

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年2月13日
【発行者名】	日立投資顧問株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 川手 健
【本店の所在の場所】	東京都千代田区神田練堀町3番地
【事務連絡者氏名】	ファンド管理グループ 都地 雅夫
【電話番号】	03-4554-5121
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券に係る ファンドの名称】	日立バランスファンド（株式70） 日立バランスファンド（株式50） 日立バランスファンド（株式30）
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額は以下のとおりです。 日立バランスファンド（株式70）5,000億円を上限とします。 日立バランスファンド（株式50）5,000億円を上限とします。 日立バランスファンド（株式30）5,000億円を上限とします。 合計15,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年8月15日付をもって提出した有価証券届出書（なお、2019年11月15日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下、「原届出書」といいます。）の記載事項につき、本日、半期報告書の提出に伴い関連情報を新たな情報に更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

．【訂正の内容】

下線を附した部分が訂正箇所です。更新・訂正後の内容、追加の内容、削除の内容を表示している個所につきましては、下線を附しておりません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社の概況（2019年8月15日現在）

〔以下 略〕

<訂正後>

委託会社の概況（2020年2月13日現在）

〔以下 略〕

2【投資方針】

（3）【運用体制】

<更新・訂正後>

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。2019年12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。2019年12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。2019年12月末現在10名在籍。

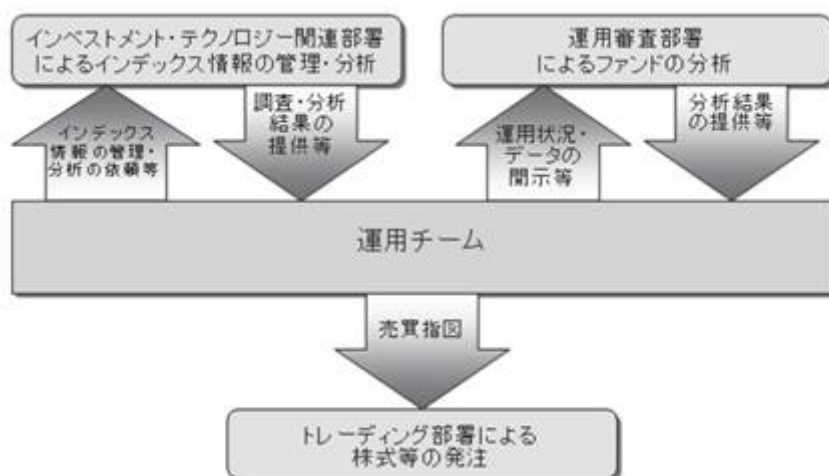
コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーは、諸法令、投資信託約款等の遵守状況や運用リスクの状況などを定期的に監視しています。2019年12月末現在コンプライアンスオフィサーおよびリスク管理オフィサーは各1名在籍。

〔中略〕

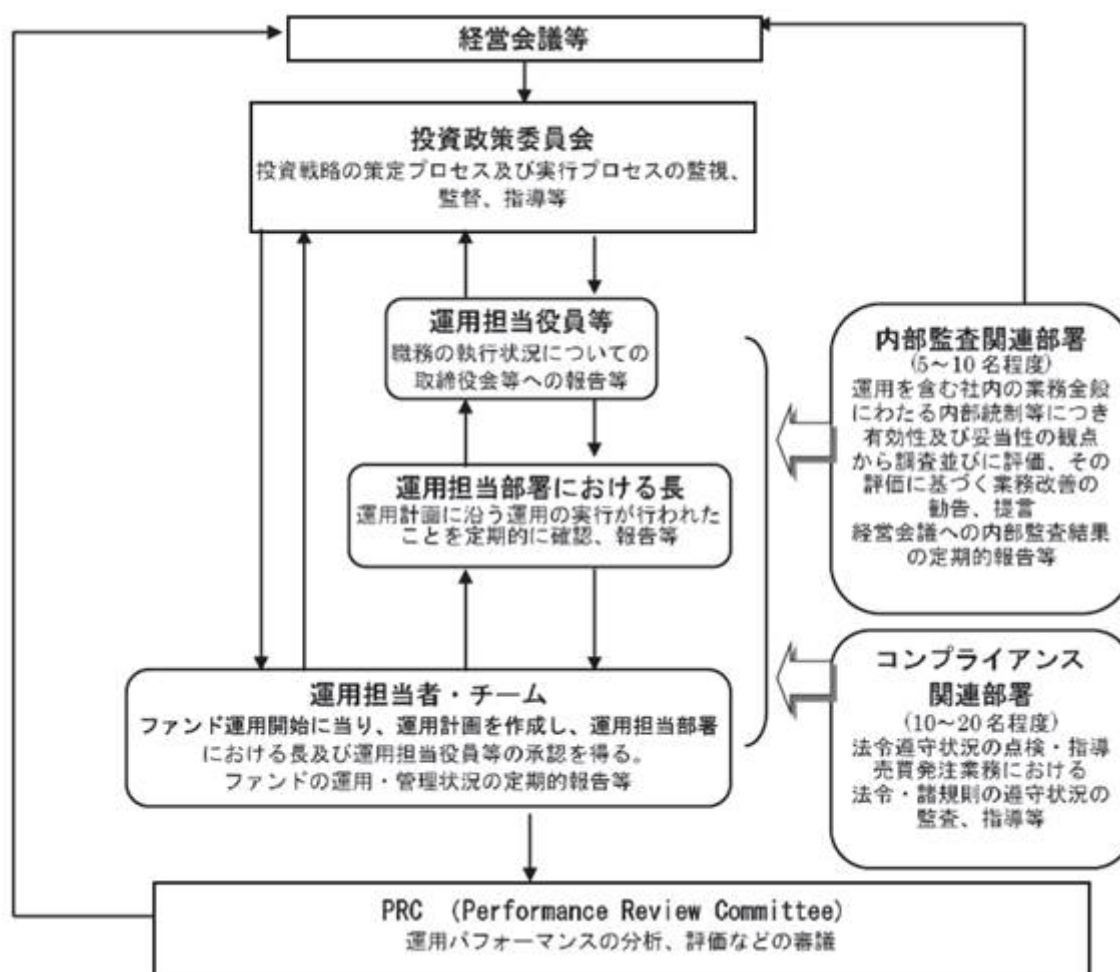
（ご参考）

「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

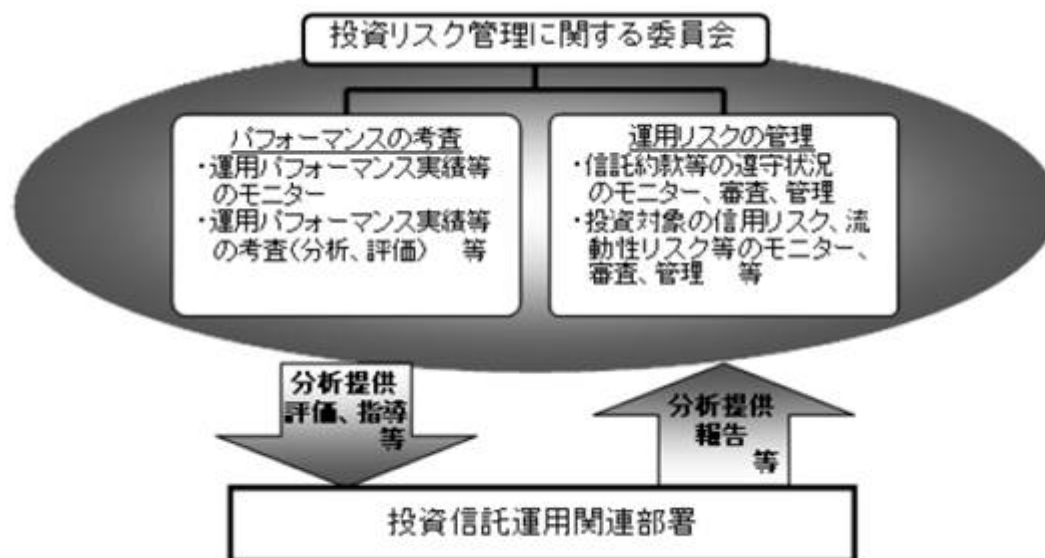
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2019年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

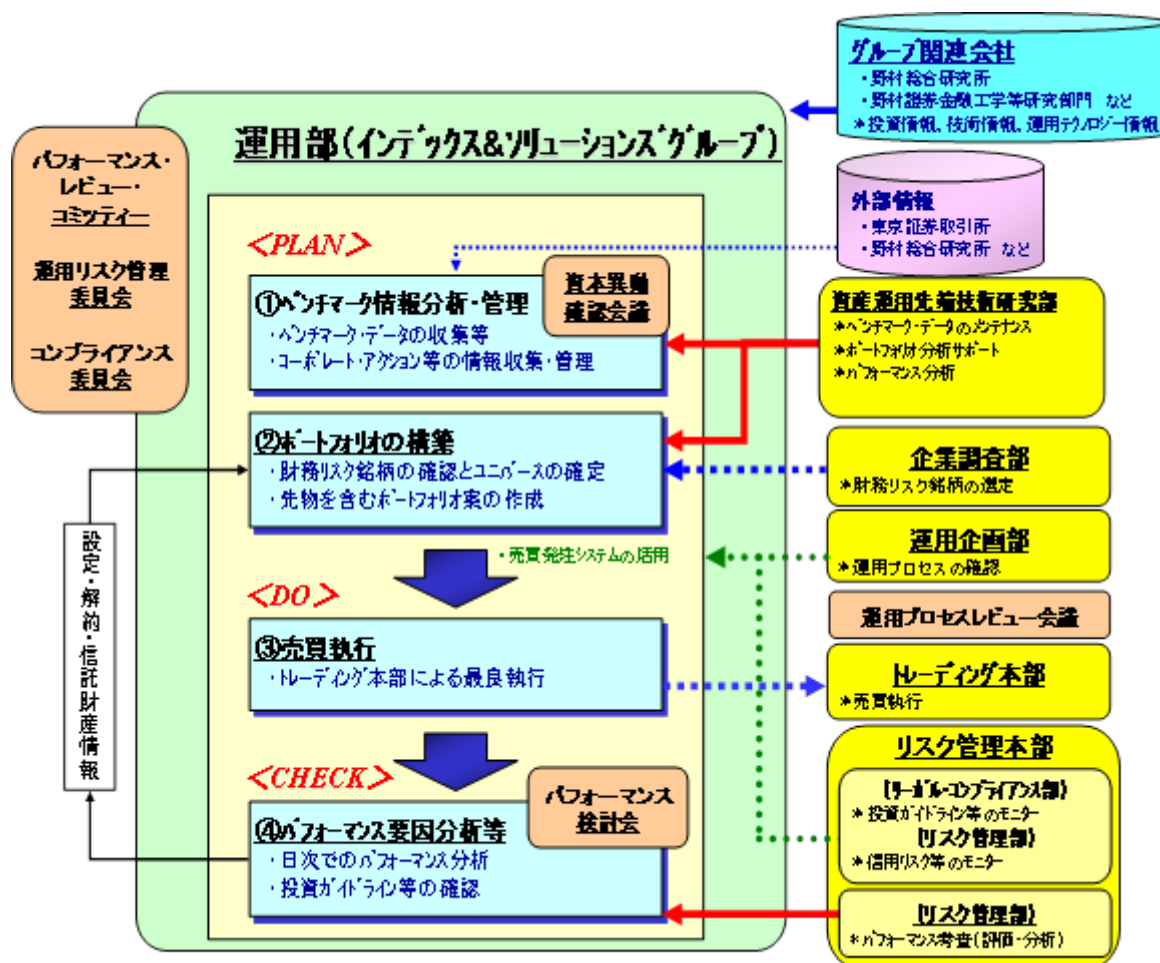


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

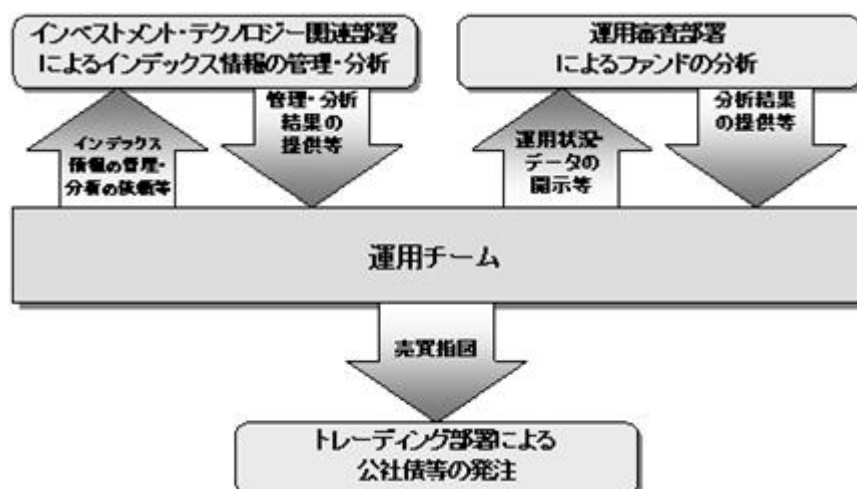
基本的には、東京証券取引所第1部の銘柄全てを、その時価総額割合に基づき組み入れますが、一部財務リスクの高い銘柄を除外しています。



