	
第133回利付国債(20年)	300,000,000	308,031,000	
第134回利付国債(20年)	300,000,000	307,875,000	
第135回利付国債(20年)	100,000,000	100,973,000	
計	銘柄数: 223	65,720,000,000	68,848,726,200
	組入時価比率: 74.8%		75.9%
小計			68,848,726,200

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	107,087,000	
		第619回東京都公募公債	130,000,000	135,028,400	
		第631回東京都公募公債	100,000,000	105,792,000	
		第646回東京都公募公債	100,000,000	108,460,000	
		第656回東京都公募公債	100,000,000	106,433,000	
		第661回東京都公募公債	100,000,000	107,101,000	
		第692回東京都公募公債	100,000,000	104,971,000	
		平成22年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,939,000	
		平成17年度第9回北海道公募公債	137,000,000	142,964,980	
		平成21年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	101,245,000	
		第3回神奈川県公募公債	100,000,000	110,048,000	
		第46回神奈川県公募公債（5年）	100,000,000	101,466,000	
		第160回神奈川県公募公債	100,000,000	106,974,000	
		第69回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,055,000	
		第304回大阪府公募公債（10年）	150,200,000	162,378,216	
		第327回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,332,000	
		第346回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,409,000	
		平成15年度第2回京都府公募公債	160,000,000	163,118,400	
		第9回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	108,521,000	
		平成22年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,728,000	
		平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,674,000	
		平成21年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,636,000	
		平成22年度第9回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,380,000	
		平成22年度第6回広島県公募公債	100,000,000	103,994,000	
		平成22年度第8回埼玉県公募公債	47,000,000	47,961,150	
		平成17年度第7回埼玉県公募公債	200,000,000	209,466,000	
		平成21年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,490,000	
		平成21年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	106,010,000	
		平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,772,000	
		平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	107,095,000	
		平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,520,000	
		第16回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,575,000	
		第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,284,000	
		第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,359,000	
		第52回共同発行市場公募地方債	106,000,000	114,528,760	
		第72回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,223,000	
		第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,496,000	
		第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,824,000	
		第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,376,000	
		第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,876,000	
		第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,498,000	
		第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,681,000	
		第89回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,579,000	
		第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,310,000	
		第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,915,000	
		平成17年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	104,749,000	
		平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	213,630,000	
		第467回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	107,344,000	
		第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	109,696,000	
		平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	105,078,000	
第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,191,000			
平成17年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	103,580,000			
平成21年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	105,837,000			
平成21年度第4回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	101,239,000			
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,904,000			
第1回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	113,475,000			

		平成17年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	105,114,000	
	計	銘柄数:57	6,030,200,000	6,345,410,906	
		組入時価比率:6.9%		7.0%	
	小計			6,345,410,906	
特殊 債券	日本円	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,815,000	
		第23回政府保証日本政策投資銀行債券	101,000,000	108,188,170	
		第34回日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,666,000	
		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	109,603,000	
		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	107,213,000	
		第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,487,000	
		第33回日本高速道路債券・機構承継債	100,000,000	114,840,000	
		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	215,051,910	
		第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,043,000	
		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	106,303,000	
		第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,332,000	
		第55回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,655,000	
		第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,975,000	
		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	213,350,000	
		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	107,466,000	
		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	107,520,040	
		第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	108,000,000	109,475,280	
		第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,610,000	
		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	103,751,000	
		第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,846,000	
		第317回政府保証道路債券	100,000,000	100,393,000	
		第329回政府保証道路債券	109,000,000	112,336,490	
		第338回政府保証道路債券	100,000,000	103,838,000	
		第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,447,000	
		第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,655,000	
		第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,321,000	
		第7回地方公共団体金融機構	134,000,000	141,964,960	
		第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,211,000	
		第13回公営企業債券	100,000,000	103,821,000	
		第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,956,000	
		第21回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,552,000	
		第844回政府保証公営企業債券	274,000,000	283,716,040	
		第849回政府保証公営企業債券	300,000,000	311,439,000	
		第871回政府保証公営企業債券	101,000,000	108,195,240	
		第10回首都高速道路債券	100,000,000	103,478,000	
		第143回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,154,000	
		第3回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,035,000	
		第3回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	105,527,000	
		第12回国際協力銀行債券	100,000,000	102,508,000	
		第31回都市再生債券	100,000,000	101,119,000	
		第56回政府保証関西国際空港債券	200,000,000	211,662,000	
		第182回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,671,000	
		第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,482,000	34,533,334	
		第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,530,000	36,140,479	
		第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	76,034,000	81,156,410	
		第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,426,000	66,662,628	
		第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,820,000	
		第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,600,000	68,717,604	
		第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,200,000	71,504,290	
		第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	88,048,000	93,098,433	
		第23回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,718,000	47,602,495	
		第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,916,000	158,515,660	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,999,000	77,922,052			
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,802,000	77,061,645			
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,595,000	92,272,578			

	第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,970,000	92,078,611	
	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,603,000	61,727,374	
	第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,502,000	99,332,942	
	第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,014,000	199,372,189	
	第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,706,000	63,623,907	
	第15回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,791,000	
	い第707号農林債	200,000,000	204,236,000	
	い第714号農林債	200,000,000	203,224,000	
	い第721号農林債	100,000,000	101,003,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	101,672,000	
	第235回信金中金債(5年)	200,000,000	203,856,000	
	第2号商工債券(10年)	100,000,000	105,617,000	
	第144号商工債券(3年)	100,000,000	100,175,000	
	第138号商工債券(3年)	100,000,000	100,261,000	
	第2回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,690,000	
	第5回政府保証中日本高速道路債券	53,000,000	56,753,460	
	第13回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	105,662,000	
	第30回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,891,000	
	第4回東京都住宅供給公社債券	100,000,000	106,532,000	
	計			
	銘柄数:74	8,234,145,000	8,627,696,221	
	組入時価比率:9.4%		9.5%	
	小計		8,627,696,221	
社債券	日本円			
	第326回東京交通債券	100,000,000	113,609,000	
	第21回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	101,446,000	
	第10回エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション円	100,000,000	100,648,000	
	第7回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	100,566,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債(2007)	100,000,000	102,420,000	
	第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債(100,000,000	101,257,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	100,502,000	
	第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2009)	100,000,000	102,057,000	
	第2回キリンホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同)	100,000,000	102,817,000	
	第21回サントリー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,035,000	
	第41回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,934,000	
	第1回JXホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	101,195,000	
	第62回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,882,000	
	第13回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	101,428,000	
	第50回株式会社東芝無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,062,000	
	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	100,996,000	
	第25回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,964,000	
	第33回川崎重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,547,000	
	第1回日本生命2010基金	100,000,000	100,197,000	
	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	102,403,000	
	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	101,037,000	

第84回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,127,000	
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	106,884,000	
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	105,104,000	
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	108,328,000	
第16回イオン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,891,000	
第1回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,576,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,380,000	
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	100,899,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,358,000	
第109回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間)	100,000,000	101,312,000	
第7回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,300,000	
第5回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,988,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保変動利付社債(社債間限定同)	100,000,000	102,474,000	
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	101,953,000	
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	100,748,000	
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	103,203,000	
第36回N T T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	101,624,000	
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	101,809,000	
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	102,552,000	
第140回オリックス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	100,880,000	
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	105,496,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,126,000	
第73回住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,835,000	
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	110,490,000	
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	109,404,000	
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	114,020,000	
第44回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	100,000,000	107,040,000	
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	107,039,000	
第8回K D D I株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,772,000	
第428回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	193,768,000	
第540回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	80,394,000	
第546回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	92,436,000	
第490回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,983,000	
第492回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,617,000	
第442回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,392,000	
第448回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,944,000	
第354回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,079,000	
第383回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	110,801,000	
第450回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,489,000	
第233回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	112,107,000	
第393回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,328,000	

	第4 1 1回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,242,000	
	第2 5 8回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,232,000	
	第1 2回電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,135,000	
	第2 4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	101,197,000	
計	銘柄数: 66	6,700,000,000	6,918,758,000	
	組入時価比率: 7.5%		7.6%	
小計			6,918,758,000	
合計			90,740,591,327	
株式以外計			90,740,591,327	

(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23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,298,213,510	917,538,396
コール・ローン	27,255,042	622,189,807
株式	65,420,151,008	50,308,166,805
派生商品評価勘定	22,742,791	788,251
未収入金	1,209,967	2,975,627
未収配当金	119,388,718	131,637,226
未収利息	37	852
差入委託証拠金	280,264,869	218,561,466
流動資産合計	67,169,225,942	52,201,858,430
資産合計	67,169,225,942	52,201,858,430
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,984,226	63,874,408
未払解約金	1,300,000	18,600,000
流動負債合計	10,284,226	82,474,408
負債合計	10,284,226	82,474,408
純資産の部		
元本等		
元本	71,027,564,899	59,404,183,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,868,623,183	7,284,799,591
元本等合計	67,158,941,716	52,119,384,022
純資産合計	67,158,941,716	52,119,384,022
負債純資産合計	67,169,225,942	52,201,858,430

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
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。
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。
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。
5. 追加情報	当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

貸借対照表に関する注記

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	71,027,564,899口	59,404,183,613口
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	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,868,623,183円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,284,799,591円であります。
3. 1口当たり純資産額（1万口当たり純資産額）	0.9455円 (9,455円)	0.8774円 (8,774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23年5月17日 至平成24年5月15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る場合、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>

（金融商品の時価等に関する事項）

自平成23年5月17日 至平成24年5月15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ぬ。</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>

関連当事者との取引に関する注記
該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
期首元本額	60,737,527,298円	71,027,564,899円
期中追加設定元本額	18,411,615,847円	24,072,505,964円
期中一部解約元本額	8,121,578,246円	35,695,887,250円
期末元本額	71,027,564,899円	59,404,183,613円
元本の内訳*		
日立バランスファンド(株式70)	3,113,918,321円	3,441,895,310円
日立バランスファンド(株式50)	2,681,618,304円	2,899,252,749円
日立バランスファンド(株式30)	512,086,556円	553,513,725円
日立外国株式特化型ファンド	54,320,124,795円	41,266,508,046円
日立外国株式インデックスファンド	10,399,816,923円	11,243,013,783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23年5月16日現在	平成24年5月15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	15,100,198円	3,024,830,590円
合計	15,100,198円	3,024,830,590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23年5月17日 至平成24年5月15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。
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。
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。
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。
5. 取引に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(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	為替予約取引	ドル	6,478,400	-	6,472,000	6,400
以外の取引	(外国・買建)	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

(平成24年5月15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	為替予約取引	ドル	409,040,000	-	408,069,985	970,015
以外の取引	(外国・買建)	カナダドル	41,600,000	-	41,361,337	238,663
		ユーロ	31,270,000	-	31,030,974	239,026
		ポンド	55,240,000	-	55,197,094	42,906
		デンマーククローネ	4,400,000	-	4,366,774	33,226
		オーストラリアドル	31,920,000	-	31,657,937	262,063
		香港ドル	9,080,000	-	9,053,604	26,396
		計	582,550,000	-	580,737,705	1,812,295

(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

(平成24年5月15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）	1,831,499,579	-	1,770,225,717	70,153,086
合計		1,831,499,579	-	1,770,225,717	70,153,086

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	1,076,061,654	-	1,050,482,337	37,426,611
		S&PTSE601206	120,704,042	-	113,610,465	6,834,454
		EURX50 1206	235,690,597	-	219,331,577	14,278,893
		FTSE100 1206	227,746,021	-	217,371,070	8,508,521
		SMI 1206	77,492,511	-	75,203,505	2,370,999
		SPI200 1206	93,804,754	-	94,226,763	733,608

(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24年5月15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	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	6,300	13.16	82,908.00	
		ANADAEKO PETROLEUM CORP	14,800	66.75	987,900.00	
		APACHE CORP	11,428	85.05	971,951.40	
		ARCH COAL INC	7,800	8.19	63,882.00	
		BAKER HUGHES INC	12,861	41.58	534,760.38	
		CABOT OIL & GAS CORP	6,100	35.22	214,842.00	
		CALPINE CORP	9,200	17.66	162,472.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	7,200	47.04	338,688.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	19,500	15.52	302,640.00	
		CHEVRON CORP	59,203	101.94	6,035,153.82	
		CIMAREX ENERGY CO	2,500	61.70	154,250.00	
		COBALT INTERNATIONAL ENERGY	4,400	22.00	96,800.00	
		CONCHO RESOURCES INC	2,900	92.02	266,858.00	
		CONOCOPHILLIPS	37,500	52.93	1,984,875.00	
		CONSOL ENERGY INC	6,600	33.53	221,298.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,500	74.45	111,675.00	
		DENBURY RESOURCES INC	13,000	16.82	218,660.00	
		DEVON ENERGY CORPORATION	11,322	63.77	722,003.94	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	61.67	123,340.00	
		EL PASO CORPORATION	22,760	29.23	665,274.80	
		EOG RESOURCES INC	8,000	101.04	808,320.00	
		EXXON MOBIL CORPORATION	142,522	82.12	11,703,906.64	
		FMC TECHNOLOGIES INC	7,000	43.07	301,490.00	
		HALLIBURTON CO	27,252	31.58	860,618.16	
		HELMERICH & PAYNE	3,100	45.03	139,593.00	
		HESS CORP	9,000	46.63	419,670.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	6,400	28.90	184,960.00	
		KINDER MORGAN INC	3,200	33.55	107,360.00	
		KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	2,753	71.39	196,536.67	
		MARATHON OIL CORP	20,835	25.45	530,250.75	
		MARATHON PETROLEUM CORP	10,517	35.82	376,718.94	
		MURPHY OIL CORP	5,400	46.99	253,746.00	
		NABORS INDUSTRIES LTD	9,868	14.63	144,368.84	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	12,609	67.10	846,063.90	
		NEWFIELD EXPLORATION CO	3,900	31.52	122,928.00	
		NOBLE CORP	7,698	33.36	256,805.28	
		NOBLE ENERGY INC	5,200	86.86	451,672.00	
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	24,120	81.66	1,969,639.20	
		PEABODY ENERGY CORP	7,900	28.00	221,200.00	
		PHILLIPS 66	18,750	31.32	587,250.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,200	98.76	316,032.00	
		PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,750	38.03	180,642.50	
		QEP RESOURCES INC	5,100	28.64	146,064.00	
		RANGE RESOURCES CORP	4,700	66.06	310,482.00	
		ROWAN COMPANIES PLC	3,600	30.95	111,420.00	
		SCHLUMBERGER LTD	39,897	67.25	2,683,073.25	
		SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,200	29.97	305,694.00	
		SUNOCO INC	3,400	48.60	165,240.00	
		SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,000	23.09	115,450.00	
		ULTRA PETROLEUM CORP	5,700	19.72	112,404.00	
		VALERO ENERGY CORP	16,468	22.05	363,119.40	
		WEATHERFORD INTL LTD	22,284	12.82	285,680.88	
		WHITING PETROLEUM CORP	3,400	47.45	161,330.00	
		WILLIAMS COS INC	17,384	31.67	550,551.28	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,190	82.88	513,027.20	
		AIRGAS INC	2,400	90.96	218,304.00	
		ALCOA INC	31,304	8.92	279,231.68	

ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	2,900	38.88	112,752.00
BALL CORP	5,300	40.48	214,544.00
CELANESE CORP-SERIES A	5,200	43.69	227,188.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,900	165.78	314,982.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	4,200	54.48	228,816.00
DOW CHEMICAL	35,033	31.67	1,109,495.11
DU PONT (E I) DE NEMOURS	27,399	50.84	1,392,965.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,600	48.25	221,950.00
ECOLAB INC	8,900	64.26	571,914.00
FREEPORT-MCMORAN COPPER	28,094	34.30	963,624.20
INTERNATIONAL PAPER CO	12,285	30.75	377,763.75
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,336	57.59	134,530.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,500	39.32	334,220.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,540	75.89	116,870.60
MEADWESTVACO CORP	4,928	27.85	137,244.80
MONSANTO CO	15,916	71.50	1,137,994.00
MOSAIC CO/THE	9,000	48.06	432,540.00
NEWMONT MINING CORP	14,653	44.67	654,549.51
NUCOR CORP	9,344	36.72	343,111.68
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	21.28	114,912.00
PPG INDUSTRIES INC	4,578	103.12	472,083.36
PRAXAIR INC	8,894	110.40	981,897.60
ROCK-TENN COMPANY -CL A	2,300	55.74	128,202.00
SEALED AIR CORP	5,254	17.54	92,155.16
SIGMA-ALDRICH	3,560	69.96	249,057.60
UNITED STATES STEEL CORP	4,840	25.53	123,565.20
VULCAN MATERIALS CO	3,751	39.03	146,401.53
WALTER ENERGY INC	2,300	61.59	141,657.00
WEYERHAEUSER CO	15,796	19.43	306,916.28
3M CO	19,776	85.83	1,697,374.08
AGCO CORP	3,200	42.77	136,864.00
AMETEK INC	5,300	49.76	263,728.00
BOEING CO	20,976	73.12	1,533,765.12
CATERPILLAR INC	19,220	93.60	1,798,992.00
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	4,672	59.02	275,741.44
COVIDIEN PLC	14,287	55.15	787,928.05
CUMMINS INC	5,400	103.66	559,764.00
DANAHER CORP	17,316	53.07	918,960.12
DEERE & CO	12,222	77.33	945,127.26
DOVER CORP	5,500	58.34	320,870.00
EATON CORP	9,408	44.22	416,021.76
EMERSON ELECTRIC CO	21,846	47.79	1,044,020.34
FASTENAL CO	8,300	43.43	360,469.00
FIRST SOLAR INC	2,100	16.16	33,936.00
FLOWSERVE CORP	1,800	111.06	199,908.00
FLUOR CORP	4,994	52.61	262,734.34
GENERAL DYNAMICS CORP	8,986	66.30	595,771.80
GENERAL ELECTRIC CO	313,902	18.60	5,838,577.20
GOODRICH CORP	3,700	124.88	462,056.00
GRAINGER (W W) INC	1,723	191.25	329,523.75
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	21,769	58.15	1,265,867.35
ILLINOIS TOOL WORKS	12,916	55.78	720,454.48
INGERSOLL-RAND PLC	9,141	43.29	395,713.89
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,700	38.25	141,525.00
JOY GLOBAL INC	3,100	63.67	197,377.00
KBR INC	4,300	28.72	123,496.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,300	70.35	232,155.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	8,157	85.20	694,976.40
MASCO CORP	11,970	13.50	161,595.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,300	60.11	438,803.00
PACCAR INC	9,475	39.39	373,220.25
PALL CORP	3,400	57.95	197,030.00
PARKER HANNIFIN CORP	4,466	85.11	380,101.26
PENTAIR INC	3,300	42.06	138,798.00

