

【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】 2022年8月15日

【計算期間】 第21期（自 2021年5月18日 至 2022年5月16日）

【ファンド名】 日立バランスファンド（株式70）
日立バランスファンド（株式50）
日立バランスファンド（株式30）

【発行者名】 日立投資顧問株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 柿沼 敬二

【本店の所在の場所】 東京都台東区東上野二丁目16番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド管理グループ 都地 雅夫

【連絡場所】 東京都台東区東上野二丁目16番1号

【電話番号】 080-7784-4536

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

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

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

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

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

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

商品分類表

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

< 商品分類表の定義 >

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

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

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

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

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

属性区分表

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

< 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、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

当ファンドの運用にあたっては、TOPIX（東証株価指数、配当込み）（1）、NOMURA - BPI 総合（ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）（2）、MSCI コクサイ指数（除く日本、円ベース）（3）ならびにFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・

円ベース)(4)を基に、各ファンドに定められた基本資産配分(後記「2 投資方針(1) 投資方針」参照)にしたがって委託者が計算する合成指数をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求します。

- 1 TOPIX(東証株価指数)は、株式会社JPX総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- 2 NOMURA - BPI総合(ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)は、野村證券株式会社(以下「野村證券」といいます。)が算出している国内債券市場の全体を表す指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利は、野村證券に帰属しています。
- 3 MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc. が算出している日本を除く世界の主要株式市場の動きを表す指数です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。
- 4 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

ファンドの特色

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

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

（２）【ファンドの沿革】

2001年12月5日 信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始

証券取引所への上場の予定はありません。

なお、主要投資対象であるマザーファンドは以下のとおりです。

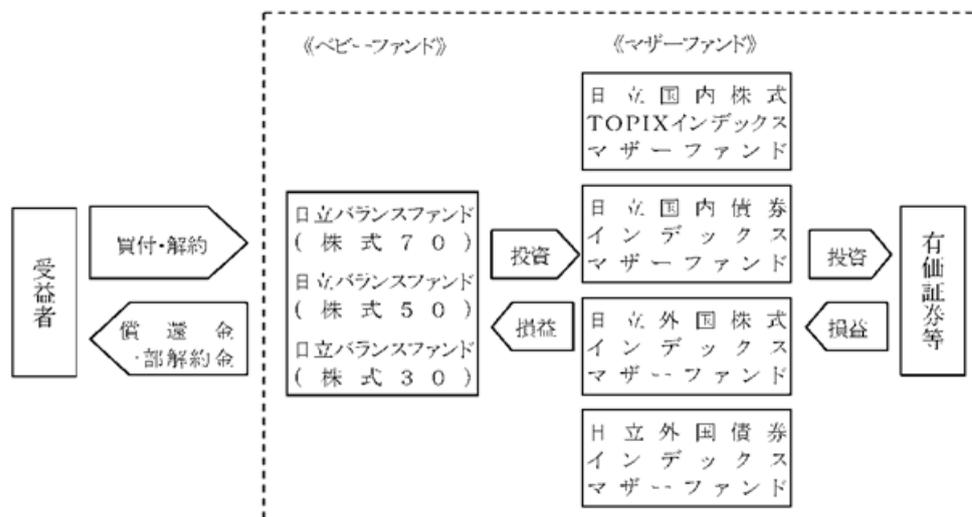
マザーファンド名	設定日
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	2001年 6月22日
日立国内債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立国内債券マザーファンドN」）	2000年 4月28日
日立外国株式インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国株式マザーファンドS」）	2000年 4月 3日
日立外国債券インデックスマザーファンド （設定当時の名称「日立外国債券マザーファンドU」）	2001年 3月29日

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

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

ただし、各ファンドから有価証券等に直接投資する場合もあります。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もあります。



ファンドの関係法人

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

1. 委託者（委託会社）：日立投資顧問株式会社

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

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

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

2. 受託者（受託会社）：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

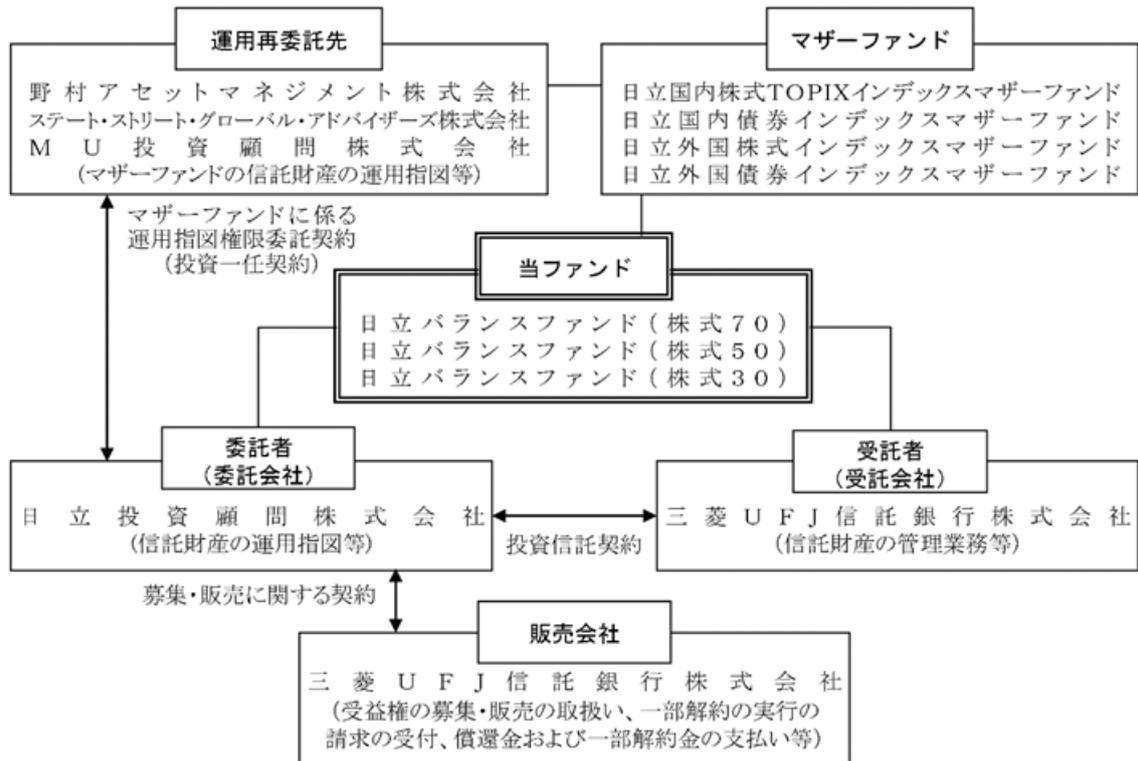
3. 販売会社：三菱UFJ信託銀行株式会社

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

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

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

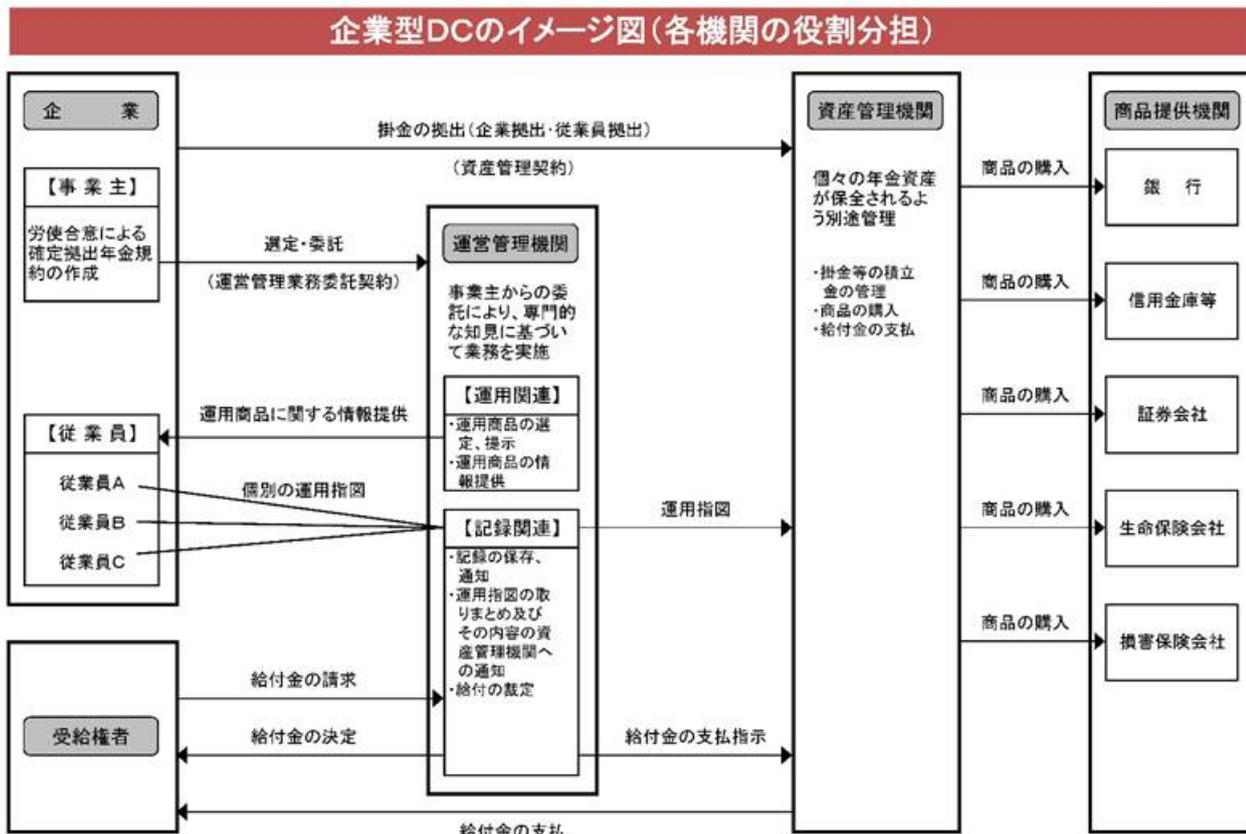
ファンドの関係法人図



（ご参考）

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

制度の詳細は関係法令等によりご確認下さい。



（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（2022年8月15日現在）

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

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

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

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

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

マザーファンドの受益証券の組入比率はできるだけ高位を保ちます。

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

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドが投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

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す。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
なお、1.の証券または証書、12.ならびに17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものおよび14.の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券のうち投資法人債券以外のものを以下「投資信託証券」といいます。
 -) 委託者は、信託金を、) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
 -))の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記) に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
 -) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
 -) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(3) 【運用体制】

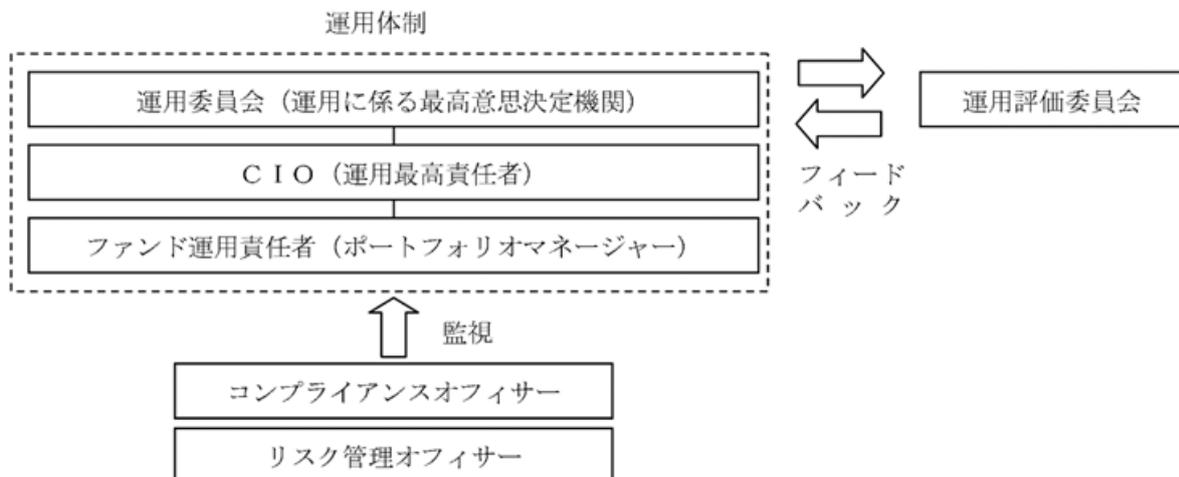
運用委員会は、当社の運用方針策定のための最高意思決定機関で、当ファンドに関する運用方針を策定します。2022年6月末現在10名程度出席。

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。2022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。2022年6月末現在9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。2022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。

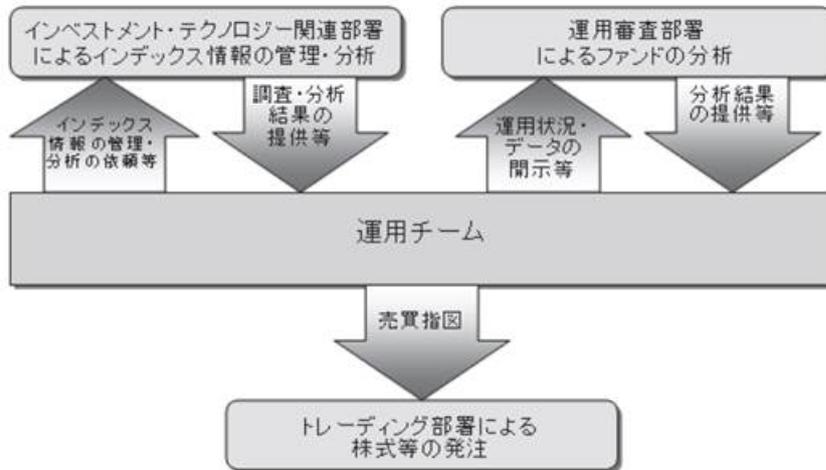
運用体制図



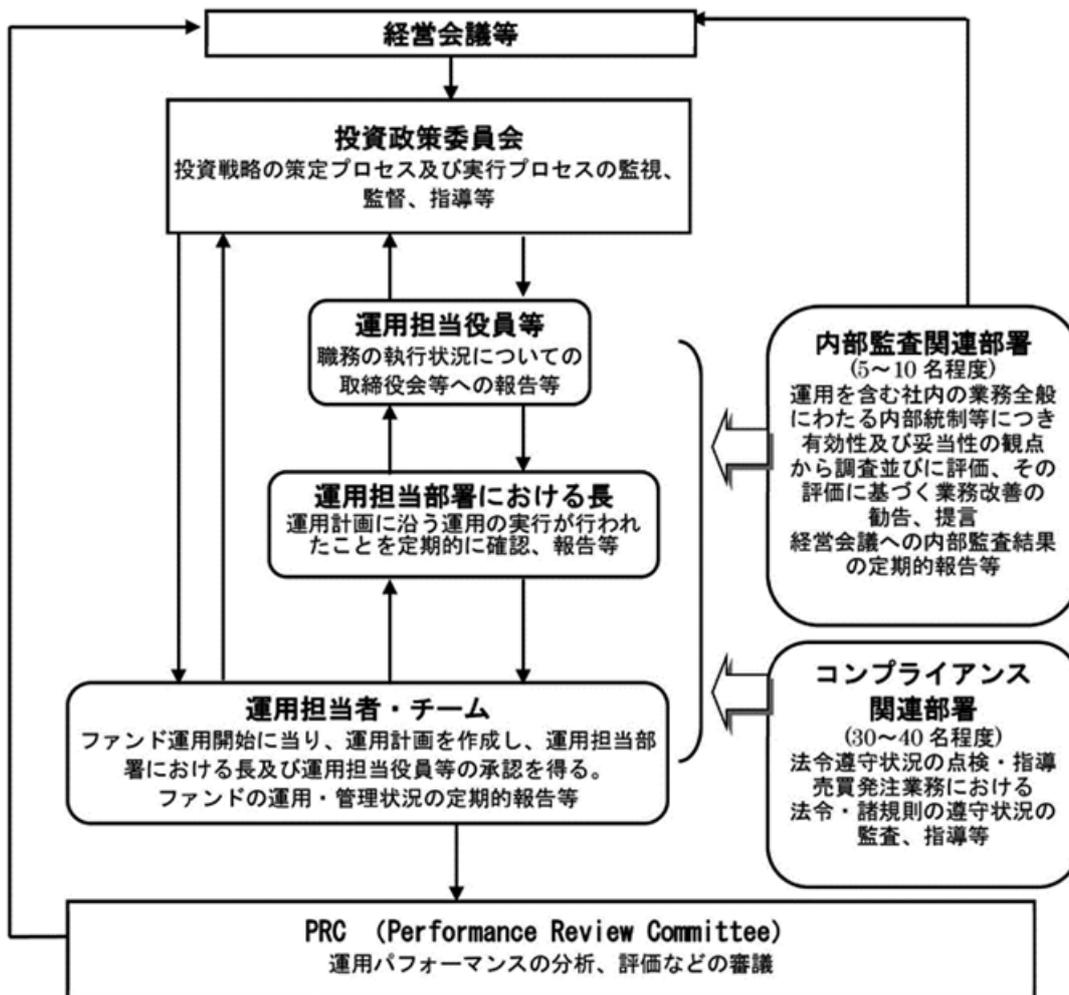
（ご参考）

「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

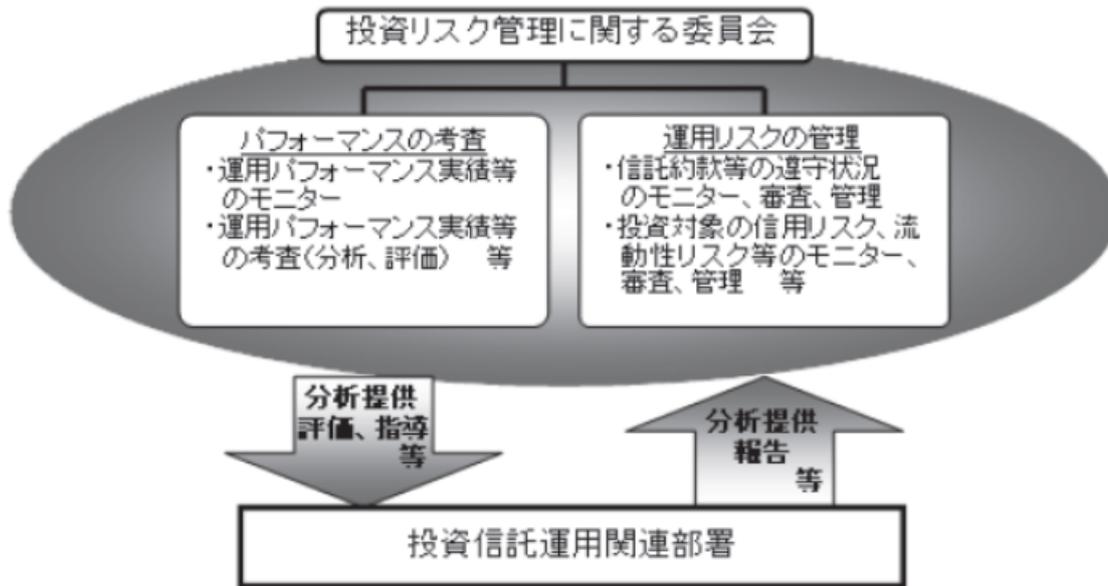
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2022年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



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。

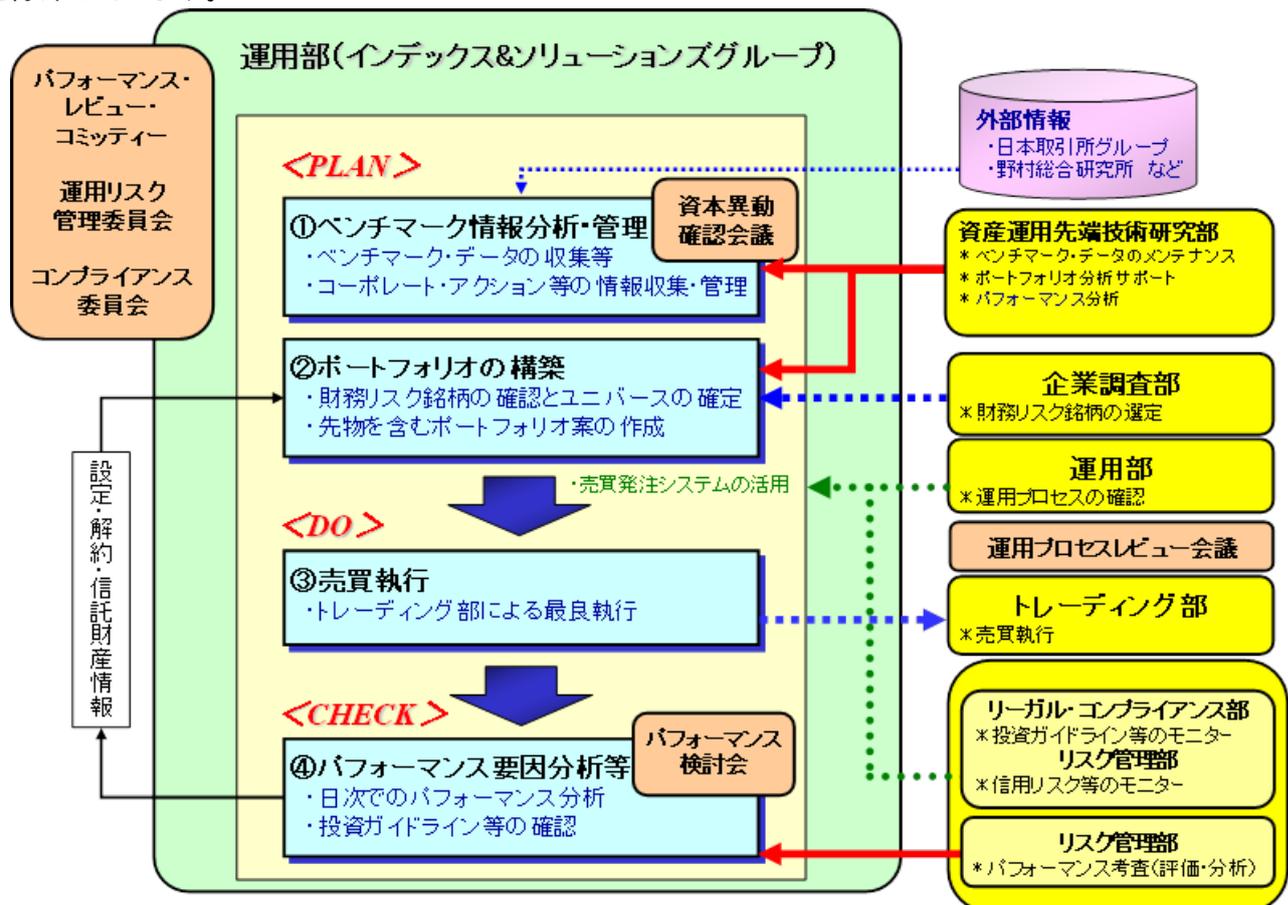


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

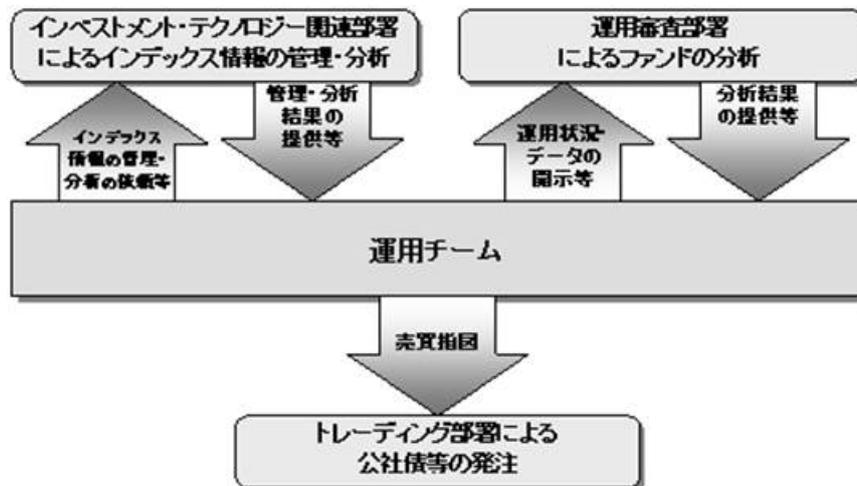
基本的には、TOPIX採用銘柄を、その時価総額割合に基づき組み入れますが、一部財務リスクの高い銘柄を除外しています。



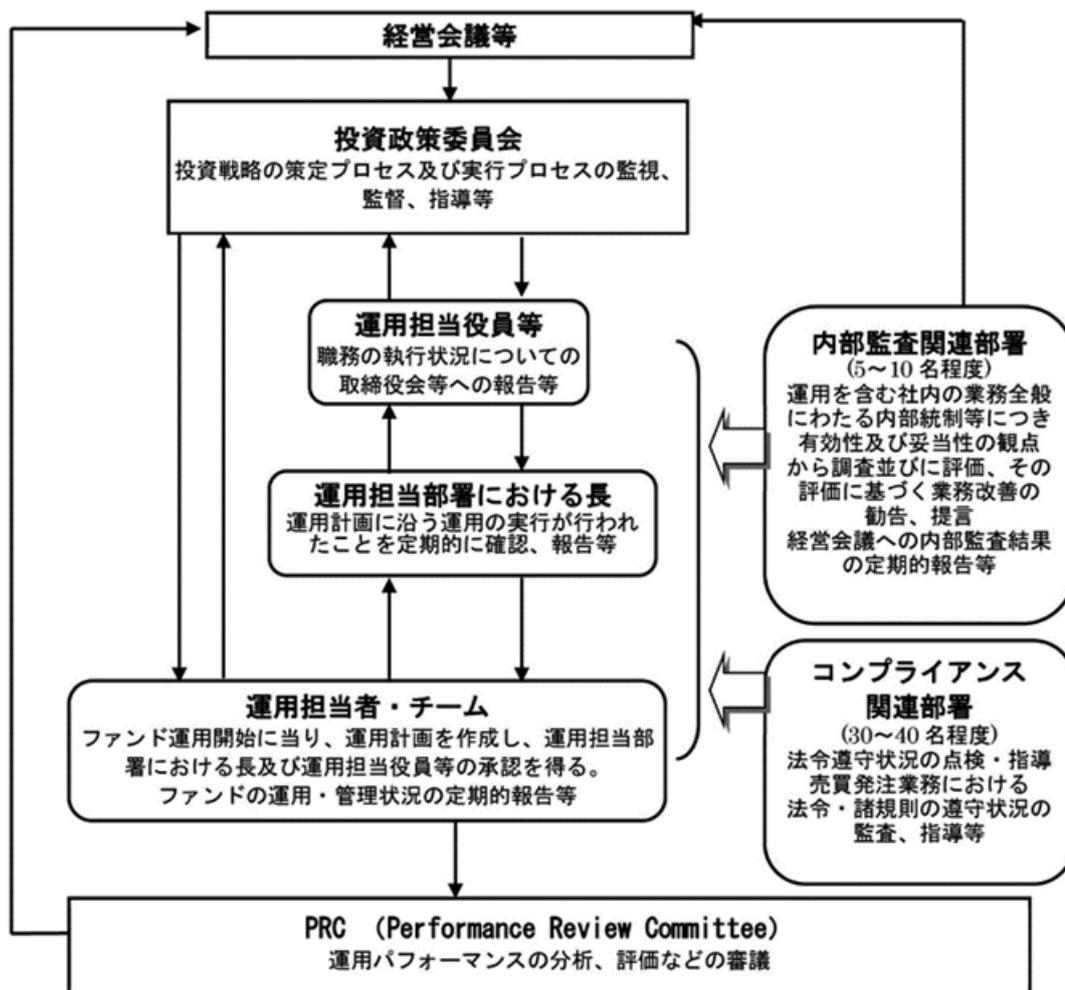
（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の運用体制

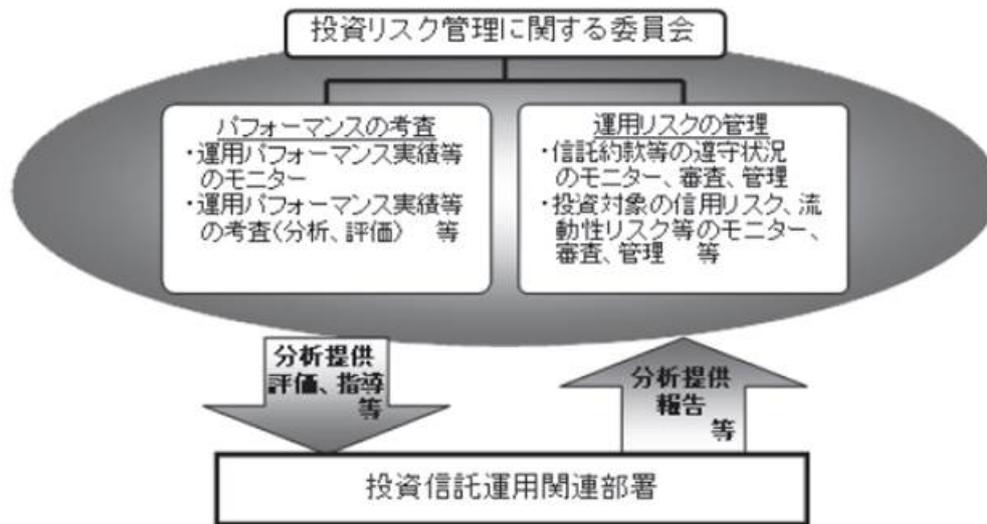
当マザーファンドの運用は、野村アセットマネジメント株式会社に委託しており、同社の運用体制等は、次の通りです。（2022年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）



内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。

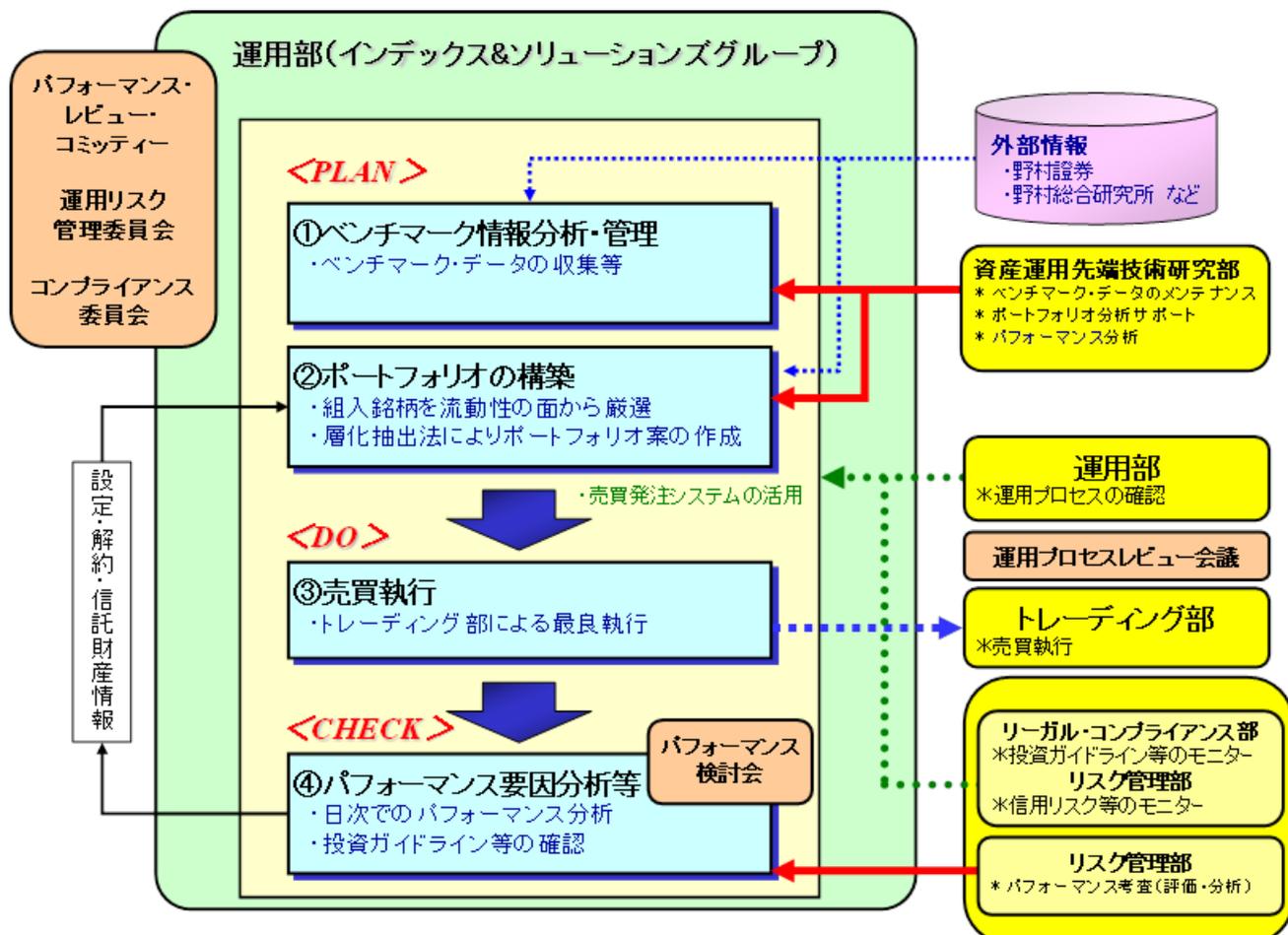


リスクマネジメント体制は、以下の通りです。



運用のプロセスは、以下の通りです。

ベンチマーク・データ、信託財産情報、追加設定・解約等の資金流入出データ等入手した後、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。