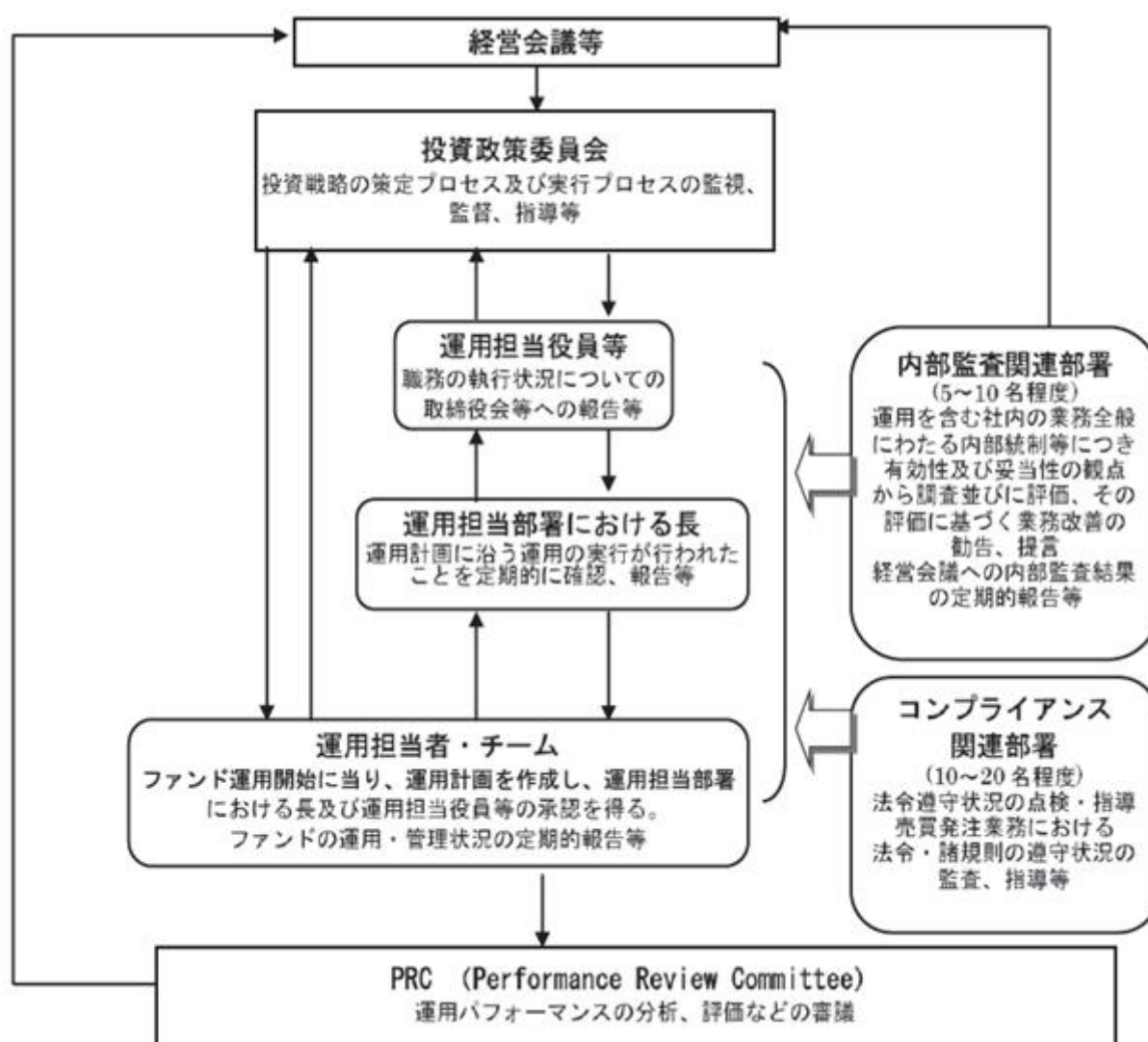
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

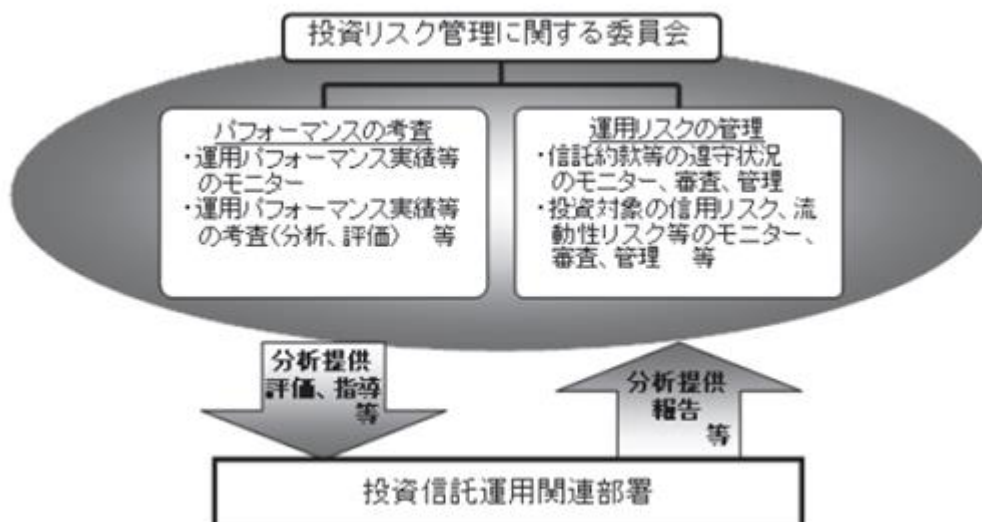
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2019年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

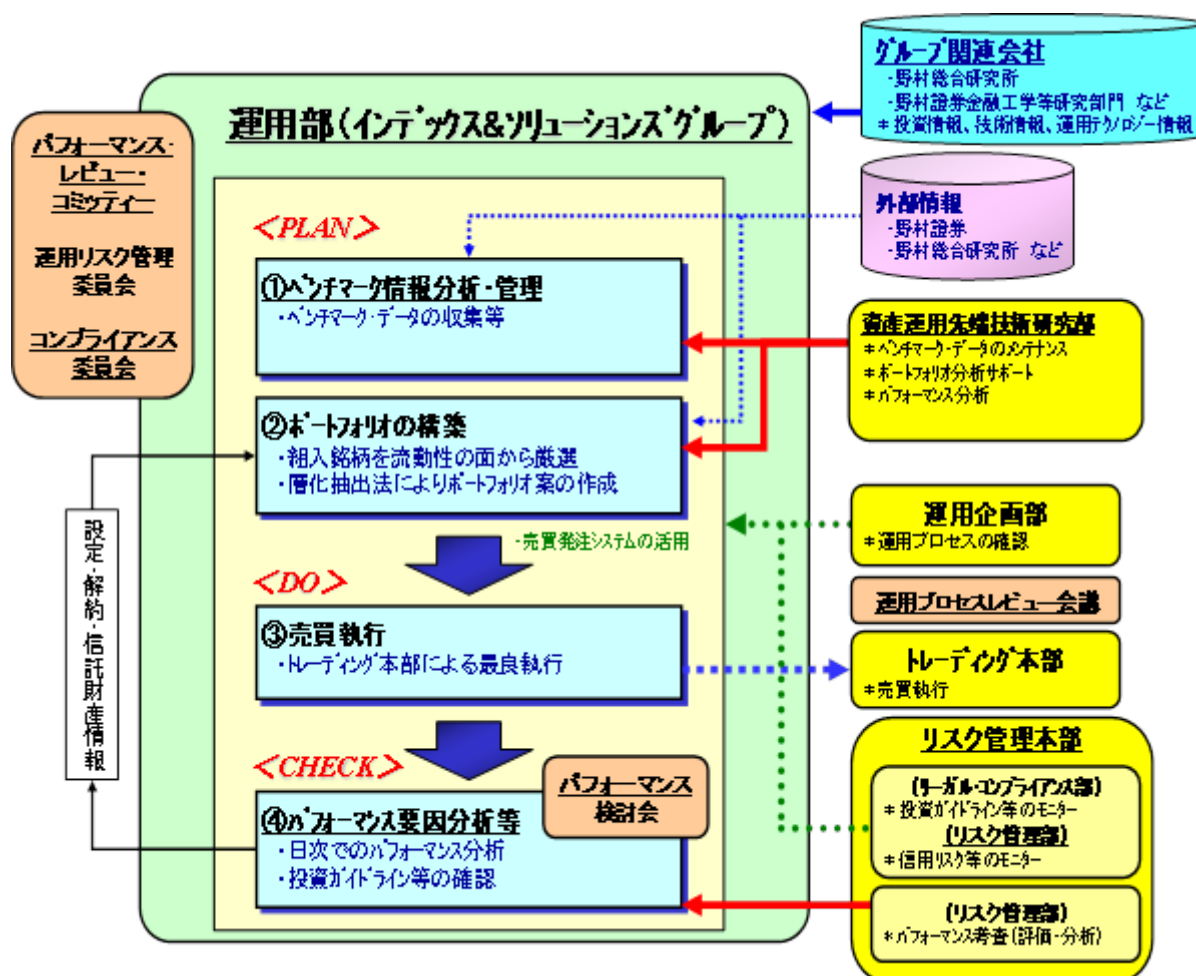


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



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・解約等の資金流出入データ等入手した後、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。（2019年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

〔中略〕

（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。（2019年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

〔以下 略〕

3【投資リスク】

(1) 主なリスクおよび留意点

ファミリーファンド方式に係る留意点

<更新・訂正後>

〔中略〕

2019年12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T O P I X インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	5,467,382,199
	日立バランスファンド（株式50）	3,886,951,218
	日立バランスファンド（株式30）	997,101,753
	日立国内株式インデックスファンド	11,205,928,882
	日立国内株式T O P I Xインデックスファンド （非課税適格機関投資家専用）	7,838,425,823
	合計	29,395,789,875

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立国内債券 インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	3,407,508,069
	日立バランスファンド（株式50）	6,549,164,460
	日立バランスファンド（株式30）	3,832,436,753
	日立国内債券インデックスファンド	11,346,084,358
	日立国内債券特化型ファンドN （非課税適格機関投資家専用）	46,339,833,709
	合計	71,475,027,349

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 ）	2,754,761,844
	日立バランスファンド（株式 5 0 ）	1,740,783,954
	日立バランスファンド（株式 3 0 ）	332,617,925
	日立外国株式インデックスファンド	12,129,806,115
	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）	22,512,903,838
	合計	39,470,873,676

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 7 0 ）	1,039,796,311
	日立バランスファンド（株式 5 0 ）	1,004,286,431
	日立バランスファンド（株式 3 0 ）	390,069,028
	日立外国債券インデックスファンド	6,792,813,844
	日立外国債券特化型ファンドⅡ（為替ヘッジなし） （非課税適格機関投資家専用）	9,049,758,062
	合計	18,276,723,676

(2) リスク管理体制

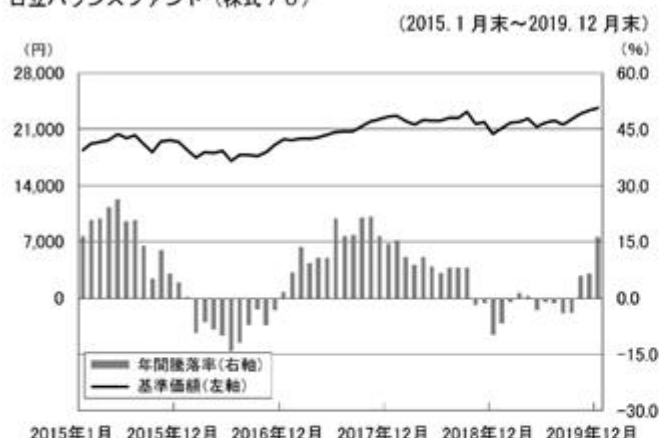
< 更新・訂正後 >

〔 中略 〕

< リスクの定量的比較 >

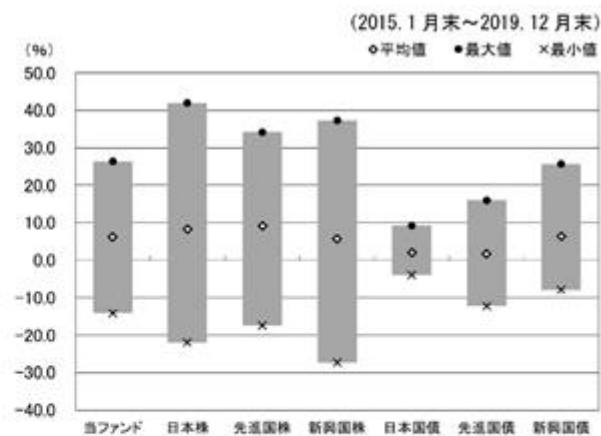
○ファンドの年間騰落率及び基準価額の推移

日立バランスファンド（株式70）



※年間騰落率は、2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

○ 代表的な資産クラスと騰落率の比較



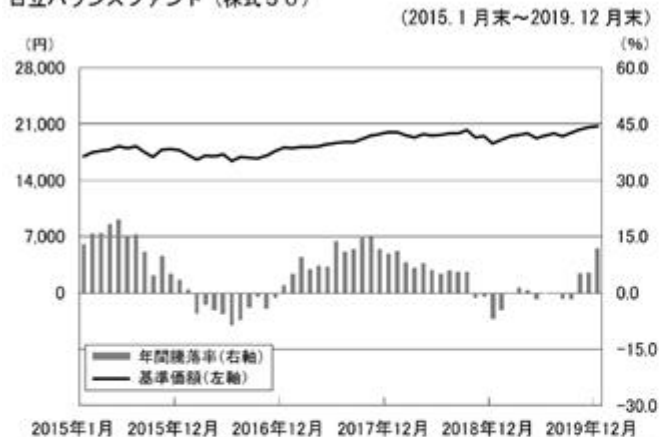
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値%	6.3	8.2	9.2	5.6	2.1	1.7	6.3
最大値%	26.4	41.9	34.1	37.2	9.3	15.9	25.7
最小値%	△ 14.2	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 8.0

※2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

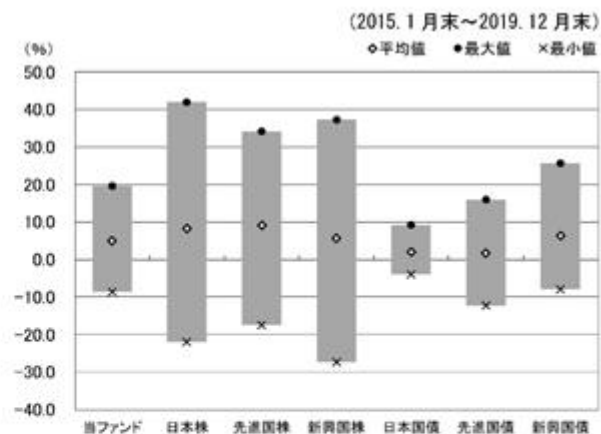
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド（株式50）