PRECISION CASTPARTS CORP	4,300	168.90	726,270.00
QUANTA SERVICES INC	5,900	22.90	135,110.00
RAYTHEON COMPANY	10,222	51.83	529,806.26
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,131	76.67	316,723.77
ROCKWELL COLLINS	4,417	51.85	229,021.45
ROPER INDUSTRIES INC	2,800	101.00	282,800.00
SPX CORP	1,700	76.98	130,866.00
TE CONNECTIVITY LTD	12,487	32.73	408,699.51
TEXTRON INC	8,084	23.63	191,024.92
TYCO INTERNATIONAL LTD	13,687	54.80	750,047.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	25,558	75.95	1,941,130.10
XYLEM INC	5,048	25.43	128,370.64
AVERY DENNISON CORP	3,298	30.20	99,599.60
CINTAS CORP	3,974	38.41	152,641.34
DUN&BRADSTREET CORP	1,600	68.04	108,864.00
EQUIFAX INC	3,498	46.12	161,327.76
MANPOWERGROUP	2,726	38.11	103,887.86
NIELSEN HOLDINGS NV	2,900	28.04	81,316.00
PITNEY BOWES INC	5,714	14.24	81,367.36
REPUBLIC SERVICES INC	8,645	25.73	222,435.85
ROBERT HARF INTL INC	4,744	29.17	138,382.48
STERICYCLE INC	2,400	81.45	195,480.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,058	22.61	136,971.38
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	4,400	48.69	214,236.00
WASTE MANAGEMENT INC	12,935	32.62	421,939.70
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,800	60.45	290,160.00
CSX CORP	31,086	21.54	669,592.44
DELTA AIR LINES INC	6,500	11.43	74,295.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,200	38.49	238,638.00
FEDEX CORPORATION	8,945	87.78	785,192.10
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	8,900	14.51	129,139.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,700	54.94	148,338.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	150,000	0.74	111,750.00
KANSAS CITY SOUTHERN	3,200	70.18	224,576.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,578	68.01	719,409.78
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	6,062	8.08	48,980.96
UNION PACIFIC CORP	14,362	111.07	1,595,187.34
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,500	24.00	60,000.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	21,515	76.21	1,639,658.15
AUTOLIV INC	2,600	59.22	153,972.00
BORGWARNER INC	3,200	76.32	244,224.00
FORD MOTOR COMPANY	105,045	10.32	1,084,064.40
GENERAL MOTORS CO	23,100	21.63	499,653.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	8,100	10.60	85,860.00
HARLEY-DAVIDSON INC	6,814	47.76	325,436.64
JOHNSON CONTROLS INC	20,116	31.76	638,884.16
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,000	41.49	124,470.00
COACH INC	8,600	67.15	577,490.00
DR HORTON INC	8,233	16.90	139,137.70
FOSSIL INC	1,600	77.24	123,584.00
GARMIN LTD	3,400	44.36	150,824.00
HASBRO INC	3,300	35.10	115,830.00
LEGGETT & PLATT INC	5,300	20.53	108,809.00
MATTEL INC	9,941	31.88	316,919.08
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,100	72.42	152,082.00
NEWELL RUBBERMAID INC	9,850	18.26	179,861.00
NIKE INC -CL B	10,492	107.47	1,127,575.24
RALPH LAUREN CORP	1,800	157.57	283,626.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,683	69.53	325,608.99
TOLL BROTHERS INC	4,800	26.78	128,544.00
VF CORP	2,629	138.88	365,115.52
WHIRLPOOL CORP	2,260	61.02	137,905.20
APOLLO GROUP INC CL A	3,400	31.93	108,562.00
CARNIVAL CORP	13,203	31.63	417,610.89

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	900	399.92	359,928.00
DARDEN RESTAURANTS INC	3,800	50.43	191,634.00
H&R BLOCK INC	8,824	14.59	128,742.16
INTL GAME TECHNOLOGY	8,608	14.70	126,537.60
LAS VEGAS SANDS CORP	10,800	49.30	532,440.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7,896	38.69	305,496.24
MCDONALD'S CORPORATION	30,435	90.88	2,765,932.80
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,900	11.14	110,286.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,800	25.48	122,304.00
STARBUCKS CORP	22,058	53.67	1,183,852.86
STARWOOD HOTELS & RESORTS WO	5,717	54.87	313,691.79
WYNN RESORTS LTD	2,400	108.09	259,416.00
YUM! BRANDS INC	13,626	69.81	951,231.06
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	7,800	12.36	96,408.00
CBS CORP-CL B	18,026	31.77	572,686.02
COMCAST CORP-CL A	62,110	28.90	1,794,979.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	19,215	28.64	550,317.60
DIRECTV-CLASS A	20,933	46.93	982,385.69
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,107	50.61	207,855.27
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,407	46.81	159,481.67
DISH NETWORK CORP-A	6,100	30.59	186,599.00
INTERPUBLIC GROUP COS INC	14,898	11.39	169,688.22
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,017	49.77	199,926.09
LIBERTY GLOBAL INC-C W/I	3,317	47.82	158,618.94
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	16,462	17.92	294,999.04
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	3,200	85.74	274,368.00
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	8,690	46.57	404,693.30
NEWS CORP CLASS B	12,853	20.41	262,329.73
NEWS CORP INC-CL A	50,994	20.14	1,027,019.16
OMNICOM GROUP	8,140	50.45	410,663.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,000	53.46	160,380.00
SIRIUS XM RADIO INC	117,300	2.02	236,946.00
THE WALT DISNEY CO	50,707	45.17	2,290,435.19
TIME WARNER CABLE	9,435	76.11	718,097.85
TIME WARNER INC	29,642	35.57	1,054,365.94
VIACOM INC-CL B	14,826	47.73	707,644.98
VIRGIN MEDIA INC	8,300	22.13	183,679.00
WASHINGTON POST-CL B	178	330.02	58,743.56
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	2,500	45.91	114,775.00
ADVANCE AUTO PARTS	2,400	82.34	197,616.00
AMAZON COM INC	10,844	222.93	2,417,452.92
AUTOZONE INC	670	377.62	253,005.40
BED BATH & NEYOND INC	7,201	71.02	511,415.02
BEST BUY COMPANY INC	9,031	19.56	176,646.36
CARMAX INC	6,574	28.70	188,673.80
DOLLAR GENERAL CORP	5,600	46.82	262,192.00
DOLLAR TREE INC	3,450	99.72	344,034.00
EBAY INC	34,436	40.25	1,386,049.00
EXPEDIA INC	3,700	41.40	153,180.00
FAMILY DOLLAR STORES	3,200	67.05	214,560.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,200	20.88	108,576.00
GAP INC	10,463	27.37	286,372.31
GENUINE PARTS CO	4,610	63.76	293,933.60
HOME DEPOT INC	45,758	49.88	2,282,409.04
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	4,700	33.54	157,638.00
KOHL'S CORP	7,121	47.26	336,538.46
LIMITED BRANDS INC	7,505	48.00	360,240.00
LOWE'S COMPANIES	37,350	29.56	1,104,066.00
MACY'S	12,414	36.68	455,345.52
NETFLIX INC	1,500	76.96	115,440.00
NORDSTROM INC	4,900	50.20	245,980.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	100.89	383,382.00
PETSMART INC	3,300	56.28	185,724.00
PRICELINE.COM INC	1,500	663.18	994,770.00

ROSS STORES INC	6,800	60.53	411,604.00
SEARS HOLDINGS CORP	1,560	52.71	82,227.60
SHERWIN-WILLIAMS CO	2,635	120.54	317,622.90
STAPLES INC	20,595	15.09	310,778.55
TARGET CORP	18,926	54.92	1,039,415.92
TIFFANY & CO	3,521	61.59	216,858.39
TJX COMPANIES INC	22,362	39.70	887,771.40
URBAN OUTFITTERS INC	3,500	27.02	94,570.00
COSTCO WHOLESALE CORP	12,889	84.30	1,086,542.70
CVS CAREMARK CORP	38,621	45.12	1,742,579.52
KROGER CO	16,729	22.52	376,737.08
SAFEWAY INC	9,978	18.91	188,683.98
SYSCO CORP	17,429	27.57	480,517.53
WAL-MART STORES INC	56,362	59.07	3,329,303.34
WALGREEN CO	25,954	32.85	852,588.90
WHOLE FOODS MARKET INC	4,500	87.45	393,525.00
ALTRIA GROUP INC	61,062	31.69	1,935,054.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19,769	33.05	653,365.45
BEAM INC	4,129	58.40	241,133.60
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	2,475	86.38	213,790.50
BUNGE LIMITED	4,300	62.52	268,836.00
CAMPBELL SOUP CO	5,547	34.44	191,038.68
COCA-COLA COMPANY	60,714	76.87	4,667,085.18
COCA-COLA ENTERPRISES	9,100	28.83	262,353.00
CONAGRA FOODS INC	12,181	25.61	311,955.41
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,100	19.32	98,532.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	6,314	40.81	257,674.34
GENERAL MILLS INC	19,064	39.16	746,546.24
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,400	25.13	110,572.00
HEINZ (H J) CO	9,466	54.92	519,872.72
HERSHEY CO/THE	4,800	69.00	331,200.00
HORMEL FOODS CORP	4,200	29.22	122,724.00
JM SMUCKER CO/THE COM	3,355	77.06	258,536.30
KELLOGG CO	7,400	50.96	377,104.00
KRAFT FOODS INC-A	49,842	39.04	1,945,831.68

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		LORILLARD INC	3,992	128.96	514,808.32	
		MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,500	56.70	198,450.00	
		MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,983	82.62	494,315.46	
		MOLSON COORS BREWING CO -B	5,200	40.93	212,836.00	
		MONSTER BEVERAGE CORP	4,300	70.84	304,612.00	
		PEPCICO INC	46,438	67.15	3,118,311.70	
		PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	51,662	85.39	4,411,418.18	
		RALCORP HOLDINGS INC	2,000	70.40	140,800.00	
		REYNOLDS AMERICAN INC	10,300	40.47	416,841.00	
		SARA LEE CORP	16,508	21.22	350,299.76	
		TYSON FOODS INC-CL A	8,700	19.41	168,867.00	
		AVON PRODUCTS INC	12,626	20.96	264,640.96	
		CHURCH & DWIGHT CO INC	4,200	53.19	223,398.00	
		CLOROX COMPANY	3,874	69.07	267,577.18	
		COLGATE-PALMOLIVE CO	14,400	99.01	1,425,744.00	
		CROWN HOLDINGS INC	5,100	36.17	184,467.00	
		ENERGIZER HOLDINGS INC-W/I	2,200	74.43	163,746.00	
		ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,900	57.44	396,336.00	
		HERBALIFE LTD	3,400	43.01	146,234.00	
		KIMBERLY-CLARK CORP	11,638	79.53	925,570.14	
		PROCTER & GAMBLE CO	81,818	63.58	5,201,988.44	
		AETNA INC-NEW	10,704	41.53	444,537.12	
		AMERISOURCEBERGEN CORP	8,200	36.65	300,530.00	
		BARD (C.R.) INC	2,500	100.61	251,525.00	
		BAXTER INTERNATIONAL INC	16,725	53.46	894,118.50	
		BECTON DICKINSON & CO	6,342	76.48	485,036.16	
		BOSTON SCIENTIFIC CORP	43,447	6.23	270,674.81	
		CARDINAL HEALTH INC	10,214	42.76	436,750.64	
		CAREFUSION CORP	6,507	25.50	165,928.50	
		CIGNA CORP	8,412	44.74	376,352.88	
		COVENTRY HEALTH CARE INC	4,150	30.08	124,832.00	
		DAVITA INC	2,700	81.99	221,373.00	
		DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,100	39.08	160,228.00	
		EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	22,893	54.42	1,245,837.06	
		HCA HOLDINGS INC	5,900	25.89	152,751.00	
		HENRY SCHEIN INC	3,000	75.91	227,730.00	
		HOLOGIC INC	7,644	17.60	134,534.40	
		HOSPIRA INC	4,802	32.74	157,217.48	
		HUMANA INC	4,800	77.77	373,296.00	
		INTUITIVE SURGICAL INC	1,150	550.56	633,144.00	
		LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,900	85.33	247,457.00	
		MCKESSON CORP	7,252	89.44	648,618.88	
		MEDTRONIC INC	31,336	38.09	1,193,588.24	
		OMNICARE INC	3,300	35.13	115,929.00	
		PATTERSON COS INC	3,600	33.23	119,628.00	
		QUEST DIAGNOSTICS	4,638	56.59	262,464.42	
		ST JUDE MEDICAL INC	9,416	39.69	373,721.04	
		STRYKER CORP	8,476	52.64	446,176.64	
		THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,228	52.54	589,919.12	
		UNITEDHEALTH GROUP INC	31,604	55.16	1,743,276.64	
		VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,300	63.87	210,771.00	
		WATERS CORPORATION	2,574	83.84	215,804.16	
		WELLPOINT INC	10,276	66.08	679,038.08	
		ZIMMER HOLDINGS INC	5,293	61.36	324,778.48	
		ABBOTT LABORATORIES	46,324	61.68	2,857,264.32	
		ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,500	86.02	473,110.00	
		ALLERGAN INC	9,000	91.60	824,400.00	
		AMGEN INC	23,525	70.20	1,651,455.00	
		BIOGEN IDEC INC	6,810	136.87	932,084.70	
		BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	50,303	32.91	1,655,471.73	
		CELGENE CORP	13,200	71.11	938,652.00	

COVANCE INC	2,200	45.39	99,858.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,300	84.07	277,431.00
FMC CORP	2,100	103.99	218,379.00
FOREST LABORATORIES INC	7,800	34.03	265,434.00
GILEAD SCIENCES INC	22,300	52.46	1,169,858.00
ILLUMINA INC	4,000	45.04	180,160.00
JOHNSON & JOHNSON	81,161	63.93	5,188,622.73
LIFE TECHNOLOGIES CORP	5,168	43.48	224,704.64
LILLY (ELI) & CO	30,949	40.93	1,266,742.57
LULULEMON ATHLETICA INC	2,900	72.23	209,467.00
MERCK & CO. INC.	90,592	38.23	3,463,332.16
MYLAN INC	12,500	21.42	267,750.00
PERRIGO CO	2,500	99.91	249,775.00
PFIZER INC	228,469	22.58	5,158,830.02
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,500	64.70	420,550.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	4,500	21.86	98,370.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	3,700	71.79	265,623.00
BANK OF AMERICA CORP	301,036	7.35	2,212,614.60
BB&T CORPORATION	20,600	31.14	641,484.00
CIT GROUP INC	6,300	36.45	229,635.00
COMERICA INC	5,758	30.52	175,734.16
FIFTH THIRD BANCORP	27,072	13.78	373,052.16
KEYCORP	27,893	7.67	213,939.31
M & T BANK CORP	3,300	83.84	276,672.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	12,700	12.79	162,433.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	10,400	11.92	123,968.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,567	64.26	1,000,335.42
REGIONS FINANCIAL CORP	36,784	6.46	237,624.64
SUNTRUST BANKS INC	15,767	23.01	362,798.67
US BANCORP	56,694	31.56	1,789,262.64
WELLS FARGO COMPANY	148,938	32.41	4,827,080.58
AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,022	58.42	1,812,305.24
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,624	49.66	328,947.84
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	35,860	21.40	767,404.00
BLACKROCK INC	3,100	176.49	547,119.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,785	52.31	773,403.35
CITIGROUP INC	86,905	28.14	2,445,506.70
CME GROUP INC	1,860	260.11	483,804.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,216	33.60	544,857.60
EATON VANCE CORP	4,400	24.76	108,944.00
FRANKLIN RESOURCES INC	4,600	113.79	523,434.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,908	99.77	1,387,601.16
HUDSON CITY BANCORP INC	15,600	6.26	97,656.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,100	123.14	258,594.00
INVESCO LTD	13,280	22.56	299,596.80
JPMORGAN CHASE & CO	112,918	35.79	4,041,335.22
LEGG MASON INC	3,850	22.72	87,472.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	6,000	22.31	133,860.00
MOODY'S CORP	5,836	37.88	221,067.68
MORGAN STANLEY	42,833	14.30	612,511.90
NASDAQ OMX GROUP/THE	4,500	23.56	106,020.00
NORTHERN TRUST CORP	6,321	44.19	279,324.99
NYSE EURONEXT INC	7,700	25.28	194,656.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	31,852	12.91	411,209.32
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,800	18.81	90,288.00
SLM CORP	14,900	13.63	203,087.00
STATE STREET CORP	14,524	42.44	616,398.56
T ROWE PRICE GROUP INC	7,500	59.49	446,175.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,300	17.51	110,313.00
ACE LTD	10,000	75.48	754,800.00
AFLAC INC	13,819	42.73	590,485.87
ALLEGHANY CORP	441	338.35	149,212.35
ALLSTATE CORP	14,885	34.40	512,044.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	16,425	31.30	514,102.50