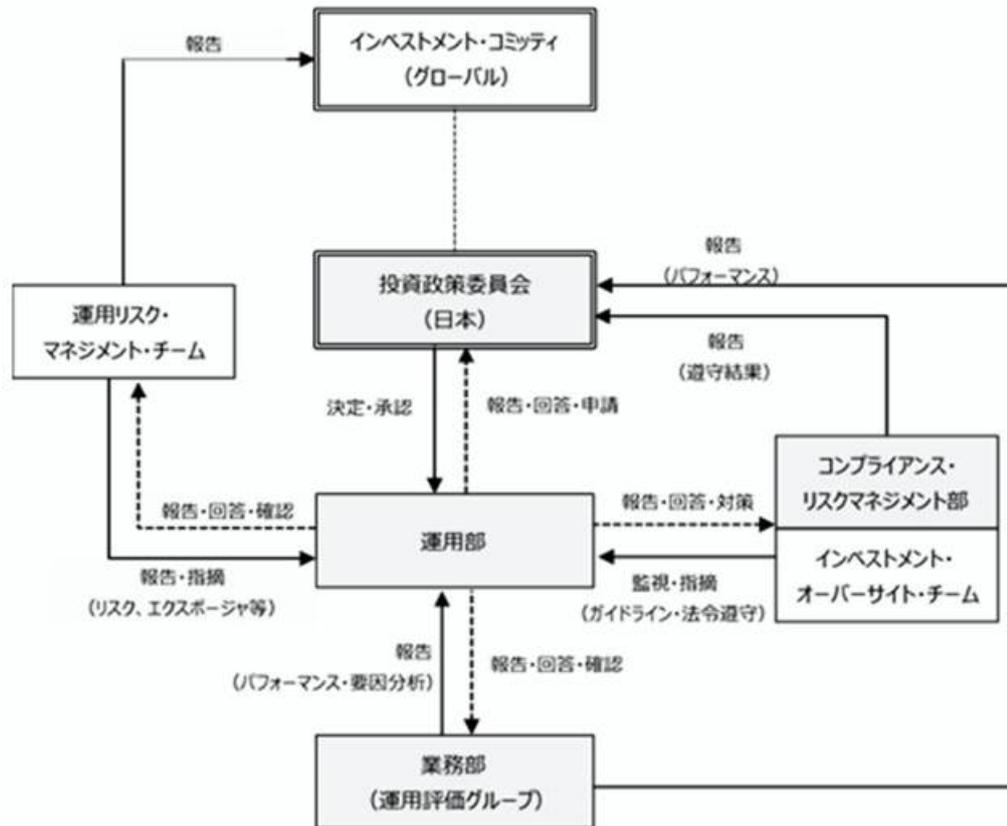


（ご参考）

「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。（2022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、常にポ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。

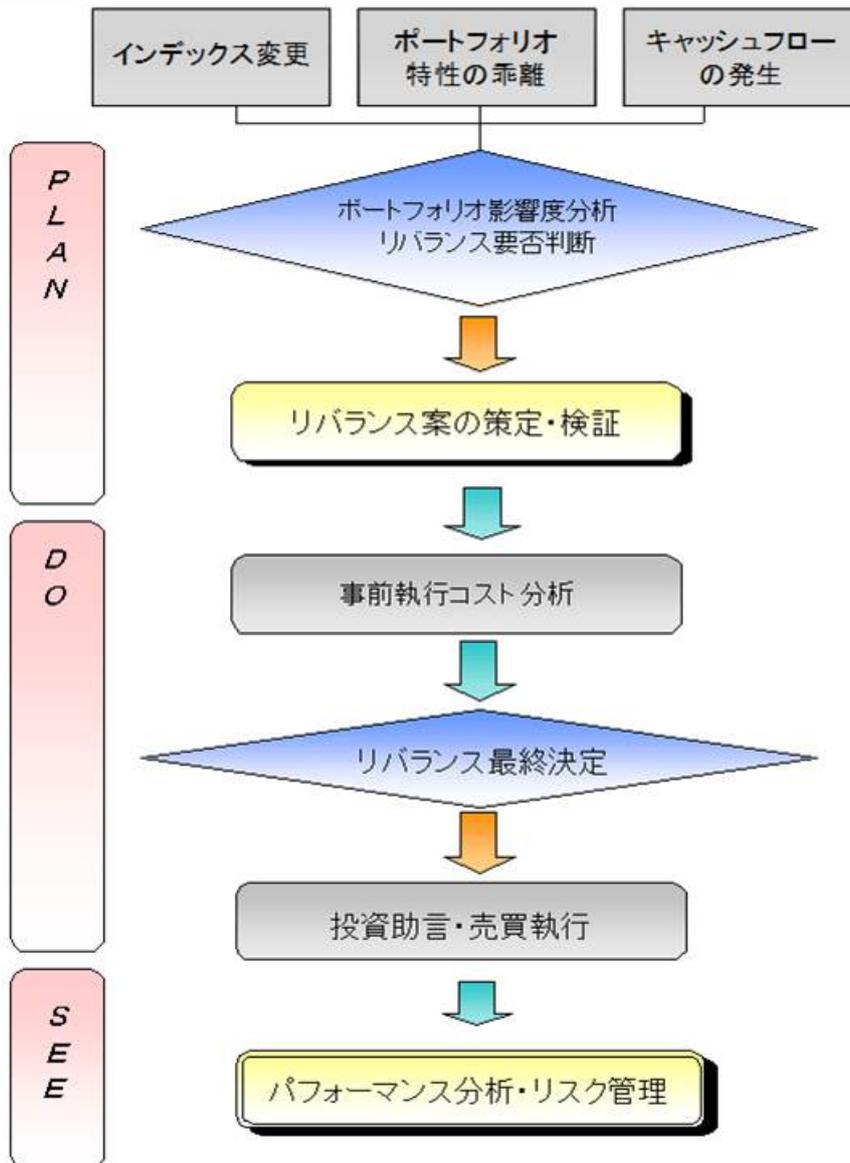
（ご参考）

「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。（2022年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。）

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

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



A. コンプライアンス体制

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

B. リスク管理における補完体制

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

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

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

（４）【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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

４．先物取引等の運用指図（投資信託約款第20条）

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

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

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

5. スワップ取引の運用指図（投資信託約款第21条）

- イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- 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。

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

二． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

10． 外貨建資産への投資制限（投資信託約款第26条）

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

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

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

11． 外国為替予約の指図（投資信託約款第28条）

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

12． 資金の借入れ（投資信託約款第35条）

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

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

ハ． 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

13． 受託者による資金の立替え（投資信託約款第37条）

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

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

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

その他法令上の投資制限

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

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

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

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

（ご参考）

「日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド」の概要

(1) 投資方針

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

国内株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

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

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

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

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

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

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2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。）

- 八． 金銭債権
- 二． 約束手形
- 2． 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ． 為替手形
 - 運用の指図範囲
 - ） 委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
 - 1． 株券または新株引受権証券
 - 2． 国債証券
 - 3． 地方債証券
 - 4． 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5． 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6． 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7． 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - 8． 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - 9． 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - 10． コマーシャル・ペーパー
 - 11． 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
 - 12． 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. までの証券または証書の性質を有するもの
 - 13． 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 14． 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 15． 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 16． オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - 17． 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 18． 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 19． 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 - 20． 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - 21． 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

) の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記) に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、

) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

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

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

委託者は、株式への投資割合については、制限を設けません。

2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

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

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、取得時において信託財産に属する外貨建資産の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- 10． 外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）
- 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 11． 受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）
- イ． 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ロ． 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ． イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- その他法令上の投資制限
- 委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2. 投資方針 (5) 投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）

（ご参考）

「日立国内債券インデックスマザーファンド」の概要

(1) 投資方針

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

国内債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

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

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

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

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

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

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

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

野村アセットマネジメント株式会社
東京都江東区豊洲二丁目2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。）

- 八． 金銭債権
- 二． 約束手形
- 2． 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ． 為替手形
 - 運用の指図範囲
 - ） 委託者（委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。以下同じ。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
 - 1． 株券または新株引受権証券
 - 2． 国債証券
 - 3． 地方債証券
 - 4． 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5． 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6． 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7． 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - 8． 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - 9． 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - 10． コマーシャル・ペーパー
 - 11． 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
 - 12． 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から11. までの証券または証書の性質を有するもの
 - 13． 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 14． 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 15． 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 16． オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - 17． 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 18． 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 19． 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 - 20． 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 - 21． 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

) の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記) に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、

) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。）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るものとします。

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、取得時において信託財産に属する外貨建資産の時価総額が、信託財産の純資産総額
の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- 10．外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）
- 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避す
るため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 11．受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合
で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子
等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるもの
があるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど
別にこれを定めます。
- その他法令上の投資制限
- 委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関
連法令に定める投資制限に従います。（前記「2．投資方針 (5) 投資制限 その他法令上の投
資制限」の記載と同じです。）

（ご参考）

「日立外国株式インデックスマザーファンド」の概要

(1) 投資方針

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

外国株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

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

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

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

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

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

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

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

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

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

(2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

八．金銭債権

二．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲

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

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

22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

) ()の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記()に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、

) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

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

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

委託者は、株式への投資割合については、制限を設けません。

2. 信用取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第18条）

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

3. 先物取引等の運用指図（マザーファンド投資信託約款第19条）

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

4. スワップ取引の運用指図（マザーファンド投資信託約款第20条）

- イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- ニ. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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

- イ. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- ニ. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

6. 有価証券の貸付の指図（マザーファンド投資信託約款第22条）

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

- ロ． 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7． 公社債の空売りの指図（マザーファンド投資信託約款第23条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ． イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8． 公社債の借入れの指図（マザーファンド投資信託約款第24条）
- イ． 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- ロ． イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ． 信託財産の一部解約等の事由により、ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ． イ．の借入れに係る品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 9． 外貨建資産への投資制限（マザーファンド投資信託約款第25条および運用の基本方針 2. 運用方法 (3)投資制限）
- 委託者は、外貨建資産への投資割合については、制限を設けません。
- 10． 外国為替予約の指図（マザーファンド投資信託約款第27条）
- 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためおよび為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 11． 受託者による資金の立替え（マザーファンド投資信託約款第36条）
- イ． 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ロ． 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ． イ．ロ．の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- その他法令上の投資制限
- 委託者は、当マザーファンドの運用にあたっては、投資信託及び投資法人に関する法律および関連法令に定める投資制限に従います。（前記「2. 投資方針 (5) 投資制限 その他法令上の投資制限」の記載と同じです。）

（ご参考）

「日立外国債券インデックスマザーファンド」の概要

(1) 投資方針

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

外国債券の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。

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

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

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

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

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

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

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

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

MU投資顧問株式会社

東京都千代田区神田駿河台二丁目3番地11

(2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

八．金銭債権

二．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲

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

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

22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

) の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応等で、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前記) に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

) デリバティブ取引等については、ヘッジ目的に限るものとし、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、

) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(3) 投資制限

ファンドの投資信託約款に定める投資制限

当マザーファンドは、委託者（11.を除き委託者から運用指図権限の委託を受けた者を含みます。）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るものとし、

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。）

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。

2022年6月末現在、当ファンドを含めてマザーファンドに投資しているベビーファンドとその口数は、次のとおりです。なお、マザーファンドに投資するベビーファンドが新たに設定されたり、マザーファンドに投資しているベビーファンドが償還等の理由で今後投資しなくなったりすることがあります。

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	5,519,653,292
	日立バランスファンド（株式50）	3,432,387,522
	日立バランスファンド（株式30）	797,217,241
	日立国内株式インデックスファンド	10,746,429,442
	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）	5,176,021,657
	合計	25,671,709,154

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）	4,287,029,556
	日立バランスファンド（株式50）	7,141,051,326
	日立バランスファンド（株式30）	3,801,888,727
	日立国内債券インデックスファンド	9,813,398,498
	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）	32,425,798,252
	合計	57,469,166,359

マザーファンド名	ベビーファンド名	口数
日立外国株式 インデックスマザーファンド	日立バランスファンド（株式70）	2,198,377,377
	日立バランスファンド（株式50）	1,210,351,068
	日立バランスファンド（株式30）	207,108,915
	日立外国株式インデックスファンド	13,416,607,738
	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）	23,259,843,733
	合計	40,292,288,831

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）	1,182,357,799
	日立バランスファンド（株式50）	979,953,723
	日立バランスファンド（株式30）	345,555,876
	日立外国債券インデックスファンド	6,410,364,720
	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）	9,399,409,951
	合計	18,317,642,069

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ます、この場合、当ファンドの運用に影響を与え、または受益者に直接的な影響を与えることがあります。

その他のリスク

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

その他の留意点

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

流動性リスクに関する事項

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

（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。

流動性リスクに対する管理体制

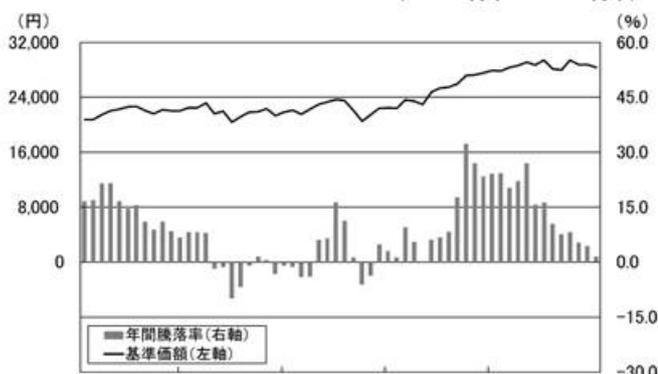
- ・委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。
- ・取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

< リスクの定量的比較 >

○ ファンドの年間騰落率及び基準価額の推移

日立バランスファンド（株式70）

(2017.7月末～2022.6月末)

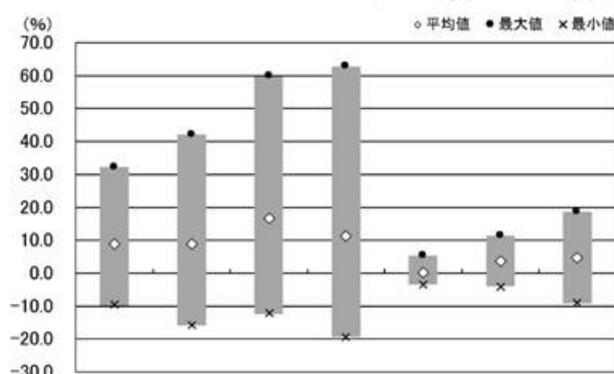


2017年7月 2018年6月 2019年6月 2020年6月 2021年6月 2022年6月

*年間騰落率は、2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

○ 代表的な資産クラスと騰落率の比較

(2017.7月末～2022.6月末)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

	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(%)	8.7	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	4.5
最大値(%)	32.3	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	18.7
最小値(%)	△ 9.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.0	△ 9.1

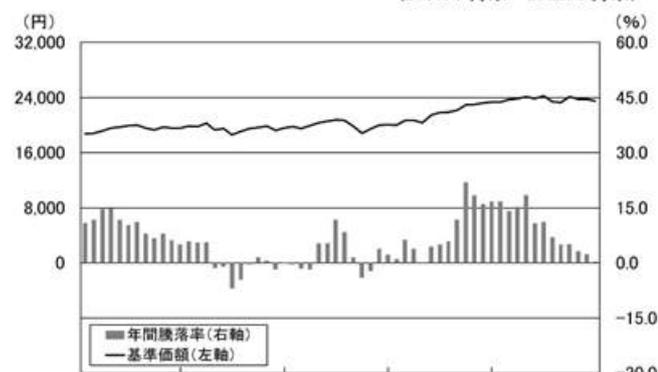
*2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド（株式50）

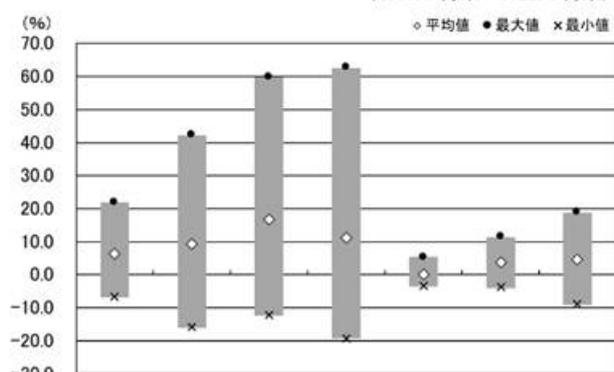
(2017.7月末～2022.6月末)



2017年7月 2018年6月 2019年6月 2020年6月 2021年6月 2022年6月

*年間騰落率は、2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

(2017.7月末～2022.6月末)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

	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(%)	6.2	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	4.5
最大値(%)	21.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	18.7
最小値(%)	△ 6.9	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.0	△ 9.1

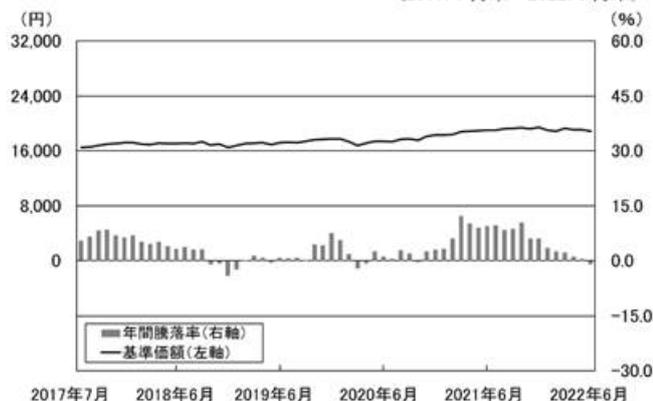
*2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

日立バランスファンド（株式30）

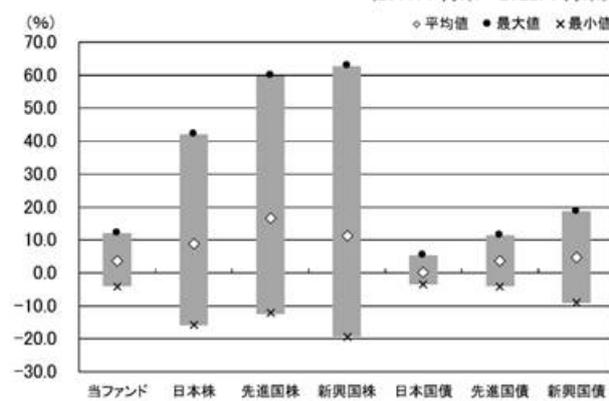
(2017.7月末～2022.6月末)



2017年7月 2018年6月 2019年6月 2020年6月 2021年6月 2022年6月

*年間騰落率は、2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

(2017.7月末～2022.6月末)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

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(%)	3.7	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7
最大値(%)	12.2	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4
最小値(%)	△ 4.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.0

*2017年7月から2022年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX) (配当込み)

先進国株・・・MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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

日本国債・・・NOMURA-BPI 国債

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

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

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

(注2) 各指数等に関する著作権等の知的財産権は、開発元もしくは公表元に帰属します。(東証株価指数(TOPIX)：株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社、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・ディバーシファイド：J. P. Morgan Securities Inc.)。なお、各社は当ファンドの運用に関し一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

かかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

かかりません。

(3)【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率	信託報酬の配分（税抜）		役務の内容
		委託会社	年率	
日立バランスファンド （株式70）	年率0.154% （税抜0.14%）	委託会社	年率0.061%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.039%	運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社から の指図の実行の対価
日立バランスファンド （株式50）	年率0.154% （税抜0.14%）	委託会社	年率0.061%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.039%	運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社から の指図の実行の対価
日立バランスファンド （株式30）	年率0.154% （税抜0.14%）	委託会社	年率0.062%	委託した資金の運用の対価
		販売会社	年率0.038%	運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価
		受託会社	年率0.04%	運用財産の管理、委託会社から の指図の実行の対価

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（ご参考）マザーファンドにおける管理報酬等

マザーファンドについては信託報酬を収受しません。

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

マザーファンド	運用再委託先	報酬
日立国内株式ＴＯＰＩＸ インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.02365% (税抜0.0215%)
日立国内債券 インデックスマザーファンド	野村アセットマネジメント株式会社	年0.0275% (税抜0.025%)
日立外国株式 インデックスマザーファンド	ステート・ストリート・グローバル・アド バイザーズ株式会社	年0.0451% (税抜0.041%)
日立外国債券 インデックスマザーファンド	MU投資顧問株式会社	年0.0396% (税抜0.036%)

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

個別元本について

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

一部解約時および償還時の課税について

一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

個人、法人別の課税の取扱いについて

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

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、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収が行われ、申告分離課税が適用されます。

2. 法人の受益者に対する課税

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

確定拠出年金による取得に係る課税の取扱いについて

確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

- * 税制に関する記載は、2022年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法が改正された場合は、上記の内容が変更になることがあります。
- * 税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は2022年6月30日現在の運用状況であります。

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

日立バランスファンド（株式70）

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	29,443,593,966	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		284,683,275	0.95
合計(純資産総額)		29,728,277,241	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	5,519,653,292	2.1068	11,629,119,712	2.1180	11,690,625,672	39.32
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	2,198,377,377	4.0131	8,822,350,513	4.0364	8,873,530,444	29.84
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	4,287,029,556	1.3859	5,941,394,262	1.3736	5,888,663,798	19.80
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	1,182,357,799	2.4631	2,912,265,495	2.5295	2,990,774,052	10.06

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	24,442,998,864	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		234,427,942	0.94
合計(純資産総額)		24,677,426,806	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	7,141,051,326	1.3860	9,897,497,138	1.3736	9,808,948,101	39.74
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	3,432,387,522	2.1063	7,229,639,122	2.1180	7,269,796,771	29.45
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	1,210,351,068	4.0134	4,857,643,962	4.0364	4,885,461,050	19.79
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	979,953,723	2.4629	2,413,528,025	2.5295	2,478,792,942	10.04

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日立バランスファンド（株式30）

（1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,620,838,483	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		82,281,657	0.94
合計(純資産総額)		8,703,120,140	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	3,801,888,727	1.3860	5,269,417,776	1.3736	5,222,274,355	60.00
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	797,217,241	2.1062	1,679,138,108	2.1180	1,688,506,116	19.40
3	日本	親投資信託 受益証券	日立外国債券 インデックスマザーファンド	345,555,876	2.4629	851,069,568	2.5295	874,083,588	10.04
4	日本	親投資信託 受益証券	日立外国株式 インデックスマザーファンド	207,108,915	4.0141	831,374,345	4.0364	835,974,424	9.60

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考）

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	53,367,734,530	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,004,650,687	1.84
合計(純資産総額)		54,372,385,217	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	991,365,000	1.82

（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	1,011,800	2,220.84	2,247,045,912	2,100.00	2,124,780,000	3.90
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	139,000	12,615.56	1,753,562,840	11,095.00	1,542,205,000	2.83
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	244,100	3,594.97	877,532,601	3,896.00	951,013,600	1.74
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,281,300	759.84	973,582,992	729.40	934,580,220	1.71
5	日本	株式	キーエンス	電気機器	20,100	56,651.08	1,138,686,826	46,380.00	932,238,000	1.71
6	日本	株式	任天堂	その他製品	12,500	61,526.22	769,077,837	58,680.00	733,500,000	1.34
7	日本	株式	日立製作所	電気機器	106,700	6,180.40	659,448,680	6,438.00	686,934,600	1.26
8	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	130,600	5,533.91	722,729,654	5,235.00	683,691,000	1.25
9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	158,800	4,036.60	641,012,628	4,289.00	681,093,200	1.25
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	174,400	3,519.18	613,744,992	3,818.00	665,859,200	1.22
11	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	14,100	62,425.21	880,195,595	44,300.00	624,630,000	1.14
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	151,900	5,393.11	819,213,409	3,995.00	606,840,500	1.11
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	143,300	4,592.35	658,083,755	4,037.00	578,502,100	1.06
14	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	142,000	3,907.95	554,928,900	4,032.00	572,544,000	1.05
15	日本	株式	第一三共	医薬品	161,000	2,692.58	433,505,380	3,437.00	553,357,000	1.01
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	162,300	3,483.19	565,321,737	3,293.00	534,453,900	0.98
17	日本	株式	信越化学工業	化学	34,500	18,744.49	646,684,905	15,300.00	527,850,000	0.97
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	24,200	22,330.60	540,400,520	21,750.00	526,350,000	0.96
19	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	329,900	1,434.16	473,131,896	1,506.50	496,994,350	0.91
20	日本	株式	HOYA	精密機器	42,800	13,920.30	595,788,840	11,585.00	495,838,000	0.91
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	60,900	7,124.91	433,907,019	7,903.00	481,292,700	0.88
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	131,000	4,134.90	541,671,900	3,667.00	480,377,000	0.88
23	日本	株式	三井物産	卸売業	158,400	3,322.19	526,234,896	2,994.50	474,328,800	0.87
24	日本	株式	村田製作所	電気機器	60,500	8,110.45	490,682,225	7,396.00	447,458,000	0.82
25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	22,600	23,409.63	529,057,638	18,920.00	427,592,000	0.78
26	日本	株式	ファナック	電気機器	19,500	21,582.87	420,866,039	21,240.00	414,180,000	0.76
27	日本	株式	日本電産	電気機器	49,300	9,704.34	478,423,962	8,380.00	413,134,000	0.75
28	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	262,400	1,566.73	411,109,952	1,543.00	404,883,200	0.74
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	189,700	1,922.76	364,747,572	2,115.00	401,215,500	0.73
30	日本	株式	S M C	機械	6,500	68,291.94	443,897,632	60,470.00	393,055,000	0.72

□.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	0.32
		建設業	2.20
		食料品	3.38
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.16
		医薬品	5.36
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.59
		機械	5.20
		電気機器	17.02
		輸送用機器	7.92
		精密機器	2.57
		その他製品	2.47
		電気・ガス業	1.34
		陸運業	3.01
		海運業	0.60
		空運業	0.42
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.95
		卸売業	5.40
		小売業	4.23
		銀行業	5.29
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.30
その他金融業	1.13		
不動産業	2.01		
サービス業	5.10		
合計			98.15

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
(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	1,020,340,235	991,365,000	1.82

（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	60,627,688,150	76.80
地方債証券	日本	6,519,954,010	8.25
特殊債券	日本	5,966,641,697	7.55
社債券	日本	5,153,502,000	6.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		669,744,884	0.84
合計(純資産総額)		78,937,530,741	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143回利付 国債（5年）	950,000,000	100.40	953,800,000	100.44	954,265,500	0.1	2025/3/20	1.20
2	日本	国債証券	第358回利付 国債（10年）	830,000,000	99.64	827,053,500	99.05	822,123,300	0.1	2030/3/20	1.04
3	日本	国債証券	第433回利付 国債（2年）	700,000,000	100.09	700,637,000	100.12	700,889,000	0.005	2024/2/1	0.88
4	日本	国債証券	第365回利付 国債（10年）	710,000,000	98.91	702,318,400	98.70	700,791,300	0.1	2031/12/20	0.88
5	日本	国債証券	第341回利付 国債（10年）	670,000,000	101.17	677,852,400	101.18	677,912,700	0.3	2025/12/20	0.85
6	日本	国債証券	第362回利付 国債（10年）	670,000,000	99.25	664,975,000	98.72	661,424,000	0.1	2031/3/20	0.83
7	日本	国債証券	第353回利付 国債（10年）	660,000,000	100.03	660,217,800	99.77	658,515,000	0.1	2028/12/20	0.83
8	日本	国債証券	第349回利付 国債（10年）	630,000,000	100.25	631,612,800	100.16	631,026,900	0.1	2027/12/20	0.79
9	日本	国債証券	第434回利付 国債（2年）	590,000,000	100.10	590,620,900	100.13	590,784,700	0.005	2024/3/1	0.74
10	日本	国債証券	第354回利付 国債（10年）	580,000,000	100.00	580,000,000	99.66	578,068,600	0.1	2029/3/20	0.73
11	日本	国債証券	第139回利付 国債（5年）	550,000,000	100.27	551,512,500	100.29	551,606,000	0.1	2024/3/20	0.69
12	日本	国債証券	第361回利付 国債（10年）	550,000,000	99.35	546,452,500	98.79	543,378,000	0.1	2030/12/20	0.68
13	日本	国債証券	第144回利付 国債（5年）	540,000,000	100.41	542,257,200	100.47	542,570,400	0.1	2025/6/20	0.68
14	日本	国債証券	第364回利付 国債（10年）	520,000,000	99.02	514,904,000	98.64	512,964,400	0.1	2031/9/20	0.64
15	日本	国債証券	第100回利付 国債（20年）	450,000,000	112.72	507,258,000	112.03	504,153,000	2.2	2028/3/20	0.63
16	日本	国債証券	第347回利付 国債（10年）	500,000,000	100.31	501,560,000	100.34	501,735,000	0.1	2027/6/20	0.63
17	日本	国債証券	第138回利付 国債（5年）	500,000,000	100.25	501,290,000	100.27	501,360,000	0.1	2023/12/20	0.63
18	日本	国債証券	第437回利付 国債（2年）	500,000,000	100.14	500,745,000	100.15	500,765,000	0.005	2024/6/1	0.63
19	日本	国債証券	第152回利付 国債（20年）	455,000,000	110.61	503,284,600	108.62	494,261,950	1.2	2035/3/20	0.62
20	日本	国債証券	第344回利付 国債（10年）	490,000,000	100.37	491,857,100	100.48	492,376,500	0.1	2026/9/20	0.62
21	日本	国債証券	第151回利付 国債（20年）	450,000,000	110.62	497,794,500	108.66	488,983,500	1.2	2034/12/20	0.61
22	日本	国債証券	第355回利付 国債（10年）	480,000,000	99.88	479,439,200	99.55	477,849,600	0.1	2029/6/20	0.60
23	日本	国債証券	第150回利付 国債（20年）	430,000,000	113.01	485,981,700	111.06	477,596,700	1.4	2034/9/20	0.60
24	日本	国債証券	第348回利付 国債（10年）	460,000,000	100.30	461,380,000	100.26	461,196,000	0.1	2027/9/20	0.58

25	日本	国債証券	第87回利付 国債(20年)	420,000,000	108.74	456,708,000	108.29	454,855,800	2.2	2026/3/20	0.57
26	日本	国債証券	第346回利付 国債(10年)	450,000,000	100.34	451,561,500	100.42	451,908,000	0.1	2027/3/20	0.57
27	日本	国債証券	第360回利付 国債(10年)	450,000,000	99.45	447,552,000	98.87	444,919,500	0.1	2030/9/20	0.56
28	日本	国債証券	第146回利付 国債(20年)	380,000,000	115.97	440,705,000	114.26	434,218,400	1.7	2033/9/20	0.55
29	日本	国債証券	第141回利付 国債(20年)	380,000,000	115.31	438,212,200	113.92	432,911,200	1.7	2032/12/20	0.54
30	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	430,000,000	100.41	431,788,800	100.48	432,076,900	0.1	2026/3/20	0.54

□.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	76.80
地方債証券	8.25
特殊債券	7.55
社債券	6.52
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	114,310,364,506	70.28
	カナダ	5,965,483,240	3.66
	ユーロ(ドイツ)	3,565,985,436	2.19
	ユーロ(イタリア)	794,851,498	0.48
	ユーロ(フランス)	4,818,117,100	2.96
	ユーロ(オランダ)	2,472,181,583	1.52
	ユーロ(スペイン)	1,165,727,834	0.71
	ユーロ(ベルギー)	405,391,321	0.24
	ユーロ(オーストリア)	86,033,315	0.05
	ユーロ(ルクセンブルク)	116,996,307	0.07
	ユーロ(フィンランド)	464,525,569	0.28
	ユーロ(アイルランド)	277,309,022	0.17
	ユーロ(ポルトガル)	86,747,971	0.05
	ユーロ(イギリス)	124,269,267	0.07
	ユーロ(マルタ共和国)	0	0
	イギリス	7,481,963,354	4.60
	スイス	4,816,932,629	2.96
	スウェーデン	1,560,519,904	0.95
	ノルウェー	391,569,351	0.24
	デンマーク	1,264,531,246	0.77
	オーストラリア	3,455,942,228	2.12
	ニュージーランド	88,197,445	0.05
	香港	1,456,476,054	0.89
	シンガポール	577,437,185	0.35
イスラエル	240,653,026	0.14	
	小計	155,988,206,391	95.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,645,724,818	4.08
合計(純資産総額)		162,633,931,209	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	4,883,396,999	3.00
	買建	カナダ	245,114,400	0.15
	買建	ドイツ	950,085,198	0.58
	買建	イギリス	288,713,216	0.17
	買建	オーストラリア	201,293,430	0.12

（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場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.上位銘柄明細（30銘柄）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび 機器	399,860	24,297.60	9,715,639,775	19,029.95	7,609,318,366	4.67
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	174,456	42,898.38	7,483,880,619	35,572.33	6,205,807,589	3.81
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	224,480	22,696.34	5,094,875,319	14,887.18	3,341,875,423	2.05
4	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	7,360	388,003.08	2,855,702,695	305,347.22	2,247,355,542	1.38
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	6,965	389,933.00	2,715,883,381	306,864.36	2,137,310,326	1.31
6	アメリカ	株式	TESLA, INC.	自動車・自動車部 品	21,570	148,037.39	3,193,166,688	93,690.03	2,020,894,154	1.24
7	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・ サービス	23,064	71,185.67	1,641,826,468	70,487.24	1,625,717,768	0.99
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	64,307	24,546.36	1,578,502,850	24,190.99	1,555,650,200	0.95
9	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製 造装置	61,100	37,846.69	2,312,432,881	21,242.80	1,297,935,422	0.79
10	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-A	メディア・娯楽	56,600	31,142.53	1,762,667,651	22,407.31	1,268,254,267	0.77
11	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	103,522	11,451.05	1,185,435,640	12,044.24	1,246,843,979	0.76
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	31,650	48,878.13	1,546,992,967	37,380.61	1,183,096,408	0.72
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	58,736	21,102.02	1,239,448,552	19,435.89	1,141,586,787	0.70
14	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	72,218	19,209.00	1,387,236,081	15,759.20	1,138,098,194	0.69
15	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・ サービス	40,640	30,609.48	1,243,969,511	27,267.65	1,108,157,702	0.68
16	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバ コ	68,806	17,267.05	1,188,077,055	16,095.67	1,107,479,358	0.68
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	47,703	22,633.59	1,079,690,257	20,089.22	958,316,367	0.58
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	25,558	42,160.31	1,077,533,275	37,432.55	956,701,154	0.58
19	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	137,156	7,167.49	983,065,520	6,962.47	954,945,797	0.58
20	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・ サービス	21,400	49,510.96	1,059,534,613	44,091.60	943,560,266	0.58
21	アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	43,210	22,381.34	967,098,133	21,067.85	910,342,023	0.55
22	アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	19,838	39,622.16	786,024,513	44,147.63	875,800,882	0.53
23	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバ コ	100,928	8,503.97	858,289,117	8,573.93	865,350,253	0.53
24	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	17,169	53,098.56	911,649,177	45,773.88	785,891,746	0.48
25	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	61,692	11,262.43	694,801,954	12,644.26	780,050,107	0.47

26	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	177,936	5,877.23	1,045,772,576	4,354.62	774,844,518	0.47
27	アメリカ	株式	PEPCICO INC	食品・飲料・タバコ	33,738	22,956.77	774,515,601	22,788.65	768,843,690	0.47
28	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	102,825	7,053.33	725,259,412	6,962.47	715,916,924	0.44
29	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,628	81,345.10	783,190,642	73,249.54	705,246,625	0.43
30	イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	37,845	16,836.13	637,163,567	18,317.58	693,228,944	0.42