※年間騰落率は、2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値%	4.9	8.2	9.2	5.6	2.1	1.7	6.3
最大値%	19.6	41.9	34.1	37.2	9.3	15.9	25.7
最小値%	△ 8.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 8.0

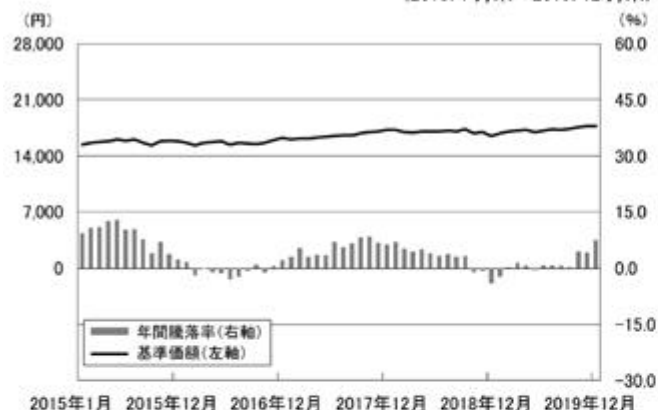
※2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド（株式30）

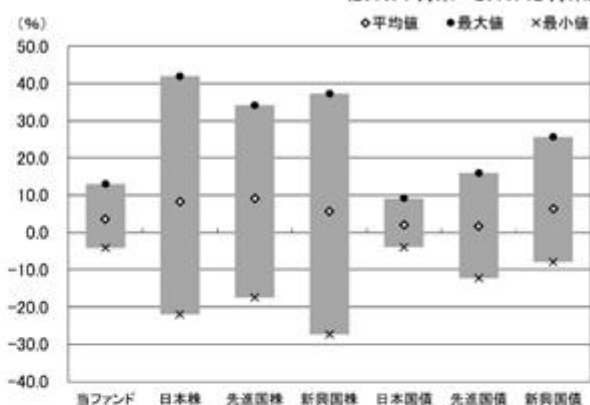
(2015.1月末～2019.12月末)



2015年1月 2015年12月 2016年12月 2017年12月 2018年12月 2019年12月

*年間騰落率は、2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

(2015.1月末～2019.12月末)



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値%	3.6	8.2	9.2	5.6	2.1	1.7	6.3
最大値%	13.0	41.9	34.1	37.2	9.3	15.9	25.7
最小値%	△ 4.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 8.0

*2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX) (配当込み)

先進国株・・・MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI 国債

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（３）【信託報酬等】

<訂正前>

委託者および受託者の信託報酬の総額は、2019年11月16日以降、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。

〔以下 略〕

<訂正後>

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。

〔以下 略〕

（ご参考）マザーファンドにおける管理報酬等

<訂正前>

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、2019年11月16日以降、毎日、この投資信託が保有するそれぞれの運用再委託先が運用するマザーファンドの純資産総額に次表の率を乗じて得た額とします。

〔以下 略〕

<訂正後>

マザーファンドについては信託報酬を収受しません。

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

〔以下 略〕

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

〔中略〕

- * 税制に関する記載は、2019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。

<訂正後>

〔中略〕

- * 税制に関する記載は、2020年1月末現在の情報をもとに作成しています。税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。
- * 税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は2019年12月30日現在の運用状況であり、原届出書が以下の内容に更新・訂正されます。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

<更新・訂正後>

日立バランスファンド（株式７０）

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	24,991,674,645	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	240,443,270	0.95
合計(純資産総額)		25,232,117,915	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.上位銘柄明細

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (％)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式ＴＯＰＩＸ インデックスマザーファンド	5,467,382,199	1.6251	8,885,042,812	1.8368	10,042,487,623	39.80
2	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	2,754,761,844	2.4567	6,767,623,423	2.8040	7,724,352,210	30.61
3	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,407,508,069	1.4191	4,835,847,232	1.4245	4,853,995,244	19.23
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	1,039,796,311	2.1794	2,266,179,495	2.2801	2,370,839,568	9.39

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

日立バランスファンド（株式５０）

（１）投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	23,639,868,468	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	227,775,277	0.95
合計(純資産総額)		23,867,643,745	100.00

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．上位銘柄明細

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (％)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	6,549,164,460	1.4186	9,290,851,818	1.4245	9,329,284,773	39.08
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式ＴＯＰＩＸ インデックスマザーファンド	3,886,951,218	1.6249	6,315,907,035	1.8368	7,139,551,997	29.91
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	1,740,783,954	2.4569	4,276,932,097	2.8040	4,881,158,207	20.45
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	1,004,286,431	2.1788	2,188,139,276	2.2801	2,289,873,491	9.59

ロ．種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日立バランスファンド（株式３０）

（１）投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,112,839,704	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	87,787,727	0.95
合計(純資産総額)		9,200,627,431	100.00

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ．上位銘柄明細

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (％)
1	日本	親投資信託 受益証券	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,832,436,753	1.4186	5,437,075,245	1.4245	5,459,306,154	59.33
2	日本	親投資信託 受益証券	日立国内株式ＴＯＰＩＸ インデックスマザーファンド	997,101,753	1.6235	1,618,794,696	1.8368	1,831,476,499	19.90
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	332,617,925	2.4549	816,543,745	2.8040	932,660,661	10.13
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	390,069,028	2.1788	849,885,595	2.2801	889,396,390	9.66

ロ．種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考）

日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	53,088,871,200	98.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	905,738,403	1.67
合計(純資産総額)		53,994,609,603	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	912,130,000	1.68

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	243,600	6,674.32	1,625,865,064	7,714.00	1,879,130,400	3.48
2	日本	株式	ソニー	電気機器	138,200	4,832.55	667,858,540	7,401.00	1,022,818,200	1.89
3	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,484,000	556.36	825,645,094	593.20	880,308,800	1.63
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	170,200	5,413.82	921,433,800	4,756.00	809,471,200	1.49
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	286,700	2,382.84	683,163,080	2,757.00	790,431,900	1.46
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	181,900	4,518.99	822,004,706	4,332.00	787,990,800	1.45
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	19,800	34,327.45	679,683,510	38,490.00	762,102,000	1.41
8	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	149,600	3,179.23	475,613,605	4,099.00	613,210,400	1.13
9	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	149,100	3,922.62	584,863,470	4,038.00	602,065,800	1.11
10	日本	株式	任天堂	その他製品	13,400	33,021.85	442,492,790	43,970.00	589,198,000	1.09
11	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	172,100	3,051.50	525,163,798	3,099.00	533,337,900	0.98
12	日本	株式	K D D I	情報・通信業	159,800	2,441.69	390,183,146	3,253.00	519,829,400	0.96
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,929,400	172.17	504,377,770	168.30	493,018,020	0.91
14	日本	株式	日立製作所	電気機器	105,000	3,721.40	390,747,744	4,626.00	485,730,000	0.89
15	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	158,400	2,526.29	400,164,368	3,038.00	481,219,200	0.89
16	日本	株式	花王	化学	52,300	8,677.55	453,835,865	9,025.00	472,007,500	0.87
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	77,100	5,456.75	420,715,880	6,119.00	471,774,900	0.87
18	日本	株式	H O Y A	精密機器	43,600	7,559.39	329,589,404	10,450.00	455,620,000	0.84
19	日本	株式	第一三共	医薬品	62,500	5,585.88	349,117,500	7,228.00	451,750,000	0.83
20	日本	株式	信越化学工業	化学	36,800	9,657.49	355,395,650	12,060.00	443,808,000	0.82
21	日本	株式	三菱商事	卸売業	151,100	3,090.57	466,986,597	2,900.00	438,190,000	0.81
22	日本	株式	村田製作所	電気機器	64,200	5,539.79	355,654,538	6,746.00	433,093,200	0.80
23	日本	株式	ダイキン工業	機械	27,800	12,970.72	360,586,016	15,450.00	429,510,000	0.79
24	日本	株式	ファナック	電気機器	20,800	19,387.48	403,259,728	20,330.00	422,864,000	0.78
25	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	18,200	25,808.66	469,717,612	22,000.00	400,400,000	0.74
26	日本	株式	日本電産	電気機器	26,300	14,305.08	376,223,604	15,005.00	394,631,500	0.73
27	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	150,600	2,040.50	307,299,640	2,534.50	381,695,700	0.70
28	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	38,500	10,794.99	415,607,324	9,858.00	379,533,000	0.70
29	日本	株式	三井物産	卸売業	189,200	1,751.82	331,444,890	1,946.00	368,183,200	0.68
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	192,300	1,681.90	323,430,991	1,870.00	359,601,000	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.28
		建設業	2.76
		食料品	3.71
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.01
		医薬品	5.91
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.58
		機械	5.02
		電気機器	14.15
		輸送用機器	7.57
		精密機器	2.33
		その他製品	2.29
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.31
		海運業	0.17
		空運業	0.49
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.56
		卸売業	4.91
		小売業	4.56
		銀行業	5.75
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.27
		その他金融業	1.16
		不動産業	2.38
		サービス業	5.08
合計			98.32

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
（先物）

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指数 先物取引	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	53	日本円	907,711,235	912,130,000	1.68

（ご参考）

日立国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	80,218,157,050	78.78
地方債証券	日本	6,662,756,270	6.54
特殊債券	日本	8,726,223,542	8.57
社債券	日本	5,345,446,000	5.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	864,736,759	0.84
合計(純資産総額)		101,817,319,621	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第127回利付国債 (5年)	940,000,000	100.54	945,084,000	100.28	942,650,800	0.1	2021/3/20	0.92
2	日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	900,000,000	103.45	931,104,000	102.53	922,833,000	0.8	2022/9/20	0.90
3	日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	900,000,000	102.55	923,004,000	101.48	913,374,000	0.1	2026/9/20	0.89
4	日本	国債証券	第138回利付国債 (5年)	900,000,000	101.78	916,038,000	100.93	908,406,000	0.1	2023/12/20	0.89
5	日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	820,000,000	102.19	838,007,200	101.46	831,996,600	0.1	2026/6/20	0.81
6	日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	810,000,000	103.14	835,513,200	102.22	827,998,200	1	2021/12/20	0.81
7	日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	800,000,000	102.63	821,109,400	101.56	812,552,000	0.1	2028/3/20	0.79
8	日本	国債証券	第129回利付国債 (5年)	800,000,000	100.72	805,835,000	100.41	803,344,000	0.1	2021/9/20	0.78
9	日本	国債証券	第402回利付国債 (2年)	800,000,000	100.70	805,616,000	100.35	802,848,000	0.1	2021/7/1	0.78
10	日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	760,000,000	103.17	784,137,600	102.37	778,072,800	0.6	2023/3/20	0.76
11	日本	国債証券	第32回利付国債 (30年)	530,000,000	143.04	758,112,100	139.55	739,630,900	2.3	2040/3/20	0.72
12	日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	720,000,000	102.46	737,735,200	101.50	730,850,400	0.1	2026/12/20	0.71
13	日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	700,000,000	104.52	731,683,000	103.48	724,360,000	0.8	2023/9/20	0.71
14	日本	国債証券	第315回利付国債 (10年)	700,000,000	103.07	721,490,000	101.94	713,643,000	1.2	2021/6/20	0.70
15	日本	国債証券	第356回利付国債 (10年)	700,000,000	101.86	713,077,000	101.21	708,505,000	0.1	2029/9/20	0.69
16	日本	国債証券	第152回利付国債 (20年)	600,000,000	117.74	706,494,000	115.77	694,656,000	1.2	2035/3/20	0.68
17	日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	660,000,000	102.15	674,195,200	101.52	670,058,400	0.1	2027/3/20	0.65
18	日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	650,000,000	103.73	674,249,000	102.77	668,018,000	0.8	2022/12/20	0.65
19	日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	650,000,000	102.16	664,059,500	101.60	660,419,500	0.1	2027/12/20	0.64
20	日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	650,000,000	102.11	663,767,000	101.40	659,132,500	0.1	2026/3/20	0.64
21	日本	国債証券	第141回利付国債 (5年)	650,000,000	101.49	659,729,500	101.08	657,072,000	0.1	2024/9/20	0.64
22	日本	国債証券	第9回利付国債 (40年)	660,000,000	100.90	665,992,900	99.06	653,796,000	0.4	2056/3/20	0.64
23	日本	国債証券	第333回利付国債 (10年)	630,000,000	103.95	654,894,000	103.10	649,555,200	0.6	2024/3/20	0.63
24	日本	国債証券	第317回利付国債 (10年)	630,000,000	103.17	649,989,900	102.11	643,343,400	1.1	2021/9/20	0.63
25	日本	国債証券	第131回利付国債 (5年)	620,000,000	100.84	625,263,800	100.52	623,279,800	0.1	2022/3/20	0.61

26	日本	国債証券	第329回利付国債 （10年）	590,000,000	104.23	614,957,000	103.26	609,234,000	0.8	2023/6/20	0.59
27	日本	国債証券	第341回利付国債 （10年）	590,000,000	103.40	610,083,600	102.57	605,216,100	0.3	2025/12/20	0.59
28	日本	国債証券	第353回利付国債 （10年）	590,000,000	101.98	601,701,200	101.39	598,224,600	0.1	2028/12/20	0.58
29	日本	国債証券	第140回利付国債 （5年）	570,000,000	102.23	582,745,200	101.02	575,865,300	0.1	2024/6/20	0.56
30	日本	国債証券	第128回利付国債 （5年）	560,000,000	100.62	563,488,800	100.34	561,954,400	0.1	2021/6/20	0.55

□.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	78.78
地方債証券	6.54
特殊債券	8.57
社債券	5.25
合計	99.15