AON PLC	8,615	47.83	412,055.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,900	38.66	150,774.00
ASSURANT INC	2,600	37.78	98,228.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,100	34.51	141,491.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,950	80.53	2,170,283.50
CHUBB CORP	8,170	73.26	598,534.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,440	35.56	157,886.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	102.37	163,792.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL-A	5,996	19.11	114,583.56
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	16,200	5.73	92,826.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,432	19.09	237,326.88
LINCOLN NATIONAL CORP	8,851	22.73	201,183.23
LOEWS CORP	9,296	40.11	372,862.56
MARSH & MCLENNAN COS	15,833	32.51	514,730.83
METLIFE INC	31,326	34.08	1,067,590.08
PARTNERRE LTD	1,900	73.25	139,175.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,900	24.58	218,762.00
PROGRESSIVE CORP	17,236	21.97	378,674.92
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,924	49.81	693,554.44
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	1,900	78.40	148,960.00
TORCHMARK CORP	3,550	47.61	169,015.50
TRAVELERS COS INC/THE	12,232	64.48	788,719.36
UNUM GROUP	8,483	21.33	180,942.39
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,800	35.48	170,304.00
WR BERKLEY CORP	3,400	38.75	131,750.00
XL GROUP PLC	10,100	21.77	219,877.00
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28,600	16.53	472,758.00
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,831	143.70	406,814.70
BOSTON PROPERTIES INC	4,400	107.52	473,088.00
CBRE GROUP INC	8,600	17.01	146,286.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,500	72.52	253,820.00
DUKE REALTY CORP	8,300	14.33	118,939.00
EQUITY RESIDENTIAL	8,800	62.73	552,024.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,800	100.47	180,846.00
GENERAL GROWTH PROPERTIES	13,903	17.69	245,944.07
HCP INC	12,000	41.26	495,120.00
HEALTH CARE REIT INC	6,600	55.83	368,478.00
HOST HOTELS & RESORTS INC	20,757	15.67	325,262.19
KIMCO REALTY CORP	11,900	19.24	228,956.00
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,900	36.07	140,673.00
MACERICH CO/THE	3,900	59.61	232,479.00
PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,700	38.34	180,198.00
PROLOGIS INC	13,472	33.76	454,814.72
PUBLIC STORAGE	4,300	136.96	588,928.00
RAYONIER INC	3,500	44.29	155,015.00
REGENCY CENTERS CORP	3,000	46.75	140,250.00
SIMON PROPERTY GROUP INC	8,669	154.46	1,339,013.74
VENTAS INC	8,500	58.49	497,165.00
VORNADO REALTY TRUST	4,927	87.01	428,698.27
*NEW CA INC	11,584	26.09	302,226.56
ACCENTURE PLC-CL A	19,000	58.81	1,117,390.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	15,000	12.64	189,600.00
ADOBE SYSTEMS INC	14,500	32.23	467,335.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,900	29.66	174,994.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,600	126.10	201,760.00
AUTODESK INC	6,600	35.93	237,138.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,485	53.40	773,499.00
BMC SOFTWARE INC	5,628	43.92	247,181.76
CERNER CORP	4,200	79.23	332,766.00
CITRIX SYSTEMS INC	5,498	78.19	429,888.62
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	8,900	60.04	534,356.00
COMPUTER SCIENCES CORP	4,436	26.59	117,953.24
ELECTRONIC ARTS INC	9,612	14.38	138,220.56
F5 NETWORKS INC	2,300	125.53	288,719.00

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	7,927	32.49	257,548.23
FISERV INC	4,121	66.04	272,150.84
GOOGLE INC-CL A	7,590	604.00	4,584,360.00
IHS INC-CLASS A	1,200	96.33	115,596.00
INTUIT INC	8,316	55.35	460,290.60
IRON MOUNTAIN INC	4,450	30.63	136,303.50
MASTERCARD INC-CLASS A	3,220	414.44	1,334,496.80
MICROSOFT CORP	225,156	30.68	6,907,786.08
NUANCE COMMUNICATIONS INC	7,000	22.58	158,060.00
ORACLE CORPORATION	119,956	26.96	3,234,013.76
PAYCHEX INC	9,557	29.89	285,658.73
RED HAT INC	5,700	55.91	318,687.00
SAIC INC	7,800	11.09	86,502.00
SALESFORCE.COM INC	3,800	136.55	518,890.00
SYMANTEC CORP	21,700	15.25	330,925.00
SYNOPSYS INC	4,100	29.19	119,679.00
VERISIGN INC	4,926	39.76	195,857.76
VISA INC-CLASS A SHARES	15,510	116.72	1,810,327.20
VMWARE INC-CLASS A	2,500	100.67	251,675.00
WESTERN UNION CO	18,160	17.32	314,531.20
YAHOO! INC	34,782	15.50	539,121.00
*NEW-MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	8,358	39.35	328,887.30
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,196	38.90	396,624.40
AMPHENOL CORP-CL A	4,900	53.46	261,954.00
APPLE INC	27,670	558.22	15,445,947.40
ARROW ELECTRONICS INC	3,900	36.66	142,974.00
AVNET INC	4,300	33.03	142,029.00
CISCO SYSTEMS INC	159,739	16.70	2,667,641.30
CORNING INC	46,460	13.31	618,382.60
DELL INC	47,821	15.44	738,356.24
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	1,600	44.82	71,712.00
EMC CORP/MASS	60,525	26.10	1,579,702.50
FLEXTRONICS INTL LTD	22,962	6.59	151,319.58
FLIR SYSTEMS INC	4,500	21.08	94,860.00
HARRIS CORP	4,000	40.66	162,640.00
HEWLETT-PACKARD CO.	58,967	22.98	1,355,061.66
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,005	199.44	6,981,397.20
JUNIPER NETWORKS INC	15,500	17.57	272,335.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,195	48.85	400,325.75
NETAPP INC	10,898	35.79	390,039.42
QUALCOMM INC	49,936	61.46	3,069,066.56

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
		SANDISK CORP	7,100	35.79	254,109.00	
		SEAGATE TECHNOLOGY	12,300	31.37	385,851.00	
		TERADATA CORP	4,900	69.60	341,040.00	
		WESTERN DIGITAL CORP	7,400	39.93	295,482.00	
		XEROX CORP	40,799	7.69	313,744.31	
		ALLIANT ENERGY CORP	3,200	44.77	143,264.00	
		AMERICAN TOWER CORP	11,600	67.20	779,520.00	
		AT&T INC	176,194	33.53	5,907,784.82	
		CENTURYLINK INC	18,303	39.15	716,562.45	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,400	54.38	456,792.00	
		FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	28,658	3.33	95,431.14	
		LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	4,960	23.88	118,444.80	
		METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,100	6.73	54,513.00	
		NII HOLDINGS INC	6,300	12.43	78,309.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,400	51.91	176,494.00	
		SPRINT NEXTEL CORP	93,063	2.50	232,657.50	
		VERIZON COMMUNICATIONS	84,098	40.89	3,438,767.22	
		WINDSTREAM CORP	18,900	9.68	182,952.00	
		*NEW SPECTRA ENERGY CORP	19,177	29.57	567,063.89	
		AES CORPORATION	19,100	12.22	233,402.00	
		AMEREN CORPORATION	7,072	32.60	230,547.20	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	14,277	38.26	546,238.02	
		AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,100	33.86	172,686.00	
		CENTRPOINT ENERGY INC	12,500	20.08	251,000.00	
		CONSOLIDATED EDISON INC	8,638	59.02	509,814.76	
		DOMINION RESOURCES INC/VA	16,826	52.27	879,495.02	
		DTE ENERGY COMPANY	4,927	56.28	277,291.56	
		DUKE ENERGY CORP	39,455	21.69	855,778.95	
		EDISON INTERNATIONAL	9,079	44.31	402,290.49	
		ENERGEN CORP	2,100	45.16	94,836.00	
		ENTERGY CORP	5,219	64.26	335,372.94	
		EQT CORP	4,100	48.76	199,916.00	
		EXELON CORPORATION	25,231	38.82	979,467.42	
		FIRSTENERGY CORP	12,393	47.91	593,748.63	
		INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,300	53.89	123,947.00	
		MDU RESOURCES GROUP INC	5,400	22.97	124,038.00	
		NEXTERA ENERGY INC	11,844	65.70	778,150.80	
		NISOURCE INC	8,214	25.12	206,335.68	
		NORTHEAST UTILITIES	9,136	36.20	330,723.20	
		NRG ENERGY INC	6,600	16.07	106,062.00	
		ONEOK INC	2,900	84.61	245,369.00	
		P G & E CORPORATION	12,009	44.08	529,356.72	
		PEPCO HOLDINGS INC	6,500	18.86	122,590.00	
		PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	48.45	155,040.00	
		PPL CORPORATION	17,028	27.38	466,226.64	
		PROGRESS ENERGY INC	8,679	54.83	475,869.57	
		PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,966	31.82	476,218.12	
		SCANA CORP	3,600	46.65	167,940.00	
		SEMPRA ENERGY	6,665	64.74	431,492.10	
		SOUTHERN CO	25,523	45.45	1,160,020.35	
		URS CORP	2,900	38.69	112,201.00	
		WISCONSIN ENERGY CORP	6,800	37.25	253,300.00	
		XCEL ENERGY INC	14,300	27.49	393,107.00	
		ADVANCED MICTO DEVICED	19,311	6.75	130,349.25	
		ALTERA CORPORATION	9,400	33.77	317,438.00	
		ANALOG DEVICES	8,736	37.19	324,891.84	
		APPLIED MATERIALS INC	38,852	10.95	425,429.40	
		AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,900	31.13	214,797.00	
		BROADCOM CORP-CL A	14,333	33.05	473,705.65	
		CREE INC	4,000	31.15	124,600.00	
		INTEL CORP	151,357	27.02	4,089,666.14	

	KLA-TENCOR CORPORATION	4,870	49.98	243,402.60	
	LAM RESEARCH CORP	3,500	41.20	144,200.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,070	30.42	215,069.40	
	LSI CORP	18,100	7.72	139,732.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	15,100	13.53	204,303.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,500	26.62	226,270.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,600	31.70	177,520.00	
	MICRON TECHNOLOGY	29,427	6.21	182,741.67	
	NVIDIA CORP	17,900	13.13	235,027.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	33,909	30.65	1,039,310.85	
	XILINX INC	7,726	32.96	254,648.96	
計	銘柄数：586			372,830,737.15	
				(29,804,089,127)	
	組入時価比率：57.2%			59.2%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	8,800	19.62	172,656.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	8,618	10.91	94,022.38	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,400	47.12	160,208.00	
	CAMECO CORP	11,606	21.14	245,350.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	32,464	30.25	982,036.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	14,200	20.98	297,916.00	
	CENOVUS ENERGY INC	22,266	32.10	714,738.60	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	8,400	41.16	345,744.00	
	ENBRIDGE INC	21,968	40.15	882,015.20	
	ENCANA CORP	21,666	20.56	445,452.96	
	ENERPLUS CORP	6,600	15.43	101,838.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,800	40.39	153,482.00	
	HUSKY ENERGY INC	9,828	23.68	232,727.04	
	IMPERIAL OIL LTD	8,712	42.14	367,123.68	
	MEG ENERGY CORP	3,600	38.55	138,780.00	
	NEXEN INC	15,552	16.52	256,919.04	
	NIKO RESOURCES LTD	1,500	35.97	53,955.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	8,000	27.10	216,800.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,900	30.39	240,081.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	12,000	8.13	97,560.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,836	14.29	197,716.44	
	PRECISION DRILLING CORP	7,600	7.86	59,736.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	6,700	11.09	74,303.00	
	SUNCOR ENERGY INC	46,743	27.99	1,308,336.57	
	TALISMAN ENERGY INC	30,432	10.31	313,753.92	
	TOURMALINE OIL CORP	4,500	24.33	109,485.00	
	TRANSCANADA CORPORATION	20,843	42.65	888,953.95	
	VERMILION ENERGY INC	2,600	44.70	116,220.00	
	AGNCIO-EAGLE MINES LTD	5,000	35.82	179,100.00	
	AGRIUM INC	4,603	81.05	373,073.15	
	BARRICK GOLD CORP	29,704	36.65	1,088,651.60	
	CENTERRA GOLD INC	6,100	9.74	59,414.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	18,900	10.93	206,577.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,000	17.35	242,900.00	
	GOLDCORP INC	24,042	33.62	808,292.04	
	IAMGOLD CORP	10,900	10.04	109,436.00	
	INMET MINING CORPORATION	1,900	46.43	88,217.00	
	IVANHOE MINES LTD	9,700	9.19	89,143.00	
	KINROSS GOLD CORP	33,469	7.73	258,715.37	
	NEW GOLD INC	12,300	7.69	94,587.00	
	OSISKO MINING CORP	10,000	6.47	64,700.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	3,800	15.96	60,648.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	25,368	40.28	1,021,823.04	
	SILVER WHEATON CORP	10,400	24.48	254,592.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,175	31.70	544,447.50	
	YAMANA GOLD INC	21,958	13.13	288,308.54	
	BOMBARDIER INC 'B'	43,050	3.80	163,590.00	
	CAE INC	9,406	10.14	95,376.84	
	FINNING INTERNATIONAL INC	5,000	25.39	126,950.00	
	SNC-LAVALIN GROUP	4,400	36.71	161,524.00	

RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	2,900	20.49	59,421.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	13,170	81.93	1,079,018.10	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,028	73.13	367,697.64	
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,230	42.25	263,217.50	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,200	25.10	105,420.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	11,864	35.50	421,172.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,986	19.11	209,942.46	
THOMSON REUTERS CORP	10,986	29.05	319,143.30	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,305	68.15	157,085.75	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	3,400	42.56	144,704.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	57.83	57,830.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,270	32.48	106,209.60	
METRO INC	3,300	52.86	174,438.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	6,300	41.27	260,001.00	
VITERRA INC	10,800	16.00	172,800.00	
WESTON (GEORGE) LTD	1,427	59.74	85,248.98	
SAPUTO INC	4,600	44.07	202,722.00	
TIM HORTONS INC	4,660	54.95	256,067.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	8,324	51.20	426,188.80	
BANK OF MONTREAL	18,953	55.99	1,061,178.47	
BANK OF NOVA SCOTIA	32,292	52.50	1,695,330.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,900	71.67	852,873.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,708	73.30	345,096.40	
ROYAL BANK OF CANADA	42,686	53.22	2,271,748.92	
TORONTO-DOMINION BANK	26,786	79.93	2,141,004.98	
BONAVISTA ENERGY CORP	5,300	17.90	94,870.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	16,538	32.39	535,665.82	
CI FINANCIAL CORP	4,496	22.28	100,170.88	
IGM FINANCIAL INC	3,446	43.03	148,281.38	
POWER CORP OF CANADA	10,230	24.52	250,839.60	
POWER FINANCIAL CORP	8,166	26.89	219,583.74	
TMX GROUP INC	3,300	47.10	155,430.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	628	410.00	257,480.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,318	22.24	184,992.32	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,100	26.85	83,235.00	
INTACT FINANCIAL CORP	3,800	64.38	244,644.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	53,042	12.00	636,504.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,213	22.89	394,005.57	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	7,275	18.19	132,332.25	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,600	24.31	63,206.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	27.59	129,673.00	
CGI GROUP INC	6,618	20.94	138,580.92	
OPEN TEXT CORP	1,600	50.60	80,960.00	
ONEX CORPORATION	2,606	38.51	100,357.06	
RESEARCH IN MOTION	13,700	11.85	162,345.00	
BCE INC	7,499	40.41	303,034.59	
BELL ALIANT INC	2,700	26.24	70,848.00	
FORTIS INC	5,400	33.72	182,088.00	
TELUS CORP	2,000	59.99	119,980.00	
TELUS CORPORATION	4,369	58.50	255,586.50	
CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	71.08	177,700.00	
TRANSALTA CORP	6,092	16.66	101,492.72	
計	銘柄数：102		34,207,421.95	
			(2,727,357,752)	
	組入時価比率：5.2%			5.4%