□.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	5.07
		素材	4.13
		資本財	5.64
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	2.01
		耐久消費財・アパレル	1.54
		消費者サービス	1.65
		メディア・娯楽	5.58
		小売	4.45
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.29
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	4.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
		銀行	5.63
		各種金融	4.44
		保険	3.11
		不動産	2.72
		ソフトウェア・サービス	10.63
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.04
電気通信サービス	1.64		
公益事業	3.15		
半導体・半導体製造装置	4.09		
合計			95.91

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	35,127,758.38	4,801,262,014	35,728,687.5	4,883,396,999	3.00
	カナダ	モントリオール取引所	S&PTSE60 2209	買建	10	カナダ ドル	2,419,008.09	256,414,858	2,312,400	245,114,400	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SMI 2209	買建	14	スイス フラン	1,519,437.5	217,583,450	1,510,180	216,257,776	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURX50 2209	買建	147	ユーロ	5,129,733.74	731,859,112	5,143,530	733,827,422	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2209	買建	13	オース トラリ アドル	2,116,025	198,694,748	2,143,700	201,293,430	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2209	買建	24	ボンド	1,719,311.25	284,907,066	1,742,280	288,713,216	0.17

（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	23,458,417,068	50.62
	カナダ	946,539,306	2.04
	メキシコ	352,976,179	0.76
	ユーロ(ドイツ)	3,002,032,322	6.47
	ユーロ(イタリア)	3,768,868,592	8.13
	ユーロ(フランス)	4,008,006,054	8.65
	ユーロ(オランダ)	791,033,898	1.70
	ユーロ(スペイン)	2,415,229,755	5.21
	ユーロ(ベルギー)	922,758,887	1.99
	ユーロ(オーストリア)	594,044,466	1.28
	ユーロ(フィンランド)	250,275,139	0.54
	ユーロ(アイルランド)	304,644,393	0.65
	イギリス	2,284,014,403	4.92
	スウェーデン	117,002,168	0.25
	ノルウェー	88,598,292	0.19
	デンマーク	170,813,454	0.36
	ポーランド	187,322,544	0.40
	オーストラリア	689,965,300	1.48
	シンガポール	194,264,585	0.41
	マレーシア	233,904,692	0.50
	イスラエル	172,327,941	0.37
中国	935,093,557	2.01	
	小計	45,888,132,995	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		446,464,375	0.96
合計(純資産総額)		46,334,597,370	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	2.500% US TREASURY N/B	2,190,000	13,696.83	299,960,599	13,520.64	296,102,057	2.5	2024/5/15	0.63
2	アメ リカ	国債 証券	0.125% US TREASURY N/B	2,220,000	13,341.24	296,175,736	13,269.70	294,587,473	0.125	2023/7/15	0.63
3	アメ リカ	国債 証券	0.875% US TREASURY N/B	2,430,000	12,094.04	293,885,278	11,454.42	278,342,520	0.875	2030/11/15	0.60
4	アメ リカ	国債 証券	1.125% US TREASURY N/B	2,210,000	12,334.30	272,588,079	11,657.30	257,626,531	1.125	2031/2/15	0.55
5	アメ リカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,750,000	13,507.82	236,386,992	13,267.57	232,182,481	2.25	2025/11/15	0.50
6	アメ リカ	国債 証券	2.375% US TREASURY N/B	1,720,000	13,637.03	234,556,976	13,462.98	231,563,256	2.375	2024/8/15	0.49
7	アメ リカ	国債 証券	3.125% US TREASURY N/B	1,670,000	14,222.19	237,510,651	13,609.27	227,274,814	3.125	2028/11/15	0.49
8	アメ リカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,700,000	13,465.11	228,906,965	13,282.51	225,802,835	2	2025/2/15	0.48
9	アメ リカ	国債 証券	1.500% US TREASURY N/B	1,760,000	13,087.11	230,333,136	12,781.71	224,958,195	1.5	2026/8/15	0.48
10	アメ リカ	国債 証券	2.750% US TREASURY N/B	1,620,000	13,772.64	223,116,858	13,603.93	220,383,686	2.75	2024/2/15	0.47
11	アメ リカ	国債 証券	1.875% US TREASURY N/B	1,750,000	12,573.34	220,033,507	12,284.64	214,981,352	1.875	2032/2/15	0.46
12	アメ リカ	国債 証券	1.625% US TREASURY N/B	1,650,000	13,170.39	217,311,589	12,901.31	212,871,625	1.625	2026/5/15	0.45
13	アメ リカ	国債 証券	3.125% US TREASURY N/B	1,620,000	15,199.24	246,227,737	13,123.41	212,599,332	3.125	2048/5/15	0.45
14	アメ リカ	国債 証券	0.375% US TREASURY N/B	1,650,000	13,007.02	214,615,897	12,875.68	212,448,771	0.375	2024/9/15	0.45
15	アメ リカ	国債 証券	1.250% US TREASURY N/B	1,810,000	12,389.82	224,255,895	11,677.59	211,364,515	1.25	2031/8/15	0.45
16	アメ リカ	国債 証券	1.625% US TREASURY N/B	1,730,000	12,845.78	222,232,068	12,122.87	209,725,743	1.625	2031/5/15	0.45
17	アメ リカ	国債 証券	1.375% US TREASURY N/B	1,770,000	12,407.26	219,608,602	11,761.95	208,186,598	1.375	2031/11/15	0.44
18	アメ リカ	国債 証券	0.125% US TREASURY N/B	1,550,000	13,184.28	204,356,354	13,103.12	203,098,472	0.125	2023/12/15	0.43
19	アメ リカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,490,000	13,550.54	201,903,055	13,392.50	199,548,314	2	2024/5/31	0.43
20	アメ リカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,520,000	13,360.47	203,079,144	13,008.09	197,722,997	2	2026/11/15	0.42
21	アメ リカ	国債 証券	0.750% US TREASURY N/B	1,580,000	12,743.27	201,343,734	12,503.01	197,547,662	0.75	2026/3/31	0.42
22	アメ リカ	国債 証券	2.000% US TREASURY N/B	1,490,000	13,406.94	199,763,424	13,199.23	196,668,532	2	2025/8/15	0.42
23	アメ リカ	国債 証券	2.375% US TREASURY N/B	1,480,000	13,621.01	201,591,040	13,165.06	194,842,893	2.375	2027/5/15	0.42
24	アメ リカ	国債 証券	2.250% US TREASURY N/B	1,730,000	12,941.88	223,894,654	11,130.87	192,564,181	2.25	2049/8/15	0.41

25	アメリカ	国債証券	0.375% US TREASURY N/B	1,500,000	12,591.64	188,874,675	12,381.28	185,719,290	0.375	2026/1/31	0.40
26	アメリカ	国債証券	2.125% US TREASURY N/B	1,380,000	13,610.33	187,822,666	13,444.82	185,538,616	2.125	2024/3/31	0.40
27	アメリカ	国債証券	1.250% US TREASURY N/B	1,500,000	12,671.73	190,075,965	12,168.79	182,531,869	1.25	2028/9/30	0.39
28	アメリカ	国債証券	2.125% US TREASURY N/B	1,350,000	13,531.32	182,672,820	13,361.53	180,380,761	2.125	2024/11/30	0.38
29	アメリカ	国債証券	0.125% US TREASURY N/B	1,370,000	13,235.72	181,329,478	13,163.99	180,346,697	0.125	2023/10/15	0.38
30	アメリカ	国債証券	0.375% US TREASURY N/B	1,370,000	13,031.07	178,525,676	12,905.58	176,806,471	0.375	2024/8/15	0.38

□.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	99.03
合計	99.03

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】

2022年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
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
19期 (2020年 5月15日)	22,157,711,620	22,157,711,620	2.1213	2.1213
20期 (2021年 5月17日)	27,634,476,168	27,634,476,168	2.7157	2.7157
21期 (2022年 5月16日)	29,416,034,623	29,416,034,623	2.8202	2.8202
2021年 6月末日	28,478,473,501		2.7900	
7月末日	28,500,958,753		2.7818	
8月末日	29,043,886,753		2.8359	
9月末日	29,370,191,732		2.8620	
10月末日	29,963,740,480		2.9126	
11月末日	29,658,731,536		2.8658	
12月末日	30,484,487,380		2.9404	
2022年 1月末日	29,238,646,742		2.8122	
2月末日	29,084,075,352		2.7938	
3月末日	30,568,592,720		2.9389	
4月末日	29,988,967,447		2.8722	
5月末日	29,603,115,539		2.8761	
6月末日	29,728,277,241		2.8340	

【分配の推移】

期	1口当たりの分配金（円）
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	
18期	
19期	
20期	
21期	

【収益率の推移】

期	収益率（％）
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	1.66
20期	28.02
21期	3.85

（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）
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	1,874,137,360	1,996,671,300	10,445,457,532
20期	1,588,252,403	1,858,065,744	10,175,644,191
21期	1,490,771,030	1,236,066,675	10,430,348,546

（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

2022年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
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
19期 (2020年 5月15日)	21,568,431,191	21,568,431,191	1.9238	1.9238
20期 (2021年 5月17日)	24,324,503,291	24,324,503,291	2.2926	2.2926
21期 (2022年 5月16日)	24,720,346,144	24,720,346,144	2.3415	2.3415
2021年 6月末日	24,738,228,111		2.3374	
7月末日	24,732,627,817		2.3347	
8月末日	25,061,804,133		2.3666	
9月末日	25,210,114,730		2.3820	
10月末日	25,530,171,030		2.4095	
11月末日	25,200,043,086		2.3815	
12月末日	25,671,306,402		2.4243	
2022年 1月末日	24,850,259,993		2.3439	
2月末日	24,669,271,615		2.3288	
3月末日	25,558,053,889		2.4133	
4月末日	25,160,877,719		2.3734	
5月末日	24,672,773,115		2.3746	
6月末日	24,677,426,806		2.3459	

分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	
18期	
19期	
20期	
21期	

収益率の推移

期	収益率（％）
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	0.73
20期	19.17
21期	2.13

（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）
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	1,147,563,792	1,416,825,942	11,211,589,502
20期	889,595,823	1,491,239,831	10,609,945,494
21期	777,252,687	829,651,463	10,557,546,718

（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

2022年6月末日及び同日1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次のとおりです。

期	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
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
19期 (2020年 5月15日)	8,526,779,741	8,526,779,741	1.6987	1.6987
20期 (2021年 5月17日)	8,822,900,421	8,822,900,421	1.8816	1.8816
21期 (2022年 5月16日)	8,711,572,471	8,711,572,471	1.8894	1.8894
2021年 6月末日	8,898,859,646		1.9038	
7月末日	8,894,749,774		1.9049	
8月末日	8,974,195,904		1.9199	
9月末日	9,018,502,550		1.9271	
10月末日	9,074,573,612		1.9379	
11月末日	8,978,294,000		1.9239	
12月末日	9,055,176,063		1.9428	
2022年 1月末日	8,830,524,623		1.8993	
2月末日	8,767,786,460		1.8871	
3月末日	8,915,432,299		1.9260	
4月末日	8,842,451,807		1.9061	
5月末日	8,649,370,521		1.9056	
6月末日	8,703,120,140		1.8874	

分配の推移

期	1口当たりの分配金（円）
12期	
13期	
14期	
15期	
16期	
17期	
18期	
19期	
20期	
21期	

収益率の推移

期	収益率（％）
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	0.01
20期	10.77
21期	0.41

（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）
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	806,345,793	863,678,546	5,019,703,148
20期	557,465,780	888,078,611	4,689,090,317
21期	479,576,773	558,002,197	4,610,664,893

（注１）設定口数には、当初自己設定の口数を含みます。

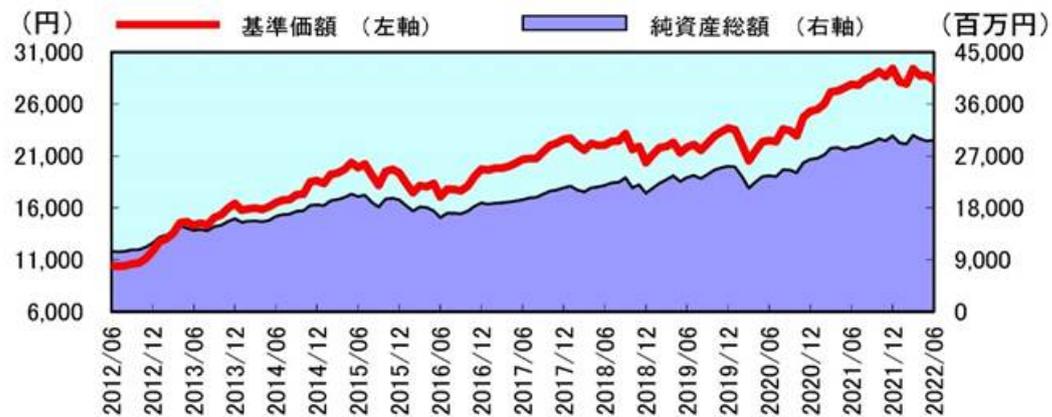
（注２）本邦外における受益証券の発行はありません。

< 参考情報 >

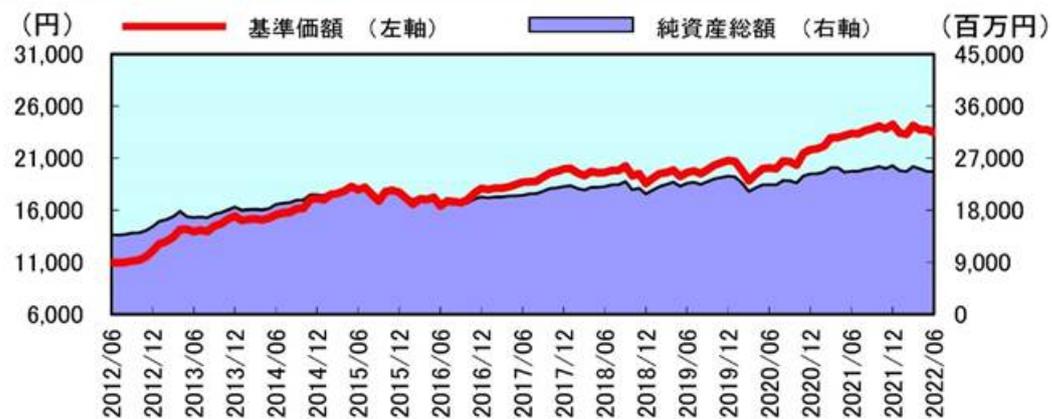
運用実績（2022年6月末現在）

◆ 基準価額・純資産の推移（2012年6月末～2022年6月末）

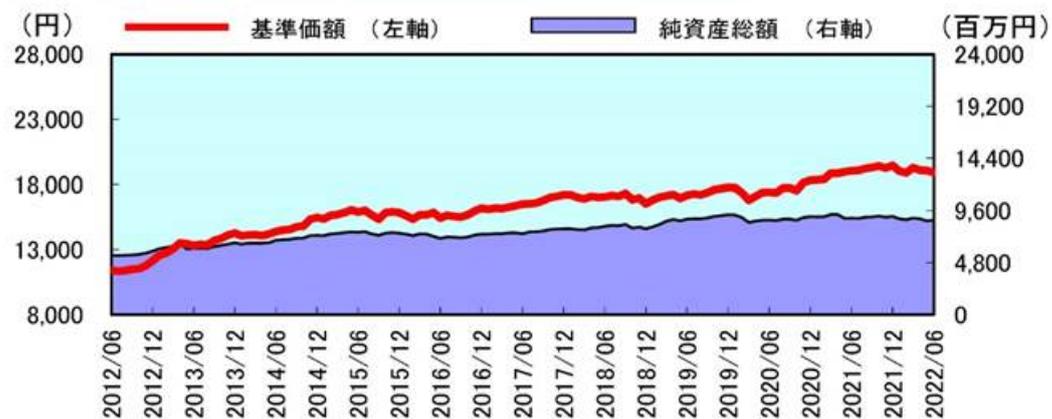
日立バランスファンド(株式70)



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	3.9%
ソニーグループ	電気機器	2.8%
日本電信電話	情報・通信業	1.7%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.7%
キーエンス	電気機器	1.7%
任天堂	その他製品	1.3%
日立製作所	電気機器	1.3%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.3%
KDDI	情報・通信業	1.3%
武田薬品工業	医薬品	1.2%
合計		18.2%

○組入上位10業種

業種	組入比率
電気機器	17.0%
情報・通信業	9.0%
輸送用機器	7.9%
化学	6.2%
卸売業	5.4%
医薬品	5.4%
銀行業	5.3%
機械	5.2%
サービス業	5.1%
小売業	4.2%
合計	70.7%

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	4.7%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.8%
AMAZON COM INC	アメリカ	2.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
TESLA,INC.	アメリカ	1.2%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
NVIDIA CORP	アメリカ	0.8%
META PLATFORMS INC-A	アメリカ	0.8%
合計		18.1%

○組入上位10ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	70.3%
イギリス	4.6%
カナダ	3.7%
フランス	3.0%
スイス	3.0%
ドイツ	2.2%
オーストラリア	2.1%
オランダ	1.5%
スウェーデン	1.0%
香港	0.9%
合計	92.3%

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143回利付国債(5年)	2025/3/20	1.2%
第358回利付国債(10年)	2030/3/20	1.0%
第433回利付国債(2年)	2024/2/1	0.9%
第365回利付国債(10年)	2031/12/20	0.9%
第341回利付国債(10年)	2025/12/20	0.9%
第362回利付国債(10年)	2031/3/20	0.8%
第353回利付国債(10年)	2028/12/20	0.8%
第349回利付国債(10年)	2027/12/20	0.8%
第434回利付国債(2年)	2024/3/1	0.7%
第354回利付国債(10年)	2029/3/20	0.7%
合計		8.7%

○債券種別構成比

債券種別	組入比率
国債証券	76.8%
地方債証券	8.3%
特殊証券	7.6%
社債券	6.5%
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 2.500%	2024/5/15	0.6%
米国債 0.125%	2023/7/15	0.6%
米国債 0.875%	2030/11/15	0.6%
米国債 1.125%	2031/2/15	0.6%
米国債 2.250%	2025/11/15	0.5%
米国債 2.375%	2024/8/15	0.5%
米国債 3.125%	2028/11/15	0.5%
米国債 2.000%	2025/2/15	0.5%
米国債 1.500%	2026/8/15	0.5%
米国債 2.750%	2024/2/15	0.5%
合計		5.4%

○組入上位5ヶ国

国/地域	組入比率
アメリカ	50.6%
フランス	8.7%
イタリア	8.1%
ドイツ	6.5%
スペイン	5.2%
合計	79.1%

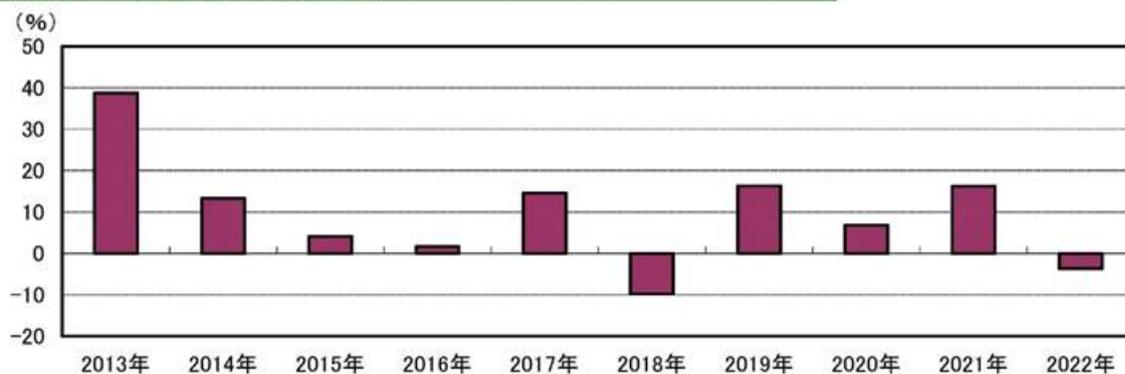
ファンドの運用実績は、あくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

◆ 資産の構成（資産別マザーファンドの保有時価比率を表示しています。）

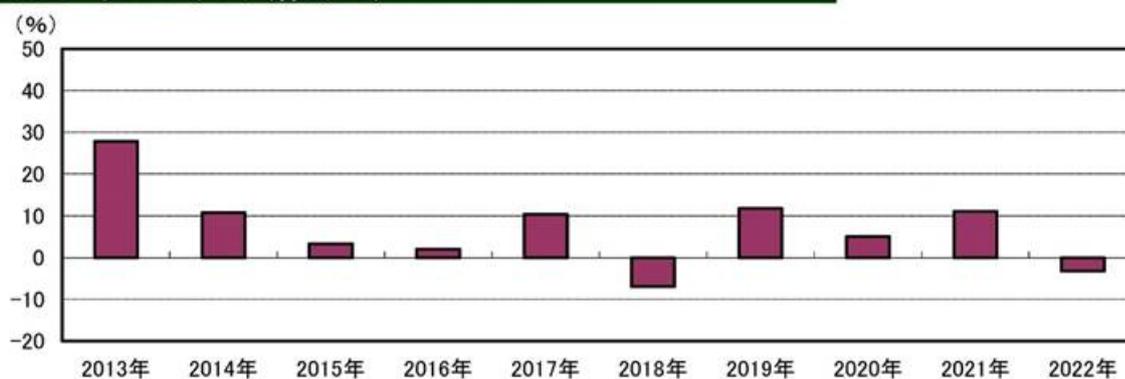
ファンド名	区分	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期資産
日立バランスファンド 株式(70)	基本資産配分	40.0%	30.0%	20.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	39.3%	29.8%	19.8%	10.1%	1.0%
日立バランスファンド 株式(50)	基本資産配分	30.0%	20.0%	40.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	29.5%	19.8%	39.7%	10.0%	1.0%
日立バランスファンド 株式(30)	基本資産配分	20.0%	10.0%	60.0%	10.0%	0.0%
	ファンド実績	19.4%	9.6%	60.0%	10.0%	1.0%

◆ 年間収益率の推移

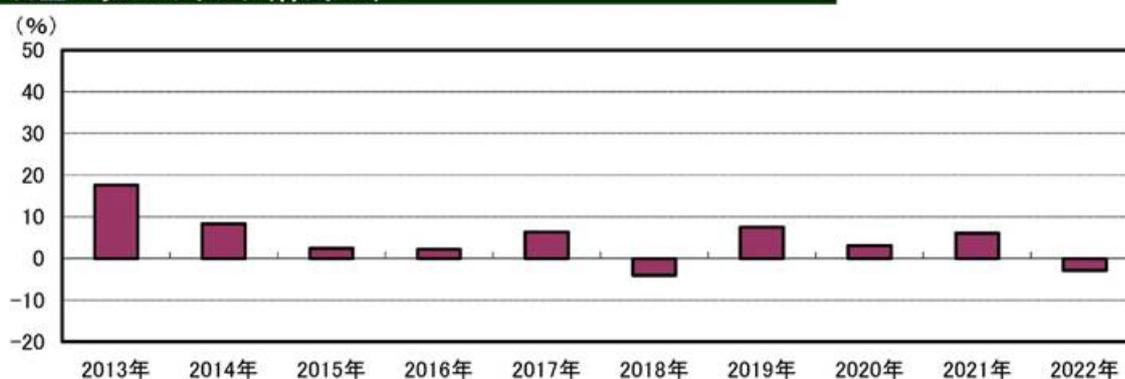
日立バランスファンド(株式70)



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)



※2022年は、1月から6月末までの騰落率を表示しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額は、原則として毎営業日に委託者が計算します。

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

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

基準価額は、販売会社または委託者にお問い合わせ下さい。

<お問い合わせ先（委託者）>

日立投資顧問株式会社 電話（03 - 6284 - 3610（代表））

（受付時間は、営業日の午前9時から午後5時までです。）

（ご参考）確定拠出年金の加入者等による基準価額の入手方法

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

信託契約の解約

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

信託契約に関する監督官庁の命令

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

委託者の登録取消等に伴う取扱い

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

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

受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

投資信託約款の変更

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

委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告によります。

運用報告書

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

その他の契約の変更

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

4【受益者の権利等】

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

(1) 一部解約（換金）請求権

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

(2) 償還金請求権

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

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

(3) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

(4) 反対者の買取請求権

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

（ご参考）確定拠出年金の加入者等の権利

確定拠出年金の加入者等は、当ファンドの受益者ではないため、前記の権利を直接有しておりません。ただし、加入者等は、運営管理機関に対して行う配分の指図（一部解約の指図）を通じて解約でき、また、ファンドの償還金は資産管理機関または連合会に支払われます。なお、これらは各事業主または連合会により定められた確定拠出年金に係る規約等にしがって行われるため、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21期計算期間（2021年5月18日から2022年5月16日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 【財務諸表】

【日立バランスファンド（株式70）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	326,417,590	294,683,769
親投資信託受益証券	27,363,643,403	29,127,046,554
未収入金	-	44,500,000
流動資産合計	27,690,060,993	29,466,230,323
資産合計	27,690,060,993	29,466,230,323
負債の部		
流動負債		
未払解約金	34,476,690	27,537,635
未払受託者報酬	6,030,656	6,473,519
未払委託者報酬	15,076,585	16,183,739
未払利息	894	807
流動負債合計	55,584,825	50,195,700
負債合計	55,584,825	50,195,700
純資産の部		
元本等		
元本	10,175,644,191	10,430,348,546
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,458,831,977	18,985,686,077
元本等合計	27,634,476,168	29,416,034,623
純資産合計	27,634,476,168	29,416,034,623
負債純資産合計	27,690,060,993	29,466,230,323

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自	2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		6,263,756,282		1,088,003,151
営業収益合計		6,263,756,282		1,088,003,151
営業費用				
支払利息		261,729		292,649
受託者報酬		11,396,082		12,906,722
委託者報酬		28,490,091		32,266,678
その他費用		-		2,704
営業費用合計		40,147,902		45,468,753
営業利益又は営業損失（ ）		6,223,608,380		1,042,534,398
経常利益又は経常損失（ ）		6,223,608,380		1,042,534,398
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,223,608,380		1,042,534,398
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（ ）		679,871,582		141,664,129
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,712,254,088		17,458,831,977
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,328,058,703		2,757,320,400
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,328,058,703		2,757,320,400
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,125,217,612		2,131,336,569
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,125,217,612		2,131,336,569
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,458,831,977		18,985,686,077

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年5月16日から翌年5月15日までとなっております。ただし、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、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年5月18日から2022年5月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,175,644,191口	10,430,348,546口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7157円 (27,157円)	2.8202円 (28,202円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第20期計算期間 自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16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2.15 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4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価に関する事項

項目	第21期 2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,587,817,333	931,492,082
合計	5,587,817,333	931,492,082

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期計算期間	第21期計算期間
	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,445,457,532円	10,175,644,191円
期中追加設定元本額	1,588,252,403円	1,490,771,030円
期中一部解約元本額	1,858,065,744円	1,236,066,675円

(4) 【附属明細表】

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	4,256,205,329	5,899,526,206	
		日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	5,553,243,453	11,696,796,685	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	1,181,510,488	2,909,587,727	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	2,148,409,075	8,621,135,936	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	13,139,368,345	29,127,046,554 100.0%	
合計				29,127,046,554	

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

【日立バランスファンド(株式50)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	268,043,841	252,793,638
親投資信託受益証券	24,088,348,520	24,498,464,740
未収入金	3,900,000	5,200,000
流動資産合計	24,360,292,361	24,756,458,378
資産合計	24,360,292,361	24,756,458,378
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,668,007	16,988,582
未払受託者報酬	5,462,968	5,463,720
未払委託者報酬	13,657,361	13,659,240
未払利息	734	692
流動負債合計	35,789,070	36,112,234
負債合計	35,789,070	36,112,234
純資産の部		
元本等		
元本	10,609,945,494	10,557,546,718
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,714,557,797	14,162,799,426
元本等合計	24,324,503,291	24,720,346,144
純資産合計	24,324,503,291	24,720,346,144
負債純資産合計	24,360,292,361	24,756,458,378

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第20期		第21期	
	自	2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自	2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,153,321,158		553,016,220
営業収益合計		4,153,321,158		553,016,220
営業費用				
支払利息		222,190		241,013
受託者報酬		10,528,207		11,017,575
委託者報酬		26,320,367		27,543,825
その他費用		-		2,298
営業費用合計		37,070,764		38,804,711
営業利益又は営業損失()		4,116,250,394		514,211,509
経常利益又は経常損失()		4,116,250,394		514,211,509
当期純利益又は当期純損失()		4,116,250,394		514,211,509
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()		379,096,925		55,718,991
期首剰余金又は期首欠損金()		10,356,841,689		13,714,557,797
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,011,608,909		1,064,332,422
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,011,608,909		1,064,332,422
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,391,046,270		1,074,583,311
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,391,046,270		1,074,583,311
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		13,714,557,797		14,162,799,426

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年5月16日から翌年5月15日までとなっております。ただし、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、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年5月18日から2022年5月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,609,945,494口	10,557,546,718口
1口当たり純資産額	2.2926円	2.3415円
(1万口当たり純資産額)	(22,926円)	(23,415円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第20期計算期間 自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16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2.15 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4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価に関する事項

項目	第21期 2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,497,907,623	444,031,935
合計	3,497,907,623	444,031,935

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期計算期間	第21期計算期間
	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,211,589,502円	10,609,945,494円
期中追加設定元本額	889,595,823円	777,252,687円
期中一部解約元本額	1,491,239,831円	829,651,463円

(4) 【附属明細表】

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	7,193,790,496	9,971,313,006	
		日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	3,480,888,375	7,331,795,184	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	986,377,942	2,429,054,319	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	1,187,774,679	4,766,302,231	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	12,848,831,492	24,498,464,740 100.0%	
合計				24,498,464,740	

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

【日立バランスファンド（株式30）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,113,931	95,877,990
親投資信託受益証券	8,735,866,658	8,633,694,573
未収入金	500,000	5,900,000
流動資産合計	8,835,480,589	8,735,472,563
資産合計	8,835,480,589	8,735,472,563
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,533,992	17,141,202
未払受託者報酬	2,013,132	1,931,053
未払委託者報酬	5,032,773	4,827,575
未払利息	271	262
流動負債合計	12,580,168	23,900,092
負債合計	12,580,168	23,900,092
純資産の部		
元本等		
元本	4,689,090,317	4,610,664,893
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,133,810,104	4,100,907,578
元本等合計	8,822,900,421	8,711,572,471
純資産合計	8,822,900,421	8,711,572,471
負債純資産合計	8,835,480,589	8,735,472,563

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第20期		第21期	
	自	2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自	2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
営業収益				
有価証券売買等損益		923,695,887		52,077,915
営業収益合計		923,695,887		52,077,915
営業費用				
支払利息		89,161		87,864
受託者報酬		3,962,051		3,922,402
委託者報酬		9,904,999		9,805,908
その他費用		-		794
営業費用合計		13,956,211		13,816,968
営業利益又は営業損失()		909,739,676		38,260,947
経常利益又は経常損失()		909,739,676		38,260,947
当期純利益又は当期純損失()		909,739,676		38,260,947
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()		107,740,002		16,510,726
期首剰余金又は期首欠損金()		3,507,076,593		4,133,810,104
剰余金増加額又は欠損金減少額		450,527,836		438,236,410
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		450,527,836		438,236,410
剰余金減少額又は欠損金増加額		625,793,999		492,889,157
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		625,793,999		492,889,157
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,133,810,104		4,100,907,578

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年5月16日から翌年5月15日までとなっております。ただし、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、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年5月18日から2022年5月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,689,090,317口	4,610,664,893口
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8816円 (18,816円)	1.8894円 (18,894円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第20期計算期間 自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16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2.15 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4.1 日立外国債券インデックス マザーファンド 年10,000分の3.6	同左
2.分配金の計算過程	投資信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで投資信託財産内に留保し、期中には分配を行わないため、分配金の計算過程の記載を行っておりません。	同左

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	第21期計算期間 自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価に関する事項

項目	第21期 2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	第20期 2021年 5月17日現在	第21期 2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	739,347,328	17,639,529
合計	739,347,328	17,639,529

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期計算期間	第21期計算期間
	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,019,703,148円	4,689,090,317円
期中追加設定元本額	557,465,780円	479,576,773円
期中一部解約元本額	888,078,611円	558,002,197円

(4) 【附属明細表】

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	日立国内債券 インデックスマザーファンド	3,785,862,328	5,247,583,772	
		日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	809,695,216	1,705,461,033	
		日立外国債券 インデックスマザーファンド	345,216,309	850,129,682	
		日立外国株式 インデックスマザーファンド	206,967,725	830,520,086	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	5,147,741,578	8,633,694,573 100.0%	
合計				8,633,694,573	

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

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

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	407,802,562	243,150,002
株式	51,179,708,050	53,365,087,440
派生商品評価勘定	-	4,734,060
未収入金	-	29,352,319
未収配当金	521,837,084	673,417,781
前払金	27,140,700	35,886,800
差入委託証拠金	38,775,000	47,250,000
流動資産合計	52,175,263,396	54,398,878,402
資産合計	52,175,263,396	54,398,878,402
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,513,965	42,145,610
未払金	115,714,327	18,610,300
未払利息	1,117	666
流動負債合計	145,229,409	60,756,576
負債合計	145,229,409	60,756,576
純資産の部		
元本等		
元本	25,083,862,970	25,798,453,032
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,946,171,017	28,539,668,794
元本等合計	52,030,033,987	54,338,121,826
純資産合計	52,030,033,987	54,338,121,826
負債純資産合計	52,175,263,396	54,398,878,402

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	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,083,862,970口	25,798,453,032口
1口当たり純資産額	2.0742円	2.1063円
(1万口当たり純資産額)	(20,742円)	(21,063円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価に関する事項

項目	2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,031,934,960	2,314,743,420
合計	2,031,934,960	2,314,743,420

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.取引の内容	投資信託の利用しているデリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券先物取引であります。
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の価額等の変動によるリスクを回避する目的で行いません。
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、有価証券関連では有価証券等の価額変動リスクを回避する目的で利用しております。
4.取引に係るリスクの内容	有価証券先物取引は株式等の相場変動によるリスクを有しております。なお、取引の相手方の契約不履行によるリスクは極めて低いものであると認識しております。
5.取引に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、投資信託運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2021年 5月17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	911,210,700	-	881,720,000	29,490,700
	東証株価指数先物	911,210,700	-	881,720,000	29,490,700
合計		911,210,700	-	881,720,000	29,490,700