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考）

日立外国株式インデックスマザーファンド
投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	73,157,370,841	66.09
	カナダ	3,863,551,582	3.49
	ユーロ(ドイツ)	3,273,384,966	2.95
	ユーロ(イタリア)	744,698,841	0.67
	ユーロ(フランス)	4,044,347,261	3.65
	ユーロ(オランダ)	1,826,304,253	1.65
	ユーロ(スペイン)	1,094,641,413	0.98
	ユーロ(ベルギー)	379,177,651	0.34
	ユーロ(オーストリア)	84,441,746	0.07
	ユーロ(ルクセンブルク)	95,737,363	0.08
	ユーロ(フィンランド)	355,874,004	0.32
	ユーロ(アイルランド)	361,212,468	0.32
	ユーロ(ポルトガル)	61,670,046	0.05
	ユーロ(イギリス)	86,942,908	0.07
	ユーロ(マルタ共和国)	0	0
	イギリス	6,190,504,062	5.59
	スイス	3,597,718,118	3.25
	スウェーデン	1,046,923,934	0.94
	ノルウェー	241,360,733	0.21
	デンマーク	706,130,245	0.63
	オーストラリア	2,673,292,845	2.41
	ニュージーランド	102,723,848	0.09
	香港	1,223,972,003	1.10
	シンガポール	482,246,018	0.43
	イスラエル	147,203,313	0.13
	小計	105,841,430,462	95.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,836,812,912	4.37
合計(純資産総額)		110,678,243,374	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,316,552,112	2.99
	買建	カナダ	187,692,951	0.16
	買建	ドイツ	761,260,728	0.68
	買建	イギリス	326,553,306	0.29
	買建	オーストラリア	167,716,536	0.15

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

資産の種類	建別	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	—	5,036,516	0.00

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	106,090	20,894.18	2,216,664,363	31,750.48	3,368,409,272	3.04
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	170,356	12,982.99	2,211,731,148	17,415.65	2,966,861,766	2.68
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	9,844	195,705.90	1,926,528,978	204,855.28	2,016,595,455	1.82
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	56,500	18,434.34	1,041,540,439	22,799.43	1,288,168,134	1.16
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	75,118	11,171.83	839,205,766	15,244.17	1,145,112,193	1.03
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	7,345	128,999.77	947,503,332	148,113.06	1,087,890,487	0.98
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	7,030	129,427.06	909,872,294	148,414.35	1,043,352,940	0.94
8	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	61,807	15,285.85	944,772,723	15,968.37	986,957,045	0.89
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・ サービス	40,540	17,151.25	695,311,705	20,749.56	841,187,503	0.76
10	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバ コ	69,946	10,681.37	747,119,246	11,959.36	836,509,395	0.75
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	58,636	11,449.27	671,339,725	13,814.42	810,022,355	0.73
12	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	207,836	3,041.38	632,109,418	3,872.94	804,937,605	0.72
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	30,950	22,124.32	684,747,973	24,775.89	766,814,055	0.69
14	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	98,822	8,836.18	873,209,617	7,657.14	756,694,719	0.68
15	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	171,763	3,453.66	593,211,654	4,299.13	738,432,222	0.66
16	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・ サービス	22,164	26,938.03	597,054,576	32,426.47	718,700,352	0.64
17	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・ サービス	21,200	25,830.34	547,603,285	32,949.07	698,520,377	0.63
18	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製 造装置	104,657	5,897.42	617,206,903	6,582.36	688,890,553	0.62
19	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	42,072	12,389.63	521,256,698	15,968.37	671,821,263	0.60
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	96,625	6,470.86	625,247,225	6,741.22	651,371,040	0.58
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,058	21,138.00	550,814,200	24,099.91	627,995,538	0.56
22	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	59,992	9,075.68	544,468,652	10,024.73	601,404,202	0.54
23	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	99,438	5,280.79	525,111,395	5,907.47	587,427,519	0.53
24	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	44,503	13,462.56	599,124,674	13,180.06	586,552,566	0.52
25	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	16,427	30,785.00	505,705,209	35,658.89	585,768,750	0.52
26	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバ コ	94,728	5,148.49	487,706,348	6,064.14	574,444,422	0.51
27	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	129,756	4,636.84	601,658,254	4,307.89	558,975,769	0.50

28	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	101,339	5,938.15	601,766,385	5,233.68	530,376,019	0.47
29	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	50,530	9,446.37	477,325,136	10,465.56	528,824,949	0.47
30	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	105,850	4,401.31	465,879,496	4,941.15	523,021,363	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.02
		素材	4.12
		資本財	6.63
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.07
		耐久消費財・アパレル	1.83
		消費者サービス	1.72
		メディア・娯楽	5.78
		小売	4.53
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	4.57
		家庭用品・パーソナル用品	1.96
		ヘルスケア機器・サービス	4.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
		銀行	7.50
		各種金融	4.30
		保険	3.65
		不動産	2.96
		ソフトウェア・サービス	9.27
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.59
		電気通信サービス	2.23
		公益事業	3.40
		半導体・半導体製造装置	3.25
合計		95.62	

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（先物）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価 指数 先物 取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	187	ドル	29,653,767.5	3,248,866,766	30,271,560	3,316,552,112	2.99
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE60 2003	買建	11	カナダドル	2,223,342	186,293,826	2,240,040	187,692,951	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SMI 2003	買建	15	スイスフラン	1,557,150	175,023,660	1,594,050	179,171,220	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 2003	買建	126	ユーロ	4,699,800	575,913,492	4,750,200	582,089,508	0.52
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2003	買建	13	オーストラリアドル	2,186,275	167,293,763	2,191,800	167,716,536	0.15
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2003	買建	30	ポンド	2,204,400	316,287,312	2,275,950	326,553,306	0.29

（為替予約）

資産の種類	通貨	買建 / 売建	数量	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
為替予約取引	ポンド	売建	35,112.36	5,000,000	5,036,516	0.00

（ご参考）

日立外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	19,796,175,187	47.50
	カナダ	786,558,264	1.88
	メキシコ	361,021,545	0.86
	ユーロ(ドイツ)	2,615,246,719	6.27
	ユーロ(イタリア)	3,686,440,547	8.84
	ユーロ(フランス)	4,078,558,131	9.78
	ユーロ(オランダ)	772,695,576	1.85
	ユーロ(スペイン)	2,326,643,818	5.58
	ユーロ(ベルギー)	983,494,520	2.36
	ユーロ(オーストリア)	569,821,170	1.36
	ユーロ(フィンランド)	231,534,428	0.55
	ユーロ(アイルランド)	290,403,258	0.69
	イギリス	2,656,651,001	6.37
	スウェーデン	136,335,978	0.32
	ノルウェー	97,855,067	0.23
	デンマーク	204,965,904	0.49
	ポーランド	236,537,396	0.56
	オーストラリア	805,910,607	1.93
	シンガポール	171,243,674	0.41
	マレーシア	187,653,859	0.45
	南アフリカ	247,131,884	0.59
	小計	41,242,878,533	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	430,371,395	1.03
合計(純資産総額)		41,673,249,928	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債 証券	2.875% US TREASURY N/B	2,460,000	11,377.97	279,898,239	11,831.62	291,057,953	2.875	2028/5/15	0.69
2	アメリカ	国債 証券	1.625% US TREASURY N/B	2,550,000	10,604.56	270,416,485	10,854.14	276,780,659	1.625	2026/5/15	0.66
3	アメリカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	2,140,000	11,264.95	241,070,127	11,712.64	250,650,683	2.75	2028/2/15	0.60
4	アメリカ	国債 証券	3.000% US TREASURY N/B	1,910,000	11,335.07	216,499,982	12,514.66	239,030,048	3	2048/2/15	0.57
5	アメリカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	2,090,000	11,264.89	235,436,325	11,401.94	238,300,619	2.75	2023/11/15	0.57
6	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,900,000	10,992.56	208,858,783	11,046.72	209,887,858	2.25	2021/4/30	0.50
7	アメリカ	国債 証券	3.125% US TREASURY N/B	1,620,000	11,617.63	188,205,762	12,809.96	207,521,362	3.125	2048/5/15	0.49
8	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,830,000	10,775.39	197,189,770	11,117.77	203,455,232	2	2025/2/15	0.48
9	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,820,000	10,749.71	195,644,888	11,108.35	202,172,095	2	2025/8/15	0.48
10	アメリカ	国債 証券	2.500% US TREASURY N/B	1,750,000	11,029.61	193,018,186	11,148.58	195,100,254	2.5	2022/1/15	0.46
11	アメリカ	国債 証券	1.500% US TREASURY N/B	1,810,000	10,515.21	190,325,452	10,755.71	194,678,362	1.5	2026/8/15	0.46
12	アメリカ	国債 証券	2.875% US TREASURY N/B	1,640,000	11,357.98	186,270,899	11,850.45	194,347,457	2.875	2028/8/15	0.46
13	アメリカ	国債 証券	2.375% US TREASURY N/B	1,720,000	11,067.43	190,359,937	11,294.09	194,258,439	2.375	2024/8/15	0.46
14	アメリカ	国債 証券	2.125% US TREASURY N/B	1,670,000	10,918.96	182,346,741	11,176.83	186,653,092	2.125	2025/5/15	0.44
15	アメリカ	国債 証券	2.500% US TREASURY N/B	1,630,000	11,116.72	181,202,544	11,331.75	184,707,632	2.5	2024/5/15	0.44
16	アメリカ	国債 証券	2.875% US TREASURY N/B	1,580,000	11,310.35	178,703,658	11,602.23	183,315,279	2.875	2025/5/31	0.43
17	アメリカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,600,000	10,837.02	173,392,395	11,297.51	180,760,305	2.25	2027/11/15	0.43
18	アメリカ	国債 証券	1.500% US TREASURY N/B	1,630,000	10,888.29	177,479,159	10,866.98	177,131,815	1.5	2024/10/31	0.42
19	アメリカ	国債 証券	5.250% US TREASURY N/B	1,260,000	13,836.66	174,342,007	14,005.70	176,471,887	5.25	2028/11/15	0.42
20	フランス	国債 証券	5.500% FRANCE GOV'T	940,000	18,704.68	175,824,082	18,596.67	174,808,703	5.5	2029/4/25	0.41
21	アメリカ	国債 証券	2.500% US TREASURY N/B	1,560,000	11,034.74	172,142,041	11,157.14	174,051,467	2.5	2022/2/15	0.41
22	フランス	国債 証券	4.500% FRANCE GOV'T	790,000	20,935.82	165,392,997	21,894.22	172,964,352	4.5	2041/4/25	0.41
23	アメリカ	国債 証券	1.750% US TREASURY N/B	1,550,000	10,742.87	166,514,509	10,995.37	170,428,283	1.75	2023/5/15	0.40
24	アメリカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,490,000	10,941.12	163,022,760	11,110.06	165,540,024	2	2024/5/31	0.39

25	アメリカ	国債証券	3.625% US TREASURY N/B	1,460,000	11,218.77	163,794,083	11,197.37	163,481,665	3.625	2021/2/15	0.39
26	アメリカ	国債証券	1.375% US TREASURY N/B	1,500,000	10,913.05	163,695,787	10,882.38	163,235,840	1.375	2022/10/15	0.39
27	アメリカ	国債証券	3.000% US TREASURY N/B	1,300,000	11,701.13	152,114,738	12,554.89	163,213,585	3	2049/2/15	0.39
28	アメリカ	国債証券	1.625% US TREASURY N/B	1,480,000	10,466.40	154,902,776	10,868.69	160,856,677	1.625	2026/2/15	0.38
29	アメリカ	国債証券	2.250% US TREASURY N/B	1,430,000	10,932.03	156,328,082	11,240.17	160,734,448	2.25	2024/11/15	0.38
30	アメリカ	国債証券	1.750% US TREASURY N/B	1,450,000	10,928.28	158,460,079	10,991.94	159,383,266	1.75	2022/7/15	0.38

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.96
合計	98.96

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。

（３）【運用実績】

日立バランスファンド（株式７０）

【純資産の推移】

2019年12月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
9期 (2010年 5月17日)	9,225,602,031	9,225,602,031	1.0903	1.0903
10期 (2011年 5月16日)	9,981,783,949	9,981,783,949	1.0860	1.0860
11期 (2012年 5月15日)	10,201,481,825	10,201,481,825	1.0393	1.0393
12期 (2013年 5月15日)	14,637,027,742	14,637,027,742	1.5314	1.5314
13期 (2014年 5月15日)	15,715,164,702	15,715,164,702	1.5943	1.5943
14期 (2015年 5月15日)	19,885,040,123	19,885,040,123	1.9820	1.9820
15期 (2016年 5月16日)	17,347,927,953	17,347,927,953	1.7758	1.7758
16期 (2017年 5月15日)	19,493,670,645	19,493,670,645	2.0454	2.0454
17期 (2018年 5月15日)	21,985,000,610	21,985,000,610	2.2493	2.2493
18期 (2019年 5月15日)	22,796,928,479	22,796,928,479	2.1572	2.1572
2018年12月末日	20,532,950,840	—	2.0369	—
2019年 1月末日	21,444,408,220	—	2.1159	—
2月末日	22,311,539,107	—	2.1794	—
3月末日	22,910,886,279	—	2.1901	—
4月末日	23,572,353,936	—	2.2313	—
5月末日	22,566,224,604	—	2.1319	—
6月末日	23,287,884,026	—	2.1827	—
7月末日	23,607,623,392	—	2.2090	—
8月末日	23,112,115,405	—	2.1537	—
9月末日	23,809,606,114	—	2.2217	—
10月末日	24,548,251,141	—	2.2925	—
11月末日	24,925,138,365	—	2.3345	—
12月末日	25,232,117,915	—	2.3686	—

【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
9期	—
10期	—
11期	—
12期	—
13期	—
14期	—
15期	—
16期	—
17期	—
18期	—