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	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,155	18.69	77,656.95	
		ENEL GREEN POWER SPA	49,940	1.27	63,473.74	
		ENI SPA	71,331	16.46	1,174,108.26	
		FUGRO NV-CVA	2,000	48.66	97,320.00	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	6,658	10.49	69,842.42	
		NESTE OIL OYJ	3,702	7.88	29,190.27	
		OMV AG	4,760	23.53	112,002.80	
		REPSOL SA	23,451	13.80	323,623.80	
		SAIPEM	7,797	33.34	259,951.98	
		SBM OFFSHORE NV	6,203	12.09	75,025.28	
		TECHNIP S.A.	2,916	75.56	220,332.96	
		TENARIS SA	13,854	13.45	186,336.30	
		TOTAL SA	63,080	34.47	2,174,367.60	
		ACER INOX SA	2,890	8.71	25,171.90	
		AIR LIQUIDE	8,411	93.83	789,204.13	
		AKZO NOBEL	6,913	37.99	262,659.43	
		ARCELORMITTAL	25,343	12.06	305,636.58	
		ARKEMA	1,604	58.65	94,074.60	
		BASF SE	27,280	57.69	1,573,783.20	
		BAYER AG	24,547	51.51	1,264,415.97	
		CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL	5,897	5.49	32,374.53	
		CRH PLC	21,200	13.90	294,680.00	
		ENSO OY-R SHS	16,768	4.65	78,105.34	
		HEIDELBERGCEMENT AG	4,111	36.51	150,121.38	
		IMERYS	1,233	37.45	46,175.85	
		K+S AG	5,041	35.10	176,959.26	
		KONINKLIJKE DSM NV	4,516	41.60	187,888.18	
		LAFARGE	5,898	29.26	172,604.97	
		LANXESS	2,419	58.16	140,689.04	
		LINDE AG	5,057	123.91	626,628.04	
		SALZGITTER AG	1,421	35.50	50,445.50	
		SOLVAY SA	1,810	88.19	159,623.90	
		THYSSENKRUPP AG	11,322	15.82	179,204.61	
		UMICORE	3,316	37.89	125,659.82	
		UPM-KYMMENE OYJ	16,078	8.81	141,727.57	
		VOESTALPINE AG	3,154	21.90	69,072.60	
		WACKER CHEMIE AG	475	58.73	27,896.75	
		ACCIONA S.A.	928	46.50	43,152.00	
		ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,071	13.29	54,123.94	
		ALSTOM	6,042	23.95	144,705.90	
		BEKAERT NV	1,196	22.85	27,328.60	
		BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,582	25.58	66,047.56	
		BRENTAG AG	1,232	90.94	112,038.08	
		COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,865	30.20	358,323.00	
EIFFAGE	1,188	26.97	32,040.36			
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	12,099	28.72	347,543.77			
FIAT INDUSTRIAL	22,380	7.68	171,878.40			
FINMECCANICA SPA	14,875	2.77	41,293.00			
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	1,831	11.22	20,552.97			
GEA GROUP AG	5,077	21.20	107,647.63			
HOCHTIEF AG	1,554	40.34	62,688.36			
KONE OYJ	4,562	45.62	208,118.44			
LEGRAND SA	6,548	25.80	168,938.40			
MAN SE	1,854	82.28	152,558.24			
METSO OYJ	3,716	29.37	109,138.92			
PIRELLI & C.	7,540	8.97	67,633.80			
PRYSMIAN SPA	5,839	11.21	65,455.19			
SAFRAN SA	4,846	27.10	131,326.60			
SCHNEIDER ELECTRIC SA	14,504	42.67	618,958.20			
SIEMENS AG	24,438	67.25	1,643,455.50			
THALES SA	2,901	24.52	71,147.02			

VALLOUREC	3,306	34.56	114,255.36
VINCI SA	13,372	33.92	453,578.24
WARTSILA OYJ	4,874	29.03	141,492.22
WENDEL	1,062	56.48	59,981.76
ZARDOYA OTIS SA	5,334	8.78	46,832.52
BIC	1,067	83.04	88,603.68
BUREAU VERITAS SA	1,578	67.74	106,893.72
EDENRED	4,563	23.16	105,679.08
RANDSTAD HOLDING NV	3,454	23.35	80,668.17
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	11,755	11.38	133,771.90
ADP	1,271	60.93	77,442.03
ATLANTIA SPA	9,133	11.07	101,102.31
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	8,426	9.02	76,010.94
DEUTSCHE POST AG	24,961	13.55	338,371.31
FERROVIAL SA	10,580	8.38	88,723.88
FRAPORT AG	1,343	42.62	57,238.66
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	33,911	2.00	67,822.00
RYANAIR HOLDINGS PLC	3,762	4.33	16,308.27
TNT EXPRESS NV - W/I	10,174	9.08	92,379.92
VOPAK	2,022	47.42	95,883.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,807	66.61	653,273.69
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,914	45.16	86,438.15
CONTINENTAL AG	2,337	68.55	160,201.35
DAIMLER AG	26,901	38.59	1,038,270.99
FIAT SPA	22,100	3.44	76,200.80
MICHELIN (CGDE)-B	5,300	52.52	278,356.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,192	36.10	115,231.20
PEUGEOT SA	5,608	8.42	47,247.40
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	4,493	42.90	192,749.70
RENAULT SA	5,646	31.86	179,881.56
VOLKSWAGEN AG	854	124.00	105,896.00
VOLKSWAGEN AG PFD	4,280	134.90	577,372.00
ADIDAS AG	6,173	60.09	370,935.57
CHRISTIAN DIOR	1,596	109.50	174,762.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,362	27.10	91,110.20
LVMH	7,530	121.05	911,506.50
PHILIPS ELECTRONICS NV	29,822	14.60	435,401.20
ACCOR SA	4,274	25.14	107,469.73
AUTOGRILL SPA	3,284	7.48	24,580.74
GREEK ORG OF FOOTBALL PROGNO	7,175	5.15	36,951.25
SODEXO	2,754	59.91	164,992.14
*NEW WOLTERS KLUWER	8,762	12.40	108,648.80
AXEL SPRINGER AG	1,178	34.35	40,464.30
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,661	23.41	85,704.01
JC DECAUX SA	2,408	19.05	45,884.44
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,612	45.88	119,838.56
LAGARDERE S C A	3,379	21.14	71,432.06
MEDIASET SPA	25,901	1.49	38,670.19
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,299	18.87	43,395.92
PUBLICIS GROUPE	4,241	37.49	159,016.29
REED ELSEVIER NV	20,135	8.87	178,597.45
SANOMA OYJ	1,843	7.08	13,057.65
SES	8,750	18.50	161,875.00
TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	3,533	7.13	25,193.82
VIVENDI SA	38,114	12.43	473,757.02
INDITEX	6,446	67.47	434,911.62
PPR	2,241	121.20	271,609.20
CARREFOUR SA	17,017	14.00	238,238.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,603	71.98	115,383.94
COLRUYT SA	2,789	31.58	88,076.62
DELHAIZE GROUP	2,952	31.44	92,810.88
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	21,128	3.64	77,053.81
JERONIMO MARTINS	6,339	13.95	88,429.05
KESKO OYJ-B SHS	2,162	20.11	43,477.82

KONINKLIJKE AHOLD NV	34,272	9.40	322,430.97
METRO AG	3,752	23.10	86,693.71
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	23,829	55.47	1,321,794.63
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	5,231	12.49	65,335.19
DANONE	17,316	52.24	904,587.84
HEINEKEN HOLDING NV	3,340	34.71	115,931.40
HEINEKEN NV	7,638	41.09	313,883.61
KERRY GROUP PLC-A	4,231	33.30	140,892.30
PERNOD-RICARD SA	5,869	78.69	461,831.61
SUEDZUCKER AG	2,086	22.44	46,820.27
UNILEVER NV-CVA	48,346	25.93	1,253,611.78
BEIERSDORF AG	2,937	52.05	152,897.28
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,242	55.03	288,467.26
HENKEL AG + CO KGAA	3,797	45.74	173,674.78
L OREAL	7,118	91.03	647,951.54
CELESION AG NAMON	2,457	12.94	31,793.58
ESSILOR INTERNATIONAL	5,934	68.82	408,377.88
FRESENIUS MEDICAL CARE	6,182	52.37	323,788.43
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,344	76.10	254,478.40
ELAN CORPORATION PLC	14,581	10.29	150,038.49
GRIFOLS SA	5,078	18.49	93,892.22
MERCK KGAA	2,133	78.11	166,621.42
ORION OYJ	3,430	14.94	51,244.20
QIAGEN N.V.	6,692	13.14	87,966.34
SANOFI	33,843	54.87	1,856,965.41
UCB SA	2,907	37.99	110,451.46
BANCA CARIGE SPA	18,215	0.81	14,845.22
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	157,184	0.24	38,227.14
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	138,107	5.04	697,164.13
BANCO DE SABADELL SA	41,094	1.57	64,846.33
BANCO ESPRITO SANTO-REG	15,299	0.60	9,317.09
BANCO POPOLARE SPA	50,602	0.97	49,336.95
BANCO POPULAR ESPANOL	35,953	2.03	73,200.30
BANCO SANTANDER SA	254,892	4.72	1,203,854.91
BANKIA SAU	24,731	1.88	46,642.66
BANKINTER SA	9,501	3.30	31,362.80
BNP PARIBAS	28,663	27.62	791,672.06
COMMERZBANK AG	106,550	1.51	161,742.90
CREDIT AGRICOLE	29,101	3.27	95,189.37
ERSTE GROUP BANK AG	5,525	15.45	85,361.25
INTESA SANPAOLO	297,704	1.03	307,528.23
INTESA SANPAOLO-RNC	27,198	0.89	24,464.60
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	9,736	0.21	2,112.71
KBC GROUP	4,626	13.05	60,369.30
NATIONAL BANK OF GREECE	35,267	1.46	51,489.82
NATIXIS	32,069	2.02	64,971.79
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,324	23.68	31,352.32
SOCIETE GENERAL-A	19,501	16.49	321,668.99
UBI BANCA SCPA	23,290	2.43	56,641.28
UNICREDIT SPA	119,660	2.67	319,970.84
AGEAS	63,947	1.30	83,131.10
CAIXABANK	26,897	2.35	63,315.53
DEUTSCHE BANK AG -REG	27,570	30.00	827,100.00
DEUTSCHE BOERSE AG	5,738	45.07	258,611.66
EURAZEO	802	34.68	27,813.36
EXOR SPA	1,886	16.27	30,685.22
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,415	50.93	122,995.95
ING GROEP N V	113,505	4.91	557,423.05
MEDIOBANCA SPA	14,732	3.16	46,612.04
POHJOLA BANK PLC	4,982	8.63	42,994.66
AEGON NV	50,352	3.48	175,275.31
ALLIANZ SE-REG	13,488	76.91	1,037,429.52
ASSICURAZIONI GENERALI	34,496	9.26	319,605.44
AXA	51,526	9.51	490,063.78

CNP ASSURANCES	4,756	9.59	45,633.82
DELTA LLOYD NV	3,634	11.59	42,118.06
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	2,214	43.59	96,508.26
MAPFRE SA	27,557	1.96	54,259.73
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,308	103.88	551,442.81
SAMPO OYJ-A SHS	12,352	19.58	241,852.16
SCOR SE	4,991	18.80	93,830.80
VIENNA INSURANCE GROUP WIENER STAEDTICHE	1,146	28.75	32,953.23
*NEW-IMMOEAST AG-TEMP	12,296	-	-
CORIO NV	2,203	33.35	73,470.05
FONCIERE DES REGIONS	866	53.03	45,923.98
GECINA SA	697	67.59	47,110.23
ICADE	739	60.50	44,709.50
IMMOFINANZ AG	34,528	2.57	88,909.60
KLEPIERRE	2,989	23.83	71,227.87
UNIBAIL-RODAMCO SE	2,715	133.80	363,267.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	9,111	15.18	138,350.53
ATOS	1,611	45.43	73,187.73
CAP GEMINI SA	4,479	28.39	127,181.20
DASSAULT SYSTEMES SA	1,712	71.35	122,151.20
INDRA SISTEMAS SA	2,967	7.60	22,558.10
SAP AG	27,317	48.79	1,332,987.64
UNITEDINTERNET AG-REG SHARE	4,094	14.52	59,444.88
ALCATEL-LUCENT	67,295	1.16	78,398.67
NEOPOST SA	1,180	42.81	50,521.70
NOKIA OYJ	110,607	2.33	258,156.73
BELGACOM SA	4,394	21.92	96,338.45
BOUYGUES SA	6,196	20.35	126,088.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	83,218	8.81	733,317.01
ELISA CORPORATION CLASS A	5,196	16.34	84,902.64
FRANCE TELECOM SA	54,892	10.14	556,879.34
HELLNIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,900	1.93	13,317.00
ILIAD SA	699	98.61	68,928.39
KONINKLIJKE KPN NV	43,584	7.76	338,342.59
MOBISTAR SA	923	29.12	26,882.37
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	19,234	4.12	79,378.71
TELECOM ITALIA SPA	275,828	0.79	219,145.34
TELECOM ITALIA-RNC	174,874	0.66	115,679.15
TELEFONICA SA	121,962	10.89	1,328,166.18
TELEKOM AUSTRIA AG	9,531	7.88	75,151.93
A2A SPA	32,882	0.54	17,937.13
E.ON AG	53,398	15.52	828,736.96
EDP RENOVAVEIS SA	6,262	3.44	21,541.28
ELECTRICITE DE FRANCE	6,986	15.89	111,042.47
ENAGAS	5,117	13.27	67,902.59
ENEL SPA	194,756	2.43	473,257.08
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	55,399	2.04	113,013.96
FORTUM OYJ	13,051	15.79	206,075.29
GAS NATURAL SDG-E	10,081	10.03	101,162.83
GDF SUEZ	36,694	16.65	611,138.57
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	15,815	5.97	94,415.55
IBERDROLA SA	113,056	3.40	385,068.73
RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,135	30.78	96,510.97
RWE AG	14,473	31.12	450,399.76
RWE AG-NON VTG PFD	1,158	28.47	32,969.41
SNAM SPA	46,983	3.41	160,399.96
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,064	9.58	77,293.44
TERNA SPA	34,814	2.74	95,459.98
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10,564	10.17	107,488.70
VERBUND AG	2,479	19.64	48,687.56
ASML HOLDING NV	12,746	36.71	467,905.66
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,923	6.66	212,798.71
STMICROELECTRONS NV	18,437	3.86	71,222.13

計	銘柄数：252			59,241,436.73	
				(6,076,394,165)	
	組入時価比率：11.7%			12.1%	

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
	ポンド	BG GROUP PLC	100,800	12.90	1,300,320.00	
		BP PLC	563,666	4.03	2,276,646.97	
		ESSAR ENERGY PLC	9,621	1.24	12,016.62	
		PETROFAC LTD	7,909	15.63	123,617.67	
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	108,220	20.15	2,180,633.00	
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	79,094	20.90	1,653,460.07	
		TULLOW OIL PLC	26,737	13.93	372,446.41	
		ANGLO AMERICAN PLC	39,274	21.19	832,216.06	
		ANTOFAGASTA PLC	11,526	10.16	117,104.16	
		BHP BILLITON PLC	62,711	17.98	1,127,543.78	
		EURASIAN NATURAL RESOURCES	8,431	4.92	41,547.96	
		GLENCORE INTERNATIONAL PLC	40,579	3.71	150,913.30	
		JOHNSON MATTHEY PLC	6,280	21.81	136,966.80	
		KAZAKHMYS PLC	6,063	7.37	44,684.31	
		LONMIN PLC	5,943	8.54	50,753.22	
		RANDGOLD RESOURCES LTD	2,691	47.03	126,557.73	
		REXAM PLC	25,484	3.97	101,400.83	
		RIO TINTO PLC - REG	40,739	30.43	1,239,687.77	
		VEDANTA RESOURCES PLC	3,836	10.53	40,393.08	
		XSTRATA PLC	61,522	10.13	623,217.86	
		AMEC PLC	9,664	10.11	97,703.04	
		BAE SYSTEMS PLC	95,635	2.74	262,613.71	
		BALFOUR BEATTY PLC	25,202	2.60	65,525.20	
		BUNZL PLC	9,580	10.15	97,237.00	
		COBHAM PLC	30,909	2.16	66,887.07	
		FRESNILLO PLC	5,194	13.81	71,729.14	
		INVENSYS PLC	29,771	2.09	62,221.39	
		MEGGITT PLC	22,525	3.88	87,554.67	
		ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	55,394	8.29	459,216.26	
		ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C ENT S	5,871,764	-	5,871.76	
		SMITHS GROUP PLC	11,910	10.26	122,196.60	
		WEIR GROUP PLC/THE	6,159	15.10	93,000.90	
		WOLSELEY PLC	8,374	22.39	187,493.86	
		AGGREKO PLC	7,823	21.62	169,133.26	
		BABCOCK INTL GROUP PLC	10,348	7.99	82,680.52	
		CAPITA PLC	18,797	6.44	121,146.66	
		G4S PLC	41,063	2.66	109,556.08	
		INTERTEK GROUP PLC	4,662	24.78	115,524.36	
		SERCO GROUP PLC	14,305	5.39	77,175.47	
		STANDARD LIFE PLC	68,949	2.08	143,689.71	
		GKN PLC	45,019	1.90	85,536.10	
		*NEW WHITBREAD PLC	5,125	18.87	96,708.75	
		CARNIVAL PLC	5,880	19.67	115,659.60	
		COMPASS GROUP PLC	56,134	6.29	353,363.53	
		INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	8,469	14.71	124,578.99	
		TUI TRAVEL PLC	14,489	1.77	25,761.44	
		BRITISH SKY BROADCASTING PLC	33,507	6.93	232,371.04	
		ITV PLC	106,961	0.82	88,242.82	
		PEARSON PLC	24,055	11.59	278,797.45	
		REED ELSEVIER PLC	35,731	5.01	179,012.31	
		WPP PLC	37,229	8.02	298,762.72	
		BURBERRY GROUP PLC	12,886	14.45	186,202.70	
		EXPERIAN PLC	29,633	9.21	272,919.93	
		KINGFISHER PLC	69,466	2.83	196,658.24	
		MARKS & SPENCER PLC	46,458	3.51	163,206.95	
		NEXT PLC	5,035	29.85	150,294.75	
		MORRISON (WM)SUPERMAKETS	63,690	2.78	177,631.41	
		SAINSBURY (J) PLC	35,463	3.13	111,318.35	
		TESCO PLC	237,735	3.18	757,780.31	
		ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,757	12.13	142,612.41	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	58,517	31.03	1,816,075.09	