(2022年 5月16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	966,886,800	-	929,500,000	37,386,800
	東証株価指数先物	966,886,800	-	929,500,000	37,386,800
合計		966,886,800	-	929,500,000	37,386,800

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	29,429,674,196円	25,083,862,970円
期中追加設定元本額	1,242,206,072円	2,420,480,186円
期中一部解約元本額	5,588,017,298円	1,705,890,124円
期末元本額	25,083,862,970円	25,798,453,032円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	5,240,503,345円	5,553,243,453円
日立バランスファンド（株式50）	3,446,301,875円	3,480,888,375円
日立バランスファンド（株式30）	828,052,419円	809,695,216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）	4,935,931,256円	5,182,864,231円
日立国内株式インデックスファンド	10,633,074,075円	10,771,761,757円

（注）*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	極洋	1,000	3,190.00	3,190,000	
	日本水産	28,400	537.00	15,250,800	
	マルハニチロ	4,300	2,444.00	10,509,200	
	雪国まいたけ	2,100	931.00	1,955,100	
	カネコ種苗	800	1,829.00	1,463,200	
	サカタのタネ	3,400	4,340.00	14,756,000	
	ホクト	2,400	1,935.00	4,644,000	
	ホクリヨウ	400	640.00	256,000	
	住石ホールディングス	5,100	180.00	918,000	
	日鉄鉱業	600	5,490.00	3,294,000	
	三井松島ホールディングス	1,200	2,345.00	2,814,000	
	I N P E X	107,400	1,472.00	158,092,800	
	石油資源開発	3,400	2,514.00	8,547,600	
	K & O エナジーグループ	1,300	1,578.00	2,051,400	
	ショーボンドホールディングス	3,900	5,510.00	21,489,000	
	ミライト・ホールディングス	9,400	1,670.00	15,698,000	
	タマホーム	1,800	2,588.00	4,658,400	
	サンヨーホームズ	300	721.00	216,300	
	日本アクア	1,200	566.00	679,200	
	ファーストコーポレーション	700	775.00	542,500	
	ベストセラ	600	1,190.00	714,000	
	Robot Home	4,800	200.00	960,000	
	キャンディル	500	517.00	258,500	
	ダイセキ環境ソリューション	600	1,011.00	606,600	
	第一カッター興業	700	1,300.00	910,000	
	安藤・間	14,000	805.00	11,270,000	
	東急建設	8,300	595.00	4,938,500	
コムシスホールディングス	9,400	2,465.00	23,171,000		
ビーアールホールディングス	3,900	304.00	1,185,600		
高松コンストラクショングループ	1,700	2,024.00	3,440,800		
東建コーポレーション	800	8,420.00	6,736,000		
ソネック	300	1,003.00	300,900		

ヤマウラ	1,400	926.00	1,296,400	
オリエンタル白石	9,800	230.00	2,254,000	
大成建設	17,800	3,905.00	69,509,000	
大林組	65,500	918.00	60,129,000	
清水建設	61,100	705.00	43,075,500	
飛島建設	1,800	1,005.00	1,809,000	
長谷工コーポレーション	19,300	1,516.00	29,258,800	
松井建設	2,500	679.00	1,697,500	
銭高組	300	3,700.00	1,110,000	
鹿島建設	48,000	1,374.00	65,952,000	
不動テトラ	1,400	1,578.00	2,209,200	
大末建設	700	1,549.00	1,084,300	
鉄建建設	1,400	1,790.00	2,506,000	
西松建設	4,100	3,990.00	16,359,000	
三井住友建設	15,100	432.00	6,523,200	
大豊建設	1,000	4,395.00	4,395,000	
佐田建設	1,400	453.00	634,200	
ナカノフドー建設	1,600	310.00	496,000	
奥村組	3,800	2,891.00	10,985,800	
東鉄工業	3,000	2,099.00	6,297,000	
イチケン	500	1,859.00	929,500	
富士ピー・エス	900	481.00	432,900	
浅沼組	800	5,260.00	4,208,000	
戸田建設	27,100	701.00	18,997,100	
熊谷組	3,300	2,680.00	8,844,000	
北野建設	400	2,074.00	829,600	
植木組	600	1,395.00	837,000	
矢作建設工業	2,900	807.00	2,340,300	
ピーエス三菱	2,200	561.00	1,234,200	
日本ハウスホールディングス	4,600	412.00	1,895,200	
大東建託	6,900	11,220.00	77,418,000	
新日本建設	2,900	692.00	2,006,800	
東亜道路工業	300	5,050.00	1,515,000	
日本道路	600	6,610.00	3,966,000	
東亜建設工業	1,600	2,531.00	4,049,600	
日本国土開発	6,100	528.00	3,220,800	
若築建設	1,100	1,860.00	2,046,000	
東洋建設	7,500	825.00	6,187,500	
五洋建設	26,000	631.00	16,406,000	

世紀東急工業	3,200	771.00	2,467,200	
福田組	700	4,580.00	3,206,000	
住友林業	16,300	1,844.00	30,057,200	
日本基礎技術	1,800	679.00	1,222,200	
巴コーポレーション	2,800	449.00	1,257,200	
大和ハウス工業	59,000	3,097.00	182,723,000	
ライト工業	3,900	1,727.00	6,735,300	
積水ハウス	69,700	2,230.00	155,431,000	
日特建設	1,400	736.00	1,030,400	
北陸電気工事	1,300	757.00	984,100	
ユアテック	3,800	660.00	2,508,000	
日本リーテック	1,400	1,059.00	1,482,600	
四電工	700	1,712.00	1,198,400	
中電工	3,000	2,064.00	6,192,000	
関電工	10,900	809.00	8,818,100	
きんでん	14,500	1,470.00	21,315,000	
東京エネシス	2,100	931.00	1,955,100	
トーエネック	700	3,085.00	2,159,500	
住友電設	1,700	2,209.00	3,755,300	
日本電設工業	3,400	1,583.00	5,382,200	
エクシオグループ	9,800	2,085.00	20,433,000	
新日本空調	1,700	1,709.00	2,905,300	
九電工	4,900	2,760.00	13,524,000	
三機工業	4,400	1,496.00	6,582,400	
日揮ホールディングス	20,100	1,793.00	36,039,300	
中外炉工業	700	1,505.00	1,053,500	
ヤマト	1,800	735.00	1,323,000	
太平電業	1,400	2,627.00	3,677,800	
高砂熱学工業	5,800	1,597.00	9,262,600	
三晃金属工業	300	2,679.00	803,700	
朝日工業社	900	1,561.00	1,404,900	
明星工業	3,900	674.00	2,628,600	
大気社	3,100	3,040.00	9,424,000	
ダイダン	1,400	1,967.00	2,753,800	
日比谷総合設備	2,000	1,809.00	3,618,000	
フィル・カンパニー	400	1,182.00	472,800	
テスホールディングス	1,900	1,511.00	2,870,900	
インフロニア・ホールディングス	27,300	963.00	26,289,900	
レイズネクスト	3,100	1,088.00	3,372,800	

ニッポン	5,900	1,618.00	9,546,200
日清製粉グループ本社	22,900	1,588.00	36,365,200
日東富士製粉	300	4,040.00	1,212,000
昭和産業	1,900	2,514.00	4,776,600
鳥越製粉	1,800	653.00	1,175,400
中部飼料	2,400	1,020.00	2,448,000
フィード・ワン	2,700	660.00	1,782,000
東洋精糖	400	970.00	388,000
日本甜菜製糖	1,100	1,625.00	1,787,500
DM三井製糖ホールディングス	1,900	1,882.00	3,575,800
塩水港精糖	2,600	208.00	540,800
日新製糖	1,000	1,707.00	1,707,000
森永製菓	4,800	3,805.00	18,264,000
中村屋	500	3,160.00	1,580,000
江崎グリコ	5,600	3,770.00	21,112,000
名糖産業	900	1,611.00	1,449,900
井村屋グループ	1,200	2,308.00	2,769,600
不二家	1,200	2,416.00	2,899,200
山崎製パン	15,100	1,631.00	24,628,100
第一屋製パン	400	518.00	207,200
モロゾフ	700	3,125.00	2,187,500
亀田製菓	1,200	4,215.00	5,058,000
寿スピリッツ	2,000	6,820.00	13,640,000
カルビー	9,800	2,516.00	24,656,800
森永乳業	3,900	4,290.00	16,731,000
六甲バター	1,500	1,496.00	2,244,000
ヤクルト本社	15,100	6,970.00	105,247,000
明治ホールディングス	13,100	6,610.00	86,591,000
雪印メグミルク	5,000	1,778.00	8,890,000
プリマハム	2,700	2,181.00	5,888,700
日本ハム	8,000	4,040.00	32,320,000
林兼産業	700	484.00	338,800
丸大食品	2,100	1,478.00	3,103,800
S Foods	1,900	2,941.00	5,587,900
柿安本店	700	2,445.00	1,711,500
伊藤ハム米久ホールディングス	13,800	660.00	9,108,000
サッポロホールディングス	7,000	2,756.00	19,292,000
アサヒグループホールディングス	48,300	4,686.00	226,333,800
キリンホールディングス	78,900	1,966.50	155,156,850

宝ホールディングス	13,700	1,012.00	13,864,400	
オエノンホールディングス	6,000	300.00	1,800,000	
養命酒製造	600	1,735.00	1,041,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホール デ	14,600	1,577.00	23,024,200	
サントリー食品インターナショナル	14,400	5,120.00	73,728,000	
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,010.00	5,511,000	
伊藤園	6,500	5,760.00	37,440,000	
キーコーヒー	2,100	2,025.00	4,252,500	
ユニカフェ	600	919.00	551,400	
ジャパンフーズ	300	1,126.00	337,800	
日清オイリオグループ	2,600	3,105.00	8,073,000	
不二製油グループ本社	4,700	1,855.00	8,718,500	
かどや製油	200	3,540.00	708,000	
J - オイルミルズ	2,000	1,584.00	3,168,000	
キッコーマン	14,600	7,270.00	106,142,000	
味の素	45,200	3,150.00	142,380,000	
ブルドックソース	900	1,875.00	1,687,500	
キューピー	10,600	2,223.00	23,563,800	
ハウス食品グループ本社	7,600	2,846.00	21,629,600	
カゴメ	8,100	3,235.00	26,203,500	
焼津水産化学工業	1,000	963.00	963,000	
アリアケジャパン	2,000	5,020.00	10,040,000	
ピエトロ	300	1,766.00	529,800	
エバラ食品工業	500	2,814.00	1,407,000	
やまみ	200	1,587.00	317,400	
ニチレイ	9,200	2,385.00	21,942,000	
東洋水産	10,100	4,530.00	45,753,000	
イトアンドホールディングス	800	2,225.00	1,780,000	
大冷	200	1,905.00	381,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,100	530.00	583,000	
日清食品ホールディングス	7,800	8,400.00	65,520,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,972.00	1,972,000	
一正蒲鉾	900	821.00	738,900	
フジッコ	2,000	1,928.00	3,856,000	
ロック・フィールド	2,300	1,395.00	3,208,500	
日本たばこ産業	115,100	2,284.50	262,945,950	
ケンコーマヨネーズ	1,200	1,381.00	1,657,200	
わらべや日洋ホールディングス	1,400	1,681.00	2,353,400	

なとり	1,200	1,980.00	2,376,000	
イフジ産業	400	993.00	397,200	
ピックルスコーポレーション	1,000	1,248.00	1,248,000	
ファーマフーズ	2,700	1,692.00	4,568,400	
ユーグレナ	11,000	898.00	9,878,000	
紀文食品	1,700	1,039.00	1,766,300	
ミヨシ油脂	800	1,118.00	894,400	
理研ビタミン	2,100	1,673.00	3,513,300	
片倉工業	2,200	2,185.00	4,807,000	
グンゼ	1,300	3,685.00	4,790,500	
東洋紡	8,300	1,057.00	8,773,100	
ユニチカ	5,800	266.00	1,542,800	
富士紡ホールディングス	900	3,190.00	2,871,000	
倉敷紡績	1,700	1,844.00	3,134,800	
シキボウ	1,100	875.00	962,500	
日本毛織	5,900	946.00	5,581,400	
ダイトウボウ	3,400	91.00	309,400	
トーア紡コーポレーション	800	380.00	304,000	
ダイドーリミテッド	2,800	137.00	383,600	
帝国繊維	2,300	1,440.00	3,312,000	
帝人	19,300	1,330.00	25,669,000	
東レ	144,500	634.60	91,699,700	
住江織物	400	1,922.00	768,800	
日本フェルト	1,200	424.00	508,800	
イチカワ	300	1,384.00	415,200	
日東製網	200	1,342.00	268,400	
アツギ	1,600	522.00	835,200	
ダイニック	800	705.00	564,000	
セーレン	4,100	2,070.00	8,487,000	
ソトー	800	835.00	668,000	
東海染工	200	1,139.00	227,800	
小松マテーレ	3,300	1,447.00	4,775,100	
ワコールホールディングス	4,900	1,960.00	9,604,000	
ホギメディカル	2,700	3,130.00	8,451,000	
クラウドシアホールディングス	500	234.00	117,000	
T S Iホールディングス	6,800	322.00	2,189,600	
マツオカコーポレーション	600	1,045.00	627,000	
ワールド	2,700	1,375.00	3,712,500	
三陽商会	1,000	859.00	859,000	

ナイガイ	700	294.00	205,800	
オンワードホールディングス	12,200	246.00	3,001,200	
ルックホールディングス	700	1,620.00	1,134,000	
ゴールドウイン	3,700	6,930.00	25,641,000	
デサント	3,900	2,526.00	9,851,400	
キング	1,000	529.00	529,000	
ヤマトインターナショナル	1,700	286.00	486,200	
特種東海製紙	1,200	3,245.00	3,894,000	
王子ホールディングス	85,300	557.00	47,512,100	
日本製紙	9,500	972.00	9,234,000	
三菱製紙	2,900	296.00	858,400	
北越コーポレーション	13,300	600.00	7,980,000	
中越パルプ工業	800	923.00	738,400	
巴川製紙所	600	675.00	405,000	
大王製紙	9,700	1,397.00	13,550,900	
阿波製紙	500	323.00	161,500	
レンゴー	18,600	740.00	13,764,000	
トーモク	1,200	1,498.00	1,797,600	
ザ・バック	1,500	2,201.00	3,301,500	
北の達人コーポレーション	7,500	183.00	1,372,500	
クラレ	29,900	1,091.00	32,620,900	
旭化成	135,800	1,028.00	139,602,400	
共和レザー	1,200	582.00	698,400	
昭和電工	18,300	2,340.00	42,822,000	
住友化学	150,300	520.00	78,156,000	
住友精化	900	2,936.00	2,642,400	
日産化学	10,800	7,420.00	80,136,000	
ラサ工業	700	1,739.00	1,217,300	
クレハ	1,600	9,420.00	15,072,000	
多木化学	800	4,625.00	3,700,000	
テイカ	1,400	1,188.00	1,663,200	
石原産業	3,600	1,035.00	3,726,000	
片倉コープアグリ	500	1,300.00	650,000	
日本曹達	2,600	3,765.00	9,789,000	
東ソー	28,800	1,892.00	54,489,600	
トクヤマ	6,500	1,730.00	11,245,000	
セントラル硝子	3,300	2,594.00	8,560,200	
東亜合成	11,100	1,010.00	11,211,000	
大阪ソーダ	1,800	3,065.00	5,517,000	

関東電化工業	4,300	978.00	4,205,400
デンカ	7,400	3,270.00	24,198,000
信越化学工業	35,100	17,965.00	630,571,500
日本カーバイド工業	700	1,391.00	973,700
堺化学工業	1,400	1,839.00	2,574,600
第一稀元素化学工業	1,900	1,030.00	1,957,000
エア・ウォーター	18,800	1,775.00	33,370,000
日本酸素ホールディングス	19,200	2,402.00	46,118,400
日本化学工業	600	2,048.00	1,228,800
東邦アセチレン	400	1,126.00	450,400
日本パーカライズン	10,000	892.00	8,920,000
高压ガス工業	3,200	634.00	2,028,800
チタン工業	200	1,712.00	342,400
四国化成工業	2,600	1,228.00	3,192,800
戸田工業	400	2,343.00	937,200
ステラ ケミファ	1,100	2,344.00	2,578,400
保土谷化学工業	600	3,655.00	2,193,000
日本触媒	3,300	5,110.00	16,863,000
大日精化工業	1,600	1,852.00	2,963,200
カネカ	5,100	3,330.00	16,983,000
三菱瓦斯化学	18,500	1,984.00	36,704,000
三井化学	18,100	3,055.00	55,295,500
J S R	19,500	3,665.00	71,467,500
東京応化工業	3,300	7,250.00	23,925,000
大阪有機化学工業	1,700	2,672.00	4,542,400
三菱ケミカルホールディングス	136,700	742.20	101,458,740
K H ネオケム	3,400	2,538.00	8,629,200
ダイセル	29,500	823.00	24,278,500
住友ベークライト	3,200	4,350.00	13,920,000
積水化学工業	42,800	1,673.00	71,604,400
日本ゼオン	17,800	1,381.00	24,581,800
アイカ工業	5,500	3,005.00	16,527,500
U B E	9,900	1,941.00	19,215,900
積水樹脂	3,100	1,689.00	5,235,900
タキロンシーアイ	4,500	528.00	2,376,000
旭有機材	1,200	1,940.00	2,328,000
ニチバン	1,200	1,645.00	1,974,000
リケンテクノス	4,800	420.00	2,016,000
大倉工業	1,000	1,692.00	1,692,000

積水化成成品工業	2,700	411.00	1,109,700	
群栄化学工業	500	2,620.00	1,310,000	
タイガースポリマー	1,100	429.00	471,900	
ミライアル	700	1,649.00	1,154,300	
ダイキアクシス	800	727.00	581,600	
ダイキョーニシカワ	4,400	493.00	2,169,200	
竹本容器	700	799.00	559,300	
森六ホールディングス	1,100	1,791.00	1,970,100	
恵和	600	5,080.00	3,048,000	
日本化薬	15,500	1,057.00	16,383,500	
カーリットホールディングス	2,000	622.00	1,244,000	
日本精化	1,600	1,896.00	3,033,600	
扶桑化学工業	1,800	3,795.00	6,831,000	
トリケミカル研究所	2,200	2,367.00	5,207,400	
A D E K A	9,200	2,396.00	22,043,200	
日油	6,800	4,655.00	31,654,000	
新日本理化	3,300	243.00	801,900	
ハリマ化成グループ	1,500	765.00	1,147,500	
花王	46,300	5,019.00	232,379,700	
第一工業製薬	800	2,458.00	1,966,400	
石原ケミカル	1,000	1,226.00	1,226,000	
日華化学	700	815.00	570,500	
ニイタカ	400	2,362.00	944,800	
三洋化成工業	1,300	4,635.00	6,025,500	
有機合成薬品工業	1,500	282.00	423,000	
大日本塗料	2,500	761.00	1,902,500	
日本ペイントホールディングス	78,700	970.00	76,339,000	
関西ペイント	20,500	1,521.00	31,180,500	
神東塗料	1,600	155.00	248,000	
中国塗料	4,800	884.00	4,243,200	
日本特殊塗料	1,500	891.00	1,336,500	
藤倉化成	2,600	456.00	1,185,600	
太陽ホールディングス	3,100	3,100.00	9,610,000	
D I C	8,400	2,448.00	20,563,200	
サカタインクス	4,200	956.00	4,015,200	
東洋インキ S C ホールディングス	4,300	1,940.00	8,342,000	
T & K T O K A	1,700	804.00	1,366,800	
富士フイルムホールディングス	37,600	7,078.00	266,132,800	
資生堂	39,800	5,360.00	213,328,000	

ライオン	24,000	1,368.00	32,832,000
高砂香料工業	1,400	2,547.00	3,565,800
マンダム	4,400	1,377.00	6,058,800
ミルボン	2,600	5,170.00	13,442,000
ファンケル	8,700	2,332.00	20,288,400
コーセー	4,000	11,420.00	45,680,000
コタ	1,500	1,388.00	2,082,000
シーボン	300	1,708.00	512,400
ポーラ・オルビスホールディングス	9,100	1,498.00	13,631,800
ノエビアホールディングス	1,700	5,240.00	8,908,000
アジュバンホールディングス	500	962.00	481,000
新日本製薬	700	1,302.00	911,400
エステー	1,400	1,447.00	2,025,800
アグロ カネショウ	700	1,189.00	832,300
コニシ	3,400	1,495.00	5,083,000
長谷川香料	3,700	2,403.00	8,891,100
星光PMC	1,200	555.00	666,000
小林製薬	6,000	8,980.00	53,880,000
荒川化学工業	1,700	984.00	1,672,800
メック	1,600	2,596.00	4,153,600
日本高純度化学	600	2,299.00	1,379,400
タカラバイオ	5,600	1,945.00	10,892,000
JCU	2,300	3,515.00	8,084,500
新田ゼラチン	1,300	610.00	793,000
OATアグリオ	900	1,544.00	1,389,600
デクセリアルズ	5,600	3,715.00	20,804,000
アース製薬	1,800	5,270.00	9,486,000
北興化学工業	1,900	954.00	1,812,600
大成ラミック	600	2,621.00	1,572,600
クミアイ化学工業	8,000	904.00	7,232,000
日本農薬	3,800	627.00	2,382,600
アキレス	1,400	1,330.00	1,862,000
有沢製作所	3,100	1,011.00	3,134,100
日東電工	12,900	8,950.00	115,455,000
レック	2,700	794.00	2,143,800
三光合成	2,400	340.00	816,000
きもと	3,300	223.00	735,900
藤森工業	1,800	3,505.00	6,309,000
前澤化成工業	1,300	1,253.00	1,628,900

未来工業	800	1,469.00	1,175,200
ウェーブロックホールディングス	800	670.00	536,000
J S P	1,300	1,375.00	1,787,500
エフピコ	3,900	2,624.00	10,233,600
天馬	1,700	2,160.00	3,672,000
信越ポリマー	3,800	1,026.00	3,898,800
東リ	5,200	207.00	1,076,400
ニフコ	7,100	2,764.00	19,624,400
バルカー	1,700	2,700.00	4,590,000
ユニ・チャーム	41,200	4,404.00	181,444,800
ショーエイコーポレーション	600	588.00	352,800
協和キリン	23,900	2,766.00	66,107,400
武田薬品工業	168,100	3,661.00	615,414,100
アステラス製薬	182,900	1,956.00	357,752,400
住友ファーマ	13,200	1,112.00	14,678,400
塩野義製薬	26,200	6,847.00	179,391,400
わかもと製薬	2,400	266.00	638,400
日本新薬	5,300	7,130.00	37,789,000
中外製薬	66,900	3,566.00	238,565,400
科研製薬	3,300	3,735.00	12,325,500
エーザイ	24,900	5,582.00	138,991,800
ロート製薬	10,700	3,515.00	37,610,500
小野薬品工業	46,800	3,349.00	156,733,200
久光製薬	5,300	3,460.00	18,338,000
持田製薬	2,600	3,160.00	8,216,000
参天製薬	39,000	1,000.00	39,000,000
扶桑薬品工業	700	2,105.00	1,473,500
日本ケミファ	200	1,913.00	382,600
ツムラ	6,500	3,025.00	19,662,500
キッセイ薬品工業	3,600	2,518.00	9,064,800
生化学工業	3,800	790.00	3,002,000
栄研化学	3,600	1,582.00	5,695,200
日水製薬	800	947.00	757,600
鳥居薬品	1,100	2,952.00	3,247,200
J C R ファーマ	6,000	2,223.00	13,338,000
東和薬品	3,100	2,466.00	7,644,600
富士製薬工業	1,300	937.00	1,218,100
ゼリア新薬工業	3,600	1,997.00	7,189,200
第一三共	163,800	3,341.00	547,255,800

キョーリン製薬ホールディングス	4,100	1,689.00	6,924,900	
大幸薬品	3,200	596.00	1,907,200	
ダイト	1,400	2,573.00	3,602,200	
大塚ホールディングス	43,200	4,422.00	191,030,400	
大正製薬ホールディングス	4,700	4,755.00	22,348,500	
ペプチドリーム	11,200	1,775.00	19,880,000	
あすか製薬ホールディングス	2,300	987.00	2,270,100	
サワイグループホールディングス	4,500	3,810.00	17,145,000	
日本コークス工業	18,100	126.00	2,280,600	
ニチレキ	2,600	1,225.00	3,185,000	
ユシロ化学工業	1,100	1,000.00	1,100,000	
ピーピー・カストロール	800	1,212.00	969,600	
富士石油	5,400	315.00	1,701,000	
MORESCO	700	1,172.00	820,400	
出光興産	23,100	3,415.00	78,886,500	
ENEOSホールディングス	321,800	497.30	160,031,140	
コスモエネルギーホールディングス	6,900	3,495.00	24,115,500	
横浜ゴム	11,600	1,681.00	19,499,600	
TOYO TIRE	10,900	1,688.00	18,399,200	
ブリヂストン	60,000	4,824.00	289,440,000	
住友ゴム工業	18,600	1,173.00	21,817,800	
藤倉コンポジット	1,700	803.00	1,365,100	
オカモト	1,200	3,620.00	4,344,000	
フコク	900	966.00	869,400	
ニッタ	2,100	2,785.00	5,848,500	
住友理工	4,100	551.00	2,259,100	
三ツ星ベルト	2,600	2,609.00	6,783,400	
バンドー化学	3,400	839.00	2,852,600	
日東紡績	3,000	2,279.00	6,837,000	
A G C	19,100	4,830.00	92,253,000	
日本板硝子	10,100	369.00	3,726,900	
石塚硝子	400	1,745.00	698,000	
日本山村硝子	800	790.00	632,000	
日本電気硝子	8,400	2,682.00	22,528,800	
オハラ	800	1,138.00	910,400	
住友大阪セメント	3,800	3,290.00	12,502,000	
太平洋セメント	12,200	2,012.00	24,546,400	
日本ヒューム	2,000	665.00	1,330,000	
日本コンクリート工業	4,100	294.00	1,205,400	

三谷セキサン	1,000	4,725.00	4,725,000	
アジアパイルホールディングス	3,200	437.00	1,398,400	
東海カーボン	17,400	1,006.00	17,504,400	
日本カーボン	1,100	4,090.00	4,499,000	
東洋炭素	1,300	2,861.00	3,719,300	
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	4,095.00	4,914,000	
TOTO	14,500	4,440.00	64,380,000	
日本碍子	22,500	1,801.00	40,522,500	
日本特殊陶業	15,800	2,337.00	36,924,600	
ダントーホールディングス	1,400	250.00	350,000	
MARUWA	700	15,260.00	10,682,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,535.00	1,767,500	
黒崎播磨	400	4,025.00	1,610,000	
ヨータイ	1,400	1,520.00	2,128,000	
東京窯業	2,500	287.00	717,500	
ニッカトー	900	466.00	419,400	
フジインコーポレーテッド	1,700	5,520.00	9,384,000	
クニミネ工業	700	924.00	646,800	
エーアンドエーマテリアル	400	860.00	344,000	
ニチアス	4,800	2,133.00	10,238,400	
ニチハ	2,900	2,247.00	6,516,300	
日本製鉄	92,600	2,039.00	188,811,400	
神戸製鋼所	38,600	642.00	24,781,200	
中山製鋼所	3,200	410.00	1,312,000	
合同製鐵	1,100	1,211.00	1,332,100	
ジェイ エフ イー ホールディングス	54,400	1,504.00	81,817,600	
東京製鐵	6,900	1,302.00	8,983,800	
共英製鋼	2,300	1,226.00	2,819,800	
大和工業	3,700	3,955.00	14,633,500	
東京鐵鋼	900	1,171.00	1,053,900	
大阪製鐵	1,100	1,235.00	1,358,500	
淀川製鋼所	2,600	2,255.00	5,863,000	
丸一鋼管	6,500	2,768.00	17,992,000	
モリ工業	600	2,410.00	1,446,000	
大同特殊鋼	3,300	3,490.00	11,517,000	
日本高周波鋼業	800	339.00	271,200	
日本冶金工業	1,500	2,070.00	3,105,000	
山陽特殊製鋼	2,100	1,967.00	4,130,700	
愛知製鋼	1,200	1,935.00	2,322,000	

日立金属	22,800	1,994.00	45,463,200
日本金属	500	1,119.00	559,500
大平洋金属	1,300	2,601.00	3,381,300
新日本電工	13,000	330.00	4,290,000
栗本鐵工所	900	1,615.00	1,453,500
虹技	300	961.00	288,300
日本鑄鉄管	200	1,002.00	200,400
三菱製鋼	1,400	953.00	1,334,200
日亜鋼業	2,600	256.00	665,600
日本精線	300	4,085.00	1,225,500
エンビプロ・ホールディングス	1,400	1,042.00	1,458,800
シンニッタン	2,600	213.00	553,800
新家工業	500	1,489.00	744,500
大紀アルミニウム工業所	3,000	1,277.00	3,831,000
日本軽金属ホールディングス	5,400	1,602.00	8,650,800
三井金属鉱業	5,700	3,100.00	17,670,000
東邦亜鉛	1,100	2,370.00	2,607,000
三菱マテリアル	13,400	1,873.00	25,098,200
住友金属鉱山	25,700	4,980.00	127,986,000
DOWAホールディングス	5,500	4,425.00	24,337,500
古河機械金属	3,400	1,226.00	4,168,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	1,317.00	3,160,800
東邦チタニウム	3,800	1,680.00	6,384,000
UACJ	3,100	2,146.00	6,652,600
CKサンエツ	400	4,100.00	1,640,000
古河電気工業	6,400	2,199.00	14,073,600
住友電気工業	77,300	1,394.00	107,756,200
フジクラ	23,600	747.00	17,629,200
昭和電線ホールディングス	1,800	1,651.00	2,971,800
東京特殊電線	300	2,291.00	687,300
タツタ電線	3,700	460.00	1,702,000
カナレ電気	300	1,682.00	504,600
平河ヒューテック	1,200	1,063.00	1,275,600
リョービ	2,500	1,092.00	2,730,000
アーレスティ	2,300	348.00	800,400
アサヒホールディングス	8,500	2,058.00	17,493,000
稲葉製作所	1,200	1,269.00	1,522,800
宮地エンジニアリンググループ	600	3,390.00	2,034,000
トーカロ	5,500	1,312.00	7,216,000

アルファＣｏ	800	934.00	747,200
SUMCO	33,300	1,987.00	66,167,100
川田テクノロジーズ	400	3,405.00	1,362,000
RS Technologies	700	6,240.00	4,368,000
ジェイテックコーポレーション	300	1,657.00	497,100
信和	1,300	791.00	1,028,300
東洋製罐グループホールディングス	12,600	1,279.00	16,115,400
ホッカンホールディングス	1,100	1,218.00	1,339,800
コロナ	1,100	823.00	905,300
横河ブリッジホールディングス	3,400	1,885.00	6,409,000
駒井ハルテック	400	1,741.00	696,400
高田機工	200	2,625.00	525,000
三和ホールディングス	19,900	1,265.00	25,173,500
文化シャッター	6,600	934.00	6,164,400
三協立山	2,700	599.00	1,617,300
アルインコ	1,500	844.00	1,266,000
東洋シャッター	500	561.00	280,500
LIXIL	33,300	2,518.00	83,849,400
日本ファイルコン	1,400	510.00	714,000
ノーリツ	3,800	1,474.00	5,601,200
長府製作所	2,200	1,840.00	4,048,000
リンナイ	3,900	8,720.00	34,008,000
ダイニチ工業	1,000	632.00	632,000
日東精工	2,600	491.00	1,276,600
三洋工業	300	1,781.00	534,300
岡部	3,700	637.00	2,356,900
ジーテクト	2,500	1,258.00	3,145,000
東プレ	3,700	1,028.00	3,803,600
高周波熱錬	3,400	578.00	1,965,200
東京製綱	1,300	880.00	1,144,000
サンコール	1,800	600.00	1,080,000
モリテック スチール	1,600	296.00	473,600
パイオラックス	2,900	1,395.00	4,045,500
エイチワン	2,000	565.00	1,130,000
日本発條	18,900	891.00	16,839,900
中央発條	1,000	664.00	664,000
アドバネクス	300	1,730.00	519,000
立川ブラインド工業	900	1,045.00	940,500
三益半導体工業	1,700	2,244.00	3,814,800

日本ドライケミカル	500	1,562.00	781,000	
日本製鋼所	6,100	3,030.00	18,483,000	
三浦工業	8,900	2,829.00	25,178,100	
タクマ	6,800	1,474.00	10,023,200	
ツガミ	4,500	1,169.00	5,260,500	
オークマ	2,300	5,000.00	11,500,000	
芝浦機械	2,400	2,807.00	6,736,800	
アマダ	33,400	1,000.00	33,400,000	
アイダエンジニアリング	5,200	972.00	5,054,400	
滝澤鉄工所	600	1,270.00	762,000	
F U J I	9,300	2,123.00	19,743,900	
牧野フライス製作所	2,300	4,175.00	9,602,500	
オーエスジー	9,700	1,640.00	15,908,000	
ダイジェット工業	200	955.00	191,000	
旭ダイヤモンド工業	5,400	556.00	3,002,400	
D M G 森精機	12,300	1,722.00	21,180,600	
ソディック	4,600	721.00	3,316,600	
ディスコ	3,100	32,350.00	100,285,000	
日東工器	1,100	1,518.00	1,669,800	
日進工具	1,700	1,387.00	2,357,900	
パンチ工業	1,800	447.00	804,600	
富士ダイス	1,100	692.00	761,200	
豊和工業	1,100	739.00	812,900	
O K K	800	1,176.00	940,800	
東洋機械金属	1,400	575.00	805,000	
津田駒工業	400	548.00	219,200	
エンシュウ	500	710.00	355,000	
島精機製作所	3,100	1,893.00	5,868,300	
オプトラン	2,700	1,867.00	5,040,900	
N C ホールディングス	500	1,650.00	825,000	
イワキポンプ	1,300	887.00	1,153,100	
フリーー	1,900	942.00	1,789,800	
ヤマシンフィルタ	4,000	303.00	1,212,000	
日阪製作所	2,500	769.00	1,922,500	
やまびこ	3,900	1,208.00	4,711,200	
野村マイクロ・サイエンス	700	3,905.00	2,733,500	
平田機工	1,000	4,215.00	4,215,000	
ペガサスミシン製造	2,100	561.00	1,178,100	
マルマエ	900	2,060.00	1,854,000	