【収益率の推移】

期	収益率（％）
9期	8.70
10期	0.39
11期	4.30
12期	47.35
13期	4.11
14期	24.32
15期	10.40
16期	15.18
17期	9.97
18期	4.09
19期中間計算期間	7.13

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
9期	1,563,787,337	593,927,003	8,461,774,880
10期	1,463,693,183	733,900,007	9,191,568,056
11期	1,417,633,235	793,915,348	9,815,285,943
12期	1,944,918,343	2,202,403,757	9,557,800,529
13期	2,261,532,131	1,962,471,266	9,856,861,394
14期	1,763,150,742	1,586,985,879	10,033,026,257
15期	1,406,795,897	1,670,688,320	9,769,133,834
16期	1,117,467,696	1,355,884,843	9,530,716,687
17期	1,571,044,252	1,327,710,546	9,774,050,393
18期	2,096,243,112	1,302,302,033	10,567,991,472
19期中間計算期間	941,855,455	798,989,270	10,710,857,657

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

日立バランスファンド（株式５０）

純資産の推移

2019年12月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
9期 (2010年 5月17日)	11,843,460,727	11,843,460,727	1.1195	1.1195
10期 (2011年 5月16日)	12,815,240,356	12,815,240,356	1.1195	1.1195
11期 (2012年 5月15日)	13,374,729,464	13,374,729,464	1.0956	1.0956
12期 (2013年 5月15日)	17,117,193,057	17,117,193,057	1.4636	1.4636
13期 (2014年 5月15日)	18,190,497,087	18,190,497,087	1.5155	1.5155
14期 (2015年 5月15日)	21,534,819,583	21,534,819,583	1.7907	1.7907
15期 (2016年 5月16日)	19,488,077,758	19,488,077,758	1.6825	1.6825
16期 (2017年 5月15日)	20,776,203,481	20,776,203,481	1.8533	1.8533
17期 (2018年 5月15日)	22,260,170,947	22,260,170,947	1.9892	1.9892
18期 (2019年 5月15日)	22,249,586,762	22,249,586,762	1.9380	1.9380
2018年12月末日	20,782,214,172	—	1.8568	—
2019年 1月末日	21,453,734,862	—	1.9090	—
2月末日	22,076,459,483	—	1.9506	—
3月末日	22,460,295,856	—	1.9615	—
4月末日	22,847,344,291	—	1.9852	—
5月末日	22,138,210,641	—	1.9245	—
6月末日	22,637,379,499	—	1.9604	—
7月末日	22,811,215,440	—	1.9774	—
8月末日	22,448,603,499	—	1.9497	—
9月末日	22,914,840,731	—	1.9889	—
10月末日	23,425,599,045	—	2.0328	—
11月末日	23,656,455,265	—	2.0571	—
12月末日	23,867,643,745	—	2.0767	—

分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
9期	—
10期	—
11期	—
12期	—
13期	—
14期	—
15期	—
16期	—
17期	—
18期	—

収益率の推移

期	収益率（％）
9期	6.76
10期	0.00
11期	2.13
12期	33.59
13期	3.55
14期	18.16
15期	6.04
16期	10.15
17期	7.33
18期	2.57
19期中間計算期間	5.31

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

（４）設定及び解約の実績

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
9期	1,596,166,519	546,052,192	10,579,431,901
10期	1,516,114,802	647,746,736	11,447,799,967
11期	1,501,118,637	741,217,518	12,207,701,086
12期	1,621,195,930	2,133,455,878	11,695,441,138
13期	1,779,180,272	1,471,292,153	12,003,329,257
14期	1,243,555,682	1,220,654,621	12,026,230,318
15期	1,015,439,687	1,459,033,617	11,582,636,388
16期	909,333,996	1,281,826,035	11,210,144,349
17期	1,126,087,244	1,145,889,203	11,190,342,390
18期	1,383,433,415	1,092,924,153	11,480,851,652
19期中間計算期間	657,019,139	596,612,957	11,541,257,834

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

日立バランスファンド（株式３０）

純資産の推移

2019年12月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
9期 (2010年 5月17日)	4,585,652,650	4,585,652,650	1.1345	1.1345
10期 (2011年 5月16日)	5,018,619,209	5,018,619,209	1.1371	1.1371
11期 (2012年 5月15日)	5,288,769,335	5,288,769,335	1.1350	1.1350
12期 (2013年 5月15日)	6,017,104,914	6,017,104,914	1.3722	1.3722
13期 (2014年 5月15日)	6,629,586,999	6,629,586,999	1.4126	1.4126
14期 (2015年 5月15日)	7,528,771,603	7,528,771,603	1.5847	1.5847
15期 (2016年 5月16日)	7,217,040,101	7,217,040,101	1.5596	1.5596
16期 (2017年 5月15日)	7,612,669,650	7,612,669,650	1.6414	1.6414
17期 (2018年 5月15日)	8,093,462,907	8,093,462,907	1.7187	1.7187
18期 (2019年 5月15日)	8,624,969,214	8,624,969,214	1.6988	1.6988
2018年12月末日	7,914,599,583	—	1.6516	—
2019年 1月末日	8,098,269,860	—	1.6807	—
2月末日	8,328,555,961	—	1.7036	—
3月末日	8,643,475,549	—	1.7141	—
4月末日	8,773,870,484	—	1.7232	—
5月末日	8,649,913,894	—	1.6950	—
6月末日	8,812,982,034	—	1.7182	—
7月末日	8,835,734,050	—	1.7274	—
8月末日	8,841,540,136	—	1.7221	—
9月末日	8,935,222,723	—	1.7374	—
10月末日	9,059,310,497	—	1.7590	—
11月末日	9,132,321,326	—	1.7688	—
12月末日	9,200,627,431	—	1.7766	—

分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
9期	—
10期	—
11期	—
12期	—
13期	—
14期	—
15期	—
16期	—
17期	—
18期	—

収益率の推移

期	収益率（％）
9期	4.67
10期	0.23
11期	0.18
12期	20.90
13期	2.94
14期	12.18
15期	1.58
16期	5.24
17期	4.71
18期	1.16
19期中間計算期間	3.54

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

（４）設定及び解約の実績

期	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
9期	652,963,008	278,235,272	4,041,863,602
10期	656,838,408	285,301,181	4,413,400,829
11期	674,454,849	428,086,598	4,659,769,080
12期	826,723,933	1,101,491,747	4,385,001,266
13期	1,005,765,009	697,676,389	4,693,089,886
14期	732,598,184	674,751,204	4,750,936,866
15期	625,743,362	749,224,751	4,627,455,477
16期	626,093,297	615,672,733	4,637,876,041
17期	801,659,364	730,398,178	4,709,137,227
18期	1,043,886,482	675,987,808	5,077,035,901
19期中間計算期間	441,555,723	346,530,516	5,172,061,108

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

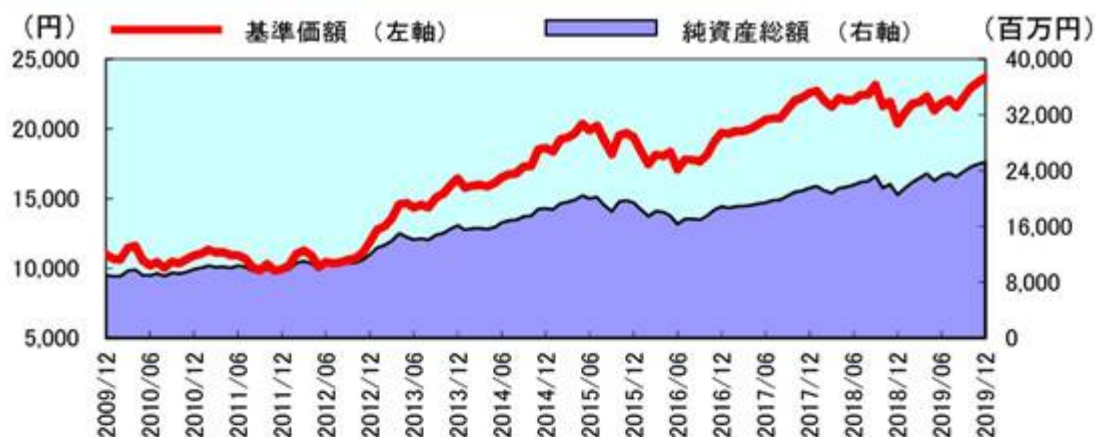
（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

< 参考情報 >

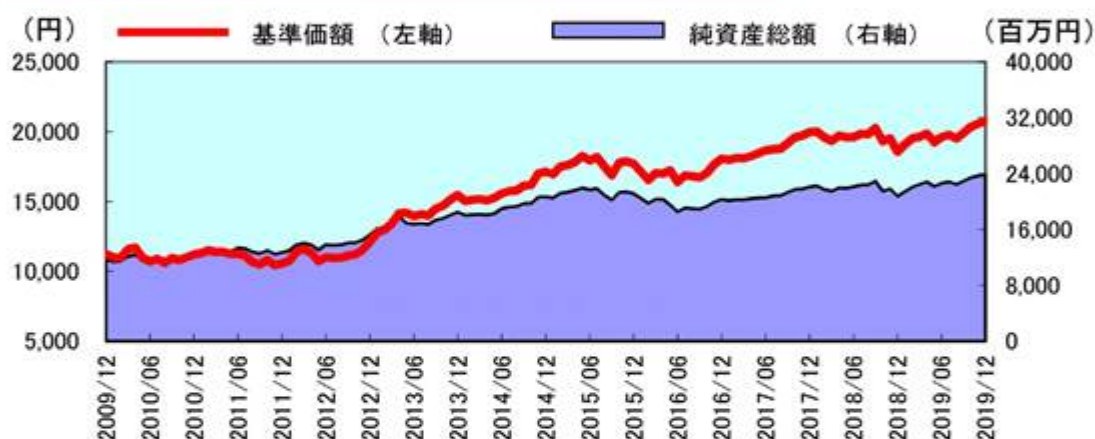
運用実績（2019年12月末現在）

◆ 基準価額・純資産の推移（2009年12月末～2019年12月末）

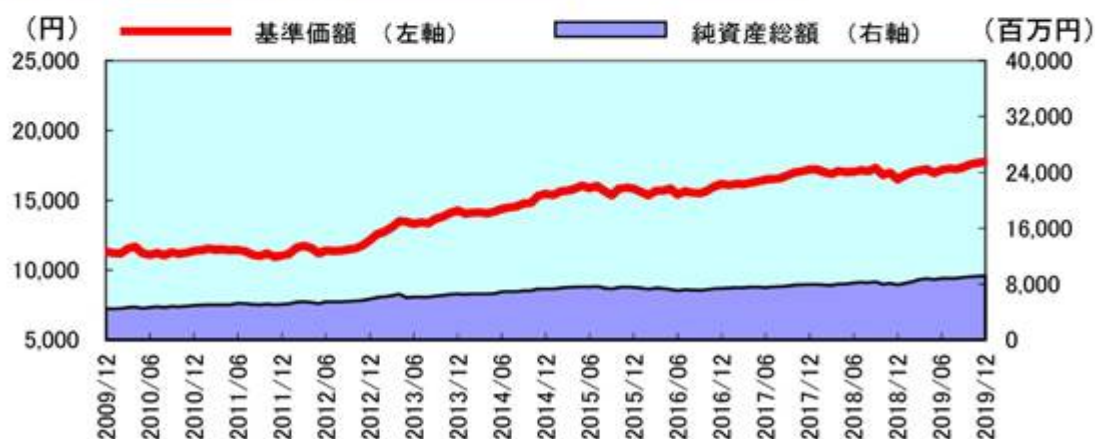
日立バランスファンド(株式70)



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TOPIXインデックスマザーファンド）

○組入上位10銘柄

銘柄名	業種	組入比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
ソニー	電気機器	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.6%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
日本電信電話	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	医薬品	1.5%
キーエンス	電気機器	1.4%
リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.1%
任天堂	その他製品	1.1%
合計		16.2%

○組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	14.2%
情報・通信業	8.6%
輸送用機器	7.6%
化学	7.0%
医薬品	5.9%
銀行業	5.8%
サービス業	5.1%
機械	5.0%
卸売業	4.9%
小売業	4.6%
合計	68.7%

外国株式（日立外国株式インデックスマザーファンド）

○組入上位10銘柄

銘柄名	国/地域	組入比率
APPLE INC	アメリカ	3.0%
MICROSOFT CORP	アメリカ	2.7%
AMAZON COM INC	アメリカ	1.8%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.2%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.8%
NESTLE SA-REGISTERED	スイス	0.8%
合計		14.1%

○組入上位10ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	66.1%
イギリス	5.6%
フランス	3.7%
カナダ	3.5%
スイス	3.3%
ドイツ	3.0%
オーストラリア	2.4%
オランダ	1.7%
香港	1.1%
スペイン	1.0%
合計	91.4%

国内債券（日立国内債券インデックスマザーファンド）

○組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
第127回利付国債（5年）	2021/3/20	0.9%
第325回利付国債（10年）	2022/9/20	0.9%
第344回利付国債（10年）	2026/9/20	0.9%
第138回利付国債（5年）	2023/12/20	0.9%
第343回利付国債（10年）	2026/6/20	0.8%
第320回利付国債（10年）	2021/12/20	0.8%
第350回利付国債（10年）	2028/3/20	0.8%
第129回利付国債（5年）	2021/9/20	0.8%
第402回利付国債（2年）	2021/7/1	0.8%
第328回利付国債（10年）	2023/3/20	0.8%
合計		8.4%

○債券種別構成比

債券種別	組入比率
国債証券	78.8%
特殊債券	8.6%
地方債証券	6.5%
社債券	5.3%
合計	99.2%

外国債券（日立外国債券インデックスマザーファンド）

○組入上位10銘柄

銘柄名	償還期限	組入比率
米国債 2.875%	2028/5/15	0.7%
米国債 1.625%	2026/5/15	0.7%
米国債 2.750%	2028/2/15	0.6%
米国債 3.000%	2048/2/15	0.6%
米国債 2.750%	2023/11/15	0.6%
米国債 2.250%	2021/4/30	0.5%
米国債 3.125%	2048/5/15	0.5%
米国債 2.000%	2025/2/15	0.5%
米国債 2.000%	2025/8/15	0.5%
米国債 2.500%	2022/1/15	0.5%
合計		5.7%