DIAGEO PLC	74,165	15.45	1,145,849.25	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	29,888	24.99	746,901.12	
SABMILLER PLC	28,283	24.96	706,085.09	
TATE & LYLE PLC	13,554	6.90	93,522.60	
UNILEVER PLC	38,062	20.73	789,025.26	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	18,353	34.30	629,507.90	
SMITH & NEPHEW PLC	26,174	5.97	156,258.78	
ASTRAZENECA PLC	38,675	26.60	1,028,755.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	150,007	14.19	2,129,349.36	
SHIRE PLC	16,619	20.18	335,371.42	
BARCLAYS PLC	343,646	1.89	652,240.10	
HSBC HOLDINGS PLC	531,140	5.45	2,898,962.12	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,219,395	0.29	358,258.25	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	518,660	0.21	113,327.21	
STANDARD CHARTERED PLC	70,689	13.67	966,672.07	
3I GROUP PLC	35,672	1.83	65,386.77	
ICAP PLC	15,745	3.44	54,257.27	
INVESTEC PLC	17,742	3.36	59,772.79	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,748	10.05	47,717.40	
MAN GROUP PLC	53,128	0.83	44,096.24	
SCHRODERS PLC	3,648	12.79	46,657.92	
ADMIRAL GROUP PLC	5,826	11.32	65,950.32	
AVIVA PLC	85,719	2.90	249,185.13	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	172,651	1.10	190,779.35	
OLD MUTUAL PLC	143,395	1.47	212,081.20	
PRUDENTIAL PLC	75,466	7.15	539,959.23	
RESOLUTION LTD	39,990	2.11	84,618.84	
RSA INSURANCE GROUP PLC	102,713	1.00	103,637.41	
BRITISH LAND COMPANY PLC	25,603	5.00	128,015.00	
CAPITAL SHOPPING CENTERS GRO	20,521	3.12	64,025.52	
HAMMERSON PLC	20,567	4.23	87,101.24	
LAND SECURITIES GROUP PLC	22,788	7.38	168,175.44	
SEGRO PLC	27,171	2.17	59,205.60	
SAGE GROUP PLC (THE)	43,233	2.65	114,783.61	
BT GROUP PLC	230,121	2.04	471,517.92	
INMARSAT PLC	12,782	4.35	55,703.95	
VODAFONE GROUP PLC	1,494,247	1.69	2,534,990.03	
*NEW SEVERN TRENT PLC	6,908	17.04	117,712.32	
CENTRICA PLC	153,082	3.13	480,524.39	
INTERNATIONAL POWER PLC	44,770	4.19	187,765.38	
NATIONAL GRID PLC	105,516	6.73	710,122.68	
SSE PLC	27,722	13.32	369,257.04	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,432	6.42	144,013.44	
ARM HOLDINGS PLC	39,752	4.91	195,301.57	
計	銘柄数：105		41,306,179.68	
			(5,314,453,077)	
	組入時価比率：10.2%		10.6%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	10,215	41.60	424,944.00
	GIVAUDAN-REG	243	862.50	209,587.50
	HOLCIM LTD-REG	7,239	54.60	395,249.40
	LONZA AG-REG	1,851	37.80	69,967.80
	SIKA FINANZ AG-BEARER	59	1,821.00	107,439.00
	SYNGENTA AG	2,802	310.00	868,620.00
	ABB LTD	65,022	15.52	1,009,141.44
	GEBERIT AG-REG	1,146	188.20	215,677.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,413	111.50	157,549.50
	SULZER AG-REG	685	119.60	81,926.00
	ADECCO SA-REG	4,039	38.80	156,713.20
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	161	1,731.00	278,691.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,576	103.00	162,328.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	788	110.80	87,310.40
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	15,467	53.50	827,484.50
	THE SWATCH GROUP AG-B	909	385.20	350,146.80
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,243	66.70	82,908.10

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	61	854.50	52,124.50
	ARYZTA AG	2,513	45.50	114,341.50
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	33	2,901.00	95,733.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	34,920.00	104,760.00
	NESTLE SA-REGISTERED	98,113	54.75	5,371,686.75
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,425	96.20	137,085.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	225	145.80	32,805.00
	SYNTHESE INC	1,919	156.80	300,899.20
	ACTELION LTD-REG	3,188	38.66	123,248.08
	NOVARTIS AG-REG SHS	69,359	49.37	3,424,253.83
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	20,879	154.90	3,234,157.10
	CREDIT SUISSE GROUP AG	33,798	19.29	651,963.42
	GAM HOLDING LTD	5,549	10.55	58,541.95
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,046	34.20	206,773.20
	PARGESA HOLDING SA-BR	982	55.35	54,353.70
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	459	160.00	73,440.00
	UBS AG-REG	107,986	11.10	1,198,644.60
	BALOISE HOLDING AG	1,362	63.90	87,031.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	872	83.55	72,855.60
	SWISS RE AG	10,207	55.80	569,550.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,368	203.70	889,761.60
	SWISSCOM AG-REG	683	356.20	243,284.60
計	銘柄数：39			22,582,978.87
				(1,928,812,225)
	組入時価比率：3.7%			3.8%
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,436	139.00	894,604.00
	BOLIDEN AB	7,891	97.15	766,610.65
	HOLMEN AB	1,548	186.30	288,392.40
	SSAB AB-A SHARES	6,560	62.70	411,312.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	16,975	105.10	1,784,072.50
	ALFA LAVAL AB	11,057	129.30	1,429,670.10
	ASSA ABLOY AB-B	9,211	188.10	1,732,589.10
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,817	147.20	2,917,062.40
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,429	129.60	1,481,198.40
	HEXAGON AB-B SHS	7,331	133.30	977,222.30
	SANDVIK AB	29,599	95.55	2,828,184.45
	SCANIA AB-B SHS	9,680	121.40	1,175,152.00
	SKANSKA AB-B SHS	11,669	100.70	1,175,068.30
	SKF AB-B SHARES	11,493	147.00	1,689,471.00
	VOLVO AB-B SHS	41,127	84.15	3,460,837.05
	SECURITAS AB-B SHS	11,463	52.60	602,953.80
	ELECTROLUX AB-SER B	6,975	136.20	949,995.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	16,072	35.70	573,770.40
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,552	306.50	475,688.00
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,306	224.60	6,806,727.60
	SWEDISH MATCH AB	6,229	268.20	1,670,617.80
	GETINGE AB-B SHS	5,811	179.40	1,042,493.40
	NORDEA BANK AB	77,844	55.95	4,355,371.80
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	41,425	42.46	1,758,905.50
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	14,452	213.30	3,082,611.60
	SWEDBANK AB-A SHARES	24,162	106.10	2,563,588.20
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,440	91.20	313,728.00
	INVESTOR AB-B SHS	13,367	129.50	1,731,026.50
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,937	126.00	748,062.00
	RATOS AB-B SHS	7,005	69.20	484,746.00
	ERICSSON LM-B SHS	89,200	61.45	5,481,340.00
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,234	664.00	1,483,376.00
	TELE2 AB -B SHS	9,233	111.90	1,033,172.70
	TELIASONERA	63,837	45.24	2,887,985.88
計	銘柄数：34			61,057,606.83
				(692,393,261)
	組入時価比率：1.3%			1.4%
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	5,035	86.55	435,779.25
	NORSK HYDRO ASA	26,998	26.20	707,347.60

	SEADRILL LTD	9,667	212.10	2,050,370.70	
	STATOIL ASA	33,061	150.70	4,982,292.70	
	SUBSEA 7 SA	8,534	129.00	1,100,886.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,476	251.10	1,375,023.60	
	ORKLA ASA	23,221	40.13	931,858.73	
	DNB ASA	28,754	57.70	1,659,105.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,290	68.75	501,187.50	
	TELENOR ASA	21,312	102.40	2,182,348.80	
計	銘柄数：10			15,926,200.68	
				(214,685,185)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
デンマーク	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,715	152.20	1,022,023.00	
クローネ	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,512	42.12	316,405.44	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	16	37,860.00	605,760.00	
	A.P.MOLLER MAERSK	39	39,880.00	1,555,320.00	
	DSV A/S	6,042	120.50	728,061.00	
	CARLSBERG AS-B	3,135	484.30	1,518,280.50	
	COLOPLAST-B	653	1,020.00	666,060.00	
	WILLIAM DEMANT HDGS	723	519.50	375,598.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	12,624	818.50	10,332,744.00	
	DANSKE BANK A/S	19,164	83.30	1,596,361.20	
	TRYG A/S	754	325.90	245,728.60	
	TDC A/S	13,700	39.41	539,917.00	
計	銘柄数：12			19,502,259.24	
				(269,131,177)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
	オーストラ リアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,180	13.25	55,385.00	
		ORIGIN ENERGY LIMITED	32,017	13.09	419,102.53	
		SANTOS LIMITED	27,833	12.69	353,200.77	
		WHITEHAVEN COAL LTD	13,240	4.60	60,904.00	
		WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	19,069	33.49	638,620.81	
		WORLEYPARSONS LTD	5,620	27.00	151,740.00	
		ALUMINA LIMITED	89,962	0.95	85,913.71	
		AMCOR LIMITED	35,820	7.67	274,739.40	
		BHP BILLITON LTD	95,437	34.46	3,288,759.02	
		BORAL LIMITED	23,826	3.72	88,632.72	
		FORTESCUE METALS GROUP LTD	36,393	5.34	194,338.62	
		ILUKA RESOURCES LIMITED	12,226	13.69	167,373.94	
		INCITEC PIVOT LTD	47,258	3.17	149,807.86	
		JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,462	7.34	91,471.08	
		LYNAS CORP LTD	54,253	1.03	56,151.85	
		NEWCREST MINING LTD	22,654	25.65	581,075.10	
		ORICA LTD	10,680	26.85	286,758.00	
		OZ MINERALS LTD	9,033	8.76	79,129.08	
		RIO TINTO LIMITED	12,905	61.00	787,205.00	
		SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	5,284	13.20	69,748.80	
		LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	4,344	18.78	81,580.32	
		WESFARMERS LIMITED	29,794	30.84	918,846.96	
		BRAMBLES LTD	43,506	7.27	316,288.62	
		CAMPBELL BROTHERS LTD	2,343	61.00	142,923.00	
		ASCIANO GROUP	28,220	4.76	134,327.20	
		QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,218	1.52	52,011.36	
		QR NATIONAL LTD	52,152	3.46	180,445.92	
		SYDNEY AIRPORT	10,490	3.00	31,470.00	
		TOLL HOLDINGS LTD	19,593	5.63	110,308.59	
		TRANSURBAN GROUP	38,203	5.90	225,397.70	
		CROWN LTD	12,491	9.12	113,917.92	
		ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	25,061	4.50	112,774.50	
		TABCORP HOLDINGS LIMITED	24,810	3.03	75,174.30	
		TATTS GROUP LTD	48,428	2.70	130,755.60	
		FAIRFAX MEDIA LTD	70,760	0.67	47,763.00	
		HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,948	2.02	30,194.96	
		METCASH LTD	28,283	3.98	112,566.34	
		WOOLWORTHS LIMITED	36,302	26.97	979,064.94	
		COCA-COLA AMATIL LIMITED	16,626	12.73	211,648.98	
		COCHLEAR LIMITED	2,081	66.06	137,470.86	
		RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,806	20.74	99,676.44	
		SONIC HEALTHCARE LIMITED	10,690	12.47	133,304.30	
		CSL LIMITED	15,457	38.36	592,930.52	
		AUST&NZ BANKING GROUP LTD	78,215	22.20	1,736,373.00	
		BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	13,505	7.17	96,830.85	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	46,816	52.80	2,471,884.80			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	65,416	24.80	1,622,316.80			
WESTPAC BANKING CORPORATION	89,984	22.07	1,985,946.88			
ASX LTD	5,086	30.48	155,021.28			
MACQUARIE GROUP LIMITED	10,226	28.79	294,406.54			
SUNCORP GROUP LTD	37,804	8.28	313,017.12			
AMP LIMITED	84,003	4.16	349,452.48			
INSURANSE AUSTRALIA GROUP LTD	63,756	3.43	218,683.08			
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	32,881	13.30	437,317.30			
CFS GANDEL RETAIL TRUST	52,711	1.89	99,623.79			
DEXUS PROPERTY GROUP	139,586	0.95	132,606.70			
GENERAL PROPERTY TRUST	56,573	3.20	181,033.60			
GOODMAN GROUP	40,673	3.61	146,829.53			
LEND LEASE CORP LIMITED	15,660	7.56	118,389.60			
MIRVAC GROUP	98,554	1.30	128,612.97			
STOCKLAND	67,794	3.29	223,042.26			

	WESTFIELD GROUP	64,821	9.41	609,965.61	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	84,790	2.68	227,237.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	12,754	8.41	107,261.14	
	TELSTRA CORPORATION LTD	128,386	3.64	467,325.04	
	AGL ENERGY LTD	13,554	14.63	198,295.02	
	APA GROUP	16,459	4.94	81,307.46	
	SP AUSNET	40,628	1.12	45,706.50	
計	銘柄数：68			25,299,386.17	
				(2,017,373,053)	
	組入時価比率：3.9%			4.0%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	19,527	6.26	122,239.02	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	33,470	2.59	86,687.30	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LTD	15,765	3.64	57,384.60	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	55,267	2.63	145,352.21	
	CONTACT ENERGY LIMITED	10,792	4.82	52,017.44	
計	銘柄数：5			463,680.57	
				(28,817,747)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	62,800	70.20	4,408,560.00	
	NWS HOLDINGS LTD	49,500	11.48	568,260.00	
	SANDS CHINA LTD	70,800	27.75	1,964,700.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	12.40	458,800.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	20,500	20.20	414,100.00	
	MTR CORP	42,031	26.00	1,092,806.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	9,800	40.55	397,390.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	23,500	25.75	605,125.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	40,000	20.75	830,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	40,378	15.48	625,051.44	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	15.18	713,460.00	
	WYNN MACAU LTD	44,800	20.55	920,640.00	
	LI & FUNG LTD	167,200	14.88	2,487,936.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	17,500	17.08	298,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,354	28.45	1,290,321.30	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	108,500	22.85	2,479,225.00	
	HANG SENG BANK	22,500	104.70	2,355,750.00	
	WING HANG BANK LIMITED	5,500	77.10	424,050.00	
	FIRST PACIFIC CO	72,000	7.99	575,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	30,300	113.90	3,451,170.00	
	AIA GROUP LTD	249,600	26.50	6,614,400.00	
	CHEUNG KONG	41,000	96.10	3,940,100.00	
	HANG LUNG DEVELOPMENT CO	25,000	46.30	1,157,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	72,000	25.65	1,846,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	28,045	40.15	1,126,006.75	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	20,221	33.50	677,403.50	
	KERRY PROPERTIES LTD	26,500	32.70	866,550.00	
	LINK REIT	66,000	31.05	2,049,300.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	117,319	9.01	1,057,044.19	
	SINO LAND CO	84,674	11.92	1,009,314.08	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	42,000	87.85	3,689,700.00	
	SWIRE PACIFIC LTD A	21,000	85.35	1,792,350.00	
	THE WHARF (HOLDINGS)	44,625	42.80	1,909,950.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	34,000	25.25	858,500.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	61,000	3.49	212,890.00	
	PCCW LTD	144,000	2.78	400,320.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	17,000	44.80	761,600.00	
	CLP HOLDINGS LIMITED	56,900	64.85	3,689,965.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	139,512	18.74	2,614,454.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40,500	58.00	2,349,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,300	102.40	645,120.00	
計	銘柄数：41			65,629,793.14	
				(675,330,571)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポールドル	FRASER & NEAVE LTD	26,200	6.80	178,160.00	
	KEPPEL CORP	42,400	10.09	427,816.00	

	NOBLE GROUP LTD	111,254	1.14	126,829.56	
	SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	28,160	4.76	134,041.60	
	SEBACORP MARINE LIMITED	27,400	4.54	124,396.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	3.00	132,000.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	40,000	1.43	57,200.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	68,000	1.46	99,280.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	22,000	0.90	19,800.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES	30,750	1.04	32,133.75	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,600	10.23	159,588.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	57,000	1.06	60,705.00	
	CITY DEVELOPMENTS	14,000	10.21	142,940.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	177,800	1.60	285,369.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	43,750	3.83	167,562.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,800	45.58	127,624.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	49,000	2.03	99,470.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	191,680	0.69	132,259.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	4.02	225,120.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	52,500	13.68	718,200.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	76,000	8.84	671,840.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	37,000	18.10	669,700.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	25,000	6.36	159,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	65,000	2.04	132,600.00	
	CAPITALAND LIMITED	77,000	2.65	204,050.00	
	CAPITAMALL TRUST	70,000	1.78	124,950.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROP	67,000	1.97	131,990.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	20,000	2.87	57,400.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,600	4.34	72,044.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	235,490	3.17	746,503.30	
	STARHUB LTD	17,000	3.27	55,590.00	
計	銘柄数：31			6,476,161.91	
				(411,624,850)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
イスラエル シュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	12,858	40.17	516,505.86	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	70	2,239.00	156,730.00	
	DELEK GROUP LTD	113	727.00	82,151.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	624	132.80	82,867.20	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	27,916	158.80	4,433,060.80	
	BANK HAPOLIM BM	30,259	13.32	403,049.88	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	33,636	11.15	375,041.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	22,332	4.77	106,612.96	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,797	32.20	90,063.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	64,706	5.12	331,294.72	
	CELLCOM ISRAEL LTD	2,523	41.50	104,704.50	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	1,863	25.70	47,879.10	
	NICE SYSTEMS LTD	2,198	142.70	313,654.60	
計	銘柄数：13			7,043,615.42	
				(147,704,615)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
合計				50,308,166,805	
				(50,308,166,805)	