タツモ	1,000	1,331.00	1,331,000	
ナブテスコ	11,800	3,005.00	35,459,000	
三井海洋開発	2,200	1,175.00	2,585,000	
レオン自動機	2,300	1,226.00	2,819,800	
S M C	6,300	63,380.00	399,294,000	
ホソカワミクロン	1,400	2,385.00	3,339,000	
ユニオンツール	800	3,775.00	3,020,000	
オイレス工業	2,900	1,503.00	4,358,700	
日精エー・エス・ビー機械	700	2,870.00	2,009,000	
サトーホールディングス	2,800	1,836.00	5,140,800	
技研製作所	1,900	3,445.00	6,545,500	
日本エアテック	1,000	1,014.00	1,014,000	
カワタ	700	1,007.00	704,900	
日精樹脂工業	1,400	921.00	1,289,400	
オカダアイヨン	700	1,440.00	1,008,000	
ワイエイシイホールディングス	800	1,785.00	1,428,000	
小松製作所	96,900	3,104.00	300,777,600	
住友重機械工業	12,000	2,939.00	35,268,000	
日立建機	8,600	2,843.00	24,449,800	
日工	2,800	605.00	1,694,000	
巴工業	800	2,340.00	1,872,000	
井関農機	1,900	1,166.00	2,215,400	
T O W A	1,800	1,791.00	3,223,800	
丸山製作所	400	1,532.00	612,800	
北川鉄工所	900	1,335.00	1,201,500	
ローツェ	1,100	10,440.00	11,484,000	
タカキタ	700	563.00	394,100	
クボタ	103,600	2,279.00	236,104,400	
荏原実業	1,000	2,288.00	2,288,000	
三菱化工機	700	1,976.00	1,383,200	
月島機械	3,700	907.00	3,355,900	
帝国電機製作所	1,400	1,591.00	2,227,400	
東京機械製作所	900	801.00	720,900	
新東工業	4,500	663.00	2,983,500	
澁谷工業	1,800	2,302.00	4,143,600	
アイチ コーポレーション	3,000	862.00	2,586,000	
小森コーポレーション	5,300	743.00	3,937,900	
鶴見製作所	1,600	1,791.00	2,865,600	
住友精密工業	300	2,391.00	717,300	

日本ギア工業	800	263.00	210,400
酒井重工業	400	2,996.00	1,198,400
荏原製作所	8,600	5,530.00	47,558,000
石井鐵工所	300	2,924.00	877,200
西島製作所	1,900	1,246.00	2,367,400
北越工業	1,900	826.00	1,569,400
ダイキン工業	26,000	20,710.00	538,460,000
オルガノ	600	8,990.00	5,394,000
トーヨーカネツ	800	2,525.00	2,020,000
栗田工業	11,300	4,875.00	55,087,500
椿本チエイン	2,800	3,010.00	8,428,000
大同工業	900	854.00	768,600
木村化工機	1,700	646.00	1,098,200
アネスト岩田	3,300	840.00	2,772,000
ダイフク	11,200	8,140.00	91,168,000
サムコ	600	2,499.00	1,499,400
加藤製作所	1,000	750.00	750,000
油研工業	300	1,723.00	516,900
タダノ	10,900	911.00	9,929,900
フジテック	7,300	2,500.00	18,250,000
C K D	6,000	1,786.00	10,716,000
キトー	1,800	1,680.00	3,024,000
平和	6,000	1,873.00	11,238,000
理想科学工業	1,700	2,110.00	3,587,000
SANKYO	4,600	4,260.00	19,596,000
日本金銭機械	2,200	646.00	1,421,200
マースグループホールディングス	1,400	1,628.00	2,279,200
フクシマガリレイ	1,400	3,555.00	4,977,000
オーイズミ	700	405.00	283,500
ダイコク電機	1,000	1,143.00	1,143,000
竹内製作所	3,300	2,339.00	7,718,700
アマノ	5,600	2,441.00	13,669,600
JUKI	3,000	700.00	2,100,000
ジャノメ	1,800	681.00	1,225,800
マックス	2,700	1,583.00	4,274,100
グローリー	5,400	1,975.00	10,665,000
新晃工業	2,000	1,478.00	2,956,000
大和冷機工業	3,100	1,044.00	3,236,400
セガサミーホールディングス	21,200	2,336.00	49,523,200

日本ピストンリング	800	1,277.00	1,021,600	
リケン	900	2,287.00	2,058,300	
T P R	2,700	1,212.00	3,272,400	
ツバキ・ナカシマ	4,700	948.00	4,455,600	
ホシザキ	6,300	7,690.00	48,447,000	
大豊工業	1,700	624.00	1,060,800	
日本精工	39,100	726.00	28,386,600	
N T N	43,600	239.00	10,420,400	
ジェイテクト	19,800	954.00	18,889,200	
不二越	1,700	3,645.00	6,196,500	
日本トムソン	5,500	509.00	2,799,500	
T H K	12,100	2,606.00	31,532,600	
ユーシン精機	1,700	664.00	1,128,800	
前澤給装工業	1,500	795.00	1,192,500	
イーグル工業	2,500	948.00	2,370,000	
前澤工業	1,400	626.00	876,400	
日本ピラー工業	2,100	2,699.00	5,667,900	
キッツ	6,800	655.00	4,454,000	
マキタ	25,400	3,740.00	94,996,000	
三井E & Sホールディングス	7,700	342.00	2,633,400	
日立造船	17,700	792.00	14,018,400	
三菱重工業	32,900	4,653.00	153,083,700	
I H I	13,400	3,240.00	43,416,000	
サノヤスホールディングス	2,600	127.00	330,200	
スター精密	3,100	1,563.00	4,845,300	
日清紡ホールディングス	12,300	989.00	12,164,700	
イビデン	10,900	4,730.00	51,557,000	
コニカミノルタ	45,600	430.00	19,608,000	
ブラザー工業	25,500	2,191.00	55,870,500	
ミネベアミツミ	35,900	2,421.00	86,913,900	
日立製作所	102,900	6,429.00	661,544,100	
東芝	37,400	5,426.00	202,932,400	
三菱電機	209,100	1,429.00	298,803,900	
富士電機	12,600	5,670.00	71,442,000	
東洋電機製造	800	926.00	740,800	
安川電機	22,400	4,230.00	94,752,000	
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,309.00	3,141,600	
明電舎	3,400	2,035.00	6,919,000	
オリジン	500	1,246.00	623,000	

山洋電気	900	5,270.00	4,743,000
デンヨー	1,700	1,623.00	2,759,100
PHCホールディングス	3,300	1,590.00	5,247,000
東芝テック	2,300	3,980.00	9,154,000
芝浦メカトロニクス	400	9,040.00	3,616,000
マブチモーター	5,000	3,475.00	17,375,000
日本電産	52,800	8,278.00	437,078,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	395.00	355,500
トレックス・セミコンダクター	1,000	2,657.00	2,657,000
東光高岳	1,200	1,612.00	1,934,400
ダブル・スコープ	6,200	1,036.00	6,423,200
ダイヘン	2,200	3,875.00	8,525,000
ヤーマン	3,500	1,161.00	4,063,500
JVCケンウッド	17,400	191.00	3,323,400
ミマキエンジニアリング	1,900	571.00	1,084,900
I - P E X	1,000	1,298.00	1,298,000
日新電機	5,000	1,438.00	7,190,000
大崎電気工業	3,800	494.00	1,877,200
オムロン	17,800	7,267.00	129,352,600
日東工業	2,700	1,986.00	5,362,200
I D E C	2,600	2,397.00	6,232,200
正興電機製作所	600	1,082.00	649,200
不二電機工業	400	1,134.00	453,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,800	2,104.00	14,307,200
サクサホールディングス	500	1,505.00	752,500
メルコホールディングス	500	3,310.00	1,655,000
テクノメディカ	500	1,529.00	764,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	1,008.00	604,800
日本電気	26,600	5,320.00	141,512,000
富士通	19,200	19,140.00	367,488,000
沖電気工業	8,500	786.00	6,681,000
岩崎通信機	900	836.00	752,400
電気興業	1,100	2,492.00	2,741,200
サンケン電気	1,900	5,500.00	10,450,000
ナカヨ	400	1,074.00	429,600
アイホン	1,100	1,708.00	1,878,800
ルネサスエレクトロニクス	116,200	1,394.00	161,982,800
セイコーエプソン	25,700	1,902.00	48,881,400

ワコム	16,600	1,037.00	17,214,200
アルバック	4,300	5,210.00	22,403,000
アクセル	900	830.00	747,000
E I Z O	1,600	3,385.00	5,416,000
日本信号	5,100	880.00	4,488,000
京三製作所	4,500	432.00	1,944,000
能美防災	2,700	1,738.00	4,692,600
ホーチキ	1,500	1,242.00	1,863,000
星和電機	900	476.00	428,400
エレコム	4,900	1,540.00	7,546,000
パナソニック ホールディングス	228,100	1,131.00	257,981,100
シャープ	23,000	1,056.00	24,288,000
アンリツ	13,800	1,476.00	20,368,800
富士通ゼネラル	5,800	2,257.00	13,090,600
ソニーグループ	134,000	11,180.00	1,498,120,000
T D K	31,000	4,210.00	130,510,000
帝国通信工業	900	1,377.00	1,239,300
タムラ製作所	8,100	532.00	4,309,200
アルプスアルパイン	18,400	1,325.00	24,380,000
池上通信機	600	595.00	357,000
日本電波工業	2,100	1,150.00	2,415,000
鈴木	1,100	764.00	840,400
メイコー	2,300	3,755.00	8,636,500
日本トリム	400	2,335.00	934,000
ローランド ディー・ジー・	1,300	2,876.00	3,738,800
フォスター電機	2,100	712.00	1,495,200
S M K	500	2,174.00	1,087,000
ヨコオ	1,500	2,305.00	3,457,500
ティアック	3,400	112.00	380,800
ホシデン	5,000	1,170.00	5,850,000
ヒロセ電機	3,200	17,340.00	55,488,000
日本航空電子工業	4,700	1,870.00	8,789,000
T O A	2,300	804.00	1,849,200
マクセル	4,100	1,204.00	4,936,400
古野電気	2,500	982.00	2,455,000
ユニデンホールディングス	500	2,982.00	1,491,000
スミダコーポレーション	2,000	812.00	1,624,000
アイコム	800	2,430.00	1,944,000
リオン	800	2,459.00	1,967,200

本多通信工業	1,700	476.00	809,200
横河電機	20,800	2,233.00	46,446,400
新電元工業	800	3,020.00	2,416,000
アズビル	12,500	3,580.00	44,750,000
東亜ディーケーケー	1,100	932.00	1,025,200
日本光電工業	8,600	3,060.00	26,316,000
チノー	700	1,581.00	1,106,700
共和電業	2,000	337.00	674,000
日本電子材料	1,100	1,778.00	1,955,800
堀場製作所	3,900	6,320.00	24,648,000
アドバンテスト	15,900	8,580.00	136,422,000
小野測器	900	468.00	421,200
エスベック	1,700	1,761.00	2,993,700
キーエンス	19,400	51,330.00	995,802,000
日置電機	1,000	7,190.00	7,190,000
シスメックス	17,200	8,447.00	145,288,400
日本マイクロニクス	3,500	1,435.00	5,022,500
メガチップス	1,900	3,495.00	6,640,500
O B A R A G R O U P	900	2,850.00	2,565,000
澤藤電機	300	1,442.00	432,600
原田工業	1,000	899.00	899,000
コーセル	2,400	777.00	1,864,800
イリソ電子工業	1,800	3,240.00	5,832,000
オブテックスグループ	3,500	1,847.00	6,464,500
千代田インテグレ	900	1,930.00	1,737,000
アイ・オー・データ機器	200	1,297.00	259,400
レーザーテック	9,200	17,515.00	161,138,000
スタンレー電気	14,600	2,231.00	32,572,600
岩崎電気	700	2,323.00	1,626,100
ウシオ電機	10,700	1,669.00	17,858,300
岡谷電機産業	1,500	273.00	409,500
ヘリオス テクノ ホールディング	1,800	285.00	513,000
エノモト	600	1,602.00	961,200
日本セラミック	2,000	2,194.00	4,388,000
遠藤照明	1,000	790.00	790,000
古河電池	1,500	1,163.00	1,744,500
双信電機	1,000	560.00	560,000
山一電機	1,500	1,765.00	2,647,500
図研	1,400	2,788.00	3,903,200

日本電子	4,300	6,100.00	26,230,000	
カシオ計算機	14,300	1,194.00	17,074,200	
ファナック	18,800	20,000.00	376,000,000	
日本シイエムケイ	4,000	474.00	1,896,000	
エンプラス	500	3,385.00	1,692,500	
大真空	2,800	1,155.00	3,234,000	
ローム	9,300	9,550.00	88,815,000	
浜松ホトニクス	15,000	5,720.00	85,800,000	
三井ハイテック	2,000	10,890.00	21,780,000	
新光電気工業	6,300	4,965.00	31,279,500	
京セラ	30,100	7,059.00	212,475,900	
太陽誘電	10,100	4,990.00	50,399,000	
村田製作所	61,300	8,233.00	504,682,900	
双葉電子工業	3,700	668.00	2,471,600	
北陸電気工業	800	1,113.00	890,400	
ニチコン	6,400	1,231.00	7,878,400	
日本ケミコン	2,000	1,784.00	3,568,000	
K O A	3,100	1,611.00	4,994,100	
市光工業	2,600	370.00	962,000	
小糸製作所	11,400	4,830.00	55,062,000	
ミツバ	3,700	372.00	1,376,400	
S C R E E Nホールディングス	3,600	11,390.00	41,004,000	
キャノン電子	2,000	1,490.00	2,980,000	
キャノン	106,300	3,160.00	335,908,000	
リコー	56,500	1,009.00	57,008,500	
象印マホービン	5,600	1,365.00	7,644,000	
M U T O Hホールディングス	300	2,012.00	603,600	
東京エレクトロン	13,600	57,020.00	775,472,000	
トヨタ紡織	8,300	2,073.00	17,205,900	
芦森工業	400	1,033.00	413,200	
ユニプレス	3,300	808.00	2,666,400	
豊田自動織機	16,600	8,150.00	135,290,000	
モリタホールディングス	3,400	1,318.00	4,481,200	
三櫻工業	3,000	628.00	1,884,000	
デンソー	45,400	7,388.00	335,415,200	
東海理化電機製作所	5,600	1,366.00	7,649,600	
川崎重工業	15,200	2,367.00	35,978,400	
名村造船所	6,100	348.00	2,122,800	
日本車輛製造	700	2,060.00	1,442,000	

三菱ロジスネクスト	2,800	782.00	2,189,600	
近畿車輛	300	1,185.00	355,500	
日産自動車	252,200	494.70	124,763,340	
いすゞ自動車	65,400	1,517.00	99,211,800	
トヨタ自動車	1,047,400	2,049.50	2,146,646,300	
日野自動車	26,700	667.00	17,808,900	
三菱自動車工業	79,200	368.00	29,145,600	
エフテック	1,400	540.00	756,000	
レシップホールディングス	800	580.00	464,000	
G M B	400	695.00	278,000	
ファルテック	400	603.00	241,200	
武蔵精密工業	4,800	1,310.00	6,288,000	
日産車体	3,100	570.00	1,767,000	
新明和工業	5,900	940.00	5,546,000	
極東開発工業	3,800	1,275.00	4,845,000	
トビー工業	1,700	1,198.00	2,036,600	
ティラド	500	2,293.00	1,146,500	
タチエス	3,700	1,065.00	3,940,500	
N O K	9,600	1,109.00	10,646,400	
フタバ産業	5,200	373.00	1,939,600	
K Y B	2,100	2,875.00	6,037,500	
大同メタル工業	4,100	509.00	2,086,900	
プレス工業	10,100	411.00	4,151,100	
ミクニ	2,600	354.00	920,400	
太平洋工業	4,300	983.00	4,226,900	
河西工業	2,600	248.00	644,800	
アイシン	15,700	3,830.00	60,131,000	
マツダ	65,700	1,065.00	69,970,500	
今仙電機製作所	1,400	572.00	800,800	
本田技研工業	164,400	3,175.00	521,970,000	
スズキ	46,700	3,723.00	173,864,100	
S U B A R U	59,600	2,131.50	127,037,400	
安永	1,000	689.00	689,000	
ヤマハ発動機	27,900	2,545.00	71,005,500	
T B K	2,300	345.00	793,500	
エクセディ	3,200	1,650.00	5,280,000	
豊田合成	6,600	1,983.00	13,087,800	
愛三工業	3,400	733.00	2,492,200	
盟和産業	300	1,003.00	300,900	

日本プラスト	1,600	457.00	731,200
ヨロズ	1,900	759.00	1,442,100
エフ・シー・シー	3,500	1,337.00	4,679,500
シマノ	8,300	22,265.00	184,799,500
テイ・エス テック	9,000	1,265.00	11,385,000
ジャムコ	1,200	775.00	930,000
テルモ	60,500	3,980.00	240,790,000
クリエートメディック	600	982.00	589,200
日機装	6,100	826.00	5,038,600
日本エム・ディ・エム	1,200	1,510.00	1,812,000
島津製作所	26,900	4,640.00	124,816,000
JMS	1,800	569.00	1,024,200
クボテック	500	248.00	124,000
長野計器	1,500	1,117.00	1,675,500
ブイ・テクノロジー	900	2,818.00	2,536,200
東京計器	1,400	1,090.00	1,526,000
愛知時計電機	900	1,472.00	1,324,800
インターアクション	1,100	2,003.00	2,203,300
オーバル	1,900	307.00	583,300
東京精密	3,500	4,735.00	16,572,500
マニー	8,300	1,433.00	11,893,900
ニコン	31,800	1,422.00	45,219,600
トプコン	10,100	1,889.00	19,078,900
オリンパス	109,300	2,622.00	286,584,600
理研計器	1,600	3,985.00	6,376,000
タムロン	1,600	2,366.00	3,785,600
H O Y A	41,700	12,745.00	531,466,500
シード	1,000	490.00	490,000
ノーリツ鋼機	1,900	2,151.00	4,086,900
A & D ホロンホールディングス	2,400	1,000.00	2,400,000
朝日インテック	23,400	2,018.00	47,221,200
シチズン時計	23,700	537.00	12,726,900
リズム	700	1,560.00	1,092,000
大研医器	1,700	515.00	875,500
メニコン	6,900	2,431.00	16,773,900
シンシア	200	410.00	82,000
松風	800	1,439.00	1,151,200
セイコーホールディングス	3,000	2,306.00	6,918,000
ニプロ	15,600	1,014.00	15,818,400

中本パックス	600	1,579.00	947,400
スノーピーク	2,800	2,312.00	6,473,600
パラマウントベッドホールディングス	4,100	2,027.00	8,310,700
トランザクション	1,200	1,023.00	1,227,600
粧美堂	600	411.00	246,600
ニホンフラッシュ	1,800	869.00	1,564,200
前田工織	2,200	2,670.00	5,874,000
永大産業	2,600	275.00	715,000
アートネイチャー	1,800	715.00	1,287,000
バンダイナムコホールディングス	18,700	8,744.00	163,512,800
アイフィスジャパン	500	662.00	331,000
共立印刷	3,400	139.00	472,600
SHOEI	2,000	4,670.00	9,340,000
フランスベッドホールディングス	2,700	880.00	2,376,000
パイロットコーポレーション	3,400	4,740.00	16,116,000
萩原工業	1,400	1,099.00	1,538,600
フジシールインターナショナル	4,900	1,575.00	7,717,500
タカラトミー	8,800	1,213.00	10,674,400
広済堂ホールディングス	1,300	817.00	1,062,100
エステールホールディングス	500	645.00	322,500
タカノ	700	834.00	583,800
プロネクサス	1,700	1,047.00	1,779,900
ホクシン	1,500	145.00	217,500
ウッドワン	700	1,177.00	823,900
大建工業	1,200	1,899.00	2,278,800
凸版印刷	31,000	2,372.00	73,532,000
大日本印刷	24,600	2,906.00	71,487,600
共同印刷	600	2,695.00	1,617,000
NISSHA	4,200	1,476.00	6,199,200
光村印刷	200	1,300.00	260,000
TAKARA & COMPANY	1,300	1,895.00	2,463,500
アシックス	18,100	2,227.00	40,308,700
ツツミ	500	1,870.00	935,000
ローランド	1,500	4,270.00	6,405,000
小松ウオール工業	700	1,840.00	1,288,000
ヤマハ	12,400	5,170.00	64,108,000
河合楽器製作所	600	2,860.00	1,716,000
クリナップ	2,000	529.00	1,058,000
ピジョン	12,900	1,958.00	25,258,200

兼松サステック	100	1,651.00	165,100	
キングジム	1,800	929.00	1,672,200	
リンテック	4,400	2,309.00	10,159,600	
イトーキ	3,900	363.00	1,415,700	
任天堂	12,100	56,340.00	681,714,000	
三菱鉛筆	3,300	1,292.00	4,263,600	
タカラスタンダード	4,100	1,259.00	5,161,900	
コクヨ	10,000	1,668.00	16,680,000	
ナカバヤシ	1,800	487.00	876,600	
グローブライド	1,800	2,260.00	4,068,000	
オカムラ	6,900	1,076.00	7,424,400	
美津濃	2,000	2,240.00	4,480,000	
東京電力ホールディングス	160,100	500.00	80,050,000	
中部電力	63,800	1,316.00	83,960,800	
関西電力	79,000	1,264.00	99,856,000	
中国電力	32,600	884.00	28,818,400	
北陸電力	19,100	553.00	10,562,300	
東北電力	49,000	760.00	37,240,000	
四国電力	18,800	779.00	14,645,200	
九州電力	43,000	864.00	37,152,000	
北海道電力	18,600	499.00	9,281,400	
沖縄電力	4,500	1,221.00	5,494,500	
電源開発	17,400	2,107.00	36,661,800	
エフオン	1,300	533.00	692,900	
イーレックス	3,000	2,187.00	6,561,000	
レノバ	4,200	1,915.00	8,043,000	
東京瓦斯	40,000	2,596.00	103,840,000	
大阪瓦斯	37,800	2,435.00	92,043,000	
東邦瓦斯	9,300	2,867.00	26,663,100	
北海道瓦斯	1,100	1,543.00	1,697,300	
広島ガス	4,000	321.00	1,284,000	
西部ガスホールディングス	2,300	1,989.00	4,574,700	
静岡ガス	5,400	850.00	4,590,000	
メタウォーター	2,200	2,026.00	4,457,200	
SBSホールディングス	1,600	3,020.00	4,832,000	
東武鉄道	20,400	2,975.00	60,690,000	
相鉄ホールディングス	6,700	2,283.00	15,296,100	
東急	52,600	1,577.00	82,950,200	
京浜急行電鉄	26,200	1,349.00	35,343,800	

小田急電鉄	30,200	1,792.00	54,118,400
京王電鉄	10,500	4,460.00	46,830,000
京成電鉄	14,100	3,405.00	48,010,500
富士急行	2,400	3,980.00	9,552,000
新京成電鉄	500	2,783.00	1,391,500
東日本旅客鉄道	36,000	6,619.00	238,284,000
西日本旅客鉄道	24,800	4,833.00	119,858,400
東海旅客鉄道	16,900	16,515.00	279,103,500
西武ホールディングス	27,200	1,395.00	37,944,000
鴻池運輸	3,300	1,162.00	3,834,600
西日本鉄道	5,700	2,768.00	15,777,600
ハマキョウレックス	1,500	2,845.00	4,267,500
サカイ引越センター	1,000	4,465.00	4,465,000
近鉄グループホールディングス	19,800	3,705.00	73,359,000
阪急阪神ホールディングス	24,800	3,460.00	85,808,000
南海電気鉄道	8,800	2,490.00	21,912,000
京阪ホールディングス	8,600	3,015.00	25,929,000
神戸電鉄	500	3,290.00	1,645,000
名古屋鉄道	21,300	2,221.00	47,307,300
山陽電気鉄道	1,500	2,100.00	3,150,000
アルプス物流	1,400	1,100.00	1,540,000
ヤマトホールディングス	28,400	2,436.00	69,182,400
山九	5,200	3,755.00	19,526,000
丸運	1,100	239.00	262,900
丸全昭和運輸	1,600	3,115.00	4,984,000
センコーグループホールディングス	10,100	862.00	8,706,200
トナミホールディングス	500	3,480.00	1,740,000
ニッコンホールディングス	6,600	2,030.00	13,398,000
日本石油輸送	200	2,580.00	516,000
福山通運	3,100	3,415.00	10,586,500
セイノーホールディングス	12,900	1,020.00	13,158,000
エスライン	600	863.00	517,800
神奈川中央交通	500	3,310.00	1,655,000
日立物流	3,900	8,450.00	32,955,000
丸和運輸機関	4,000	1,688.00	6,752,000
C & F ロジホールディングス	1,900	1,080.00	2,052,000
九州旅客鉄道	15,000	2,576.00	38,640,000
S Gホールディングス	36,900	2,304.00	85,017,600

NIPPON EXPRESSホールディングン	6,700	7,750.00	51,925,000	
日本郵船	16,900	9,710.00	164,099,000	
商船三井	32,800	3,270.00	107,256,000	
川崎汽船	6,200	8,490.00	52,638,000	
NSユナイテッド海運	1,100	3,800.00	4,180,000	
明治海運	2,200	730.00	1,606,000	
飯野海運	8,900	686.00	6,105,400	
共栄タンカー	400	1,044.00	417,600	
乾汽船	1,300	1,836.00	2,386,800	
日本航空	45,500	2,160.00	98,280,000	
ANAホールディングス	50,400	2,473.50	124,664,400	
パスコ	400	1,297.00	518,800	
トランコム	600	7,010.00	4,206,000	
日新	1,600	1,597.00	2,555,200	
三菱倉庫	6,000	3,065.00	18,390,000	
三井倉庫ホールディングス	2,100	2,826.00	5,934,600	
住友倉庫	6,700	2,064.00	13,828,800	
澁澤倉庫	1,100	2,260.00	2,486,000	
東陽倉庫	3,200	306.00	979,200	
日本トランスシティ	4,200	547.00	2,297,400	
ケイヒン	300	1,351.00	405,300	
中央倉庫	1,200	975.00	1,170,000	
川西倉庫	400	1,076.00	430,400	
安田倉庫	1,600	967.00	1,547,200	
ファイズホールディングス	400	723.00	289,200	
東洋埠頭	600	1,400.00	840,000	
上組	10,700	2,698.00	28,868,600	
サンリツ	500	757.00	378,500	
キムラユニティー	500	1,514.00	757,000	
キューソー流通システム	1,000	1,091.00	1,091,000	
近鉄エクスプレス	3,800	3,400.00	12,920,000	
東海運	1,200	292.00	350,400	
エーアイティー	1,300	1,504.00	1,955,200	
内外トランスライン	800	1,951.00	1,560,800	
日本コンセプト	600	1,388.00	832,800	
NEC ネットエスアイ	6,900	1,794.00	12,378,600	
クロスキャット	1,100	820.00	902,000	
システナ	29,900	459.00	13,724,100	

デジタルアーツ	1,100	6,890.00	7,579,000
日鉄ソリューションズ	3,200	3,685.00	11,792,000
キューブシステム	1,100	900.00	990,000
WOW WORLD	300	1,054.00	316,200
コア	900	1,413.00	1,271,700
手間いらず	300	5,050.00	1,515,000
ラクーンホールディングス	1,800	1,436.00	2,584,800
ソリトンシステムズ	1,000	1,273.00	1,273,000
ソフトクリエイトホールディングス	900	4,030.00	3,627,000
T I S	19,500	3,490.00	68,055,000
J N Sホールディングス	1,000	391.00	391,000
グリー	9,500	850.00	8,075,000
GMOベパボ	200	2,035.00	407,000
コーエーテクモホールディングス	6,700	4,220.00	28,274,000
三菱総合研究所	1,100	4,035.00	4,438,500
ボルテージ	600	343.00	205,800
電算	200	2,181.00	436,200
A G S	1,000	751.00	751,000
ファインデックス	1,800	598.00	1,076,400
ブレインパッド	1,800	1,089.00	1,960,200
K L a b	3,800	431.00	1,637,800
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	1,035.00	3,105,000
ネクソン	47,500	2,934.00	139,365,000
アイスタイル	5,400	177.00	955,800
エムアップホールディングス	2,400	1,102.00	2,644,800
エイチーム	1,400	713.00	998,200
エニグモ	2,300	542.00	1,246,600
テクノスジャパン	1,600	470.00	752,000
e n i s h	1,400	332.00	464,800
コロブラ	6,900	606.00	4,181,400
オルトプラス	1,600	324.00	518,400
ブロードリーフ	10,400	359.00	3,733,600
クロス・マーケティンググループ	800	933.00	746,400
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,748.00	1,748,000
システム情報	1,600	963.00	1,540,800
メディアドゥ	700	1,717.00	1,201,900
じげん	5,900	329.00	1,941,100
ブイキューブ	2,100	1,015.00	2,131,500
エンカレッジ・テクノロジー	500	504.00	252,000

サイバーリンクス	700	1,021.00	714,700
ディー・エル・イー	1,400	297.00	415,800
フィックスターズ	2,200	849.00	1,867,800
CARTA HOLDINGS	900	1,991.00	1,791,900
オプティム	1,500	756.00	1,134,000
セレス	800	1,411.00	1,128,800
SHIFT	1,100	20,900.00	22,990,000
ティーガイア	1,900	1,650.00	3,135,000
セック	300	2,244.00	673,200
テクマトリックス	3,500	1,635.00	5,722,500
プロシップ	700	1,338.00	936,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,500	2,247.00	12,358,500
GMOペイメントゲートウェイ	4,100	10,580.00	43,378,000
ザッパラス	800	397.00	317,600
システムリサーチ	600	1,834.00	1,100,400
インターネットイニシアティブ	5,600	4,355.00	24,388,000
さくらインターネット	2,200	564.00	1,240,800
ヴィンクス	600	1,033.00	619,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	5,500.00	2,750,000
SRAホールディングス	1,000	2,809.00	2,809,000
システムインテグレータ	700	468.00	327,600
朝日ネット	1,900	575.00	1,092,500
eBASE	2,500	440.00	1,100,000
アバント	2,200	1,199.00	2,637,800
アドソル日進	700	1,529.00	1,070,300
ODKソリューションズ	400	554.00	221,600
フリービット	1,100	904.00	994,400
コムチュア	2,400	2,741.00	6,578,400
サイバーコム	300	1,080.00	324,000
アステリア	1,500	952.00	1,428,000
アイル	1,100	1,336.00	1,469,600
マークライnz	1,100	2,495.00	2,744,500
メディカル・データ・ビジョン	2,700	868.00	2,343,600
gumi	2,900	515.00	1,493,500
ショーケース	500	464.00	232,000
モバイルファクトリー	500	994.00	497,000
テラスカイ	800	1,229.00	983,200

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,254.00	1,128,600
P C Iホールディングス	900	985.00	886,500
パイブドHD	400	2,682.00	1,072,800
アイビーシー	300	473.00	141,900
ネオジャパン	600	1,171.00	702,600
P R T I M E S	400	2,029.00	811,600
ラクス	9,600	1,430.00	13,728,000
ランドコンピュータ	500	874.00	437,000
ダブルスタンダード	600	2,143.00	1,285,800
オープンドア	1,200	1,887.00	2,264,400
マイネット	800	510.00	408,000
アカツキ	900	2,759.00	2,483,100
ベネフィットジャパン	200	2,050.00	410,000
U b i c o mホールディングス	600	2,774.00	1,664,400
カナミックネットワーク	2,300	456.00	1,048,800
ノムラシステムコーポレーション	1,100	211.00	232,100
チェンジ	4,000	1,722.00	6,888,000
シンクロ・フード	1,100	248.00	272,800
オークネット	1,100	1,724.00	1,896,400
キャピタル・アセット・プランニング	400	713.00	285,200
セグエグループ	500	509.00	254,500
エイトレッド	300	2,002.00	600,600
マクロミル	4,400	983.00	4,325,200
ビーグリー	500	1,420.00	710,000
オロ	700	1,850.00	1,295,000
ユーザーローカル	600	1,629.00	977,400
テモナ	400	368.00	147,200
ニーズウェル	500	663.00	331,500
マネーフォワード	4,300	3,230.00	13,889,000
サインポスト	700	868.00	607,600
電算システムホールディングス	900	2,285.00	2,056,500
ソルクシーズ	1,800	360.00	648,000
フェイス	600	728.00	436,800
プロトコーポレーション	2,200	933.00	2,052,600
ハイマックス	600	1,210.00	726,000
野村総合研究所	39,200	3,310.00	129,752,000
サイバネットシステム	1,500	724.00	1,086,000
C Eホールディングス	1,100	453.00	498,300

日本システム技術	400	2,192.00	876,800
インテージホールディングス	2,400	1,456.00	3,494,400
東邦システムサイエンス	600	893.00	535,800
ソースネクスト	9,100	169.00	1,537,900
インフォコム	2,300	2,057.00	4,731,100
シンプレクス・ホールディングス	3,300	1,813.00	5,982,900
HEROZ	600	900.00	540,000
ラクスル	2,400	2,277.00	5,464,800
I P S	600	1,977.00	1,186,200
F I G	2,300	300.00	690,000
システムサポート	800	1,028.00	822,400
イーソル	1,300	543.00	705,900
アルテリア・ネットワークス	2,400	1,270.00	3,048,000
東海ソフト	300	922.00	276,600
ウイングアーク1 s t	1,600	1,211.00	1,937,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディ ン	500	1,454.00	727,000
サーバーワークス	400	2,013.00	805,200
東名	200	742.00	148,400
ヴィッツ	200	1,187.00	237,400
トピラシステムズ	400	760.00	304,000
S a n s a n	7,200	1,100.00	7,920,000
L i n k - U	400	645.00	258,000
ギフティ	1,900	1,122.00	2,131,800
ベース	400	6,100.00	2,440,000
J M D C	2,600	5,020.00	13,052,000
フォーカスシステムズ	1,400	900.00	1,260,000
クレスコ	1,500	1,901.00	2,851,500
フジ・メディア・ホールディングス	19,700	1,121.00	22,083,700
オービック	6,600	19,250.00	127,050,000
ジャストシステム	3,000	4,980.00	14,940,000
T D C ソフト	1,800	1,001.00	1,801,800
Zホールディングス	302,700	420.10	127,164,270
トレンドマイクロ	10,900	7,200.00	78,480,000
I Dホールディングス	1,300	830.00	1,079,000
日本オラクル	3,400	8,310.00	28,254,000
アルファシステムズ	600	3,800.00	2,280,000
フューチャー	4,400	1,677.00	7,378,800
C A C H o l d i n g s	1,200	1,331.00	1,597,200