○組入上位5ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	47.5%
フランス	9.8%
イタリア	8.8%
イギリス	6.4%
ドイツ	6.3%
合計	78.8%

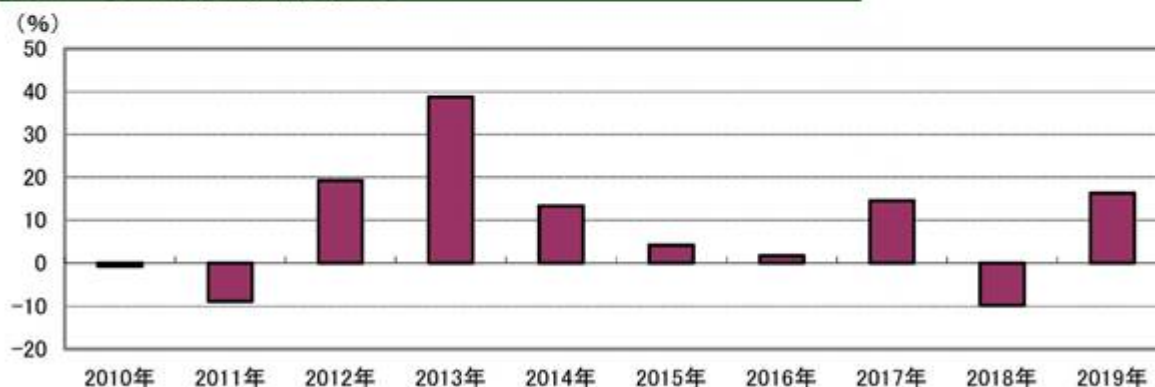
ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

◆ 資産の構成（資産別マザーファンドの保有時価比率を表示しています。）

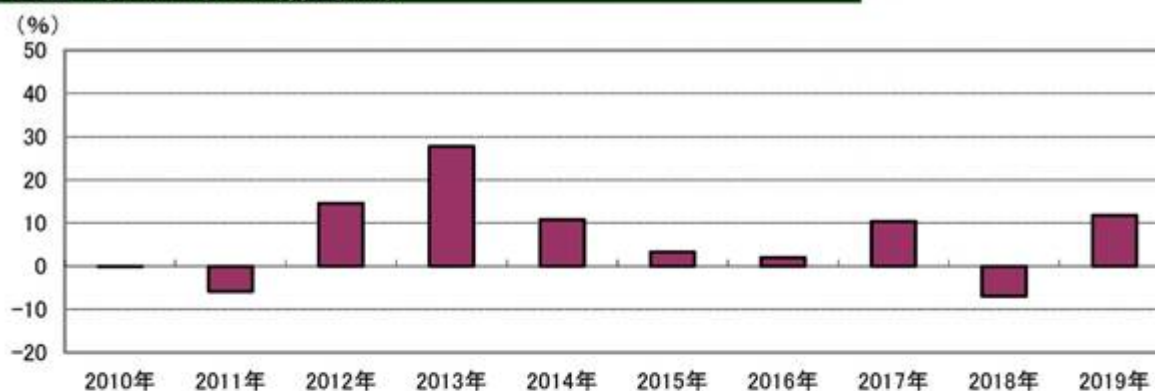
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド 株式(70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	39.8%	30.6%	19.2%	9.4%	1.0%
日立バランスファンド 株式(50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	29.9%	20.5%	39.1%	9.6%	0.9%
日立バランスファンド 株式(30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	19.9%	10.1%	59.3%	9.7%	1.0%

◆ 年間収益率の推移

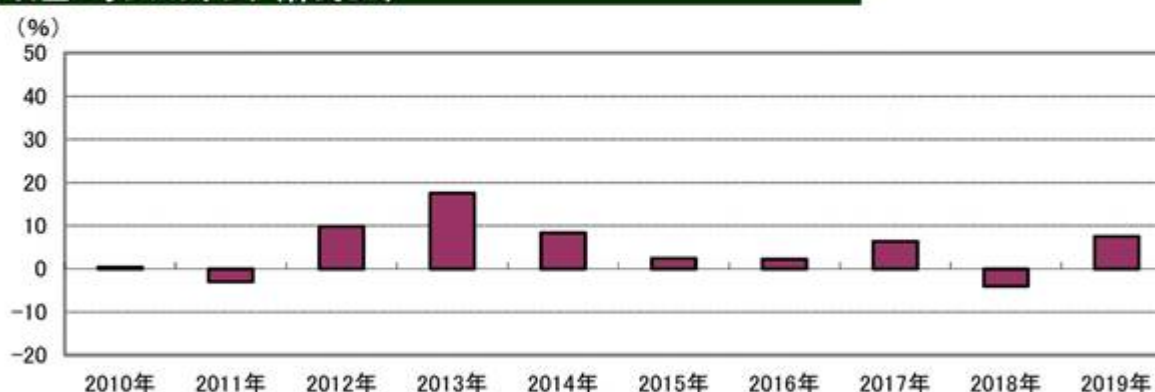
日立バランスファンド(株式70)



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)



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3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

原届出書の該当部分の末尾に、以下の情報が追加されます。

< 追加 >

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」といいます。）ならびに同規則第38条の3および第57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。

また、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 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19期中間計算期間（2019年5月16日から2019年11月15日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【日立バランスファンド（株式７０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	271,579,701	269,179,546
親投資信託受益証券	22,593,992,464	24,536,852,800
未収入金	76,600,000	19,300,000
流動資産合計	22,942,172,165	24,825,332,346
資産合計	22,942,172,165	24,825,332,346
負債の部		
流動負債		
未払解約金	122,747,752	46,840,356
未払受託者報酬	4,735,843	5,132,525
未払委託者報酬	17,759,347	19,246,879
未払利息	744	737
流動負債合計	145,243,686	71,220,497
負債合計	145,243,686	71,220,497
純資産の部		
元本等		
元本	10,567,991,472	10,710,857,657
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,228,937,007	14,043,254,192
元本等合計	22,796,928,479	24,754,111,849
純資産合計	22,796,928,479	24,754,111,849
負債純資産合計	22,942,172,165	24,825,332,346

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	768,547,642	1,680,060,336
営業収益合計	768,547,642	1,680,060,336
営業費用		
支払利息	112,573	121,757
受託者報酬	4,831,029	5,132,525
委託者報酬	18,116,309	19,246,879
その他費用	1,325	-
営業費用合計	23,061,236	24,501,161
営業利益又は営業損失（ ）	791,608,878	1,655,559,175
経常利益又は経常損失（ ）	791,608,878	1,655,559,175
中間純利益又は中間純損失（ ）	791,608,878	1,655,559,175
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,019,159	33,523,487
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,210,950,217	12,228,937,007
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,084,449,827	1,117,169,196
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,084,449,827	1,117,169,196
剰余金減少額又は欠損金増加額	799,827,342	924,887,699
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	799,827,342	924,887,699
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,707,982,983	14,043,254,192

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第18期計算期間末 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．計算期間の末日における受益権の総数	10,567,991,472口	10,710,857,657口
１口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1572円 (21,572円)	2.3111円 (23,111円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
１．運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
２．分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（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18期計算期間 自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,774,050,393円	10,567,991,472円
期中追加設定元本額	2,096,243,112円	941,855,455円
期中一部解約元本額	1,302,302,033円	798,989,270円

【日立バランスファンド（株式５０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	236,889,526	246,815,195
親投資信託受益証券	22,050,149,958	23,348,651,712
未収入金	94,300,000	6,500,000
流動資産合計	22,381,339,484	23,601,966,907
資産合計	22,381,339,484	23,601,966,907
負債の部		
流動負債		
未払解約金	110,659,637	23,683,196
未払受託者報酬	4,687,225	4,963,581
未払委託者報酬	16,405,211	17,372,468
未払利息	649	676
流動負債合計	131,752,722	46,019,921
負債合計	131,752,722	46,019,921
純資産の部		
元本等		
元本	11,480,851,652	11,541,257,834
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,768,735,110	12,014,689,152
元本等合計	22,249,586,762	23,555,946,986
純資産合計	22,249,586,762	23,555,946,986
負債純資産合計	22,381,339,484	23,601,966,907

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	575,141,690	1,211,401,754
営業収益合計	575,141,690	1,211,401,754
営業費用		
支払利息	108,016	112,772
受託者報酬	4,835,682	4,963,581
委託者報酬	16,924,826	17,372,468
その他費用	1,328	-
営業費用合計	21,869,852	22,448,821
営業利益又は営業損失（ ）	597,011,542	1,188,952,933
経常利益又は経常損失（ ）	597,011,542	1,188,952,933
中間純利益又は中間純損失（ ）	597,011,542	1,188,952,933
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,219,068	16,711,331
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,069,828,557	10,768,735,110
剰余金増加額又は欠損金減少額	558,146,055	633,493,084
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	558,146,055	633,493,084
剰余金減少額又は欠損金増加額	586,271,349	559,780,644
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	586,271,349	559,780,644
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,446,910,789	12,014,689,152

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第18期計算期間末 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．計算期間の末日における受益権の総数	11,480,851,652口	11,541,257,834口
１口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9380円 (19,380円)	2.0410円 (20,410円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
１．運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
２．分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（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18期計算期間 自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,190,342,390円	11,480,851,652円
期中追加設定元本額	1,383,433,415円	657,019,139円
期中一部解約元本額	1,092,924,153円	596,612,957円

【日立バランスファンド（株式３０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	98,046,219	102,650,193
親投資信託受益証券	8,547,389,910	9,011,794,861
未収入金	62,000,000	1,800,000
流動資産合計	8,707,436,129	9,116,245,054
資産合計	8,707,436,129	9,116,245,054
負債の部		
流動負債		
未払解約金	74,908,193	11,036,083
未払受託者報酬	1,778,477	1,932,149
未払委託者報酬	5,779,977	6,279,419
未払利息	268	281
流動負債合計	82,466,915	19,247,932
負債合計	82,466,915	19,247,932
純資産の部		
元本等		
元本	5,077,035,901	5,172,061,108
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,547,933,313	3,924,936,014
元本等合計	8,624,969,214	9,096,997,122
純資産合計	8,624,969,214	9,096,997,122
負債純資産合計	8,707,436,129	9,116,245,054

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	146,074,677	316,804,951
営業収益合計	146,074,677	316,804,951
営業費用		
支払利息	40,686	44,829
受託者報酬	1,774,941	1,932,149
委託者報酬	5,768,488	6,279,419
その他費用	481	-
営業費用合計	7,584,596	8,256,397
営業利益又は営業損失（ ）	153,659,273	308,548,554
経常利益又は経常損失（ ）	153,659,273	308,548,554
中間純利益又は中間純損失（ ）	153,659,273	308,548,554
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,737,702	7,685,719
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,384,325,680	3,547,933,313
剰余金増加額又は欠損金減少額	284,747,997	318,474,448
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	284,747,997	318,474,448
剰余金減少額又は欠損金増加額	260,219,116	242,334,582
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	260,219,116	242,334,582
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,257,932,990	3,924,936,014

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第18期計算期間末 2019年 5月15日現在	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．計算期間の末日における受益権の総数	5,077,035,901口	5,172,061,108口
１口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6988円 (16,988円)	1.7589円 (17,589円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第18期中間計算期間 自 2018年 5月16日 至 2018年11月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
１．運用の指図に関する権限を委託するために要する費用	以下の親投資信託の信託財産の運用の指図に関する権限を委託するために要する費用として、信託財産に属する各親投資信託の信託財産の純資産総額にそれぞれの率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。 日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立国内債券インデックスマザーファンド 年10,000分の2.5 日立外国株式インデックスマザーファンド 年10,000分の4.5 日立外国債券インデックスマザーファンド 年10,000分の4	同左
２．分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	第19期中間計算期間末 2019年11月15日現在
１．中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（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18期計算期間 自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	第19期中間計算期間 自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,709,137,227円	5,077,035,901円
期中追加設定元本額	1,043,886,482円	441,555,723円
期中一部解約元本額	675,987,808円	346,530,516円

（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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は、次のとおりです。

日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	389,731,331	518,044,553
株式	47,546,475,790	52,925,361,830
派生商品評価勘定	-	83,119,354
未収入金	54,383,750	26,372,220
未収配当金	543,299,768	497,042,768
前払金	40,937,800	-
差入委託証拠金	31,110,000	30,195,000
流動資産合計	48,605,938,439	54,080,135,725
資産合計	48,605,938,439	54,080,135,725
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,562,446	-
前受金	-	74,304,000
未払金	44,215,050	-
未払解約金	55,200,000	29,300,000
未払利息	1,067	1,419
流動負債合計	133,978,563	103,605,419
負債合計	133,978,563	103,605,419
純資産の部		
元本等		
元本	29,807,608,034	29,860,711,200
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,664,351,842	24,115,819,106
元本等合計	48,471,959,876	53,976,530,306
純資産合計	48,471,959,876	53,976,530,306
負債純資産合計	48,605,938,439	54,080,135,725

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
1.計算期間の末日における受益権の総数	29,807,608,034口	29,860,711,200口
1口当たり純資産額	1.6262円	1.8076円
(1万口当たり純資産額)	(16,262円)	(18,076円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	2019年11月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

項目	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額等の変動によるリスクを回避する目的で行ないます。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で利用しております。

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

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2019年 5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	975,457,800	-	940,925,000	34,532,800
	東証株価指数先物	975,457,800	-	940,925,000	34,532,800
合計		975,457,800	-	940,925,000	34,532,800

(2019年11月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	952,326,000	-	1,035,475,000	83,149,000
	東証株価指数先物	952,326,000	-	1,035,475,000	83,149,000
合計		952,326,000	-	1,035,475,000	83,149,000