(注)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、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586銘柄	100.0%	59.2%
カナダドル	株式102銘柄	100.0%	5.4%
ユーロ	株式252銘柄	100.0%	12.1%
ポンド	株式105銘柄	100.0%	10.6%
スイスフラン	株式39銘柄	100.0%	3.8%
スウェーデンクローネ	株式34銘柄	100.0%	1.4%
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68銘柄	100.0%	4.0%
ニュージーランドドル	株式5銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式41銘柄	100.0%	1.3%
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13銘柄	100.0%	0.3%

(ロ) 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23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	53,318,506	21,605,607
コール・ローン	1,023,930,775	34,438,582
国債証券	30,029,356,999	21,735,825,744
未収入金	-	18,869,067
未収利息	363,756,927	223,968,930
前払費用	19,085,386	25,364,497
流動資産合計	31,489,448,593	22,060,072,427
資産合計	31,489,448,593	22,060,072,427
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	-	17,200,000
流動負債合計	985,540,589	17,200,000
負債合計	985,540,589	17,200,000
純資産の部		
元本等		
元本	21,908,664,285	15,458,644,387
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,595,243,719	6,584,228,040
元本等合計	30,503,908,004	22,042,872,427
純資産合計	30,503,908,004	22,042,872,427
負債純資産合計	31,489,448,593	22,060,072,427

(2) 注記表

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>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。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>
5. 追加情報	<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。</p>

貸借対照表に関する注記

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
1. 受益権の総数	21,908,664,285口	15,458,644,387口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3923円 (13,923円)	1.4259円 (14,259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23年5月17日 至平成24年5月15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る場合、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>

(金融商品の時価等に関する事項)

自平成23年5月17日 至平成24年5月15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>

関連当事者との取引に関する注記
該当事項はありません。

その他の注記
(元本の移動)

区分	平成23年5月16日現在	平成24年5月15日現在
期首元本額	20,192,009,848円	21,908,664,285円
期中追加設定元本額	4,375,780,494円	10,097,280,886円
期中一部解約元本額	2,659,126,057円	16,547,300,784円
期末元本額	21,908,664,285円	15,458,644,387円
元本の内訳*		
日立バランスファンド(株式70)	702,504,730円	715,737,654円
日立バランスファンド(株式50)	892,330,963円	930,281,475円
日立バランスファンド(株式30)	348,701,744円	362,987,507円
日立外国債券特化型ファンドU(為替ヘッジなし)	13,477,254,287円	6,577,100,022円
日立外国債券インデックスファンド	6,487,872,561円	6,872,537,729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23年5月16日現在	平成24年5月15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	299,076,674円	216,975,006円
合計	299,076,674円	216,975,006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

取引の状況に関する事項
自平成23年5月17日 至平成24年5月15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。
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。
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。
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。
5. 取引に係るリスク管理体制 取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(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	7,162,616	

(平成24年5月15日現在)

該当事項はありません。

(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24年5月15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	0.125% US TREASURY N/B	840,000.00	838,621.87	
		0.125% US TREASURY N/B	900,000.00	897,890.62	
		0.25% US TREASURY N/B	810,000.00	809,778.51	
		0.25% US TREASURY N/B	890,000.00	889,687.11	
		0.25% US TREASURY N/B	800,000.00	799,750.00	
		0.25% US TREASURY N/B	870,000.00	868,776.56	
		0.25% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,297,460.94	
		0.25% US TREASURY N/B	700,000.00	698,414.06	
		0.25% US TREASURY N/B	270,000.00	269,219.52	
		0.375% US TREASURY N/B	840,000.00	841,312.50	
		0.375% US TREASURY N/B	840,000.00	841,378.12	
		0.375% US TREASURY N/B	770,000.00	770,962.50	
		0.375% US TREASURY N/B	840,000.00	840,393.75	
		0.375% US TREASURY N/B	700,000.00	700,273.44	
		0.5% US TREASURY N/B	620,000.00	622,131.25	
		0.5% US TREASURY N/B	640,000.00	642,850.00	
		0.50% US TREASURY N/B	830,000.00	832,399.22	
		0.50% US TREASURY N/B	590,000.00	592,074.22	
		0.50% US TREASURY N/B	650,000.00	652,894.53	
		0.625% US TREASURY N/B	780,000.00	783,046.87	
		0.625% US TREASURY N/B	760,000.00	765,284.37	
		0.75% US TREASURY N/B	740,000.00	744,856.25	
		0.750% US TREASURY N/B	780,000.00	784,935.94	
		0.750% US TREASURY N/B	520,000.00	523,859.37	
		0.750% US TREASURY N/B	280,000.00	282,668.75	
		0.875% US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,192,168.75	
		0.875% US TREASURY N/B	240,000.00	242,343.75	
		0.875% US TREASURY N/B	720,000.00	726,637.50	
		0.875% US TREASURY N/B	780,000.00	786,885.93	
		1.0% US TREASURY N/B	730,000.00	736,444.53	
		1.0% US TREASURY N/B	510,000.00	518,765.62	
		1.0% US TREASURY N/B	460,000.00	467,690.62	
		1.0% US TREASURY N/B	600,000.00	609,796.87	
		1.00% US TREASURY N/B	360,000.00	364,331.25	
		1.00% US TREASURY N/B	580,000.00	588,201.56	
		1.125% US TREASURY N/B	700,000.00	706,781.25	
		1.25% US TREASURY N/B	430,000.00	437,256.25	
		1.25% US TREASURY N/B	650,000.00	661,730.47	
		1.25% US TREASURY N/B	630,000.00	641,566.40	
		1.25% US TREASURY N/B	850,000.00	872,910.16	
		1.25% US TREASURY N/B	770,000.00	790,693.75	
		1.25% US TREASURY N/B	510,000.00	514,103.90	
		1.250% US TREASURY N/B	730,000.00	749,846.87	
		1.375% US TREASURY N/B	880,000.00	890,071.87	
		1.375% US TREASURY N/B	720,000.00	742,725.00	
1.375% US TREASURY N/B	410,000.00	417,815.62			
1.375% US TREASURY N/B	530,000.00	538,157.03			
1.5% US TREASURY N/B	290,000.00	295,777.34			
1.5% US TREASURY N/B	600,000.00	622,593.75			
1.5% US TREASURY N/B	220,000.00	226,204.68			
1.5% US TREASURY N/B	500,000.00	511,054.69			
1.50% US TREASURY N/B	590,000.00	612,263.28			
1.75% US TREASURY N/B	770,000.00	802,725.00			
1.75% US TREASURY N/B	130,000.00	135,474.21			
1.750% US TREASURY N/B	610,000.00	625,250.00			
1.750% US TREASURY N/B	670,000.00	688,503.51			
1.875% US TREASURY N/B	690,000.00	709,621.87			

1.875% US TREASURY N/B	710,000.00	732,021.09
1.875% US TREASURY N/B	700,000.00	738,117.19
1.875% US TREASURY N/B	650,000.00	685,191.40
1.875% US TREASURY N/B	620,000.00	653,373.44
11.25% US TREASURY N/B	130,000.00	168,725.78
2.0% US TREASURY N/B	660,000.00	697,743.75
2.00% US TREASURY N/B	550,000.00	564,523.43
2.00% US TREASURY N/B	530,000.00	559,191.40
2.125% US TREASURY N/B	990,000.00	1,034,782.02
2.125% US TREASURY N/B	870,000.00	915,471.09
2.125% US TREASURY N/B	370,000.00	391,939.84
2.125% US TREASURY N/B	330,000.00	349,954.68
2.125% US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,173,699.19
2.25% US TREASURY N/B	700,000.00	727,835.94
2.250% US TREASURY N/B	700,000.00	735,875.00
2.250% US TREASURY N/B	260,000.00	277,285.93
2.250% US TREASURY N/B	670,000.00	720,250.00
2.250% US TREASURY N/B	560,000.00	601,956.25
2.375% US TREASURY N/B	90,000.00	94,232.81
2.375% US TREASURY N/B	740,000.00	776,132.81
2.375% US TREASURY N/B	850,000.00	892,500.00
2.375% US TREASURY N/B	720,000.00	760,050.00
2.375% US TREASURY N/B	410,000.00	438,667.97
2.375% US TREASURY N/B	610,000.00	658,895.31
2.375% US TREASURY N/B	610,000.00	660,229.68
2.5% US TREASURY N/B	540,000.00	572,737.50
2.5% US TREASURY N/B	710,000.00	754,208.59
2.625% US TREASURY N/B	350,000.00	367,390.62
2.625% US TREASURY N/B	620,000.00	651,629.69
2.625% US TREASURY N/B	430,000.00	455,598.43
2.625% US TREASURY N/B	240,000.00	258,918.75
2.625% US TREASURY N/B	320,000.00	346,000.00
2.625% US TREASURY N/B	130,000.00	142,532.81
2.625% US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,570,387.50
2.625% US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,513,579.68
2.75% US TREASURY N/B	530,000.00	582,296.09
2.75% US TREASURY N/B	490,000.00	541,028.90
2.750% US TREASURY N/B	450,000.00	466,207.03
2.750% US TREASURY N/B	910,000.00	1,006,829.68
2.875% US TREASURY N/B	540,000.00	600,285.94
3.00% US TREASURY N/B	460,000.00	506,539.06
3.00% US TREASURY N/B	620,000.00	683,356.25
3.00% US TREASURY N/B	580,000.00	642,485.94
3.125% US TREASURY N/B	460,000.00	472,793.75
3.125% US TREASURY N/B	590,000.00	611,802.34
3.125% US TREASURY N/B	480,000.00	498,937.50
3.125% US TREASURY N/B	730,000.00	809,387.50
3.125% US TREASURY N/B	600,000.00	667,546.87
3.125% US TREASURY N/B	580,000.00	647,153.12
3.125% US TREASURY N/B	930,000.00	1,052,789.06
3.125% US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,308,353.12
3.125% US TREASURY N/B	180,000.00	186,510.93
3.125% US TREASURY N/B	380,000.00	393,745.31
3.250% US TREASURY N/B	470,000.00	520,304.68
3.250% US TREASURY N/B	370,000.00	410,064.06
3.250% US TREASURY N/B	590,000.00	654,900.00
3.250% US TREASURY N/B	500,000.00	558,398.44
3.250% US TREASURY N/B	580,000.00	650,143.75
3.375% US TREASURY N/B	540,000.00	559,068.75
3.375% US TREASURY N/B	530,000.00	550,040.62
3.375% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,173,000.00
3.50% US TREASURY N/B	280,000.00	289,515.62
3.50% US TREASURY N/B	290,000.00	331,982.02
3.50% US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,623,343.75

3.50% US TREASURY N/B	90,000.00	100,800.00
3.625% US TREASURY N/B	450,000.00	465,257.81
3.625% US TREASURY N/B	820,000.00	957,221.87
3.625% US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,659,403.12
3.625% US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,486,296.87
3.750% US TREASURY N/B	910,000.00	1,065,197.66
3.750% US TREASURY N/B	820,000.00	955,300.00
3.875% US TREASURY N/B	520,000.00	609,009.37
3.875% US TREASURY N/B	900,000.00	1,071,773.44
4.00% US TREASURY N/B	630,000.00	670,900.78
4.00% US TREASURY N/B	650,000.00	714,593.75
4.00% US TREASURY N/B	550,000.00	650,761.72
4.125% US TREASURY N/B	470,000.00	522,177.34
4.25% US TREASURY N/B	680,000.00	713,840.62
4.25% US TREASURY N/B	490,000.00	519,285.15
4.25% US TREASURY N/B	490,000.00	579,310.15
4.25% US TREASURY N/B	600,000.00	759,515.62
4.25% US TREASURY N/B	920,000.00	1,165,668.75
4.250% US TREASURY N/B	590,000.00	642,132.03
4.250% US TREASURY N/B	390,000.00	427,903.12
4.375% US TREASURY N/B	310,000.00	399,173.43
4.375% US TREASURY N/B	710,000.00	917,120.31
4.375% US TREASURY N/B	770,000.00	994,743.75
4.375% US TREASURY N/B	870,000.00	1,124,950.78
4.50% US TREASURY N/B	400,000.00	474,093.75
4.50% US TREASURY N/B	60,000.00	78,759.37
4.50% US TREASURY N/B	560,000.00	737,100.00
4.500% US TREASURY N/B	600,000.00	683,671.87
4.500% US TREASURY N/B	580,000.00	665,640.62
4.500% US TREASURY N/B	450,000.00	587,566.40
4.625% US TREASURY N/B	470,000.00	552,433.59
4.625% US TREASURY N/B	440,000.00	520,884.37
4.625% US TREASURY N/B	700,000.00	939,367.19
4.75% US TREASURY N/B	840,000.00	1,150,012.50
4.750% US TREASURY N/B	490,000.00	533,487.50
4.750% US TREASURY N/B	350,000.00	421,476.56
4.750% US TREASURY N/B	320,000.00	433,700.00
4.875% US TREASURY N/B	460,000.00	542,584.37
5.00% US TREASURY N/B	400,000.00	561,250.00
5.125% US TREASURY N/B	400,000.00	472,218.75
5.250% US TREASURY N/B	230,000.00	318,765.62
5.250% US TREASURY N/B	180,000.00	249,960.93
5.375% US TREASURY N/B	330,000.00	472,338.28
5.50% US TREASURY N/B	190,000.00	269,443.75
6.00% US TREASURY N/B	370,000.00	535,690.62
6.125% US TREASURY N/B	370,000.00	552,398.43
6.125% US TREASURY N/B	90,000.00	136,898.43
6.25% US TREASURY N/B	400,000.00	575,718.74
6.25% US TREASURY N/B	360,000.00	558,956.25
6.50% US TREASURY N/B	90,000.00	137,074.21
6.625% US TREASURY N/B	60,000.00	92,695.31
7.125% US TREASURY N/B	130,000.00	197,346.09
7.25% US TREASURY N/B	390,000.00	492,984.37
7.25% US TREASURY N/B	100,000.00	151,773.43
7.50% US TREASURY N/B	330,000.00	430,314.84
7.625% US TREASURY N/B	110,000.00	178,457.81
8.00% US TREASURY N/B	350,000.00	547,449.22
8.125% US TREASURY N/B	300,000.00	445,312.50
8.75% US TREASURY N/B	190,000.00	265,064.84
8.75% US TREASURY N/B	210,000.00	330,733.59
8.875% US TREASURY N/B	130,000.00	184,488.28
8.875% US TREASURY N/B	40,000.00	60,406.25
計	銘柄数 : 183	104,960,000.00
		115,368,609.27
		(9,222,566,625)

	組入時価比率：41.8%		42.4%
カナダドル	0.75% CANADA GOV'T	70,000.00	69,286.00
	1.00% CANADA GOV'T	100,000.00	99,539.00
	1.50% CANADA GOV'T	360,000.00	361,231.20
	1.50% CANADA GOV'T	80,000.00	80,120.00
	2.00% CANADA GOV'T	280,000.00	282,525.60
	2.00% CANADA GOV'T	320,000.00	324,089.60
	2.00% CANADA GOV'T	280,000.00	284,628.40
	2.00% CANADA GOV'T	90,000.00	91,955.70
	2.25% CANADA GOV'T	90,000.00	91,845.90
	2.50% CANADA GOV'T	290,000.00	294,616.80
	2.50% CANADA GOV'T	190,000.00	196,427.70
	2.75% CANADA GOV'T	160,000.00	168,619.20
	3.00% CANADA GOV'T	390,000.00	403,458.90
	3.00% CANADA GOV'T	280,000.00	295,285.20
	3.25% CANADA GOV'T	260,000.00	290,383.60
	3.50% CANADA GOV'T	270,000.00	276,342.30
	3.50% CANADA GOV'T	250,000.00	282,822.50
	3.50% CANADA GOV'T	90,000.00	111,530.70
	3.75% CANADA GOV'T	350,000.00	398,517.00
	4.00% CANADA GOV'T	210,000.00	230,991.60
	4.00% CANADA GOV'T	280,000.00	313,899.60
	4.00% CANADA GOV'T	250,000.00	330,375.00
	4.25% CANADA GOV'T	220,000.00	253,710.60
	4.50% CANADA GOV'T	200,000.00	218,602.00
	5.00% CANADA GOV'T	310,000.00	333,215.90
	5.00% CANADA GOV'T	330,000.00	484,832.70
	5.25% CANADA GOV'T	130,000.00	135,405.40
	5.75% CANADA GOV'T	340,000.00	505,090.40
	5.75% CANADA GOV'T	350,000.00	541,061.50
8.00% CANADA GOV'T	100,000.00	173,676.00	
9.00% CANADA GOV'T	50,000.00	89,153.00	
計	銘柄数：31	6,970,000.00	8,013,239.00
			(638,895,545)
	組入時価比率：2.9%		2.9%
メキシコペソ	6.00% MEX BONOS DESARR F	2,680,000.00	2,758,818.80
	7.00% MEX BONOS DESARR F	3,800,000.00	3,969,556.00
	7.25% MEX BONOS DESARR F	640,000.00	692,563.20
	7.50% MEX BONOS DESARR F	3,100,000.00	3,293,099.00
	7.75% MEX BONOS DESARR F	800,000.00	890,696.00
	7.75% MEX BONOS DESARR F	1,990,000.00	2,099,012.20
	8.00% MEX BONOS DESARR F	2,570,000.00	2,700,633.10
	8.00% MEX BONOS DESARR F	1,930,000.00	2,114,836.10
	8.00% MEX BONOS DESARR F	2,700,000.00	3,056,562.00
	8.00% MEX BONOS DESARR F	1,550,000.00	1,759,932.00
	8.50% MEX BONOS DESARR F	2,980,000.00	3,418,000.40
	8.50% MEX BONOS DESARR F	3,510,000.00	3,914,001.00
	9.00% MEX BONOS DESARR F	1,420,000.00	1,486,015.80
	9.50% MEX BONOS DESARR F	1,130,000.00	1,256,944.20
	計	銘柄数：14	30,800,000.00
			(195,118,311)
	組入時価比率：0.9%		0.9%