S Bテクノロジー	900	2,170.00	1,953,000	
トーセ	500	719.00	359,500	
オービックビジネスコンサルタント	2,000	4,240.00	8,480,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,600	3,065.00	29,424,000	
アイティフォー	2,500	744.00	1,860,000	
東計電算	200	5,340.00	1,068,000	
エクスネット	300	995.00	298,500	
大塚商会	11,400	3,850.00	43,890,000	
サイボウズ	2,800	1,262.00	3,533,600	
電通国際情報サービス	2,900	4,090.00	11,861,000	
A C C E S S	2,400	555.00	1,332,000	
デジタルガレージ	3,500	4,045.00	14,157,500	
E Mシステムズ	3,500	1,000.00	3,500,000	
ウェザーニューズ	700	6,700.00	4,690,000	
C I J	1,600	742.00	1,187,200	
ビジネスエンジニアリング	200	4,100.00	820,000	
日本エンタープライズ	2,100	161.00	338,100	
WOWOW	1,000	1,466.00	1,466,000	
スカラ	1,800	750.00	1,350,000	
インテリジェント ウェイブ	1,000	590.00	590,000	
I M A G I C A G R O U P	1,700	639.00	1,086,300	
ネットワンシステムズ	7,700	2,902.00	22,345,400	
システムソフト	5,100	101.00	515,100	
アルゴグラフィックス	1,600	3,050.00	4,880,000	
マーベラス	3,300	713.00	2,352,900	
エイベックス	3,600	1,114.00	4,010,400	
B I P R O G Y	6,600	2,809.00	18,539,400	
兼松エレクトロニクス	1,100	3,700.00	4,070,000	
都築電気	1,000	1,369.00	1,369,000	
T B Sホールディングス	11,800	1,704.00	20,107,200	
日本テレビホールディングス	17,500	1,234.00	21,595,000	
朝日放送グループホールディングス	1,900	699.00	1,328,100	
テレビ朝日ホールディングス	5,000	1,470.00	7,350,000	
スカパーJSATホールディングス	17,800	459.00	8,170,200	
テレビ東京ホールディングス	1,400	1,966.00	2,752,400	
日本BS放送	700	1,030.00	721,000	
ビジョン	3,500	1,288.00	4,508,000	
スマートバリュー	500	530.00	265,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,900	2,064.00	3,921,600	

ワイヤレスゲート	900	293.00	263,700
コネクシオ	1,500	1,395.00	2,092,500
日本通信	17,500	195.00	3,412,500
クロップス	400	1,012.00	404,800
日本電信電話	224,800	3,806.00	855,588,800
K D D I	153,000	4,413.00	675,189,000
ソフトバンク	317,900	1,457.50	463,339,250
光通信	2,400	13,600.00	32,640,000
エムティーアイ	1,900	426.00	809,400
GMOインターネット	7,400	2,537.00	18,773,800
ファイバーゲート	1,000	1,125.00	1,125,000
アイドママーケティングコミュニケーション	400	285.00	114,000
K A D O K A W A	11,400	2,823.00	32,182,200
学研ホールディングス	3,000	825.00	2,475,000
ゼンリン	3,400	912.00	3,100,800
昭文社ホールディングス	800	398.00	318,400
インプレスホールディングス	1,700	223.00	379,100
アイネット	1,000	1,207.00	1,207,000
松竹	1,300	13,280.00	17,264,000
東宝	12,400	4,885.00	60,574,000
東映	700	18,120.00	12,684,000
エヌ・ティ・ティ・データ	55,900	2,014.00	112,582,600
ピー・シー・エー	1,200	1,246.00	1,495,200
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,506.00	903,600
D T S	3,900	2,978.00	11,614,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,800	5,640.00	55,272,000
シーイーシー	2,200	1,183.00	2,602,600
カブコン	19,800	3,470.00	68,706,000
アイ・エス・ピー	1,000	1,020.00	1,020,000
ジャステック	1,200	1,119.00	1,342,800
S C S K	14,500	2,196.00	31,842,000
日本システムウエア	800	2,250.00	1,800,000
アイネス	2,000	1,465.00	2,930,000
T K C	3,400	3,380.00	11,492,000
富士ソフト	2,200	6,770.00	14,894,000
N S D	6,600	2,175.00	14,355,000
コナミホールディングス	7,600	7,960.00	60,496,000

福井コンピュータホールディングス	1,000	3,325.00	3,325,000	
J B C Cホールディングス	1,400	1,563.00	2,188,200	
ミロク情報サービス	1,800	1,185.00	2,133,000	
ソフトバンクグループ	125,900	5,110.00	643,349,000	
高千穂交易	800	1,700.00	1,360,000	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,710.00	513,000	
伊藤忠食品	500	4,800.00	2,400,000	
エレマテック	1,700	1,199.00	2,038,300	
J A L U X	200	2,554.00	510,800	
あらた	1,600	3,745.00	5,992,000	
トーメンデバイス	300	5,660.00	1,698,000	
東京エレクトロン デバイス	600	5,460.00	3,276,000	
フィールズ	1,800	1,163.00	2,093,400	
双日	22,700	1,954.00	44,355,800	
アルフレッサ ホールディングス	22,900	1,654.00	37,876,600	
横浜冷凍	5,600	864.00	4,838,400	
神栄	300	888.00	266,400	
ラサ商事	1,000	936.00	936,000	
アルコニックス	2,600	1,280.00	3,328,000	
神戸物産	15,700	2,925.00	45,922,500	
ハイパー	500	457.00	228,500	
あい ホールディングス	3,000	1,603.00	4,809,000	
ディーブイエックス	700	1,021.00	714,700	
ダイワボウホールディングス	9,800	1,684.00	16,503,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,000	2,756.00	13,780,000	
ラクト・ジャパン	700	1,980.00	1,386,000	
グリムス	900	1,445.00	1,300,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,600	700.00	2,520,000	
八洲電機	1,500	951.00	1,426,500	
メディアスホールディングス	1,200	1,041.00	1,249,200	
レスターホールディングス	2,000	1,961.00	3,922,000	
ジューテックホールディングス	500	1,014.00	507,000	
大光	900	720.00	648,000	
O C H Iホールディングス	600	1,220.00	732,000	
T O K A Iホールディングス	10,200	868.00	8,853,600	
黒谷	600	563.00	337,800	
C o m i n i x	400	721.00	288,400	
三洋貿易	2,100	946.00	1,986,600	
ビューティガレージ	300	2,499.00	749,700	

ウイン・パートナーズ	1,500	1,000.00	1,500,000
ミタチ産業	500	872.00	436,000
シップヘルスケアホールディングス	6,500	2,175.00	14,137,500
明治電機工業	700	1,039.00	727,300
デリカフーズホールディングス	800	525.00	420,000
スターティアホールディングス	500	645.00	322,500
コメダホールディングス	4,600	2,211.00	10,170,600
ピーバンドットコム	300	527.00	158,100
アセンテック	700	718.00	502,600
富士興産	500	944.00	472,000
協栄産業	200	1,275.00	255,000
フルサト・マルカホールディングス	2,000	3,830.00	7,660,000
ヤマエグループホールディングス	1,300	1,143.00	1,485,900
小野建	2,000	1,430.00	2,860,000
南陽	400	1,838.00	735,200
佐鳥電機	1,300	1,218.00	1,583,400
エコートレーディング	400	567.00	226,800
伯東	1,300	2,779.00	3,612,700
コンドーテック	1,600	1,046.00	1,673,600
中山福	1,100	342.00	376,200
ナガイレーベン	2,700	1,919.00	5,181,300
三菱食品	2,000	3,075.00	6,150,000
松田産業	1,500	1,946.00	2,919,000
第一興商	4,000	3,755.00	15,020,000
メディパルホールディングス	21,700	1,616.00	35,067,200
S P K	800	1,337.00	1,069,600
萩原電気ホールディングス	800	1,929.00	1,543,200
アズワン	3,000	6,340.00	19,020,000
スズデン	700	2,031.00	1,421,700
尾家産業	500	904.00	452,000
シモジマ	1,300	909.00	1,181,700
ドウシシャ	2,000	1,499.00	2,998,000
小津産業	500	2,015.00	1,007,500
高速	1,200	1,506.00	1,807,200
たけびし	800	1,459.00	1,167,200
リックス	500	1,836.00	918,000
丸文	1,800	742.00	1,335,600
ハビネット	1,700	1,524.00	2,590,800
橋本総業ホールディングス	400	1,904.00	761,600

日本ライフライン	6,200	926.00	5,741,200	
タカショー	1,600	705.00	1,128,000	
I D O M	6,400	655.00	4,192,000	
進和	1,200	2,013.00	2,415,600	
エスケイジャパン	500	433.00	216,500	
ダイترون	900	1,999.00	1,799,100	
シークス	2,900	1,038.00	3,010,200	
田中商事	600	611.00	366,600	
オーハシテクニカ	1,100	1,250.00	1,375,000	
白銅	700	2,368.00	1,657,600	
ダイコー通産	200	1,280.00	256,000	
伊藤忠商事	140,300	3,533.00	495,679,900	
丸紅	200,100	1,313.00	262,731,300	
高島	300	2,426.00	727,800	
長瀬産業	10,700	1,806.00	19,324,200	
蝶理	1,200	1,883.00	2,259,600	
豊田通商	20,400	4,440.00	90,576,000	
三共生興	2,700	534.00	1,441,800	
兼松	7,700	1,320.00	10,164,000	
ツカモトコーポレーション	400	1,268.00	507,200	
三井物産	160,000	3,035.00	485,600,000	
日本紙パルプ商事	1,100	3,610.00	3,971,000	
カメイ	2,400	1,050.00	2,520,000	
東都水産	100	4,575.00	457,500	
O U Gホールディングス	300	2,673.00	801,900	
スターゼン	1,500	1,945.00	2,917,500	
山善	8,400	899.00	7,551,600	
椿本興業	400	3,595.00	1,438,000	
住友商事	130,200	1,820.50	237,029,100	
内田洋行	900	4,365.00	3,928,500	
三菱商事	151,300	4,244.00	642,117,200	
第一実業	900	3,080.00	2,772,000	
キヤノンマーケティングジャパン	5,200	2,973.00	15,459,600	
西華産業	1,000	1,601.00	1,601,000	
佐藤商事	1,600	1,136.00	1,817,600	
菱洋エレクトロ	1,200	2,084.00	2,500,800	
東京産業	1,800	695.00	1,251,000	
ユアサ商事	1,900	2,993.00	5,686,700	
神鋼商事	500	3,620.00	1,810,000	

トルク	1,100	200.00	220,000	
阪和興業	4,000	2,995.00	11,980,000	
正栄食品工業	1,400	3,955.00	5,537,000	
カナデン	1,700	921.00	1,565,700	
菱電商事	1,700	1,628.00	2,767,600	
岩谷産業	4,900	5,140.00	25,186,000	
ナイス	700	1,701.00	1,190,700	
ニチモウ	300	2,499.00	749,700	
極東貿易	600	2,548.00	1,528,800	
アステナホールディングス	2,900	429.00	1,244,100	
三愛オブリ	5,000	959.00	4,795,000	
稲畑産業	4,400	2,118.00	9,319,200	
G S Iクレオス	1,000	1,210.00	1,210,000	
明和産業	1,900	689.00	1,309,100	
クワザワホールディングス	800	490.00	392,000	
ワキタ	4,300	1,052.00	4,523,600	
東邦ホールディングス	6,400	1,977.00	12,652,800	
サンゲツ	5,400	1,548.00	8,359,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,800	963.00	2,696,400	
シナネンホールディングス	800	3,310.00	2,648,000	
伊藤忠エネクス	4,700	1,022.00	4,803,400	
サンリオ	6,300	2,532.00	15,951,600	
サンワテクノス	1,200	1,346.00	1,615,200	
リョーサン	2,300	2,185.00	5,025,500	
新光商事	3,000	950.00	2,850,000	
トーヨー	900	1,107.00	996,300	
三信電気	900	1,506.00	1,355,400	
東陽テクニカ	2,100	1,022.00	2,146,200	
モスフードサービス	2,800	2,988.00	8,366,400	
加賀電子	1,800	3,090.00	5,562,000	
ソーダニッカ	2,000	602.00	1,204,000	
立花エレテック	1,500	1,551.00	2,326,500	
フォーバル	900	831.00	747,900	
P A L T A C	3,000	4,590.00	13,770,000	
三谷産業	3,300	307.00	1,013,100	
太平洋興発	800	630.00	504,000	
西本W i s m e t t a cホールディングス	500	2,974.00	1,487,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,012.00	402,400	
コア商事ホールディングス	1,300	817.00	1,062,100	

国際紙パルプ商事	4,200	329.00	1,381,800	
ヤマタネ	1,000	1,622.00	1,622,000	
丸紅建材リース	200	1,768.00	353,600	
日鉄物産	1,400	5,020.00	7,028,000	
泉州電業	600	4,985.00	2,991,000	
トラスコ中山	4,400	1,811.00	7,968,400	
オートバックスセブン	6,900	1,358.00	9,370,200	
モリト	1,500	755.00	1,132,500	
加藤産業	2,800	3,280.00	9,184,000	
北恵	500	884.00	442,000	
イノテック	1,300	1,300.00	1,690,000	
イエローハット	3,500	1,628.00	5,698,000	
J Kホールディングス	1,600	1,033.00	1,652,800	
日伝	1,600	1,982.00	3,171,200	
北沢産業	1,300	218.00	283,400	
杉本商事	1,000	2,201.00	2,201,000	
因幡電機産業	5,500	2,559.00	14,074,500	
東テク	700	2,771.00	1,939,700	
ミスミグループ本社	26,400	2,906.00	76,718,400	
アルテック	1,400	244.00	341,600	
タキヒヨー	600	1,057.00	634,200	
蔵王産業	400	1,959.00	783,600	
スズケン	8,000	3,360.00	26,880,000	
ジェコス	1,500	792.00	1,188,000	
グローセル	2,400	413.00	991,200	
ローソン	4,700	4,630.00	21,761,000	
サンエー	1,500	4,075.00	6,112,500	
カワチ薬品	1,600	2,034.00	3,254,400	
エービーシー・マート	3,300	5,370.00	17,721,000	
ハードオフコーポレーション	900	829.00	746,100	
アスクル	4,800	1,475.00	7,080,000	
ゲオホールディングス	2,700	1,181.00	3,188,700	
アダストリア	2,300	2,116.00	4,866,800	
ジーフット	1,300	320.00	416,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	386.00	115,800	
くら寿司	2,200	3,070.00	6,754,000	
キャンドウ	800	2,488.00	1,990,400	
アイケイ	700	549.00	384,300	
パルグループホールディングス	1,800	1,500.00	2,700,000	

エディオン	9,700	1,200.00	11,640,000
サーラコーポレーション	4,300	629.00	2,704,700
ワッツ	1,000	723.00	723,000
ハローズ	1,000	3,115.00	3,115,000
フジオフードグループ本社	1,700	1,328.00	2,257,600
あみやき亭	500	2,897.00	1,448,500
ひらまつ	4,500	194.00	873,000
大黒天物産	700	4,780.00	3,346,000
ハニーズホールディングス	1,800	1,071.00	1,927,800
ファーマライズホールディングス	500	721.00	360,500
アルペン	1,600	1,896.00	3,033,600
ハブ	700	475.00	332,500
クオールホールディングス	2,600	1,214.00	3,156,400
ジinzホールディングス	1,300	4,320.00	5,616,000
ビックカメラ	12,500	1,092.00	13,650,000
DCMホールディングス	13,000	1,052.00	13,676,000
Monotaro	26,600	2,017.00	53,652,200
東京一番フーズ	500	595.00	297,500
DDホールディングス	1,100	523.00	575,300
きちりホールディングス	600	368.00	220,800
アークランドサービスホールディングス	1,500	2,031.00	3,046,500
J.フロント リテイリング	24,600	987.00	24,280,200
ドトール・日レスホールディングス	3,500	1,509.00	5,281,500
マツキヨココカラ&カンパニー	12,800	4,960.00	63,488,000
ブロンコビリー	1,200	2,354.00	2,824,800
ZOZO	14,500	2,699.00	39,135,500
トレジャー・ファクトリー	600	976.00	585,600
物語コーポレーション	1,000	5,300.00	5,300,000
三越伊勢丹ホールディングス	35,100	986.00	34,608,600
Hamee	800	1,053.00	842,400
マーケットエンタープライズ	200	777.00	155,400
ウエルシアホールディングス	11,100	2,614.00	29,015,400
クリエイトSDホールディングス	3,100	2,929.00	9,079,900
丸善CHIホールディングス	2,500	384.00	960,000
ミサワ	400	622.00	248,800
ティーライフ	300	1,424.00	427,200
エー・ピーホールディングス	400	448.00	179,200
チムニー	600	1,182.00	709,200
シュッピン	1,800	1,366.00	2,458,800

オイシックス・ラ・大地	3,000	1,993.00	5,979,000
ネクステージ	4,300	1,993.00	8,569,900
ジョイフル本田	6,300	1,515.00	9,544,500
鳥貴族ホールディングス	700	1,769.00	1,238,300
ホットランド	1,600	1,354.00	2,166,400
すかいらーくホールディングス	26,700	1,558.00	41,598,600
SFPホールディングス	1,000	1,414.00	1,414,000
綿半ホールディングス	1,500	1,335.00	2,002,500
ヨシックスホールディングス	400	1,943.00	777,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6,100	1,082.00	6,600,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,100	1,000.00	1,100,000
B E E N O S	1,100	1,825.00	2,007,500
あさひ	1,700	1,301.00	2,211,700
日本調剤	1,300	1,210.00	1,573,000
コスモス薬品	2,100	11,150.00	23,415,000
トーエル	1,000	864.00	864,000
セブン&アイ・ホールディングス	78,500	5,638.00	442,583,000
クリエイト・レストランツ・ホールディン	12,200	836.00	10,199,200
ツルハホールディングス	4,600	6,700.00	30,820,000
サンマルクホールディングス	1,700	1,498.00	2,546,600
フェリシモ	500	1,155.00	577,500
トリドールホールディングス	5,200	2,202.00	11,450,400
T O K Y O B A S E	1,900	288.00	547,200
ウイルプラスホールディングス	400	876.00	350,400
J Mホールディングス	1,500	1,579.00	2,368,500
サツドラホールディングス	900	638.00	574,200
アレンザホールディングス	1,500	991.00	1,486,500
串カツ田中ホールディングス	600	1,705.00	1,023,000
パロックジャパンリミテッド	1,500	791.00	1,186,500
クスリのアオキホールディングス	2,000	5,470.00	10,940,000
力の源ホールディングス	1,100	614.00	675,400
F O O D & L I F E C O M P A N I E	11,800	3,215.00	37,937,000
メディカルシステムネットワーク	2,000	432.00	864,000
一家ホールディングス	400	532.00	212,800
藤久ホールディングス	700	674.00	471,800
はるやまホールディングス	1,000	455.00	455,000
ノジマ	3,400	2,862.00	9,730,800

カッパ・クリエイト	3,000	1,400.00	4,200,000
ライトオン	1,600	706.00	1,129,600
良品計画	24,200	1,233.00	29,838,600
パリミキホールディングス	2,600	268.00	696,800
アドヴァングループ	2,000	762.00	1,524,000
アルビス	700	2,230.00	1,561,000
コナカ	2,400	333.00	799,200
ハウス オブ ローゼ	300	1,643.00	492,900
G - 7ホールディングス	2,300	1,402.00	3,224,600
イオン北海道	3,400	1,061.00	3,607,400
コジマ	3,600	604.00	2,174,400
ヒマラヤ	700	918.00	642,600
コーナン商事	3,000	3,610.00	10,830,000
エコス	700	2,016.00	1,411,200
ワタミ	2,600	930.00	2,418,000
マルシェ	700	463.00	324,100
パン・パシフィック・インターナショナル ホ	42,100	1,944.00	81,842,400
西松屋チェーン	4,500	1,538.00	6,921,000
ゼンショーホールディングス	10,300	2,988.00	30,776,400
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,257.00	1,634,100
ハークスレイ	900	476.00	428,400
サイゼリヤ	3,100	2,362.00	7,322,200
V Tホールディングス	7,900	446.00	3,523,400
魚力	600	2,219.00	1,331,400
ポブラ	500	133.00	66,500
フジ・コーポレーション	1,100	1,139.00	1,252,900
ユナイテッドアローズ	2,200	1,890.00	4,158,000
ハイデイ日高	3,000	1,949.00	5,847,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	1,200	210.00	252,000
コロワイド	8,700	1,774.00	15,433,800
ピーシーデポコーポレーション	2,400	317.00	760,800
壱番屋	1,500	4,935.00	7,402,500
トップカルチャー	800	278.00	222,400
P L A N T	500	662.00	331,000
スギホールディングス	4,200	5,220.00	21,924,000
薬王堂ホールディングス	1,000	1,923.00	1,923,000
スクロール	3,200	810.00	2,592,000

ヨンドシーホールディングス	1,900	1,727.00	3,281,300	
木曽路	2,900	2,090.00	6,061,000	
S R Sホールディングス	3,000	822.00	2,466,000	
千趣会	3,800	386.00	1,466,800	
タカキュー	1,600	103.00	164,800	
リテールパートナーズ	3,200	1,148.00	3,673,600	
ケーヨー	3,900	930.00	3,627,000	
上新電機	2,300	1,875.00	4,312,500	
日本瓦斯	10,200	1,879.00	19,165,800	
ロイヤルホールディングス	3,700	2,126.00	7,866,200	
東天紅	200	936.00	187,200	
いなげや	2,400	1,307.00	3,136,800	
チヨダ	2,000	697.00	1,394,000	
ライフコーポレーション	1,900	2,771.00	5,264,900	
リンガーハット	2,500	2,233.00	5,582,500	
MrMaxHD	2,600	603.00	1,567,800	
テンアライド	2,000	317.00	634,000	
AOKIホールディングス	4,100	657.00	2,693,700	
オークワ	3,200	882.00	2,822,400	
コメリ	3,300	2,700.00	8,910,000	
青山商事	4,200	775.00	3,255,000	
しまむら	2,500	11,030.00	27,575,000	
はせがわ	1,100	270.00	297,000	
高島屋	15,000	1,231.00	18,465,000	
松屋	4,000	785.00	3,140,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,700	872.00	8,458,400	
近鉄百貨店	700	2,565.00	1,795,500	
丸井グループ	16,200	2,339.00	37,891,800	
アクシアル リテイリング	1,600	3,120.00	4,992,000	
井筒屋	1,000	291.00	291,000	
イオン	77,200	2,391.50	184,623,800	
イズミ	3,600	2,813.00	10,126,800	
平和堂	3,800	1,949.00	7,406,200	
フジ	5,400	2,325.00	12,555,000	
ヤオコー	2,400	6,860.00	16,464,000	
ゼビオホールディングス	2,900	881.00	2,554,900	
ケーズホールディングス	18,900	1,314.00	24,834,600	
Olympicグループ	1,000	632.00	632,000	
日産東京販売ホールディングス	3,100	223.00	691,300	

シルバーライフ	400	1,435.00	574,000
Genky DrugStores	900	3,130.00	2,817,000
ナルミヤ・インターナショナル	500	862.00	431,000
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,024.00	1,228,800
ギフトホールディングス	300	2,128.00	638,400
アインホールディングス	2,700	5,670.00	15,309,000
元気寿司	600	2,511.00	1,506,600
ヤマダホールディングス	78,820	461.00	36,336,020
アークランドサカモト	3,300	1,482.00	4,890,600
ニトリホールディングス	8,400	12,995.00	109,158,000
グルメ杵屋	1,700	1,009.00	1,715,300
愛眼	1,500	196.00	294,000
ケーユーホールディングス	1,100	1,066.00	1,172,600
吉野家ホールディングス	7,400	2,425.00	17,945,000
松屋フーズホールディングス	1,000	3,785.00	3,785,000
サガミホールディングス	3,200	1,143.00	3,657,600
関西フードマーケット	2,000	1,295.00	2,590,000
王将フードサービス	1,400	6,060.00	8,484,000
プレナス	2,400	1,935.00	4,644,000
ミニストップ	1,600	1,400.00	2,240,000
アークス	3,900	2,017.00	7,866,300
バローホールディングス	4,500	1,872.00	8,424,000
ベルク	900	5,330.00	4,797,000
大庄	1,100	1,067.00	1,173,700
ファーストリテイリング	2,800	59,830.00	167,524,000
サンドラッグ	7,900	2,679.00	21,164,100
サックスパー ホールディングス	2,000	529.00	1,058,000
ヤマザワ	500	1,513.00	756,500
やまや	400	2,458.00	983,200
ペルーナ	4,500	664.00	2,988,000
島根銀行	700	516.00	361,200
じもとホールディングス	1,500	591.00	886,500
めぶきフィナンシャルグループ	96,400	242.00	23,328,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,600	1,890.00	4,914,000
九州フィナンシャルグループ	41,000	379.00	15,539,000
ゆうちょ銀行	49,800	1,001.00	49,849,800
富山第一銀行	4,900	338.00	1,656,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	115,100	444.00	51,104,400
西日本フィナンシャルホールディングス	12,400	736.00	9,126,400

三十三フィナンシャルグループ	1,900	1,381.00	2,623,900	
第四北越フィナンシャルグループ	3,300	2,420.00	7,986,000	
ひろぎんホールディングス	29,700	596.00	17,701,200	
おきなわフィナンシャルグループ	1,900	2,092.00	3,974,800	
十六フィナンシャルグループ	2,700	2,219.00	5,991,300	
北國フィナンシャルホールディングス	1,900	4,235.00	8,046,500	
プロクレアホールディングス	2,200	1,778.00	3,911,600	
新生銀行	13,800	2,015.00	27,807,000	
あおぞら銀行	11,800	2,580.00	30,444,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,293,700	728.90	942,977,930	
りそなホールディングス	233,900	488.60	114,283,540	
三井住友トラスト・ホールディングス	38,200	4,027.00	153,831,400	
三井住友フィナンシャルグループ	143,000	3,902.00	557,986,000	
千葉銀行	66,800	695.00	46,426,000	
群馬銀行	37,700	352.00	13,270,400	
武蔵野銀行	3,000	1,715.00	5,145,000	
千葉興業銀行	4,800	258.00	1,238,400	
筑波銀行	8,200	182.00	1,492,400	
七十七銀行	6,300	1,593.00	10,035,900	
秋田銀行	1,300	1,560.00	2,028,000	
山形銀行	2,200	852.00	1,874,400	
岩手銀行	1,400	1,893.00	2,650,200	
東邦銀行	16,800	199.00	3,343,200	
東北銀行	1,000	988.00	988,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	16,900	2,261.00	38,210,900	
静岡銀行	48,700	793.00	38,619,100	
スルガ銀行	18,500	366.00	6,771,000	
八十二銀行	45,300	436.00	19,750,800	
山梨中央銀行	2,200	963.00	2,118,600	
大垣共立銀行	4,000	1,773.00	7,092,000	
福井銀行	1,800	1,301.00	2,341,800	
清水銀行	800	1,467.00	1,173,600	
富山銀行	400	1,855.00	742,000	
滋賀銀行	3,800	2,246.00	8,534,800	
南都銀行	3,100	1,954.00	6,057,400	
百五銀行	19,400	323.00	6,266,200	
京都銀行	7,200	5,290.00	38,088,000	
紀陽銀行	6,900	1,381.00	9,528,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	12,500	802.00	10,025,000	

山陰合同銀行	12,200	637.00	7,771,400	
中国銀行	16,400	907.00	14,874,800	
鳥取銀行	700	1,197.00	837,900	
伊予銀行	26,500	606.00	16,059,000	
百十四銀行	2,100	1,705.00	3,580,500	
四国銀行	3,100	789.00	2,445,900	
阿波銀行	3,100	2,021.00	6,265,100	
大分銀行	1,200	1,755.00	2,106,000	
宮崎銀行	1,300	2,025.00	2,632,500	
佐賀銀行	1,200	1,428.00	1,713,600	
琉球銀行	4,600	778.00	3,578,800	
セブン銀行	62,600	239.00	14,961,400	
みずほフィナンシャルグループ	264,200	1,499.00	396,035,800	
高知銀行	700	749.00	524,300	
山口フィナンシャルグループ	23,400	697.00	16,309,800	
長野銀行	700	1,281.00	896,700	
名古屋銀行	1,400	2,990.00	4,186,000	
北洋銀行	30,000	222.00	6,660,000	
愛知銀行	700	4,935.00	3,454,500	
中京銀行	700	1,564.00	1,094,800	
大光銀行	700	1,323.00	926,100	
愛媛銀行	2,900	855.00	2,479,500	
トマト銀行	700	1,019.00	713,300	
京葉銀行	8,800	457.00	4,021,600	
栃木銀行	9,900	231.00	2,286,900	
北日本銀行	600	1,557.00	934,200	
東和銀行	3,600	512.00	1,843,200	
福島銀行	2,400	208.00	499,200	
大東銀行	1,000	650.00	650,000	
トモニホールディングス	15,900	311.00	4,944,900	
フィデアホールディングス	1,900	1,235.00	2,346,500	
池田泉州ホールディングス	23,600	183.00	4,318,800	
F P G	7,100	804.00	5,708,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,600	1,188.00	1,900,800	
マーキュリアホールディングス	900	568.00	511,200	
S B Iホールディングス	26,000	2,675.00	69,550,000	
日本アジア投資	1,700	231.00	392,700	
ジャフコ グループ	8,100	1,522.00	12,328,200	
大和証券グループ本社	154,200	614.60	94,771,320	

野村ホールディングス	322,100	473.90	152,643,190	
岡三証券グループ	16,100	347.00	5,586,700	
丸三証券	6,300	480.00	3,024,000	
東洋証券	6,800	180.00	1,224,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	23,100	367.00	8,477,700	
光世証券	400	452.00	180,800	
水戸証券	5,500	258.00	1,419,000	
いちよし証券	3,900	602.00	2,347,800	
松井証券	10,300	841.00	8,662,300	
マネックスグループ	17,400	478.00	8,317,200	
極東証券	2,700	677.00	1,827,900	
岩井コスモホールディングス	2,000	1,209.00	2,418,000	
アイザワ証券グループ	3,300	652.00	2,151,600	
マネーパートナーズグループ	2,200	234.00	514,800	
スパークス・グループ	9,700	245.00	2,376,500	
小林洋行	800	220.00	176,000	
かんぼ生命保険	21,200	2,143.00	45,431,600	
S O M P Oホールディングス	33,100	5,007.00	165,731,700	
アニコム ホールディングス	6,500	659.00	4,283,500	
M S & A Dインシュアランスグループホール	46,000	3,786.00	174,156,000	
第一生命ホールディングス	98,200	2,524.00	247,856,800	
東京海上ホールディングス	64,700	6,852.00	443,324,400	
T & Dホールディングス	52,200	1,499.00	78,247,800	
アドバンスクリエイト	1,000	924.00	924,000	
全国保証	5,000	4,365.00	21,825,000	
あんしん保証	800	271.00	216,800	
ジェイリース	700	1,663.00	1,164,100	
イントラスト	900	539.00	485,100	
日本モーゲージサービス	1,200	943.00	1,131,600	
C a s a	700	805.00	563,500	
アルヒ	3,100	1,001.00	3,103,100	
プレミアグループ	1,100	3,675.00	4,042,500	
ネットプロテクションズホールディングス	6,400	547.00	3,500,800	
クレディセゾン	13,100	1,502.00	19,676,200	
芙蓉総合リース	2,100	7,310.00	15,351,000	
みずほリース	3,000	2,971.00	8,913,000	
東京センチュリー	3,800	4,165.00	15,827,000	

日本証券金融	8,300	902.00	7,486,600	
アイフル	35,400	348.00	12,319,200	
リコーリース	1,900	3,390.00	6,441,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,500	1,172.00	13,478,000	
アコム	41,600	326.00	13,561,600	
ジャックス	2,300	3,255.00	7,486,500	
オリエントコーポレーション	57,100	123.00	7,023,300	
オリックス	125,300	2,253.50	282,363,550	
三菱H C キャピタル	74,700	573.00	42,803,100	
九州リースサービス	1,000	580.00	580,000	
日本取引所グループ	51,500	1,895.00	97,592,500	
イー・ギャランティ	3,100	1,934.00	5,995,400	
アサックス	1,100	583.00	641,300	
NECキャピタルソリューション	900	1,923.00	1,730,700	
いちご	23,500	288.00	6,768,000	
日本駐車場開発	22,400	157.00	3,516,800	
スター・マイカ・ホールディングス	1,100	1,490.00	1,639,000	
SREホールディングス	500	2,019.00	1,009,500	
ADワークスグループ	4,200	147.00	617,400	
ヒューリック	48,900	1,029.00	50,318,100	
三栄建築設計	800	1,602.00	1,281,600	
野村不動産ホールディングス	10,900	3,095.00	33,735,500	
三重交通グループホールディングス	4,300	463.00	1,990,900	
サムティ	3,300	2,009.00	6,629,700	
ディア・ライフ	2,700	521.00	1,406,700	
コーセーアールイー	600	631.00	378,600	
地主	1,300	1,995.00	2,593,500	
プレサンスコーポレーション	2,600	1,468.00	3,816,800	
ハウスコム	400	1,121.00	448,400	
日本管理センター	1,000	988.00	988,000	
サンセイランディック	600	831.00	498,600	
エストラスト	200	545.00	109,000	
フージャースホールディングス	2,700	771.00	2,081,700	
オープンハウスグループ	6,700	4,980.00	33,366,000	
東急不動産ホールディングス	60,600	655.00	39,693,000	
飯田グループホールディングス	17,600	1,954.00	34,390,400	
イーグランド	300	1,361.00	408,300	
ムゲンエステート	1,300	498.00	647,400	
ビーロット	1,400	490.00	686,000	