時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

契約額に手数料は含まれておりません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	26,797,955,004円	29,807,608,034円
期中追加設定元本額	4,449,077,717円	1,383,342,947円
期中一部解約元本額	1,439,424,687円	1,330,239,781円
期末元本額	29,807,608,034円	29,860,711,200円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式７０）	5,549,844,675円	5,542,172,983円
日立バランスファンド（株式５０）	4,024,426,540円	3,941,013,174円
日立バランスファンド（株式３０）	1,037,127,258円	1,013,353,787円
日立国内株式ＴＯＰＩＸインデックスファンド （非課税適格機関投資家専用）	7,817,203,996円	8,042,347,681円
日立国内株式インデックスファンド	11,379,005,565円	11,321,823,575円

（注）＊は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

日立国内債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	546,936,195	395,825,003
国債証券	76,895,350,200	80,521,623,100
地方債証券	6,790,262,580	6,766,229,590
特殊債券	8,319,170,933	8,859,766,604
社債券	4,831,457,000	4,724,658,000
未収入金	29,772,700	-
未収利息	235,140,902	238,621,527
前払費用	4,386,290	3,936,151
流動資産合計	97,652,476,800	101,510,659,975
資産合計	97,652,476,800	101,510,659,975
負債の部		
流動負債		
未払解約金	241,600,000	10,300,000
未払利息	1,498	1,084
流動負債合計	241,601,498	10,301,084
負債合計	241,601,498	10,301,084
純資産の部		
元本等		
元本	68,702,614,855	71,238,392,046
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,708,260,447	30,261,966,845
元本等合計	97,410,875,302	101,500,358,891
純資産合計	97,410,875,302	101,500,358,891
負債純資産合計	97,652,476,800	101,510,659,975

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 個別法に基づき、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基準気配値段等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 約定日基準で計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
1.計算期間の末日における受益権の総数	68,702,614,855口	71,238,392,046口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4179円 (14,179円)	1.4248円 (14,248円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	2019年11月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	66,546,652,262円	68,702,614,855円
期中追加設定元本額	7,744,124,126円	5,926,533,628円
期中一部解約元本額	5,588,161,533円	3,390,756,437円
期末元本額	68,702,614,855円	71,238,392,046円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式７０）	3,226,570,777円	3,325,279,405円
日立バランスファンド（株式５０）	6,312,290,178円	6,475,721,329円
日立バランスファンド（株式３０）	3,657,453,377円	3,775,850,860円
日立国内債券特化型ファンドN（非課税適格機関投資家専用）	44,479,993,524円	46,339,833,709円
日立国内債券インデックスファンド	11,026,306,999円	11,321,706,743円

（注）＊は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

日立外国株式インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,372,818,125	3,463,527,509
コール・ローン	99,415,855	77,130,330
株式	92,121,202,979	99,651,913,261
派生商品評価勘定	84,272,503	149,350,839
未収入金	3,423,091	9,749,386
未収配当金	162,523,126	146,695,339
差入委託証拠金	1,223,660,487	1,553,628,259
流動資産合計	96,067,316,166	105,051,994,923
資産合計	96,067,316,166	105,051,994,923
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,168,939	1,047,639
未払解約金	98,500,000	71,700,000
未払利息	272	211
流動負債合計	104,669,211	72,747,850
負債合計	104,669,211	72,747,850
純資産の部		
元本等		
元本	39,044,849,365	39,579,708,945
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	56,917,797,590	65,399,538,128
元本等合計	95,962,646,955	104,979,247,073
純資産合計	95,962,646,955	104,979,247,073
負債純資産合計	96,067,316,166	105,051,994,923

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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 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.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 外国先物の評価においては、原則として計算日に知り得る直近の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。 外国為替予約取引 原則として、計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 受取利息 約定日基準で計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
1.計算期間の末日における受益権の総数	39,044,849,365口	39,579,708,945口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4578円 (24,578円)	2.6524円 (26,524円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	2019年11月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

項目	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引、通貨関連では為替予約取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額・為替等の変動によるリスクを回避する目的で行ないます。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で、また、通貨関連では外貨建有価証券等の為替変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2019年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,623,052,464	-	3,701,156,030	78,103,566
	S&P500 EMINI	2,498,943,829	-	2,552,111,446	53,167,617
	S&PTSE60 1906	155,725,642	-	158,505,551	2,779,909
	EURX50 1906	440,025,002	-	453,113,372	13,088,370
	FTSE100 1906	259,580,493	-	264,759,858	5,179,365
	SMI 1906	139,935,796	-	142,645,132	2,709,336
	SPI200 1906	128,841,702	-	130,020,671	1,178,969
合計		3,623,052,464	-	3,701,156,030	78,103,566

(2019年11月15日現在)

(単位 : 円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,073,652,583	-	5,221,963,055	148,310,472
	S&P500 EMINI	3,541,287,867	-	3,649,780,262	108,492,395
	S&PTSE60 1912	212,132,236	-	216,540,053	4,407,817
	EURX50 1912	606,152,658	-	635,215,908	29,063,250
	FTSE100 1912	368,280,513	-	367,613,335	667,178
	SMI 1912	186,100,812	-	191,134,780	5,033,968
	SPI200 1912	159,698,497	-	161,678,717	1,980,220
合計		5,073,652,583	-	5,221,963,055	148,310,472

時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

契約額に手数料は含まれておりません。

(通貨関連)

(2019年 5月15日現在)

(単位 : 円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	74,700,000	-	74,700,000	-
	ドル	59,700,000	-	59,700,000	-
	ユーロ	15,000,000	-	15,000,000	-
合計		74,700,000	-	74,700,000	-

（2019年11月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			契約額等 うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	30,400,000	-	30,407,265	7,265
	ユーロ	15,000,000	-	15,004,761	4,761
	オーストラリア ドル	15,400,000	-	15,402,504	2,504
合計		30,400,000	-	30,407,265	7,265

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	35,500,274,151円	39,044,849,365円
期中追加設定元本額	5,178,144,610円	1,243,996,294円
期中一部解約元本額	1,633,569,396円	709,136,714円
期末元本額	39,044,849,365円	39,579,708,945円
元本の内訳 *		
日立バランスファンド（株式70）	2,739,194,982円	2,810,861,136円
日立バランスファンド（株式50）	1,771,692,833円	1,788,586,649円
日立バランスファンド（株式30）	334,550,105円	348,618,350円
日立外国株式特化型ファンド（非課税適格機関 投資家専用）	22,315,703,139円	22,470,860,727円
日立外国株式インデックスファンド	11,883,708,306円	12,160,782,083円

（注）* は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

日立外国債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	5,634,676	47,232,848
コール・ローン	134,190,948	56,671,494
国債証券	39,032,107,143	40,519,591,317
未収入金	80,467,833	38,067,814
未収利息	321,593,230	314,498,054
前払費用	11,881,081	10,240,399
流動資産合計	39,574,605,559	40,986,301,926
資産合計	39,574,605,559	40,986,301,926
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,300,000	27,600,000
未払利息	367	155
流動負債合計	93,300,367	27,600,155
負債合計	93,300,367	27,600,155
純資産の部		
元本等		
元本	18,121,287,061	18,247,408,032
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	21,360,018,131	22,711,293,739
元本等合計	39,481,305,192	40,958,701,771
純資産合計	39,481,305,192	40,958,701,771
負債純資産合計	39,574,605,559	40,986,301,926

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 個別法に基づき、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。
2.収益及び費用の計上基準	受取利息 約定日基準で計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2019年 5月15日現在	2019年11月15日現在
1.計算期間の末日における受益権の総数	18,121,287,061口	18,247,408,032口
1口当たり純資産額	2.1787円	2.2446円
(1万口当たり純資産額)	(21,787円)	(22,446円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価に関する事項

項目	2019年11月15日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2018年 5月16日 至 2019年 5月15日	自 2019年 5月16日 至 2019年11月15日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,518,481,580円	18,121,287,061円
期中追加設定元本額	4,535,014,055円	385,954,964円
期中一部解約元本額	932,208,574円	259,833,993円
期末元本額	18,121,287,061円	18,247,408,032円
元本の内訳＊		
日立バランスファンド（株式７０）	1,037,998,313円	1,036,012,984円
日立バランスファンド（株式５０）	1,010,219,228円	1,004,286,431円
日立バランスファンド（株式３０）	391,358,688円	390,069,028円
日立外国債券特化型ファンドＵ（為替ヘッジなし）（非課税適格機関投資家専用）	9,026,487,508円	9,049,758,062円
日立外国債券インデックスファンド	6,655,223,324円	6,767,281,527円

（注）＊は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

原届出書が以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

（2019年12月末現在）

日立バランスファンド（株式70）

資産総額	25,263,002,391 円
負債総額	30,884,476 円
純資産総額（ - ）	25,232,117,915 円
発行済口数	10,652,829,047 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3686 円
（1万口当たり純資産額）	（23,686 円）

日立バランスファンド（株式50）

資産総額	23,882,286,963 円
負債総額	14,643,218 円
純資産総額（ - ）	23,867,643,745 円
発行済口数	11,493,072,772 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0767 円
（1万口当たり純資産額）	（20,767 円）

日立バランスファンド（株式30）

資産総額	9,211,949,745 円
負債総額	11,322,314 円
純資産総額（ - ）	9,200,627,431 円
発行済口数	5,178,773,447 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7766 円
（1万口当たり純資産額）	（17,766 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	54,060,544,202 円
負債総額	65,934,599 円
純資産総額（ - ）	53,994,609,603 円
発行済口数	29,395,789,875 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8368 円
（1万口当たり純資産額）	（18,368 円）

日立国内債券インデックスマザーファンド

資産総額	102,278,975,565 円
負債総額	461,655,944 円
純資産総額（ - ）	101,817,319,621 円
発行済口数	71,475,027,349 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4245 円
（1万口当たり純資産額）	（14,245 円）

日立外国株式インデックスマザーファンド

資産総額	110,702,051,990 円
負債総額	23,808,616 円
純資産総額（ - ）	110,678,243,374 円
発行済口数	39,470,873,676 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8040 円
（1万口当たり純資産額）	（28,040 円）

日立外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	41,673,250,012 円
負債総額	84 円
純資産総額（ - ）	41,673,249,928 円
発行済口数	18,276,723,676 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2801 円
（1万口当たり純資産額）	（22,801 円）

第三部【委託会社等の情報】

第 1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

原届出書の該当情報が以下の内容に訂正されます。下線を附した部分が訂正箇所です。

< 訂正前 >

(1) 資本の額（2019年8月15日現在）

〔以下 略〕

< 訂正後 >

(1) 資本の額（2020年2月13日現在）

〔以下 略〕

2【事業の内容及び営業の概況】

原届出書が以下の内容に更新・訂正されます。

委託者は、株式会社日立製作所により1999年8月5日に設立された会社です。

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

2019年12月末日現在、委託者が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、19本であり、その純資産総額の合計は598,249百万円です。（なお、親投資信託17本は、ファンド数及び純資産総額の合計からは除いております。）

基本的性格	募集形態	ファンド数 （本）	純資産総額 （百万円）
追加型株式投資信託	公募	7	144,614
	私募	12	453,635
合計		19	598,249

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の該当部分が以下の内容に更新・訂正されるとともに、中間財務諸表が追加されます。

<更新・訂正後>

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。

また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条および第57条の規定により、「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. 財務諸表及び中間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（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第19期		第20期	
	(2018年3月31日現在)		(2019年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		1,068		977
未収委託者報酬		282,669		271,798
未収運用受託報酬		3,585		3,448
関係会社預け金	1	1,252,115	1	1,222,024
前払費用		27,077		28,687
その他		58		219
流動資産合計		1,566,574		1,527,156
固定資産				
無形固定資産				
ソフトウェア		839		559
無形固定資産合計		839		559
投資その他の資産				
敷金		23,992		23,622
繰延税金資産		49,417		45,283
投資その他の資産合計		73,409		68,906
固定資産合計		74,248		69,465
資産合計		1,640,823		1,596,622

（単位：千円）

	第19期		第20期	
	（2018年3月31日現在）		（2019年3月31日現在）	
負債の部				
流動負債				
未払金	1	3	108,065	1 3 90,587
未払費用	1		441,830	1 392,396
未払法人税等	2		15,085	2 16,032
預り金			5,668	5,603
賞与引当金			29,437	27,742
流動負債合計			600,088	532,362
固定負債				
退職給付引当金			107,836	113,666
固定負債合計			107,836	113,666
負債合計			707,924	646,028
純資産の部				
株主資本				
資本金			300,000	100,000
資本剰余金				
その他資本剰余金			-	200,000
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			557,898	575,593
利益剰余金合計			632,898	650,593
株主資本合計			932,898	950,593
純資産合計			932,898	950,593
負債純資産合計			1,640,823	1,596,622

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,179,939	1,118,971
運用受託報酬	581,932	545,687
営業収益計	1,761,871	1,664,658
営業費用		
支払手数料	791,230	751,448
委託計算費	49,965	49,513
調査費	232,263	227,921
営業雑経費		
通信費	2,815	2,732
印刷費	4,370	4,519
諸会費	3,772	3,930
営業雑経費計	10,958	11,182
営業費用計	1,084,417	1,040,066
一般管理費		
給料		
役員報酬	19,840	20,678
給料・手当	231,988	222,665
賞与	2,812	1,681
給料計	254,642	245,025
交際費	7,035	3,817
旅費交通費	7,227	2,369
租税公課	92	149
不動産賃借料	33,602	33,883
賞与引当金繰入額	58,874	57,547
退職給付費用	10,436	10,181
その他の人件費	41,982	43,143
その他の不動産関係費	5,486	5,643
減価償却費	279	279
諸雑費	16,719	8,141
一般管理費計	1 436,378	1 410,183
営業利益	241,075	214,408
営業外収益		
受取利息	286	484
為替差益	53	-
その他	43	46
営業外収益計	1 383	1 531
営業外費用		
為替差損	-	43
その他	16	34
営業外費用合計	16	77
経常利益	241,441	214,863
税引前当期純利益	241,441	214,863
法人税等	2 77,714	2 77,235
法人税等調整額	1,776	4,133
法人税等合計	75,937	81,368
当期純利益	165,504	133,494