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	ユーロ	0.25% DEUTSCHLAND REP	240,000.00	240,756.00	
		0.25% DEUTSCHLAND REP	90,000.00	90,306.00	
		0.75% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	322,960.00	
		0.75% DEUTSCHLAND REP	160,000.00	162,048.00	
		1.00% NETHERLANDS GOVT	350,000.00	354,235.00	
		1.25% DEUTSCHLAND REP	320,000.00	332,176.00	
		1.75% DEUTSCHLAND REP	270,000.00	274,954.50	
		1.75% DEUTSCHLAND REP	400,000.00	421,080.00	
		1.75% FINNISH GOV'T	130,000.00	135,642.00	
		1.75% FRANCE GOV'T	270,000.00	271,390.50	
		1.875%FINNISH GOV'T	50,000.00	52,210.00	
		2.00% BUONI POLIENNALI	300,000.00	298,125.00	
		2.00% DEUTSCHLAND REP	400,000.00	426,280.00	
		2.00% DEUTSCHLAND REP	330,000.00	348,810.00	
		2.00% FRANCE GOV'T	220,000.00	224,837.80	
		2.00% FRANCE GOV'T	470,000.00	484,429.00	
		2.25% BUONI POLIENNALI	450,000.00	445,504.50	
		2.25% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	479,205.00	
		2.25% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	456,058.00	
		2.25% DEUTSCHLAND REP	150,000.00	163,125.00	
		2.25% DEUTSCHLAND REP	190,000.00	205,428.00	
		2.25% FRANCE GOV'T	420,000.00	435,057.00	
		2.25% NETHERLANDS GOVT	20,000.00	20,566.00	
		2.30% SPANISH GOV'T	390,000.00	386,295.00	
		2.50% BUONI POLIENNALI	70,000.00	67,459.00	
		2.50% DEUTSCHLAND REP	420,000.00	444,276.00	
		2.50% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	415,623.00	
		2.50% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	509,588.00	
		2.50% FRANCE GOV'T	620,000.00	640,150.00	
		2.50% FRANCE GOV'T	460,000.00	480,194.00	
		2.50% FRANCE GOV'T	460,000.00	479,320.00	
		2.50% FRANCE GOV'T	670,000.00	665,042.00	
		2.50% NETHERLANDS GOVT	200,000.00	210,200.00	
		2.50% NETHERLANDS GOVT	100,000.00	100,490.00	
		2.50% SPANISH GOV'T	420,000.00	413,070.00	
		2.75% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	207,950.00	
		2.75% DEUTSCHLAND REP	330,000.00	361,482.00	
		2.75% FINNISH GOV'T	30,000.00	31,239.00	
		2.75% NETHERLANDS GOVT	400,000.00	425,120.00	
		3.00% BUONI POLIENNALI	370,000.00	368,446.00	
		3.00% BUONI POLIENNALI	400,000.00	390,440.00	
		3.00% BUONI POLIENNALI	450,000.00	438,075.00	
		3.00% BUONI POLIENNALI	380,000.00	367,612.00	
		3.00% DEUTSCHLAND REP	490,000.00	561,981.00	
		3.00% FRANCE GOV'T	630,000.00	661,878.00	
		3.00% FRANCE GOV'T	740,000.00	786,620.00	
		3.00% FRANCE GOV'T	320,000.00	323,360.00	
		3.00% SPANISH GOV'T	150,000.00	144,495.00	
		3.125%FINNISH GOV'T	100,000.00	106,670.00	
		3.15% SPANISH GOV'T	360,000.00	339,084.00	
		3.20% REP OF AUSTRIA	200,000.00	215,900.00	
		3.25% BELGIUM KINGDOM	350,000.00	369,320.00	
		3.25% DEUTSCHLAND REP	470,000.00	515,308.00	
		3.25% DEUTSCHLAND REP	420,000.00	488,586.00	
		3.25% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	538,476.00	
		3.25% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	352,744.00	
		3.25% FRANCE GOV'T	600,000.00	644,040.00	
		3.25% FRANCE GOV'T	510,000.00	531,063.00	
		3.25% NETHERLANDS GOVT	390,000.00	423,228.00	
		3.25% NETHERLANDS GOVT	310,000.00	347,541.00	
		3.25% SPANISH GOV'T	340,000.00	319,753.00	
		3.30% SPANISH GOV'T	430,000.00	421,314.00	

3.375%FINNISH GOV'T	210,000.00	236,397.00
3.40% REP OF AUSTRIA	220,000.00	234,520.00
3.40% SPANISH GOV'T	90,000.00	89,077.50
3.5% DEUTSCHLAND REP	500,000.00	559,225.00
3.5% DEUTSCHLAND REP	660,000.00	776,820.00
3.50% BELGIUM KINGDOM	220,000.00	233,640.00
3.50% BELGIUM KINGDOM	190,000.00	201,666.00
3.50% BUONI POLIENNALI	480,000.00	480,288.00
3.50% FINNISH GOV'T	160,000.00	181,888.00
3.50% FRANCE GOV'T	530,000.00	569,856.00
3.50% FRANCE GOV'T	530,000.00	567,365.00
3.50% FRANCE GOV'T	680,000.00	700,400.00
3.50% NETHERLANDS GOVT	270,000.00	307,233.00
3.50% REP OF AUSTRIA	310,000.00	335,420.00
3.50% REP OF AUSTRIA	290,000.00	315,375.00
3.65% REP OF AUSTRIA	160,000.00	176,000.00
3.75% BELGIUM KINGDOM	300,000.00	321,810.00
3.75% BELGIUM KINGDOM	440,000.00	462,704.00
3.75% BUONI POLIENNALI	490,000.00	494,816.70
3.75% BUONI POLIENNALI	560,000.00	556,584.00
3.75% BUONI POLIENNALI	340,000.00	334,662.00
3.75% BUONI POLIENNALI	600,000.00	588,240.00
3.75% BUONI POLIENNALI	480,000.00	425,856.00
3.75% BUONI POLIENNALI	490,000.00	430,612.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	490,000.00	510,531.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	580,694.50
3.75% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	506,968.00
3.75% DEUTSCHLAND REP	480,000.00	570,024.00
3.75% FRANCE GOV'T	590,000.00	646,404.00
3.75% FRANCE GOV'T	490,000.00	534,639.00
3.75% FRANCE GOV'T	710,000.00	769,214.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	370,000.00	397,639.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	280,000.00	325,724.00
3.75% NETHERLANDS GOVT	260,000.00	336,310.00
3.80% REP OF AUSTRIA	260,000.00	272,844.00
3.80% SPANISH GOV'T	440,000.00	411,840.00
3.875%FINNISH GOV'T	120,000.00	137,340.00
3.90% REP OF AUSTRIA	240,000.00	268,776.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	320,000.00	338,144.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	310,000.00	337,280.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	217,160.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	240,000.00	259,848.00
4.00% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	393,495.00
4.00% BUONI POLIENNALI	400,000.00	392,080.00
4.00% BUONI POLIENNALI	540,000.00	493,128.00
4.00% BUONI POLIENNALI	460,000.00	353,510.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	40,000.00	42,220.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	609,871.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	521,400.00
4.00% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	553,705.00
4.00% FINNISH GOV'T	70,000.00	83,209.00
4.00% FRANCE GOV'T	490,000.00	514,892.00
4.00% FRANCE GOV'T	390,000.00	415,974.00
4.00% FRANCE GOV'T	530,000.00	571,499.00
4.00% FRANCE GOV'T	490,000.00	544,733.00
4.00% FRANCE GOV'T	530,000.00	573,248.00
4.00% FRANCE GOV'T	310,000.00	338,055.00
4.00% FRANCE GOV'T	220,000.00	242,066.00
4.00% IRISH GOV'T	300,000.00	292,770.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	250,000.00	283,050.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	340,000.00	393,822.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	310,000.00	361,863.00
4.00% NETHERLANDS GOVT	210,000.00	271,929.00
4.00% REP OF AUSTRIA	170,000.00	189,635.00

4.00% SPANISH GOV'T	50,000.00	49,240.00
4.00% SPANISH GOV'T	430,000.00	380,292.00
4.10% SPANISH GOV'T	390,000.00	358,449.00
4.15% REP OF AUSTRIA	240,000.00	281,520.00
4.20% SPANISH GOV'T	380,000.00	383,648.00
4.20% SPANISH GOV'T	370,000.00	263,033.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	209,680.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	320,000.00	343,328.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	150,000.00	162,120.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	90,000.00	97,074.00
4.25% BELGIUM KINGDOM	330,000.00	357,043.50
4.25% BUONI POLIENNALI	580,000.00	589,860.00
4.25% BUONI POLIENNALI	210,000.00	212,814.00
4.25% BUONI POLIENNALI	510,000.00	516,528.00
4.25% BUONI POLIENNALI	390,000.00	395,070.00
4.25% BUONI POLIENNALI	270,000.00	258,012.00
4.25% BUONI POLIENNALI	510,000.00	481,440.00
4.25% BUONI POLIENNALI	510,000.00	477,666.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	560,000.00	598,584.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	580,000.00	631,620.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	510,539.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	460,000.00	556,508.00
4.25% DEUTSCHLAND REP	330,000.00	475,134.00
4.25% FINNISH GOV'T	110,000.00	123,002.00
4.25% FRANCE GOV'T	500,000.00	561,350.00
4.25% FRANCE GOV'T	470,000.00	529,878.00
4.25% FRANCE GOV'T	610,000.00	689,422.00
4.25% FRANCE GOV'T	730,000.00	815,921.00
4.25% NETHERLANDS GOVT	180,000.00	188,550.00
4.25% SPANISH GOV'T	340,000.00	342,312.00
4.25% SPANISH GOV'T	370,000.00	355,366.50
4.30% REP OF AUSTRIA	220,000.00	237,633.00
4.30% REP OF AUSTRIA	180,000.00	204,300.00
4.30% SPANISH GOV'T	370,000.00	337,773.00
4.35% REP OF AUSTRIA	290,000.00	332,485.00
4.375%FINNISH GOV'T	190,000.00	226,879.00
4.40% IRISH GOV'T	270,000.00	231,120.00
4.40% SPANISH GOV'T	410,000.00	410,779.00
4.50% BELGIUM KINGDOM	170,000.00	187,323.00
4.50% BUONI POLIENNALI	460,000.00	452,226.00
4.50% BUONI POLIENNALI	520,000.00	507,780.00
4.50% BUONI POLIENNALI	540,000.00	520,992.00
4.50% BUONI POLIENNALI	460,000.00	437,920.00
4.50% BUONI POLIENNALI	280,000.00	243,908.00
4.50% FRANCE GOV'T	500,000.00	523,850.00
4.50% FRANCE GOV'T	340,000.00	400,588.00
4.50% IRISH GOV'T	60,000.00	58,836.00
4.50% IRISH GOV'T	40,000.00	35,366.00
4.50% IRISH GOV'T	80,000.00	68,124.00
4.50% NETHERLANDS GOVT	310,000.00	363,227.00
4.6% IRISH GOV'T	60,000.00	56,682.00
4.60% SPANISH GOV'T	260,000.00	241,670.00
4.65% REP OF AUSTRIA	130,000.00	150,345.00
4.65% SPANISH GOV'T	410,000.00	341,530.00
4.70% SPANISH GOV'T	200,000.00	151,460.00
4.75% BUONI POLIENNALI	420,000.00	424,914.00
4.75% BUONI POLIENNALI	240,000.00	240,432.00
4.75% BUONI POLIENNALI	560,000.00	530,320.00
4.75% BUONI POLIENNALI	550,000.00	506,550.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	210,000.00	286,104.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	624,790.00
4.75% DEUTSCHLAND REP	350,000.00	545,685.00
4.75% FRANCE GOV'T	310,000.00	372,310.00
4.75% SPANISH GOV'T	390,000.00	394,914.00

	4.80% SPANISH GOV'T	400,000.00	345,200.00
	4.85% REP OF AUSTRIA	190,000.00	232,750.00
	4.85% SPANISH GOV'T	400,000.00	368,200.00
	4.90% SPANISH GOV'T	230,000.00	179,722.00
	5.0% BELGIUM KINGDOM	280,000.00	332,864.00
	5.00% BUONI POLIENNALI	230,000.00	219,535.00
	5.00% BUONI POLIENNALI	450,000.00	416,475.00
	5.00% BUONI POLIENNALI	470,000.00	412,613.00
	5.00% BUONI POLIENNALI	440,000.00	380,160.00
	5.00% BUONI POLIENNALI	440,000.00	379,896.00
	5.00% FRANCE GOV'T	650,000.00	746,980.00
	5.00% IRISH GOVT	270,000.00	240,165.00
	5.25% BUONI POLIENNALI	500,000.00	510,600.00
	5.25% BUONI POLIENNALI	570,000.00	527,136.00
	5.375%FINNISH GOV'T	50,000.00	52,980.00
	5.40% IRISH GOV'T	140,000.00	123,340.00
	5.5% DEUTSCHLAND REP	400,000.00	604,400.00
	5.5% NETHERLANDS GOVT	310,000.00	437,720.00
	5.50% BELGIUM KINGDOM	60,000.00	69,621.00
	5.50% BELGIUM KINGDOM	270,000.00	329,724.00
	5.50% BUONI POLIENNALI	200,000.00	195,860.00
	5.50% FRANCE GOV'T	550,000.00	696,850.00
	5.50% SPANISH GOV'T	270,000.00	270,135.00
	5.50% SPANISH GOV'T	390,000.00	375,258.00
	5.625%DEUTSCHLAND REP	290,000.00	427,547.00
	5.75% BUONI POLIENNALI	330,000.00	316,998.00
	5.75% FRANCE GOV'T	460,000.00	615,434.00
	5.75% SPANISH GOV'T	310,000.00	280,519.00
	5.85% SPANISH GOV'T	200,000.00	194,700.00
	5.90% IRISH GOV'T	320,000.00	300,640.00
	5.90% SPANISH GOV'T	240,000.00	224,040.00
	6.00% BUONI POLIENNALI	190,000.00	200,336.00
	6.00% BUONI POLIENNALI	570,000.00	561,393.00
	6.00% FRANCE GOV'T	220,000.00	287,364.00
	6.00% SPANISH GOV'T	130,000.00	121,771.00
	6.25% DEUTSCHLAND REP	200,000.00	296,740.00
	6.25% DEUTSCHLAND REP	170,000.00	272,136.00
	6.25% REP OF AUSTRIA	200,000.00	281,180.00
	6.5% DEUTSCHLAND REP	250,000.00	396,325.00
	6.50% BUONI POLIENNALI	510,000.00	525,351.00
	7.25% BUONI POLIENNALI	210,000.00	233,415.00
	7.50% NETHERLANDS GOVT	80,000.00	121,968.00
	8.50% FRANCE GOV'T	170,000.00	241,340.50
	8.50% FRANCE GOV'T	170,000.00	259,131.00
	9.00% BUONI POLIENNALI	130,000.00	161,161.00
計	銘柄数：235	80,300,000.00	85,188,096.50
			(8,737,743,058)
	組入時価比率：39.6%		40.2%

[次へ](#)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
債券	ポンド	1.75% UK TREASURY	370,000.00	384,145.10	
		2.00% UK TREASURY	600,000.00	628,824.00	
		2.25% UK TREASURY	620,000.00	640,776.20	
		2.75% UK TREASURY	520,000.00	551,319.60	
		3.75% UK TREASURY	530,000.00	616,337.00	
		3.75% UK TREASURY	470,000.00	548,114.00	
		3.75% UK TREASURY	480,000.00	560,016.00	
		3.75% UK TREASURY	60,000.00	66,222.00	
		4.00% UK TREASURY	510,000.00	579,579.30	
		4.00% UK TREASURY	310,000.00	368,983.70	
		4.00% UK TREASURY	120,000.00	140,736.00	
		4.25% UK TREASURY	370,000.00	451,085.50	
		4.25% UK TREASURY	370,000.00	445,224.70	
		4.25% UK TREASURY	240,000.00	288,612.00	
		4.25% UK TREASURY	300,000.00	360,030.00	
		4.25% UK TREASURY	460,000.00	550,605.28	
		4.25% UK TREASURY	410,000.00	496,715.00	
		4.25% UK TREASURY	370,000.00	449,627.70	
		4.25% UK TREASURY	240,000.00	294,540.00	
		4.50% UK TREASURY	540,000.00	653,562.00	
		4.50% UK TREASURY	360,000.00	448,693.20	
		4.50% UK TREASURY	390,000.00	488,677.80	
		4.75% UK TREASURY	490,000.00	557,522.00	
		4.75% UK TREASURY	440,000.00	545,116.00	
		4.75% UK TREASURY	320,000.00	409,632.00	
		4.75% UK TREASURY	320,000.00	415,296.00	
		5.00% UK TREASURY	430,000.00	475,227.40	
		5.00% UK TREASURY	280,000.00	341,832.40	
		5.00% UK TREASURY	320,000.00	417,504.00	
		6.00% UK TREASURY	220,000.00	322,438.60	
		8.00% UK TREASURY	40,000.00	50,488.00	
		8.00% UK TREASURY	30,000.00	45,225.00	
		8.75% UK TREASURY	170,000.00	238,484.50	
計		銘柄数：33	11,700,000.00	13,831,191.98	
				(1,779,521,160)	
		組入時価比率：8.1%		8.2%	
スイスフラン	スイスフラン	2.50% SWITZERLAND	90,000.00	98,352.00	
		3.00% SWITZERLAND	150,000.00	173,655.00	
		3.00% SWITZERLAND	170,000.00	201,365.00	
		4.00% SWITZERLAND	130,000.00	175,266.00	
		4.00% SWITZERLAND	70,000.00	101,990.00	
		4.25% SWITZERLAND	120,000.00	128,484.00	
		4.25% SWITZERLAND	190,000.00	229,197.00	
計		銘柄数：7	920,000.00	1,108,309.00	
				(94,660,671)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
スウェーデン クローネ	スウェーデン クローネ	3.00% SWEDEN GOV'T	780,000.00	841,308.00	
		3.5% SWEDEN GOV'T	1,410,000.00	1,680,043.20	
		3.5% SWEDEN GOV'T	470,000.00	633,005.40	
		3.75% SWEDEN GOV'T	1,120,000.00	1,269,856.00	
		4.25% SWEDEN GOV'T	1,960,000.00	2,346,825.60	
		4.50% SWEDEN GOV'T	1,510,000.00	1,675,496.00	
		5.00% SWEDEN GOV'T	1,920,000.00	2,484,902.40	
		6.75% SWEDEN GOV'T	60,000.00	66,738.00	
計		銘柄数：8	9,230,000.00	10,998,174.60	
				(124,719,299)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
ノルウェー クローネ	ノルウェー クローネ	3.75% NORWEGIAN GOV'T	680,000.00	783,564.00	
		4.25% NORWEGIAN GOV'T	980,000.00	1,112,104.00	
		4.50% NORWEGIAN GOV'T	560,000.00	662,928.00	
		5.00% NORWEGIAN GOV'T	900,000.00	994,770.00	
		6.50% NORWEGIAN GOV'T	1,500,000.00	1,572,525.00	