ファーストブラザーズ	500	828.00	414,000	
And Doホールディングス	1,000	873.00	873,000	
シーアールイー	700	1,468.00	1,027,600	
プロパティエージェント	200	1,528.00	305,600	
ケイアイスター不動産	900	4,975.00	4,477,500	
アグレ都市デザイン	300	1,564.00	469,200	
グッドコムアセット	900	1,104.00	993,600	
ジェイ・エス・ビー	400	3,310.00	1,324,000	
ロードスターキャピタル	500	1,427.00	713,500	
テンポイノベーション	600	819.00	491,400	
グローバル・リンク・マネジメント	400	919.00	367,600	
フェイスネットワーク	300	1,304.00	391,200	
パーク24	12,500	1,937.00	24,212,500	
パラカ	600	1,723.00	1,033,800	
三井不動産	91,300	2,693.50	245,916,550	
三菱地所	132,400	1,817.50	240,637,000	
平和不動産	3,500	3,790.00	13,265,000	
東京建物	19,900	1,767.00	35,163,300	
京阪神ビルディング	3,100	1,191.00	3,692,100	
住友不動産	42,200	3,279.00	138,373,800	
テーオーシー	3,600	612.00	2,203,200	
東京楽天地	300	4,005.00	1,201,500	
レオパレス21	21,900	254.00	5,562,600	
スターツコーポレーション	2,900	2,277.00	6,603,300	
フジ住宅	2,400	617.00	1,480,800	
空港施設	2,100	525.00	1,102,500	
明和地所	1,000	598.00	598,000	
ゴールドクレスト	1,700	1,606.00	2,730,200	
エスリード	800	1,646.00	1,316,800	
日神グループホールディングス	3,400	447.00	1,519,800	
日本エスコン	3,900	732.00	2,854,800	
タカラレーベン	8,800	309.00	2,719,200	
AVANTIA	1,100	824.00	906,400	
イオンモール	10,600	1,558.00	16,514,800	
毎日コムネット	700	705.00	493,500	
ファースト住建	800	1,082.00	865,600	
カチタス	5,200	2,715.00	14,118,000	
トーセイ	2,900	1,101.00	3,192,900	
穴吹興産	500	2,230.00	1,115,000	

サンフロンティア不動産	2,900	1,042.00	3,021,800	
F Jネクストホールディングス	2,100	1,033.00	2,169,300	
インテリックス	500	638.00	319,000	
ランドビジネス	800	240.00	192,000	
サンネクスタグループ	700	1,190.00	833,000	
グランディハウス	1,400	523.00	732,200	
日本空港ビルデング	7,600	5,150.00	39,140,000	
明豊ファシリティワークス	900	602.00	541,800	
日本工営	1,300	2,904.00	3,775,200	
L I F U L L	6,200	181.00	1,122,200	
ミクシィ	4,700	2,010.00	9,447,000	
ジェイエシーリクルートメント	1,600	1,729.00	2,766,400	
日本M & Aセンターホールディングス	33,500	1,357.00	45,459,500	
メンバーズ	600	3,105.00	1,863,000	
中広	300	384.00	115,200	
U Tグループ	2,900	2,417.00	7,009,300	
アイティメディア	1,000	1,688.00	1,688,000	
E・Jホールディングス	1,200	1,157.00	1,388,400	
夢真ピーネックスグループ	6,700	1,418.00	9,500,600	
コシダカホールディングス	5,500	763.00	4,196,500	
アルトナー	500	839.00	419,500	
パソナグループ	2,200	1,950.00	4,290,000	
C D S	500	1,935.00	967,500	
リンクアンドモチベーション	4,500	447.00	2,011,500	
エス・エム・エス	6,900	3,070.00	21,183,000	
サニーサイドアップグループ	700	643.00	450,100	
パーソルホールディングス	20,400	2,465.00	50,286,000	
リニカル	1,100	808.00	888,800	
クックパッド	6,400	233.00	1,491,200	
エスクリ	900	402.00	361,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,000	583.00	583,000	
学情	800	935.00	748,000	
スタジオアリス	900	2,230.00	2,007,000	
シミックホールディングス	1,100	1,387.00	1,525,700	
エブコ	400	701.00	280,400	
N J S	500	2,044.00	1,022,000	
総合警備保障	7,900	3,660.00	28,914,000	
カカクコム	15,000	2,686.00	40,290,000	
セントケア・ホールディング	1,300	780.00	1,014,000	

サイネックス	300	589.00	176,700
ルネサンス	1,400	913.00	1,278,200
ディップ	3,600	3,835.00	13,806,000
デジタルホールディングス	1,400	1,310.00	1,834,000
新日本科学	2,500	1,331.00	3,327,500
キャリアデザインセンター	500	1,043.00	521,500
ベネフィット・ワン	7,400	1,885.00	13,949,000
エムスリー	36,100	3,843.00	138,732,300
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	315.00	409,500
プラス	300	739.00	221,700
アウトソーシング	11,700	1,172.00	13,712,400
ウェルネット	2,000	457.00	914,000
ワールドホールディングス	800	2,272.00	1,817,600
ディー・エヌ・エー	7,800	1,920.00	14,976,000
博報堂D Yホールディングス	27,600	1,390.00	38,364,000
ぐるなび	3,200	409.00	1,308,800
タカミヤ	2,500	330.00	825,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	777.00	1,010,100
ファンコミュニケーションズ	4,900	424.00	2,077,600
ライク	700	2,074.00	1,451,800
ビジネス・ブレークスルー	800	420.00	336,000
エスプール	5,800	1,253.00	7,267,400
W D Bホールディングス	900	2,290.00	2,061,000
ティア	1,200	433.00	519,600
C D G	200	1,292.00	258,400
アドウェイズ	3,100	771.00	2,390,100
バリューコマース	1,600	3,105.00	4,968,000
インフォマート	22,400	495.00	11,088,000
J Pホールディングス	5,300	217.00	1,150,100
C Lホールディングス	400	968.00	387,200
プレステージ・インターナショナル	7,700	630.00	4,851,000
アミューズ	1,100	1,980.00	2,178,000
ドリームインキュベータ	600	2,024.00	1,214,400
クイック	1,400	1,435.00	2,009,000
T A C	1,100	225.00	247,500
電通グループ	20,400	4,705.00	95,982,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,000	1,522.00	1,522,000
ぴあ	700	3,070.00	2,149,000
イオンファンタジー	800	2,111.00	1,688,800

シーティーエス	2,300	839.00	1,929,700	
ネクシィーズグループ	700	527.00	368,900	
H.U.グループホールディングス	5,300	2,716.00	14,394,800	
アルプス技研	1,600	1,800.00	2,880,000	
ダイオーズ	400	1,047.00	418,800	
日本空調サービス	2,100	782.00	1,642,200	
オリエンタルランド	23,300	17,935.00	417,885,500	
ダスキン	4,600	2,728.00	12,548,800	
明光ネットワークジャパン	2,400	579.00	1,389,600	
ファルコホールディングス	900	2,111.00	1,899,900	
秀英予備校	400	422.00	168,800	
ラウンドワン	5,700	1,534.00	8,743,800	
リゾートトラスト	9,100	1,936.00	17,617,600	
ビー・エム・エル	2,600	3,445.00	8,957,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,053.00	3,159,000	
リソー教育	9,300	341.00	3,171,300	
早稲田アカデミー	1,100	1,067.00	1,173,700	
ユー・エス・エス	22,900	2,514.00	57,570,600	
東京個別指導学院	1,800	581.00	1,045,800	
サイバーエージェント	48,100	1,388.00	66,762,800	
楽天グループ	101,700	802.00	81,563,400	
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,913.00	2,104,300	
モーニングスター	3,600	514.00	1,850,400	
テー・オー・ダブリュー	3,900	329.00	1,283,100	
山田コンサルティンググループ	1,100	1,169.00	1,285,900	
セントラルスポーツ	800	2,352.00	1,881,600	
フルキャストホールディングス	1,700	2,289.00	3,891,300	
エン・ジャパン	3,400	2,063.00	7,014,200	
リソルホールディングス	200	4,475.00	895,000	
テクノプロ・ホールディングス	12,200	2,966.00	36,185,200	
アトラグループ	500	249.00	124,500	
インターワークス	600	372.00	223,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	3,900.00	3,510,000	
KeepPer 技研	1,300	2,644.00	3,437,200	
ファーストロジック	400	772.00	308,800	
三機サービス	400	1,183.00	473,200	
Gunosy	1,100	931.00	1,024,100	
デザインワン・ジャパン	500	174.00	87,000	
イー・ガーディアン	800	2,942.00	2,353,600	

リブセンス	1,100	156.00	171,600
ジャパンマテリアル	6,300	1,858.00	11,705,400
ベクトル	2,900	1,137.00	3,297,300
ウチヤマホールディングス	1,000	285.00	285,000
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,110.00	1,665,000
キャリアリンク	800	1,770.00	1,416,000
I B J	1,700	709.00	1,205,300
アサンテ	900	1,480.00	1,332,000
バリューHR	1,700	1,247.00	2,119,900
M & A キャピタルパートナーズ	1,700	3,060.00	5,202,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,197.00	957,600
E R I ホールディングス	600	1,265.00	759,000
アビスト	300	2,808.00	842,400
シグマクシス・ホールディングス	2,500	1,037.00	2,592,500
ウィルグループ	1,500	1,114.00	1,671,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	167.00	417,500
メドピア	1,500	1,981.00	2,971,500
レアジョブ	400	716.00	286,400
リクルートホールディングス	153,900	4,692.00	722,098,800
エラン	2,800	994.00	2,783,200
土木管理総合試験所	900	321.00	288,900
ネットマーケティング	1,000	717.00	717,000
日本郵政	255,800	943.00	241,219,400
ベルシステム24ホールディングス	2,900	1,416.00	4,106,400
鎌倉新書	2,300	566.00	1,301,800
S M N	400	588.00	235,200
一蔵	300	440.00	132,000
グローバルキッズCOMPANY	400	687.00	274,800
エアトリ	1,300	2,893.00	3,760,900
アトラエ	1,400	1,313.00	1,838,200
ストライク	800	3,855.00	3,084,000
ソラスト	5,000	737.00	3,685,000
セラク	600	1,158.00	694,800
インソース	2,100	2,017.00	4,235,700
ベイカレント・コンサルティング	1,400	41,800.00	58,520,000
Orchestra Holdings	400	2,679.00	1,071,600
アイモバイル	700	1,302.00	911,400
キャリアインデックス	700	576.00	403,200
MS - Japan	800	792.00	633,600

船場	400	681.00	272,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングン	6,500	1,549.00	10,068,500
フルテック	300	1,308.00	392,400
グリーンズ	800	641.00	512,800
ツナググループ・ホールディングス	500	261.00	130,500
GameWith	600	461.00	276,600
MS&Consulting	300	696.00	208,800
ウェルビー	1,300	790.00	1,027,000
エル・ティー・エス	300	3,250.00	975,000
ミダックホールディングス	900	2,496.00	2,246,400
日総工産	1,600	579.00	926,400
キュービーネットホールディングス	900	1,347.00	1,212,300
RPAホールディングス	2,900	367.00	1,064,300
スプリックス	600	1,013.00	607,800
マネジメントソリューションズ	1,000	4,560.00	4,560,000
プロレド・パートナーズ	400	566.00	226,400
and factory	500	413.00	206,500
テノ・ホールディングス	200	610.00	122,000
フロンティア・マネジメント	500	1,079.00	539,500
ピアラ	300	858.00	257,400
コプロ・ホールディングス	400	879.00	351,600
ギークス	400	872.00	348,800
カーブスホールディングス	5,600	698.00	3,908,800
フォーラムエンジニアリング	1,400	940.00	1,316,000
Fast Fitness Japan	400	1,662.00	664,800
ダイレクトマーケティングミックス	2,300	1,972.00	4,535,600
ポピンズ	500	1,988.00	994,000
LITALICO	1,700	2,526.00	4,294,200
アドバンテッジリスクマネジメント	1,000	471.00	471,000
リログループ	11,200	1,987.00	22,254,400
東祥	1,500	1,342.00	2,013,000
ビーウィズ	500	1,405.00	702,500
TREホールディングス	3,100	2,064.00	6,398,400
人・夢・技術グループ	800	2,275.00	1,820,000
エイチ・アイ・エス	4,400	2,072.00	9,116,800
ラックランド	600	2,975.00	1,785,000
共立メンテナンス	3,600	4,720.00	16,992,000
イチネンホールディングス	2,100	1,214.00	2,549,400

建設技術研究所	1,200	2,424.00	2,908,800	
スペース	1,400	905.00	1,267,000	
燦ホールディングス	900	1,756.00	1,580,400	
スバル興業	100	8,390.00	839,000	
東京テアトル	800	1,209.00	967,200	
タナベ経営	800	654.00	523,200	
ナガワ	600	9,030.00	5,418,000	
東京都競馬	1,500	3,660.00	5,490,000	
常磐興産	800	1,269.00	1,015,200	
カナモト	3,500	1,879.00	6,576,500	
西尾レントオール	1,800	2,765.00	4,977,000	
トランス・コスモス	2,600	3,135.00	8,151,000	
乃村工藝社	8,800	860.00	7,568,000	
藤田観光	900	2,388.00	2,149,200	
KNT-CTホールディングス	1,300	1,630.00	2,119,000	
日本管財	2,200	2,523.00	5,550,600	
トーカイ	1,700	1,670.00	2,839,000	
白洋舎	200	1,302.00	260,400	
セコム	20,100	8,436.00	169,563,600	
セントラル警備保障	1,000	2,209.00	2,209,000	
丹青社	4,100	775.00	3,177,500	
メイテック	2,400	6,750.00	16,200,000	
応用地質	2,200	1,719.00	3,781,800	
船井総研ホールディングス	4,100	2,023.00	8,294,300	
進学会ホールディングス	700	331.00	231,700	
オオバ	1,400	758.00	1,061,200	
いであ	500	1,799.00	899,500	
学究社	700	1,609.00	1,126,300	
ベネッセホールディングス	6,800	2,100.00	14,280,000	
イオンディライト	2,500	2,824.00	7,060,000	
ナック	1,000	941.00	941,000	
ダイセキ	3,700	4,675.00	17,297,500	
ステップ	700	1,706.00	1,194,200	
小計	銘柄数：2,154 組入時価比率：98.2%		53,365,087,440 100.0%	
合計			53,365,087,440	

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日立国内債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	673,726,662	357,381,949
国債証券	69,607,429,050	61,570,383,050
地方債証券	6,893,487,550	6,637,108,880
特殊債券	8,261,196,100	6,096,760,502
社債券	5,115,231,000	5,770,870,000
未収入金	1,006,301,100	138,199,200
未収利息	193,050,383	175,494,094
前払費用	2,421,102	3,566,951
流動資産合計	91,752,842,947	80,749,764,626
資産合計	91,752,842,947	80,749,764,626
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,035,600,000	75,700,000
未払利息	1,845	979
流動負債合計	1,035,601,845	75,700,979
負債合計	1,035,601,845	75,700,979
純資産の部		
元本等		
元本	64,207,713,413	58,203,603,881
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,509,527,689	22,470,459,766
元本等合計	90,717,241,102	80,674,063,647
純資産合計	90,717,241,102	80,674,063,647
負債純資産合計	91,752,842,947	80,749,764,626

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	64,207,713,413口	58,203,603,881口
1口当たり純資産額	1.4129円	1.3861円
(1万口当たり純資産額)	(14,129円)	(13,861円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p>
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。</p> <p>また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。</p> <p>なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価に関する事項

項目	2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	158,143,350	400,177,650
地方債証券	2,318,440	11,614,500
特殊債券	4,141,694	13,046,981
社債券	7,892,000	3,800,000
合計	172,495,484	428,639,131

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	64,108,529,684円	64,207,713,413円
期中追加設定元本額	7,469,285,889円	3,535,856,086円
期中一部解約元本額	7,370,102,160円	9,539,965,618円
期末元本額	64,207,713,413円	58,203,603,881円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	3,893,114,794円	4,256,205,329円
日立バランスファンド（株式50）	6,883,814,197円	7,193,790,496円
日立バランスファンド（株式30）	3,745,494,128円	3,785,862,328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）	39,308,890,484円	32,982,846,478円
日立国内債券インデックスファンド	10,376,399,810円	9,984,899,250円

（注）*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	第4 2 8 回利付国債（2年）	150,000,000	150,165,000	
		第4 2 9 回利付国債（2年）	130,000,000	130,152,100	
		第4 3 1 回利付国債（2年）	390,000,000	390,510,900	
		第4 3 2 回利付国債（2年）	120,000,000	120,156,000	
		第4 3 3 回利付国債（2年）	700,000,000	700,896,000	
		第4 3 4 回利付国債（2年）	590,000,000	590,790,600	
		第1 3 6 回利付国債（5年）	100,000,000	100,202,000	
		第1 3 7 回利付国債（5年）	100,000,000	100,242,000	
		第1 3 8 回利付国債（5年）	500,000,000	501,395,000	
		第1 3 9 回利付国債（5年）	550,000,000	551,672,000	
		第1 4 0 回利付国債（5年）	240,000,000	240,777,600	
		第1 4 1 回利付国債（5年）	90,000,000	90,316,800	
		第1 4 2 回利付国債（5年）	150,000,000	150,583,500	
		第1 4 3 回利付国債（5年）	950,000,000	954,047,000	
		第1 4 4 回利付国債（5年）	540,000,000	542,424,600	
		第1 4 5 回利付国債（5年）	400,000,000	401,872,000	
		第1 4 9 回利付国債（5年）	330,000,000	330,214,500	
		第1 5 0 回利付国債（5年）	400,000,000	400,180,000	
		第1 回利付国債（40年）	180,000,000	241,155,000	
		第2 回利付国債（40年）	160,000,000	207,432,000	
		第3 回利付国債（40年）	130,000,000	169,509,600	
		第4 回利付国債（40年）	130,000,000	169,863,200	
		第5 回利付国債（40年）	190,000,000	238,881,300	
		第6 回利付国債（40年）	180,000,000	222,645,600	
		第7 回利付国債（40年）	125,000,000	148,280,000	
		第8 回利付国債（40年）	165,000,000	182,443,800	
第9 回利付国債（40年）	240,000,000	197,109,600			
第1 0 回利付国債（40年）	220,000,000	211,580,600			
第1 1 回利付国債（40年）	200,000,000	185,770,000			
第1 2 回利付国債（40年）	165,000,000	137,601,750			

第13回利付国債(40年)	440,000,000	365,068,000	
第14回利付国債(40年)	490,000,000	434,296,800	
第329回利付国債(10年)	440,000,000	444,259,200	
第330回利付国債(10年)	700,000,000	708,295,000	
第331回利付国債(10年)	300,000,000	302,745,000	
第332回利付国債(10年)	250,000,000	252,692,500	
第333回利付国債(10年)	80,000,000	80,980,000	
第334回利付国債(10年)	140,000,000	141,920,800	
第335回利付国債(10年)	200,000,000	202,582,000	
第336回利付国債(10年)	200,000,000	202,856,000	
第337回利付国債(10年)	250,000,000	252,272,500	
第338回利付国債(10年)	360,000,000	364,608,000	
第339回利付国債(10年)	50,000,000	50,689,000	
第340回利付国債(10年)	120,000,000	121,767,600	
第341回利付国債(10年)	670,000,000	678,073,500	
第342回利付国債(10年)	430,000,000	432,064,000	
第343回利付国債(10年)	220,000,000	221,080,200	
第344回利付国債(10年)	490,000,000	492,342,200	
第345回利付国債(10年)	260,000,000	261,253,200	
第346回利付国債(10年)	450,000,000	451,957,500	
第347回利付国債(10年)	500,000,000	502,035,000	
第348回利付国債(10年)	460,000,000	461,591,600	
第349回利付国債(10年)	630,000,000	631,751,400	
第350回利付国債(10年)	340,000,000	340,690,200	
第351回利付国債(10年)	180,000,000	180,217,800	
第352回利付国債(10年)	200,000,000	200,062,000	
第353回利付国債(10年)	660,000,000	659,564,400	
第354回利付国債(10年)	580,000,000	579,014,000	
第355回利付国債(10年)	500,000,000	498,595,000	
第356回利付国債(10年)	420,000,000	418,168,800	
第357回利付国債(10年)	380,000,000	377,860,600	
第358回利付国債(10年)	830,000,000	824,546,900	
第359回利付国債(10年)	370,000,000	367,199,100	
第360回利付国債(10年)	450,000,000	446,121,000	
第361回利付国債(10年)	550,000,000	544,659,500	
第362回利付国債(10年)	670,000,000	662,737,200	
第363回利付国債(10年)	280,000,000	276,634,400	
第364回利付国債(10年)	520,000,000	513,344,000	
第365回利付国債(10年)	820,000,000	809,233,400	

第1回利付国債(30年)	40,000,000	47,718,400	
第5回利付国債(30年)	5,000,000	5,877,050	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	84,217,700	
第8回利付国債(30年)	45,000,000	52,041,150	
第11回利付国債(30年)	135,000,000	155,206,800	
第12回利付国債(30年)	90,000,000	107,596,800	
第13回利付国債(30年)	70,000,000	83,054,300	
第14回利付国債(30年)	120,000,000	148,221,600	
第17回利付国債(30年)	160,000,000	199,084,800	
第18回利付国債(30年)	155,000,000	191,435,850	
第19回利付国債(30年)	110,000,000	136,171,200	
第20回利付国債(30年)	50,000,000	63,302,000	
第21回利付国債(30年)	100,000,000	124,337,000	
第23回利付国債(30年)	180,000,000	229,509,000	
第25回利付国債(30年)	260,000,000	325,650,000	
第26回利付国債(30年)	180,000,000	228,353,400	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	412,089,600	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	387,501,000	
第29回利付国債(30年)	290,000,000	371,292,800	
第30回利付国債(30年)	230,000,000	291,364,000	
第31回利付国債(30年)	220,000,000	275,514,800	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	273,462,800	
第33回利付国債(30年)	70,000,000	85,628,900	
第34回利付国債(30年)	300,000,000	378,051,000	
第35回利付国債(30年)	230,000,000	282,384,800	
第36回利付国債(30年)	170,000,000	209,047,300	
第37回利付国債(30年)	340,000,000	412,290,800	
第38回利付国債(30年)	180,000,000	215,033,400	
第39回利付国債(30年)	180,000,000	218,493,000	
第40回利付国債(30年)	150,000,000	179,308,500	
第41回利付国債(30年)	120,000,000	141,186,000	
第42回利付国債(30年)	200,000,000	235,436,000	
第43回利付国債(30年)	280,000,000	329,786,800	
第44回利付国債(30年)	130,000,000	153,194,600	
第45回利付国債(30年)	250,000,000	284,302,500	
第46回利付国債(30年)	320,000,000	363,961,600	
第47回利付国債(30年)	140,000,000	162,146,600	
第48回利付国債(30年)	200,000,000	223,166,000	
第49回利付国債(30年)	220,000,000	245,467,200	

第50回利付国債(30年)	300,000,000	295,851,000	
第51回利付国債(30年)	240,000,000	210,237,600	
第52回利付国債(30年)	260,000,000	238,516,200	
第53回利付国債(30年)	300,000,000	281,310,000	
第54回利付国債(30年)	320,000,000	313,500,800	
第55回利付国債(30年)	150,000,000	146,778,000	
第56回利付国債(30年)	300,000,000	293,202,000	
第57回利付国債(30年)	260,000,000	253,536,400	
第58回利付国債(30年)	300,000,000	291,873,000	
第59回利付国債(30年)	250,000,000	236,930,000	
第60回利付国債(30年)	160,000,000	158,648,000	
第61回利付国債(30年)	210,000,000	198,011,100	
第62回利付国債(30年)	210,000,000	187,779,900	
第63回利付国債(30年)	260,000,000	225,542,200	
第64回利付国債(30年)	230,000,000	199,083,400	
第65回利付国債(30年)	240,000,000	207,732,000	
第66回利付国債(30年)	230,000,000	198,862,600	
第67回利付国債(30年)	140,000,000	127,437,800	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	127,209,600	
第69回利付国債(30年)	100,000,000	93,225,000	
第71回利付国債(30年)	20,000,000	18,584,800	
第72回利付国債(30年)	130,000,000	120,603,600	
第73回利付国債(30年)	200,000,000	185,240,000	
第62回利付国債(20年)	230,000,000	232,226,400	
第64回利付国債(20年)	160,000,000	164,265,600	
第65回利付国債(20年)	230,000,000	237,249,600	
第66回利付国債(20年)	230,000,000	236,883,900	
第68回利付国債(20年)	85,000,000	88,548,750	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	124,788,000	
第70回利付国債(20年)	150,000,000	157,716,000	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	104,725,000	
第72回利付国債(20年)	90,000,000	94,543,200	
第75回利付国債(20年)	110,000,000	116,728,700	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	253,315,200	
第78回利付国債(20年)	190,000,000	201,445,600	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	106,334,000	
第80回利付国債(20年)	180,000,000	191,959,200	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	192,299,400	
第82回利付国債(20年)	260,000,000	278,636,800	

第83回利付国債(20年)	200,000,000	215,366,000	
第84回利付国債(20年)	140,000,000	150,253,600	
第85回利付国債(20年)	200,000,000	216,340,000	
第86回利付国債(20年)	250,000,000	272,347,500	
第87回利付国債(20年)	500,000,000	542,770,000	
第88回利付国債(20年)	250,000,000	273,757,500	
第89回利付国債(20年)	200,000,000	218,188,000	
第90回利付国債(20年)	270,000,000	295,938,900	
第91回利付国債(20年)	60,000,000	66,024,600	
第92回利付国債(20年)	140,000,000	153,542,200	
第93回利付国債(20年)	200,000,000	219,258,000	
第94回利付国債(20年)	230,000,000	253,257,600	
第96回利付国債(20年)	90,000,000	99,523,800	
第97回利付国債(20年)	210,000,000	234,255,000	
第98回利付国債(20年)	20,000,000	22,203,400	
第99回利付国債(20年)	370,000,000	412,313,200	
第100回利付国債(20年)	450,000,000	506,052,000	
第102回利付国債(20年)	180,000,000	205,383,600	
第103回利付国債(20年)	150,000,000	170,242,500	
第105回利付国債(20年)	190,000,000	214,093,900	
第106回利付国債(20年)	160,000,000	181,299,200	
第107回利付国債(20年)	170,000,000	192,210,500	
第108回利付国債(20年)	200,000,000	223,510,000	
第109回利付国債(20年)	90,000,000	100,869,300	
第112回利付国債(20年)	320,000,000	364,304,000	
第113回利付国債(20年)	210,000,000	239,750,700	
第115回利付国債(20年)	120,000,000	138,315,600	
第116回利付国債(20年)	100,000,000	115,663,000	
第117回利付国債(20年)	220,000,000	252,755,800	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,447,200	
第119回利付国債(20年)	100,000,000	112,877,000	
第120回利付国債(20年)	100,000,000	111,282,000	
第121回利付国債(20年)	240,000,000	273,712,800	
第122回利付国債(20年)	60,000,000	67,935,600	
第123回利付国債(20年)	70,000,000	81,237,100	
第124回利付国債(20年)	180,000,000	207,374,400	
第125回利付国債(20年)	250,000,000	293,182,500	
第126回利付国債(20年)	120,000,000	138,644,400	
第127回利付国債(20年)	80,000,000	91,735,200	

第128回利付国債(20年)	100,000,000	114,976,000	
第129回利付国債(20年)	100,000,000	114,085,000	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	171,622,500	
第131回利付国債(20年)	150,000,000	170,250,000	
第132回利付国債(20年)	200,000,000	227,598,000	
第133回利付国債(20年)	300,000,000	344,214,000	
第134回利付国債(20年)	300,000,000	345,324,000	
第135回利付国債(20年)	230,000,000	262,535,800	
第136回利付国債(20年)	210,000,000	237,684,300	
第138回利付国債(20年)	100,000,000	112,361,000	
第139回利付国債(20年)	90,000,000	102,011,400	
第140回利付国債(20年)	290,000,000	331,902,100	
第141回利付国債(20年)	380,000,000	435,518,000	
第142回利付国債(20年)	120,000,000	138,766,800	
第143回利付国債(20年)	230,000,000	261,530,700	
第144回利付国債(20年)	250,000,000	281,645,000	
第145回利付国債(20年)	350,000,000	402,388,000	
第146回利付国債(20年)	380,000,000	437,406,600	
第147回利付国債(20年)	240,000,000	273,883,200	
第148回利付国債(20年)	240,000,000	271,380,000	
第149回利付国債(20年)	380,000,000	430,201,800	
第150回利付国債(20年)	430,000,000	481,999,900	
第151回利付国債(20年)	450,000,000	493,753,500	
第152回利付国債(20年)	455,000,000	499,453,500	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	299,859,300	
第154回利付国債(20年)	80,000,000	87,829,600	
第155回利付国債(20年)	110,000,000	117,901,300	
第156回利付国債(20年)	350,000,000	346,815,000	
第157回利付国債(20年)	240,000,000	230,822,400	
第158回利付国債(20年)	100,000,000	100,134,000	
第159回利付国債(20年)	120,000,000	121,632,000	
第160回利付国債(20年)	320,000,000	328,387,200	
第161回利付国債(20年)	190,000,000	191,991,200	
第162回利付国債(20年)	280,000,000	282,380,000	
第163回利付国債(20年)	280,000,000	281,806,000	
第164回利付国債(20年)	350,000,000	346,188,500	
第165回利付国債(20年)	340,000,000	335,501,800	
第166回利付国債(20年)	310,000,000	314,848,400	
第167回利付国債(20年)	320,000,000	314,220,800	

		第168回利付国債(20年)	220,000,000	211,972,200	
		第169回利付国債(20年)	280,000,000	264,516,000	
		第170回利付国債(20年)	250,000,000	235,442,500	
		第171回利付国債(20年)	210,000,000	197,148,000	
		第172回利付国債(20年)	180,000,000	171,570,600	
		第173回利付国債(20年)	230,000,000	218,741,500	
		第174回利付国債(20年)	310,000,000	293,923,400	
		第175回利付国債(20年)	280,000,000	269,676,400	
		第176回利付国債(20年)	190,000,000	182,609,000	
		第177回利付国債(20年)	150,000,000	141,231,000	
		第178回利付国債(20年)	300,000,000	287,328,000	
		第179回利付国債(20年)	310,000,000	296,251,500	
	小計	銘柄数: 237 組入時価比率: 76.3%	58,620,000,000	61,570,383,050 76.9%	
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	125,903,000	
		第734回東京都公募公債	100,000,000	101,101,000	
		第740回東京都公募公債	100,000,000	101,109,000	
		第741回東京都公募公債	100,000,000	101,149,000	
		平成26年度第15回北海道公募公債	200,000,000	202,248,000	
		平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	101,518,000	
		第3回神奈川県公募公債	100,000,000	106,417,000	
		第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,714,000	
		第201回神奈川県公募公債	100,000,000	100,936,000	
		第209回神奈川県公募公債	100,000,000	101,220,000	
		第251回神奈川県公募公債	100,000,000	98,924,000	
		第6回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	113,697,000	
		第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,228,000	
		第425回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,297,000	
		平成27年度第7回京都府公募公債	200,000,000	203,160,000	
		第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,707,000	
		平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,195,000	
		平成29年度第22回兵庫県公募公債	100,000,000	100,225,000	
		第5回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	105,671,000	
		平成26年度第9回静岡県公募公債	100,000,000	101,279,000	
		平成27年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,453,000	

		令和3年度第5回静岡県公募公債 (5年)	200,000,000	199,550,000	
		平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)	100,000,000	112,688,000	
		平成29年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,438,000	
		第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	113,629,000	
		平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,240,000	
		平成26年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,162,000	
		平成20年度第2回福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	112,047,000	
		平成26年度第1回福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	112,718,000	
		第14回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,933,000	
		平成30年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,040,000	
		平成28年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	100,000,000	99,977,000	
		平成30年度第2回大分県公募公債	100,000,000	100,599,000	
		第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,073,000	
		第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,991,000	
		第132回共同発行市場公募地方債	101,000,000	102,199,880	
		第136回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,546,000	
		第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,187,000	
		第143回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,161,000	
		第163回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,977,000	
		第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,618,000	
		第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,890,000	
		平成28年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,067,000	
		平成25年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	100,984,000	
		平成28年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	100,505,000	
		第19回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	108,016,000	
		第2回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	105,310,000	
		第2回京都市公募公債(20年)	100,000,000	106,927,000	
		平成29年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	100,547,000	
		第26回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,594,000	
		平成28年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	100,719,000	
		第1回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	107,514,000	
		平成25年度第9回札幌市公募公債 (10年)	100,000,000	101,068,000	
		第4回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	113,120,000	
		第87回川崎市公募公債	100,000,000	101,065,000	
		北九州市第1回15年公募公債	100,000,000	104,855,000	
		平成26年度第2回千葉市公募公債	300,000,000	303,606,000	
		平成29年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	100,397,000	
	小計	銘柄数: 58 組入時価比率: 8.2%	6,401,000,000	6,637,108,880 8.3%	
特殊債券	日本円	第22回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,030,000	

第16回政府保証原子力損害賠償・ 廃炉等支援機構債	200,000,000	200,062,000	
第23回政府保証株式会社日本政策 投資銀行社債	108,000,000	109,319,760	
第34回日本政策投資銀行債券	100,000,000	129,007,000	
第12回日本高速道路保有・債務返 済機構債券	100,000,000	110,044,000	
第33回日本高速道路債券・機構承 継債	100,000,000	128,226,000	
第55回日本高速道路保有・債務返 済機構債券	100,000,000	114,558,000	
第128回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	101,214,000	
第130回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	200,000,000	202,178,000	
第135回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	104,731,000	
第169回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	113,153,000	
第216回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	112,098,000	
第224回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	116,632,000	
第229回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	200,000,000	202,628,000	
第239回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	108,521,000	
第261回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	101,290,000	
第288回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	99,847,000	
第354回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	99,876,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機 構債券（8年）	100,000,000	100,328,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,929,000	
第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,328,000	
第23回公営企業債券（20年）	200,000,000	223,052,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,374,000	
第64回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	101,258,000	
第76回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	101,376,000	
第113回地方公共団体金融機構債 券	100,000,000	100,502,000	
第119回政府保証地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	98,976,000	
F197回地方公共団体金融機構債 券	100,000,000	104,994,000	

第26回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,094,000	
第31回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,258,000	
第93回都市再生債券	100,000,000	105,830,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	100,000,000	101,028,000	
第11回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	109,646,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,245,000	10,316,612	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,702,000	10,844,229	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,839,000	12,115,085	
第15回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,739,000	
第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,128,000	12,476,680	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,138,000	33,838,742	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,978,000	19,052,365	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,711,000	17,597,518	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,280,000	23,516,762	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,992,000	22,077,076	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,600,000	22,708,944	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,307,000	10,386,054	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,662,000	41,641,927	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,492,000	11,762,521	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,232,000	22,177,673	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,541,000	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,260,000	59,848,152	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,411,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	41,878,900	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,575,000	41,844,186	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,974,000	46,249,912	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,395,000	47,521,006	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,651,000	52,125,672	