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利 益 剰 余 金			株主資本 合計	
		その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金	利益剰余金 合計		
					繰越利益 剰余金			
当 期 首 残 高	300,000		-	75,000	557,898	632,898	932,898	932,898
当 期 変 動 額								
減 資	200,000	200,000	200,000					-
剰余金の配当					115,800	115,800	115,800	115,800
当期純利益					133,494	133,494	133,494	133,494
当期変動額合計	200,000	200,000	200,000	-	17,694	17,694	17,694	17,694
当 期 末 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	575,593	650,593	950,593	950,593

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	
「『税効果会計に係る会計基準』」の一部改正（企業会計基準第28号 平成30年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。）等に伴い、当会計期間より税効果会計基準一部改正を適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」15,780千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」49,417千円に含めて表示しております。	

注記事項

(貸借対照表関係)

第19期 (2018年3月31日現在)	第20期 (2019年3月31日現在)
1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,252,115千円 未払金 59,583千円 未払費用 191千円	1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,222,024千円 未払金 49,609千円 未払費用 149千円
2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 5,323千円 未払事業税 8,779千円 未払事業所税 983千円	2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 3,526千円 未払事業税 11,567千円 未払事業所税 938千円
3. 消費税等の取扱い 未払消費税は、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「未払金」に含めて表示しております。	3. 消費税等の取扱い 同左

(損益計算書関係)

第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1. 関係会社との取引高 一般管理費 7,951千円 営業外収益 286千円	1. 関係会社との取引高 一般管理費 7,971千円 営業外収益 484千円
2. 法人税等には、住民税及び事業税を含んでおります。	2. 同左

（株主資本等変動計算書関係）

第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1. 発行済株式に関する事項 (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 2. 自己株式に関する事項 - 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 - 4. 配当に関する事項 (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 2017年5月26日 第18回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 112,200,000円 1株当たり配当額 18,700円 基準日 2017年 3月31日 効力発生日 2017年 5月29日 (2) 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 決議 2018年5月25日 第19回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 115,800,000円 配当の原資 利益剰余金 1株当たり配当額 19,300円 基準日 2018年 3月31日 効力発生日 2018年 5月28日	1. 発行済株式に関する事項 (1) 株式の種類 普通株式 (2) 当事業年度期首株式数 6,000株 (3) 当事業年度増加株式数 - (4) 当事業年度減少株式数 - (5) 当事業年度末株式数 6,000株 2. 自己株式に関する事項 - 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 - 4. 配当に関する事項 (1) 当事業年度中に行った剰余金の配当 決議 2018年5月25日 第19回定時株主総会 株式の種類 普通株式 配当金の総額 115,800,000円 1株当たり配当額 19,300円 基準日 2018年 3月31日 効力発生日 2018年 5月28日 (2) 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 該当事項はありません。

（リース取引関係）

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1年内	2,443千円	2,443千円
1年超	8,754千円	6,311千円
合計	11,197千円	8,754千円

（金融商品関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

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

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

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	977	977	-
未収委託者報酬	271,798	271,798	-
未収運用受託報酬	3,448	3,448	-
関係会社預け金	1,222,024	1,222,024	-
資産計	1,498,249	1,498,249	-
未払金	90,587	90,587	-
未払費用	392,396	392,396	-
負債計	482,984	482,984	-

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	第19期 (2018年3月31日現在)	第20期 (2019年3月31日現在)
敷金	23,992	23,622

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

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	977	-	-	-
未収委託者報酬	271,798	-	-	-
未収運用受託報酬	3,448	-	-	-
関係会社預け金	1,222,024	-	-	-
合計	1,498,249	-	-	-

（有価証券関係）

第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019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19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第19期 (2018年3月31日現在)	第20期 (2019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 107,836千円（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 113,666千円（退職給付引当金）
3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 10,436千円（退職給付費用）	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 10,181千円（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19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 (繰延税金資産)	1. 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 (繰延税金資産)
賞与引当金 9,013 千円	賞与引当金 9,595 千円
退職給付引当金 33,019	退職給付引当金 39,328
未払事業税 2,688	未払事業税 4,001
未払社会保険料 1,422	未払社会保険料 1,445
その他 3,272	その他 3,382
繰延税金資産小計 49,417	繰延税金資産小計 57,753
税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当額 —	税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当額 —
将来減算一時差異等の合計 に係る評価性引当額 —	将来減算一時差異等の合計 に係る評価性引当額 12,469
評価性引当額小計 —	評価性引当額小計 12,469
繰延税金資産合計 49,417	繰延税金資産合計 45,283
	(注) 評価性引当額が12,469千円増加しております。 主な理由は、将来課税所得を見直したことに伴う 退職給付引当金に係る評価性引当額の増加による ものです。
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	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異要因
(%)	(%)
法定実効税率 30.9	法定実効税率 34.6
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.4
その他 0.1	その他 2.9
税効果会計適用後の法人税等の負担率 31.5	税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.9

（ストックオプション等関係）

第19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019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19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019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19期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第20期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)																
1. 当該資産除去債務の概要 当本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。 また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。 2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。 3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減 <table> <tr> <td>期首残高</td><td>1,603千円</td></tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td><td>- 千円</td></tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td><td>370千円</td></tr> <tr> <td>期末残高</td><td>1,973千円</td></tr> </table>	期首残高	1,603千円	建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円	当年度の負担に属する償却額	370千円	期末残高	1,973千円	1. 当該資産除去債務の概要 当本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。 また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。 2. 当該資産除去債務の金額算定方法 資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。 3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減 <table> <tr> <td>期首残高</td><td>1,973千円</td></tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td><td>- 千円</td></tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td><td>370千円</td></tr> <tr> <td>期末残高</td><td>2,343千円</td></tr> </table>	期首残高	1,973千円	建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円	当年度の負担に属する償却額	370千円	期末残高	2,343千円
期首残高	1,603千円																
建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円																
当年度の負担に属する償却額	370千円																
期末残高	1,973千円																
期首残高	1,973千円																
建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円																
当年度の負担に属する償却額	370千円																
期末残高	2,343千円																

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品・サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

該当事項はありません。

(3)主要な顧客ごとの情報

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

（注）当社は、投資信託委託会社として、約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ております。

そのため、投資信託からの営業収益については当該投資信託を顧客として開示しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品・サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

該当事項はありません。

(3)主要な顧客ごとの情報

顧客の名称または氏名	売上高（千円）
日立企業年金基金	358,388
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	264,992
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	251,307

（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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

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

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

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

関係会社預け金の金利：市場金利に基づいて決定しております。

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

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

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

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

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

近隣の取引事例を参考の上、決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

株式会社日立製作所（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の受入等	事業上の関係				
主要株主	㈱日立製作所	東京都千代田区	458,790 百万円	電機機器製造業	100.0%	受入1名 兼任3名	営業上の取引、資金の預け入れ等	連結納税の未払金の支払い	59,080	未払金	49,088
								預け金の利息	484	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,765,486	関係会社預け金	1,222,024
								親会社に対する預け金の減少	1,795,577		

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

２．取引条件および取引条件の決定方法等

関係会社預け金の金利：市場金利に基づいて決定しております。

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

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

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の受入等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	㈱日立アーバンインベストメント	東京都千代田区	2,000 百万円	不動産業	-	-	建物の賃借	敷金の支払	-	敷金	23,622

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

２．取引条件および取引条件の決定方法等

近隣の取引事例を参考の上、決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

株式会社日立製作所（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第20期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
1株当たり純資産額 155,483円15銭 1株当たり当期純利益 27,584円03銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 158,432円20銭 1株当たり当期純利益 22,249円05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 165,504千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項なし 普通株式に係る当期純利益 165,504千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株	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 133,494千円 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 133,494千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

（重要な後発事象）

第19期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第20期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
該当事項はありません。	同左

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2019年9月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	600
未収委託者報酬	297,674
未収運用受託報酬	146,475
関係会社預け金	1,147,940
前払費用	21,331
その他	12,515
流動資産合計	1,626,538
固定資産	
無形固定資産	
ソフトウェア	419
無形固定資産合計	419
投資その他の資産	
敷金	23,437
繰延税金資産	45,283
投資その他の資産合計	68,721
固定資産合計	69,140
資産合計	1,695,679

(単位：千円)

当中間会計期間 (2019年9月30日現在)	
負債の部	
流動負債	
未払金	1 46,069
未払費用	429,054
未払法人税等	42,477
預り金	3,072
賞与引当金	29,702
流動負債合計	550,375
固定負債	
退職給付引当金	118,987
固定負債合計	118,987
負債合計	669,363
純資産の部	
株主資本	
資本金	100,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	200,000
利益剰余金	
利益準備金	75,000
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	651,315

利益剰余金合計	726,315
株主資本合計	1,026,315
純資産合計	1,026,315
負債純資産合計	1,695,679

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		575,196
運用受託報酬		269,672
営業収益計		844,868
営業費用		
支払手数料		379,709
委託計算費		25,386
調査費		115,941
営業雑経費		
通信費		1,361
印刷費		1,704
諸会費		2,527
営業雑経費計		5,593
営業費用計		526,630
一般管理費		
給料		
役員報酬		11,063
給料・手当		107,735
賞与		800
給料計		119,599
交際費		1,379
旅費交通費		1,708
租税公課		53
不動産賃借料		17,139
賞与引当金繰入額		29,702
退職給付費用		5,321
その他の人件費		19,550
その他の不動産関係費		2,784
減価償却費	1	139
諸雑費		3,288
一般管理費計		200,665
営業利益		117,572
営業外収益		
受取利息		309
その他		20
営業外収益計		330
営業外費用		
雑損失		41
営業外費用計		41
経常利益		117,862
税引前中間純利益		117,862
法人税等	2	42,139
中間純利益		75,722

(3) 中間株主資本等変動計算書（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							純資産 合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金			株主資本 合計	
		その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
					繰越利益 剰余金			
当 期 首 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	575,593	650,593	950,593	950,593
当中間期変動額								
中間純利益					75,722	75,722	75,722	75,722
当中間期変動額合計	-	-	-	-	75,722	75,722	75,722	75,722
当中間期末残高	100,000	200,000	200,000	75,000	651,315	726,315	1,026,315	1,026,315

重要な会計方針

1. 固定資産の減価償却の方法	(1)無形固定資産 減価償却の方法は、自社利用ソフトウェアについて見込利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。
2. 引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込み額のうち、当中間期に発生していると認められる額を計上しております。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込み額に基づき、当中間期末において発生していると認められる額を計上しております。
3. その他中間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親法人とする法人税に係る連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)	
1 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。

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)	
1 減価償却実施額は、次のとおりであります。	無形固定資産 139千円
2 税効果会計の適用に当たり「簡便法」を採用しておりますので、法人税等調整額を含めた金額で、一括掲記しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)				
1. 発行済株式に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首株式数	増加	減少	当中間会計期間末株式数
普通株式	6,000株	-	-	6,000株
2. 自己株式に関する事項 該当事項はありません。				
3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項 該当事項はありません。				

（リース取引関係）

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)	
1年内	2,443千円
1年超	5,089千円
合計	7,532千円

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金及び預金	600	600	-
未収委託者報酬	297,674	297,674	-
未収運用受託報酬	146,475	146,475	-
関係会社預け金	1,147,940	1,147,940	-
資産計	1,592,690	1,592,690	-
未払金	46,069	46,069	-
未払費用	429,054	429,054	-
負債計	475,123	475,123	-

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
敷金	23,437

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

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	600	-	-	-
未収委託者報酬	297,674	-	-	-
未収運用受託報酬	146,475	-	-	-
関係会社預け金	1,147,940	-	-	-
合計	1,592,690	-	-	-

（有価証券関係）

当中間会計期間 （自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間 （自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日）
該当事項はありません。

（持分法損益等関係）

当中間会計期間 （自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日）
該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

当中間会計期間 (自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日)	
1. 当該資産除去債務の概要	
当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。	
また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。	
2. 当該資産除去債務の金額算定方法	
資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。	
3. 当中間会計期間中における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	2,343千円
建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額	- 千円
当中間会計期間の負担に属する償却額	185千円
当中間会計期間末残高	2,528千円

（セグメント情報等）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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、中間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中間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	182,312
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	148,101
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	119,361

（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。

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日）	
1株当たり純資産額	171,052.64円
1株当たり中間純利益	12,620.44円
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	75,722千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	該当事項はありません。
普通株式に係る中間純利益	75,722千円
普通株式の期中平均株式数	6,000株

（重要な後発事象）

当中間会計期間 （自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日）
該当事項はありません。

第 2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 訂正前 >

（2019年6月末現在）

〔以下 略〕

< 訂正後 >

（2019年12月末現在）

〔以下 略〕

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月24日

日立投資顧問株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 亀井 純子 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式70）の2019年5月16日から2019年11月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日立バランスファンド（株式70）の2019年11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中間計算期間（2019年5月16日から2019年11月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月24日

日立投資顧問株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 亀井 純子 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式50）の2019年5月16日から2019年11月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日立バランスファンド（株式50）の2019年11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中間計算期間（2019年5月16日から2019年11月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月24日

日立投資顧問株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 亀井 純子 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日立バランスファンド（株式30）の2019年5月16日から2019年11月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日立バランスファンド（株式30）の2019年11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中間計算期間（2019年5月16日から2019年11月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[当期委託会社監査報告書へ](#)

独立監査人の監査報告書

2019年5月23日

日立投資顧問株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 亀井 純子 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日立投資顧問株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第20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2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[当期委託会社中間監査報告書へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月21日

日立投資顧問株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 亀井 純子 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日立投資顧問株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日立投資顧問株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。