計	銘柄数：5	4,620,000.00	5,125,891.00
			(69,097,010)
	組入時価比率：0.3%		0.3%
デンマーク クローネ	2.00% KINGDOM OF DENMARK	1,180,000.00	1,230,268.00
	3.00% KINGDOM OF DENMARK	1,310,000.00	1,503,578.70
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	2,340,000.00	2,636,946.00
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	1,260,000.00	1,483,398.00
	4.00% KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	2,543,940.00
	4.50% KINGDOM OF DENMARK	2,310,000.00	3,504,963.00
	5.00% KINGDOM OF DENMARK	270,000.00	289,672.20
	7.00% KINGDOM OF DENMARK	340,000.00	544,306.00
計	銘柄数：8	11,110,000.00	13,737,071.90
			(189,571,592)
	組入時価比率：0.9%		0.9%
ポーランドズロチ	4.75% POLAND GOV'T	200,000.00	198,800.00
	5.00% POLAND GOV'T	810,000.00	811,377.00
	5.00% POLAND GOV'T	400,000.00	399,200.00
	5.25% POLAND GOV'T	460,000.00	462,300.00
	5.25% POLAND GOV'T	330,000.00	327,690.00
	5.5% POLAND GOV'T	540,000.00	549,180.00
	5.5% POLAND GOV'T	720,000.00	728,640.00
	5.75% POLAND GOV'T	940,000.00	955,510.00
	5.75% POLAND GOV'T	270,000.00	274,860.00
	5.75% POLAND GOV'T	860,000.00	876,727.00
	6.25% POLAND GOV'T	600,000.00	626,160.00
	計	銘柄数：11	6,130,000.00
			(147,373,836)
組入時価比率：0.7%			0.7%
オーストラリア ドル	4.50% AUSTRALIAN GOV'T	250,000.00	260,820.00
	4.50% AUSTRALIAN GOV'T	350,000.00	384,349.00
	4.75% AUSTRALIAN GOV'T	10,000.00	10,646.00
	4.75% AUSTRALIAN GOV'T	70,000.00	75,514.60
	5.25% AUSTRALIAN GOV'T	350,000.00	398,527.50
	5.50% AUSTRALIAN GOV'T	300,000.00	312,888.00
	5.50% AUSTRALIAN GOV'T	190,000.00	215,589.20
	5.50% AUSTRALIAN GOV'T	230,000.00	274,100.20
	5.75% AUSTRALIAN GOV'T	420,000.00	503,227.20
	5.75% AUSTRALIAN GOV'T	260,000.00	314,917.20
	6.00% AUSTRALIAN GOV'T	460,000.00	526,373.40
	6.25% AUSTRALIAN GOV'T	270,000.00	289,429.20
	6.25% AUSTRALIAN GOV'T	240,000.00	264,283.20
	6.50% AUSTRALIAN GOV'T	360,000.00	372,268.80
計	銘柄数：14	3,760,000.00	4,202,933.50
			(335,141,917)
	組入時価比率：1.5%		1.5%
シンガポールドル	0.25% SINGAPORE GOV'T	20,000.00	20,020.00
	2.25% SINGAPORE GOV'T	250,000.00	255,740.00
	2.25% SINGAPORE GOV'T	50,000.00	53,345.00
	2.50% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	65,376.00
	2.75% SINGAPORE GOV'T	30,000.00	30,432.00
	2.875% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	64,809.60
	3.00% SINGAPORE GOV'T	140,000.00	156,452.80
	3.125% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	68,260.80
	3.25% SINGAPORE GOV'T	100,000.00	114,325.00
	3.50% SINGAPORE GOV'T	90,000.00	105,275.70
	3.625% SINGAPORE GOV'T	150,000.00	160,903.50
	3.75% SINGAPORE GOV'T	130,000.00	148,512.00
	4.00% SINGAPORE GOV'T	130,000.00	155,152.40
	計	銘柄数：13	1,270,000.00
			(88,895,321)
組入時価比率：0.4%			0.4%
マレーシア リンギット	3.21% MALAYSIAN GOV'T	440,000.00	440,550.00
	3.434% MALAYSIAN GOV'T	520,000.00	523,338.40
	3.502% MALAYSIAN GOV'T	430,000.00	405,214.80

	3.58% MALAYSIAN GOV'T	390,000.00	393,315.00	
	3.741% MALAYSIAN GOV'T	370,000.00	374,902.50	
	3.835% MALAYSIAN GOV'T	260,000.00	264,599.40	
	4.012% MALAYSIAN GOV'T	70,000.00	72,194.50	
	4.16% MALAYSIAN GOV'T	330,000.00	344,051.40	
	4.24% MALAYSIAN GOV'T	440,000.00	458,229.20	
	4.262% MALAYSIAN GOV'T	250,000.00	260,190.00	
	4.378% MALAYSIAN GOV'T	210,000.00	221,424.00	
	5.094% MALAYSIAN GOV'T	560,000.00	581,420.00	
計	銘柄数：12	4,270,000.00	4,339,429.20	
			(112,521,399)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
小計			21,735,825,744	
			(21,735,825,744)	
公社債合計			21,735,825,744	
			(21,735,825,744)	
合計			21,735,825,744	
			(21,735,825,744)	

(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183銘柄	100.0%	42.4%
カナダドル	国債証券31銘柄	100.0%	2.9%
メキシコペソ	国債証券14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券235銘柄	100.0%	40.2%
ポンド	国債証券33銘柄	100.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券7銘柄	100.0%	0.4%
スウェーデンクローネ	国債証券8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券8銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券11銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券14銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券13銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券12銘柄	100.0%	0.5%

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24年6月末現在です。

日立バランスファンド（株式70）

資産総額	10,475,567,388円
負債総額	6,364,642円
純資産総額（ - ）	10,469,202,746円
発行済口数	10,033,261,031口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0434円

日立バランスファンド（株式50）

資産総額	13,800,245,417円
負債総額	8,036,148円
純資産総額（ - ）	13,792,209,269円
発行済口数	12,534,805,749口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1003円

日立バランスファンド（株式30）

資産総額	5,468,779,761円
負債総額	2,702,835円
純資産総額（ - ）	5,466,076,926円
発行済口数	4,796,629,717口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1396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	42,257,436,896円
負債総額	62,396,285円
純資産総額（ - ）	42,195,040,611円
発行済口数	60,188,609,133口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7010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	95,247,185,766円
負債総額	960,886,500円
純資産総額（ - ）	94,286,299,266円
発行済口数	75,556,103,440口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2479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	55,540,870,306円
負債総額	37,757,952円
純資産総額（ - ）	55,503,112,354円
発行済口数	64,865,904,030口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8557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	21,905,940,545円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	21,905,940,545円
発行済口数	15,678,171,767口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3972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24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24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242,800百万円です。（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	68,553
	私募	6	174,246
合計		13	242,800

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、「財務諸表等規則」及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第12期 (平成23年3月31日現在)	第13期 (平成24年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	674	766
未収委託者報酬	220,309	213,172
未収運用受託報酬	3,729	3,109
関係会社預け金	1 612,715	1 636,613
前払費用	21,894	22,390
繰延税金資産	18,077	18,081
その他	-	43
流動資産合計	877,400	894,177
固定資産		
無形固定資産		
ソフトウェア	9,692	8,811
無形固定資産合計	9,692	8,811
投資その他の資産		
繰延税金資産	23,463	25,794
投資その他の資産合計	23,463	25,794
固定資産合計	33,156	34,606
資産合計	910,556	928,783

(単位：千円)

	第12期		第13期	
	(平成23年3月31日現在)		(平成24年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
未払金	1 3	80,292	1 3	79,231
未払費用	1	143,038	1	139,454
未払法人税等	2	9,544	2	8,169
預り金		117		1,028
賞与引当金		27,135		29,134
その他流動負債		2		-
流動負債合計		260,130		257,016
固定負債				
退職給付引当金		57,664		67,843
固定負債合計		57,664		67,843
負債合計		317,794		324,860
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		217,762		228,922
利益剰余金合計		292,762		303,922
株主資本合計		592,762		603,922
純資産合計		592,762		603,922
負債純資産合計		910,556		928,783

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第12期 （ 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日 ）		第13期 （ 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日 ）	
営業収益				
委託者報酬		468,371		454,628
運用受託報酬		541,141		558,458
営業収益計		1,009,512		1,013,086
営業費用				
支払手数料		270,339		261,528
委託計算費		21,639		21,385
調査費		156,962		179,869
営業雑経費				
通信費		4,072		3,869
印刷費		3,791		3,821
諸会費		3,047		3,138
営業雑経費計		10,911		10,828
営業費用計		459,852		473,612
一般管理費				
給料				
役員報酬	2	18,934	2	18,693
給料・手当		214,346		215,001
賞与		2,728		2,603
給料計		236,009		236,297
交際費		16,650		11,036
旅費交通費		14,912		4,697
租税公課		105		63
不動産賃借料		76,577		76,577
賞与引当金繰入額		56,820		57,621
退職給付費用		9,671		10,179
その他の人件費		36,156		39,385
その他の不動産関係費		761		670
減価償却費		3,893		3,022
諸雑費		7,516		9,596
一般管理費計	1	459,075	1	449,147
営業利益		90,584		90,326
営業外収益				
受取利息		1,013		916
訴訟和解金		6,003		322
その他		294		7
営業外収益計	1	7,310	1	1,246
営業外費用				
為替差損		6		-
その他		13		-
営業外費用計		19		-
経常利益		97,875		91,572
税引前当期純利益		97,875		91,572
法人税等	3	49,416	3	46,747
法人税等調整額		3,442		2,335
法人税等合計		45,973		44,412
当期純利益		51,901		47,160

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第12期	第13期
	（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	191,060	217,762
当期変動額		
剰余金の配当	25,200	36,000
当期純利益	51,901	47,160
当期変動額合計	26,701	11,160
当期末残高	217,762	228,922
利益剰余金合計		
当期首残高	266,060	292,762
当期変動額		
剰余金の配当	25,200	36,000
当期純利益	51,901	47,160
当期変動額合計	26,701	11,160
当期末残高	292,762	303,922
株主資本合計		
当期首残高	566,060	592,762
当期変動額		
剰余金の配当	25,200	36,000
当期純利益	51,901	47,160
当期変動額合計	26,701	11,160
当期末残高	592,762	603,922
純資産合計		
当期首残高	566,060	592,762
当期変動額		
剰余金の配当	25,200	36,000
当期純利益	51,901	47,160
当期変動額合計	26,701	11,160
当期末残高	592,762	603,922

重要な会計方針

第13期 (自平成23年4月1日 至平成24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。
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いません。
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。

追加情報

第13期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用	当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

第12期 (平成23年3月31日現在)	第13期 (平成24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 612,715千円 未払金 35,553千円 未払費用 7,276千円	1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 636,613千円 未払金 34,512千円 未払費用 7,241千円
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	2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 3,178千円 未払事業税 4,990千円
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)

第12期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第13期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

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	1. 関係会社との取引高 一般管理費 87,992千円 営業外収益 916千円
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）

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24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)当事業年度期首株式数 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>	<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)当事業年度期首株式数 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 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> <p>(2)当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 平成24年5月31日 第13回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 33,000,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 5,500円 基準日 平成24年 3月31日 効力発生日 平成24年 6月 1日</p>

（リース取引関係）

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24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	-	-	-

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組み方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

また、資金管理にあたっては、投資信託財産に属する金銭を信託銀行で管理することで、投資信託委託会社としての金銭等との混同を来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24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	766	766	-
未収委託者報酬	213,172	213,172	-
未収運用受託報酬	3,109	3,109	-
関係会社預け金	636,613	636,613	-
資産計	853,661	853,661	-

未払金	79,231	79,231	-
未払費用	139,454	139,454	-
負債計	218,685	218,685	-

(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	766	-	-	-
未収委託者報酬	213,172	-	-	-
未収運用受託報酬	3,109	-	-	-
関係会社預け金	636,613	-	-	-
合計	853,661	-	-	-

(有価証券関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(デリバティブ取引関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

第12期 (平成23年3月31日現在)	第13期 (平成24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 57,664千円 (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 67,843千円 (退職給付引当金)
3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 9,671千円 (退職給付費用)	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 10,179千円 (退職給付費用)
4. なお、退職給付債務および退職給付費用の算定方法として簡便法を採用しております。	4. 同左

(税効果会計関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)																				
<p>1. 繰延税金資産の発生 の主な原因別内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">11,041千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">23,463</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">2,346</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">4,689</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">41,540</td> </tr> </table>	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	<p>1. 繰延税金資産の発生 の主な原因別内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">11,076千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">25,794</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">1,897</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">5,107</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">43,876</td> </tr> </table>	賞与引当金	11,076千円	退職給付引当金	25,794	未払事業税	1,897	その他	5,107	繰延税金資産合計	43,876
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																				
賞与引当金	11,076千円																				
退職給付引当金	25,794																				
未払事業税	1,897																				
その他	5,107																				
繰延税金資産合計	43,876																				
<p>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</p> <p style="text-align: center;">(%)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.7</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td> 交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">6.1</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">0.2</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">47.0</td> </tr> </table>	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	<p>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</p> <p style="text-align: center;">(%)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.7</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td> 交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.3</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">3.5</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">48.5</td> </tr> </table>	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	4.3	その他	3.5	税効果会計適用後の法人税等の負担率	48.5
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																				
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	4.3																				
その他	3.5																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	48.5																				
	<p>3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.7%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更されております。</p> <p>その結果、繰延税金資産の金額及び当事業年度に計上された法人税等調整額に与える影響は軽微であります。</p>																				

(ストックオプション等関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。	同左
-------------	----

(持分法損益等関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(資産除去債務関係)

第12期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	第13期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(セグメント情報等)

前事業年度（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。

有形固定資産

該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

(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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

(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	307,092
日立国内株式特化型ファンド（注）	114,682

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

（関連当事者情報）

前事業年度（自 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）

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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	427,775 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	34,694	未払金	34,512
								預け金の利息	916	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,125,524	関係会社預け金	636,613
								親会社に対する預け金の減少	1,101,626		

（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）

（注）事業年度末現在（平成24年3月31日）で上場している取引所である。

（1株当たり情報）

第12期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第13期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
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株当たり純資産額 100,653円81銭 1株当たり当期純利益 7,860円09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 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	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 47,160千円 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 47,160千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

（重要な後発事象）

第12期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第13期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24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) 通常の実取引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いません。

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24年6月末現在）

(1) 受託者（受託会社）

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

(2) 販売会社

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

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の名称、資本金の額及び事業の内容

名称	資本金の額	事業の内容
野村アセットマネジメント株式会社 （1959年12月1日設立）	17,180百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社 （1998年2月25日設立）	310百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
MU投資顧問株式会社 （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）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23年 8月15日
有価証券報告書	平成23年 8月15日
有価証券届出書の訂正届出書	平成23年10月17日
半期報告書	平成24年 2月15日
有価証券届出書の訂正届出書	平成24年 2月15日

独立監査人の監査報告書

平成24年7月30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 辻 幸一 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 関口 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式70）の平成23年5月17日から平成24年5月15日までの第11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、注記表並びに付属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式70）の平成24年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．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24年7月30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 辻 幸一 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 関口 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式50）の平成23年5月17日から平成24年5月15日までの第11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、注記表並びに付属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式50）の平成24年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 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24年7月30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 辻 幸一 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 関口 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式30）の平成23年5月17日から平成24年5月15日までの第11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、注記表並びに付属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立バランスファンド（株式30）の平成24年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 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24年7月30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 辻 幸一 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 関口 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている日立投資顧問株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第13期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日立投資顧問株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 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。