		第99回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,202,000	
		第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,046,000	74,714,296	
		第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,026,000	75,882,310	
		第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,750,000	75,696,975	
		第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,774,000	80,549,448	
		第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,194,000	82,478,531	
		第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,264,000	84,177,736	
		第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,645,000	86,268,427	
		第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,795,000	89,345,003	
		第181回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,338,000	
		第198回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,366,000	
		い第853号商工債	100,000,000	99,734,000	
		い第857号商工債	100,000,000	99,668,000	
		第65回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,281,000	
	小計	銘柄数：70 組入時価比率：7.6%	5,803,747,000	6,096,760,502 7.6%	
社債券	日本円	クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債	100,000,000	100,615,000	
		第10回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201	100,000,000	100,030,000	
		第6回国際協力機構債券	100,000,000	114,892,000	
		第24回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人	100,000,000	101,313,000	
		第30回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人	100,000,000	100,320,000	
		第1回国際石油開発帝石株式会社無担保社債(社債間限定同順位特	100,000,000	99,773,000	
		第22回大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順	100,000,000	99,871,000	
		第6回日揮ホールディングス株式会社無担保社債(特定社債間限定	200,000,000	199,766,000	
		第16回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,599,000	
		第16回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債(特	100,000,000	99,584,000	

第13回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社	100,000,000	99,928,000	
第30回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,101,000	
第4回日本土地建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98,838,000	
第16回株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順	100,000,000	99,904,000	
第12回ヤフー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,364,000	
第33回住友金属鉱山株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約	100,000,000	99,466,000	
第11回株式会社LIXILグループ無担保社債(社債間限定同順	200,000,000	199,754,000	
第20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	99,888,000	
第38回三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	199,062,000	
第85回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	111,752,000	
株式会社三井住友フィナンシャルグループ第1回無担保劣後社債	100,000,000	101,059,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	199,976,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債(日本電信電話株	100,000,000	100,056,000	
第69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	200,000,000	199,150,000	
第76回三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位	100,000,000	98,714,000	
第71回三井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	99,012,000	
第5回イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,100,000	
第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順	100,000,000	113,194,000	
第130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	100,000,000	99,905,000	
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	111,157,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位	100,000,000	117,784,000	
第22回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,949,000	
第25回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,944,000	
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債(阪急電鉄	100,000,000	105,448,000	
第11回日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,693,000	

	第25回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,319,000	
	第522回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,153,000	
	第535回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,711,000	
	第402回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,232,000	
	第308回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,434,000	
	第321回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,145,000	
	第499回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,080,000	
	第508回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,965,000	
	第451回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,493,000	
	第72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	98,151,000	
	第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,201,000	
	第17回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,206,000	
	第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,504,000	
	第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	199,308,000	
	第17回北海道瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,064,000	
	第3回東京都競馬株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,943,000	
小計	銘柄数：51 組入時価比率：7.2%	5,700,000,000	5,770,870,000 7.2%	
	合計		80,075,122,432	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

日立外国株式インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,171,726,019	4,105,725,149
コール・ローン	359,294,406	159,612,591
株式	110,281,848,588	155,143,859,644
派生商品評価勘定	55,839,080	19,199,372
未収入金	124,392,498	9,225,950
未収配当金	115,157,057	224,793,167
差入委託証拠金	757,897,334	855,899,577
流動資産合計	113,866,154,982	160,518,315,450
資産合計	113,866,154,982	160,518,315,450
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,272,690	201,173,939
未払金	8,962,040	-
未払解約金	367,600,000	-
未払利息	984	437
流動負債合計	378,835,714	201,174,376
負債合計	378,835,714	201,174,376
純資産の部		
元本等		
元本	31,519,993,311	39,951,549,254
剰余金		
剰余金又は欠損金()	81,967,325,957	120,365,591,820
元本等合計	113,487,319,268	160,317,141,074
純資産合計	113,487,319,268	160,317,141,074
負債純資産合計	113,866,154,982	160,518,315,450

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	31,519,993,311口	39,951,549,254口
1口当たり純資産額	3.6005円	4.0128円
(1万口当たり純資産額)	(36,005円)	(40,128円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスクの管理体制	リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。 また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。 なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価に関する事項

項目	2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,740,385,805	19,842,281,216
合計	4,740,385,805	19,842,281,216

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16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）

（2021年 5月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
		契約額等	契約額等 うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,104,222,466	-	3,157,766,925	53,544,459
	S&P500 EMINI	2,258,937,172	-	2,304,244,822	45,307,650
	S&PTSE60 2106	123,440,873	-	125,423,640	1,982,767
	EURX50 2106	340,598,858	-	345,719,799	5,120,941
	FTSE100 2106	129,382,001	-	130,006,634	624,633
	SMI 2106	147,210,896	-	148,266,294	1,055,398
	SPI200 2106	104,652,666	-	104,105,736	546,930
	合計	3,104,222,466	-	3,157,766,925	53,544,459

(2022年 5月16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	5,340,856,570	-	5,157,667,808	183,188,762
	S&P500 EMINI	4,036,186,290	-	3,856,588,336	179,597,954
	S&PTSE60 2206	206,070,017	-	195,637,640	10,432,377
	EURX50 2206	564,422,917	-	566,296,080	1,873,163
	FTSE100 2206	193,901,035	-	199,974,848	6,073,813
	SMI 2206	179,111,358	-	180,357,984	1,246,626
	SPI200 2206	161,164,953	-	158,812,920	2,352,033
合計		5,340,856,570	-	5,157,667,808	183,188,762

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)

(2021年 5月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,000,000	-	23,000,096	96
	ドル	13,000,000	-	12,999,774	226
	スイスフラン	10,000,000	-	10,000,322	322
	売建	14,000,000	-	13,978,160	21,840
	ドル	14,000,000	-	13,978,160	21,840
合計		37,000,000	-	36,978,256	21,936

(2022年 5月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	220,000,000	-	221,214,212	1,214,212
	ドル	176,000,000	-	176,619,350	619,350
	カナダドル	16,000,000	-	16,234,252	234,252
	債券	17,000,000	-	17,184,873	184,873
	オーストラリアドル	11,000,000	-	11,175,737	175,737
	合計	220,000,000	-	221,214,212	1,214,212

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	42,749,029,356円	31,519,993,311円
期中追加設定元本額	1,906,620,217円	14,258,315,531円
期中一部解約元本額	13,135,656,262円	5,826,759,588円
期末元本額	31,519,993,311円	39,951,549,254円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	2,300,058,624円	2,148,409,075円
日立バランスファンド（株式50）	1,341,655,724円	1,187,774,679円
日立バランスファンド（株式30）	239,938,600円	206,967,725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）	15,099,616,423円	23,107,681,104円
日立外国株式インデックスファンド	12,538,723,940円	13,300,716,671円

（注）*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ドル	BAKER HUGHES CO	20,061	34.11	684,280.71	
	CHENIERE ENERGY INC	5,800	135.53	786,074.00	
	CHEVRON CORP	47,103	167.87	7,907,180.61	
	CONOCOPHILLIPS	32,162	102.91	3,309,791.42	
	COTERRA ENERGY INC	18,700	29.78	556,886.00	
	DEVON ENERGY CORP	15,600	68.70	1,071,720.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,200	133.43	560,406.00	
	EOG RESOURCES INC	14,300	124.28	1,777,204.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	103,522	88.86	9,198,964.92	
	HALLIBURTON CO	21,752	36.10	785,247.20	
	HESS CORP	6,800	114.27	777,036.00	
	KINDER MORGAN INC	49,457	18.74	926,824.18	
	MARATHON PETROLEUM CORP	14,951	95.88	1,433,501.88	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,752	64.08	1,457,948.16	
	ONEOK INC	10,800	64.65	698,220.00	
	PHILLIPS 66	11,650	94.60	1,102,090.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,600	261.89	1,466,584.00	
	SCHLUMBERGER LTD	34,161	40.74	1,391,719.14	
	VALERO ENERGY CORP	9,968	124.70	1,243,009.60	
	WILLIAMS COS INC	29,584	34.79	1,029,227.36	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,390	233.71	1,259,696.90	
	ALBEMARLE CORP	2,800	228.82	640,696.00	
	AMCOR PLC	25,200	12.77	321,804.00	
	AVERY DENNISON CORP	2,198	174.29	383,089.42	
	BALL CORP	7,852	69.75	547,677.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	2,600	142.52	370,552.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,200	103.86	540,072.00	
	CORTEVA INC	17,675	55.47	980,432.25	
	CROWN HOLDINGS INC	3,100	103.66	321,346.00	
	DOW INC	18,008	67.56	1,216,620.48	
DUPONT DE NEMOURS INC	12,568	64.14	806,111.52		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,200	103.05	329,760.00		

ECOLAB INC	6,300	161.99	1,020,537.00	
FMC CORP	3,100	116.77	361,987.00	
FREEMPORT-MCMORAN INC	35,827	35.04	1,255,378.08	
INTERNATIONAL PAPER CO	8,885	47.79	424,614.15	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,171	132.16	815,559.36	
LINDE PLC	11,994	308.77	3,703,387.38	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,500	106.72	693,680.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,540	332.84	512,573.60	
MOSAIC CO/THE	9,000	62.29	560,610.00	
NEWMONT CORP	19,553	65.25	1,275,833.25	
NUCOR CORP	6,944	123.79	859,597.76	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,300	155.40	357,420.00	
PPG INDUSTRIES INC	5,756	122.36	704,304.16	
RPM INTERNATIONAL INC	3,500	84.24	294,840.00	
SEALED AIR CORP	4,054	62.40	252,969.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO	6,105	273.33	1,668,679.65	
STEEL DYNAMICS INC	4,800	74.13	355,824.00	
VULCAN MATERIALS CO	3,251	168.02	546,233.02	
WESTROCK CO	6,273	46.21	289,875.33	
3M CO	14,076	149.30	2,101,546.80	
AERCAP HOLDINGS NV	3,700	44.69	165,353.00	
ALLEGION PLC	2,100	112.78	236,838.00	
AMETEK INC	5,650	121.04	683,876.00	
BOEING CO	13,576	127.20	1,726,867.20	
CARRIER GLOBAL CORP	19,935	40.19	801,187.65	
CATERPILLAR INC	13,220	204.33	2,701,242.60	
CUMMINS INC	3,500	201.12	703,920.00	
DEERE & CO	7,222	366.69	2,648,235.18	
DOVER CORP	3,500	132.83	464,905.00	
EATON CORP PLC	9,695	141.33	1,370,194.35	
EMERSON ELECTRIC CO	14,446	83.68	1,208,841.28	
FASTENAL CO	13,900	52.69	732,391.00	
FORTIVE CORP	8,208	58.50	480,168.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,700	69.65	257,705.00	
GENERAC HOLDINGS INC	1,500	226.49	339,735.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	5,786	226.31	1,309,429.66	
GENERAL ELECTRIC CO	26,805	75.05	2,011,715.25	
GRAINGER (W W) INC	1,023	477.33	488,308.59	
HEICO CORP	900	137.22	123,498.00	

HEICO CORP-CLASS A	1,700	111.48	189,516.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	16,769	193.53	3,245,304.57
HOWMET AEROSPACE INC	10,434	33.79	352,564.86
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,100	203.78	224,158.00
IDEX CORP	1,800	186.17	335,106.00
ILLINOIS TOOL WORKS	7,616	207.64	1,581,386.24
INGERSOLL-RAND INC	9,865	43.65	430,607.25
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,200	52.09	270,868.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	17,116	52.21	893,626.36
KORNIT DIGITAL LTD	1,300	43.88	57,044.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4,810	236.18	1,136,025.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	900	221.63	199,467.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	6,057	435.17	2,635,824.69
MASCO CORP	6,670	55.37	369,317.90
NORDSON CORP	1,400	211.97	296,758.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,700	452.83	1,675,471.00
OTIS WORLDWIDE CORP	9,817	75.11	737,354.87
OWENS CORNING	2,800	93.22	261,016.00
PACCAR INC	8,375	83.75	701,406.25
PARKER HANNIFIN CORP	3,166	265.35	840,098.10
PENTAIR PLC	3,892	50.02	194,677.84
PLUG POWER INC	12,200	15.03	183,366.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	36,596	91.92	3,363,904.32
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,831	203.82	577,014.42
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,800	45.08	171,304.00
SMITH (A.O.) CORP	3,200	60.01	192,032.00
SNAP-ON INC	1,300	216.49	281,437.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,983	121.61	484,372.63
SUNRUN INC	3,500	21.07	73,745.00
TEXTRON INC	5,284	63.36	334,794.24
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5,741	137.98	792,143.18
TRANSDIGM GROUP INC	1,300	563.81	732,953.00
UNITED RENTALS INC	1,800	288.44	519,192.00
WABTEC CORP	4,279	86.79	371,374.41
XYLEM INC	4,848	83.91	406,795.68
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,200	80.53	257,696.00
CINTAS CORP	2,274	375.97	854,955.78
CLARIVATE PLC	8,400	14.35	120,540.00
COPART INC	5,200	111.96	582,192.00

COSTAR GROUP INC	9,600	58.19	558,624.00	
EQUIFAX INC	2,998	198.19	594,173.62	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,100	133.08	412,548.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,600	101.64	365,904.00	
REPUBLIC SERVICES INC	5,345	130.89	699,607.05	
ROBERT HARF INTL INC	3,044	93.49	284,583.56	
ROLLINS INC	6,000	34.05	204,300.00	
TRANSUNION	4,600	83.71	385,066.00	
VERISK ANALYTICS INC	3,700	176.21	651,977.00	
WASTE CONNECTIONS INC	6,326	125.93	796,633.18	
WASTE MANAGEMENT INC	10,235	157.90	1,616,106.50	
AMERCO	300	530.37	159,111.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,100	105.79	327,949.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,791	69.31	193,444.21	
CSX CORP	54,058	33.43	1,807,158.94	
DELTA AIR LINES INC	4,400	38.33	168,652.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,100	111.59	457,519.00	
FEDEX CORPORATION	6,145	211.29	1,298,377.05	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	29,700	2.82	83,754.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,000	176.44	352,880.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,300	47.72	205,196.00	
LYFT INC-A	6,200	20.00	124,000.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,878	249.32	1,465,502.96	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,400	273.12	655,488.00	
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	3,962	42.99	170,326.38	
UBER TECHNOLOGIES INC	35,400	24.39	863,406.00	
UNION PACIFIC CORP	15,724	230.76	3,628,470.24	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17,815	178.04	3,171,782.60	
APTIV PLC	6,600	98.13	647,658.00	
BORGWARNER INC	6,500	38.40	249,600.00	
FORD MOTOR COMPANY	95,645	13.50	1,291,207.50	
GENERAL MOTORS CO	31,800	38.21	1,215,078.00	
LEAR CORP	1,600	132.64	212,224.00	
LUCID GROUP INC	10,900	18.01	196,309.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	4,700	26.70	125,490.00	
TESLA, INC.	20,870	769.59	16,061,343.30	
DR HORTON INC	8,233	68.53	564,207.49	
GARMIN LTD	3,700	101.36	375,032.00	
HASBRO INC	3,500	92.10	322,350.00	

LENNAR CORP-A	6,600	76.76	506,616.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,900	309.29	896,941.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,600	139.38	223,008.00
NEWELL BRANDS INC	10,427	22.69	236,588.63
NIKE INC -CL B	31,168	113.01	3,522,295.68
NVR INC	80	4,293.57	343,485.60
PELOTON INTERACTIVE INC-A	7,600	15.87	120,612.00
PULTE GROUP INC	7,000	42.53	297,710.00
VF CORP	8,016	47.59	381,481.44
WHIRLPOOL CORP	1,660	182.96	303,713.60
AIRBNB INC-CLASS A	7,200	121.45	874,440.00
ARAMARK	6,300	33.64	211,932.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,000	2,101.89	2,101,890.00
CAESARS ENTERTAINMENT INC	5,100	54.99	280,449.00
CARNIVAL CORP	20,003	14.28	285,642.84
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	680	1,318.28	896,430.40
DARDEN RESTAURANTS INC	3,100	128.07	397,017.00
DOMINO'S PIZZA INC	900	340.94	306,846.00
DRAFTKINGS INC	8,800	12.61	110,968.00
EXPEDIA GROUP INC	3,500	131.78	461,230.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,733	136.59	919,660.47
LAS VEGAS SANDS CORP	9,300	34.68	322,524.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,689	166.40	1,113,049.60
MCDONALD'S CORPORATION	18,235	245.04	4,468,304.40
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED	5,137	5.37	27,585.69
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,000	36.15	325,350.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,500	61.63	338,965.00
STARBUCKS CORP	28,616	75.60	2,163,369.60
VAIL RESORTS INC	1,100	237.07	260,777.00
WYNN RESORTS LTD	2,800	66.27	185,556.00
YUM! BRANDS INC	7,126	112.83	804,026.58
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,000	77.74	1,477,060.00
ALPHABET INC-CL A	7,360	2,321.01	17,082,633.60
ALPHABET INC-CL C	6,995	2,330.31	16,300,518.45
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	12,100	11.81	142,901.00
CABLE ONE INC	150	1,128.59	169,288.50
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3,080	471.39	1,451,881.20
COMCAST CORP-CL A	111,350	41.48	4,618,798.00

DISH NETWORK CORP-A	6,719	20.86	140,158.34
ELECTRONIC ARTS INC	6,912	124.94	863,585.28
FOX CORP - CLASS A	8,798	33.80	297,372.40
FOX CORP- CLASS B	3,184	31.24	99,468.16
IAC/INTERACTIVECORP	2,200	81.50	179,300.00
INTERPUBLIC GROUP COS INC	10,698	32.12	343,619.76
LIBERTY BROADBAND CORP	3,400	117.25	398,650.00
LIBERTY BROADBAND-A	600	112.59	67,554.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	5,200	61.00	317,200.00
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM A	2,000	39.53	79,060.00
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM C	4,564	39.44	180,004.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,400	91.25	401,500.00
MATCH GROUP INC	6,547	77.51	507,457.97
META PLATFORMS INC-A	57,800	198.62	11,480,236.00
NETFLIX INC	10,800	187.64	2,026,512.00
NEWS CORP-CLASS A	10,598	17.84	189,068.32
OMNICOM GROUP	5,140	77.01	395,831.40
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B	14,673	28.35	415,979.55
PINTEREST INC- CLASS A	15,000	21.47	322,050.00
ROKU INC	3,100	97.84	303,304.00
SEA LTD-ADR	7,800	75.40	588,120.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	20,700	6.14	127,098.00
SNAP INC - A	26,300	24.75	650,925.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,800	109.93	307,804.00
THE WALT DISNEY CO	44,372	107.33	4,762,446.76
TWITTER INC	19,400	40.72	789,968.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	54,223	18.10	981,436.30
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	7,600	44.03	334,628.00
ADVANCE AUTO PARTS	1,500	211.21	316,815.00
AMAZON COM INC	11,164	2,261.10	25,242,920.40
AUTOZONE INC	510	2,001.11	1,020,566.10
BATH & BODY WORKS INC	6,300	51.01	321,363.00
BEST BUY COMPANY INC	5,331	86.36	460,385.16
BURLINGTON STORES INC	1,800	172.50	310,500.00
CARMAX INC	4,374	91.66	400,920.84
CARVANA CO	2,100	38.31	80,451.00
CHEWY INC - CLASS A	1,600	27.97	44,752.00
DOLLAR GENERAL CORP	5,700	232.33	1,324,281.00
DOLLAR TREE INC	5,421	159.40	864,107.40

DOORDASH INC - A	2,900	73.71	213,759.00	
EBAY INC	15,236	46.65	710,759.40	
ETSY INC	3,400	92.08	313,072.00	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	600	38.42	23,052.00	
GENUINE PARTS CO	3,410	134.78	459,599.80	
HOME DEPOT INC	25,558	296.03	7,565,934.74	
LKQ CORP	7,500	51.09	383,175.00	
LOWE'S COMPANIES	16,450	194.00	3,191,300.00	
MERCADOLIBRE INC	1,100	794.96	874,456.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,600	635.62	1,016,992.00	
POOL CORP	1,000	411.16	411,160.00	
ROSS STORES INC	8,600	92.06	791,716.00	
TARGET CORP	11,726	219.73	2,576,553.98	
TJX COMPANIES INC	29,324	57.19	1,677,039.56	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,800	201.85	565,180.00	
ULTA BEAUTY INC	1,200	395.89	475,068.00	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,000	57.33	114,660.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	10,789	497.27	5,365,046.03	
KROGER CO	17,158	53.39	916,065.62	
SYSCO CORP	12,429	84.73	1,053,109.17	
WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	17,854	43.55	777,541.70	
WALMART INC	37,462	148.05	5,546,249.10	
ALTRIA GROUP INC	44,862	53.04	2,379,480.48	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,569	85.39	1,158,656.91	
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	7,430	66.80	496,324.00	
BUNGE LIMITED	3,400	109.58	372,572.00	
CAMPBELL SOUP CO	5,347	50.55	270,290.85	
COCA-COLA COMPANY	100,228	65.72	6,586,984.16	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	3,300	52.25	172,425.00	
CONAGRA BRANDS INC	11,581	35.89	415,642.09	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,000	248.92	995,680.00	
GENERAL MILLS INC	14,764	73.10	1,079,248.40	
HERSHEY CO/THE	3,500	225.91	790,685.00	
HORMEL FOODS CORP	7,200	53.21	383,112.00	
JM SMUCKER CO/THE COM	2,555	144.23	368,507.65	
KELLOGG CO	6,200	73.01	452,662.00	
KEURIG DR PEPPER INC	17,200	37.21	640,012.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	16,347	44.29	724,008.63	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,000	100.27	601,620.00	

MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	5,200	55.93	290,836.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,042	66.38	2,259,707.96	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,600	88.89	853,344.00	
PEPCICO INC	33,738	173.72	5,860,965.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	38,062	104.43	3,974,814.66	
TYSON FOODS INC-CL A	7,100	90.00	639,000.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,900	98.15	579,085.00	
CLOROX COMPANY	2,974	158.28	470,724.72	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,500	78.40	1,528,800.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,600	240.39	1,346,184.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,138	139.16	1,132,484.08	
PROCTER & GAMBLE CO	59,136	153.62	9,084,472.32	
ABBOTT LABORATORIES	43,227	109.88	4,749,782.76	
ABIOMED INC	1,100	254.16	279,576.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,800	275.52	495,936.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,800	152.89	580,982.00	
ANTHEM INC	5,876	486.45	2,858,380.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	12,125	73.03	885,488.75	
BECTON DICKINSON & CO	6,891	248.44	1,712,000.04	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	34,747	39.66	1,378,066.02	
CARDINAL HEALTH INC	6,814	55.61	378,926.54	
CENTENE CORP	14,156	82.32	1,165,321.92	
CERNER CORP	8,000	94.21	753,680.00	
CIGNA CORP	8,033	259.19	2,082,073.27	
COOPER COS INC/THE	1,300	327.79	426,127.00	
CVS HEALTH CORPORATION	32,222	97.48	3,141,000.56	
DAVITA INC	1,900	100.05	190,095.00	
DENTSPLY SIRONA INC	5,900	38.23	225,557.00	
DEXCOM INC	2,400	334.74	803,376.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15,200	97.55	1,482,760.00	
HCA HEALTHCARE INC	6,100	214.92	1,311,012.00	
HENRY SCHEIN INC	3,800	83.51	317,338.00	
HOLOGIC INC	6,044	76.28	461,036.32	
HUMANA INC	3,100	438.89	1,360,559.00	
IDEXX LABORATORIES INC	2,100	362.18	760,578.00	
INMODE LTD	1,000	24.32	24,320.00	
INSULET CORP	1,700	199.06	338,402.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,700	223.69	1,946,103.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,300	244.62	562,626.00	

MASIMO CORP	1,400	136.04	190,456.00	
MCKESSON CORP	3,752	324.24	1,216,548.48	
MEDTRONIC PLC	32,836	102.67	3,371,272.12	
MOLINA HEALTHCARE INC	1,400	295.89	414,246.00	
NOVOCURE LTD	2,500	65.24	163,100.00	
QUEST DIAGNOSTICS	2,938	136.39	400,713.82	
RESMED INC	3,500	196.86	689,010.00	
STERIS PLC	2,400	216.18	518,832.00	
STRYKER CORP	8,276	233.27	1,930,542.52	
TELADOC HEALTH INC	3,400	33.59	114,206.00	
TELEFLEX INC	1,100	278.46	306,306.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	23,064	485.40	11,195,265.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,700	124.66	211,922.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,400	172.78	587,452.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,093	115.07	586,051.51	
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,800	47.63	85,734.00	
ABBVIE INC	43,210	153.50	6,632,735.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,296	119.38	870,996.48	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,900	126.47	366,763.00	
AMGEN INC	13,725	243.40	3,340,665.00	
AVANTOR INC	14,200	30.05	426,710.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	600	502.11	301,266.00	
BIO-TECHNE CORP	900	367.77	330,993.00	
BIOGEN INC	3,610	199.11	718,787.10	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,400	77.73	342,012.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	54,203	75.80	4,108,587.40	
CATALENT INC	4,100	98.18	402,538.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,200	235.81	282,972.00	
DANAHER CORP	15,716	249.19	3,916,270.04	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,110	22.27	225,149.70	
EXACT SCIENCES CORP	4,100	52.29	214,389.00	
GILEAD SCIENCES INC	30,600	62.37	1,908,522.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	5,200	90.43	470,236.00	
ILLUMINA INC	3,600	233.56	840,816.00	
INCYTE CORP	4,500	74.90	337,050.00	
IQVIA HOLDINGS INC	4,667	208.71	974,049.57	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,700	146.49	249,033.00	
JOHNSON & JOHNSON	64,307	176.85	11,372,692.95	
LILLY (ELI) & CO	19,838	291.63	5,785,355.94	

MERCK & CO. INC.	61,692	90.41	5,577,573.72
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	560	1,255.11	702,861.60
MODERNA INC	8,400	137.91	1,158,444.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,600	84.12	218,712.00
NOVAVAX INC	1,700	51.89	88,213.00
PERKINELMER INC	3,000	148.61	445,830.00
PFIZER INC	137,156	49.92	6,846,827.52
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,600	645.52	1,678,352.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9,200	39.94	367,448.00
SEAGEN INC	3,300	135.63	447,579.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	17,300	7.76	134,248.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,628	541.42	5,212,791.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,200	246.72	1,529,664.00
VIATRIS INC	32,637	11.08	361,617.96
WATERS CORPORATION	1,474	320.42	472,299.08
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,800	304.97	548,946.00
ZOETIS INC	11,573	165.33	1,913,364.09
BANK OF AMERICA CORP	180,036	35.17	6,331,866.12
CITIGROUP INC	48,405	47.64	2,306,014.20
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,100	37.94	459,074.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,572	35.97	596,094.84
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	300	646.00	193,800.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,300	141.42	608,106.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	34,900	13.05	455,445.00
JPMORGAN CHASE & CO	72,218	119.09	8,600,441.62
KEYCORP	22,493	18.62	418,819.66
M & T BANK CORP	4,344	166.58	723,623.52
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,267	157.44	1,616,436.48
REGIONS FINANCIAL CORP	22,984	19.88	456,921.92
SIGNATURE BANK	1,600	201.20	321,920.00
SVB FINANCIAL GROUP	1,400	449.28	628,992.00
TRUIST FINANCIAL CORP	32,554	46.31	1,507,575.74
US BANCORP	34,294	48.60	1,666,688.40
WEBSTER FINANCIAL CORP	4,800	46.88	225,024.00
WELLS FARGO COMPANY	97,438	42.64	4,154,756.32
AGNC INVESTMENT CORP	14,300	12.39	177,177.00
ALLY FINANCIAL INC	9,700	39.58	383,926.00
AMERICAN EXPRESS COMPANY	16,022	158.75	2,543,492.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,724	261.61	712,625.64

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	34,200	6.73	230,166.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	8,657	54.20	469,209.40	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	19,060	43.46	828,347.60	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	31,850	310.36	9,884,966.00	
BLACKROCK INC	3,700	615.33	2,276,721.00	
BLACKSTONE INC	16,700	107.82	1,800,594.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,385	116.46	1,209,437.10	
CARLYLE GROUP INC/THE	3,800	37.67	143,146.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,900	109.38	317,202.00	
CME GROUP INC	8,800	200.10	1,760,880.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,000	67.87	67,870.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,116	104.90	746,468.40	
EQUITABLE HOLDINGS INC	10,100	27.81	280,881.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,000	371.81	371,810.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,200	25.09	205,738.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	900	31.00	27,900.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,208	306.99	2,519,773.92	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	13,750	98.27	1,351,212.50	
INVESCO LTD	7,880	17.84	140,579.20	
KKR & CO INC -A	12,800	51.57	660,096.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,000	263.38	263,380.00	
MOODY'S CORP	4,036	288.96	1,166,242.56	
MORGAN STANLEY	32,870	80.54	2,647,349.80	
MSCI INC	2,000	408.14	816,280.00	
NASDAQ INC	2,800	147.49	412,972.00	
NORTHERN TRUST CORP	4,721	104.15	491,692.15	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,450	94.99	422,705.50	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	3,500	10.69	37,415.00	
S&P GLOBAL INC	8,694	336.85	2,928,573.90	
SCHWAB (CHARLES) CORP	35,404	65.61	2,322,856.44	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,300	54.84	180,972.00	
SOFI TECHNOLOGIES INC	14,100	6.75	95,175.00	
STATE STREET CORP	8,824	69.21	610,709.04	
SYNCHRONY FINANCIAL	13,211	33.55	443,229.05	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,500	121.96	670,780.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,500	67.27	168,175.00	
UPSTART HOLDINGS INC	1,100	38.13	41,943.00	
AFLAC INC	15,238	56.28	857,594.64	
ALLEGHANY CORP	341	837.00	285,417.00	

ALLSTATE CORP	6,985	128.19	895,407.15	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,000	144.07	288,140.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,225	58.56	1,184,376.00	
AON PLC	5,415	280.60	1,519,449.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,300	46.02	427,986.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,000	162.02	810,100.00	
ASSURANT INC	1,400	181.62	254,268.00	
BROWN & BROWN INC	5,800	57.90	335,820.00	
CHUBB LTD	10,471	206.54	2,162,680.34	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,740	126.23	472,100.20	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	164.98	115,486.00	
EVEREST RE GROUP LTD	900	280.02	252,018.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,296	40.84	297,968.64	
GLOBE LIFE INC	2,675	96.18	257,281.50	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,232	69.55	572,535.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	4,251	54.09	229,936.59	
LOEWS CORP	5,196	63.15	328,127.40	
MARKEL CORP	330	1,325.45	437,398.50	
MARSH & MCLENNAN COS	12,333	159.95	1,972,663.35	
METLIFE INC	17,426	63.42	1,105,156.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,400	70.02	448,128.00	
PROGRESSIVE CORP	14,236	107.82	1,534,925.52	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,224	101.19	933,376.56	
TRAVELERS COS INC/THE	6,032	172.78	1,042,208.96	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,983	205.83	613,990.89	
WR BERKLEY CORP	5,050	67.33	340,016.50	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,600	166.45	599,220.00	
AMERICAN TOWER CORP	11,100	232.66	2,582,526.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,431	207.21	710,937.51	
BOSTON PROPERTIES INC	3,600	112.71	405,756.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,700	145.99	394,173.00	
CBRE GROUP INC	8,100	80.80	654,480.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	10,500	176.49	1,853,145.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6,900	131.19	905,211.00	
DUKE REALTY CORP	9,200	53.62	493,304.00	
EQUINIX INC	2,156	659.80	1,422,528.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,700	72.38	340,186.00	
EQUITY RESIDENTIAL	8,600	74.96	644,656.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,600	296.28	474,048.00	

EXTRA SPACE STORAGE INC	3,200	178.96	572,672.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	13,000	30.08	391,040.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	32,800	4.61	151,208.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	19,257	19.90	383,214.30	
INVITATION HOMES INC	14,400	36.92	531,648.00	
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	7,006	52.33	366,623.98	
KIMCO REALTY CORP	14,800	23.25	344,100.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16,100	18.21	293,181.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,800	179.76	503,328.00	
PROLOGIS INC	18,037	128.35	2,315,048.95	
PUBLIC STORAGE	3,800	318.53	1,210,414.00	
REALTY INCOME CORP	13,798	67.41	930,123.18	
REGENCY CENTERS CORP	4,100	67.89	278,349.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,600	334.17	868,842.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7,969	116.78	930,619.82	
SUN COMMUNITIES INC	2,800	162.93	456,204.00	
UDR INC	8,000	48.78	390,240.00	
VENTAS INC	9,700	55.01	533,597.00	
VICI PROPERTIES INC	23,500	28.73	675,155.00	
VORNADO REALTY TRUST	4,427	34.64	153,351.28	
WELLTOWER INC	10,600	88.37	936,722.00	
WEYERHAEUSER CO	18,176	38.71	703,592.96	
WP CAREY INC	5,000	81.34	406,700.00	
ZILLOW GROUP INC - A	1,300	40.14	52,182.00	
ZILLOW GROUP INC - C	4,000	40.56	162,240.00	
ACCENTURE PLC-CL A	15,400	286.77	4,416,258.00	
ADOBE INC	11,600	405.45	4,703,220.00	
AFFIRM HOLDINGS INC	4,500	23.71	106,695.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	3,900	98.67	384,813.00	
ANSYS INC	2,100	254.57	534,597.00	
ASANA INC - CL A	1,300	24.37	31,681.00	
AUTODESK INC	5,300	197.07	1,044,471.00	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,285	208.79	2,147,405.15	
AVALARA INC	2,300	80.41	184,943.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	4,800	32.09	154,032.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	1,800	118.54	213,372.00	
BLACK KNIGHT INC	4,200	69.34	291,228.00	
BLOCK INC-A	11,600	84.15	976,140.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,100	139.34	431,954.00	

CADENCE DESIGN SYS INC	6,700	142.44	954,348.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	3,200	56.40	180,480.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,539	122.20	310,265.80	
CITRIX SYSTEMS INC	3,398	99.15	336,911.70	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	6,300	66.38	418,194.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,800	73.38	939,264.00	
COUPA SOFTWARE INC	1,700	73.15	124,355.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,800	156.29	750,192.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	133.57	146,927.00	
DATADOG INC - CLASS A	5,300	108.86	576,958.00	
DOCUSIGN INC	4,700	79.17	372,099.00	
DROPBOX INC-CLASS A	8,600	20.77	178,622.00	
DYNATRACE INC	5,000	35.39	176,950.00	
EPAM SYSTEMS INC	1,500	319.25	478,875.00	
FAIR ISAAC CORP	700	361.53	253,071.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	14,866	96.50	1,434,569.00	
FISERV INC	14,468	96.17	1,391,387.56	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,900	233.59	443,821.00	
FORTINET INC	3,400	281.55	957,270.00	
GARTNER INC	2,000	255.52	511,040.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	7,025	122.20	858,455.00	
GODADDY INC - CLASS A	4,000	71.98	287,920.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,200	80.39	176,858.00	
HUBSPOT INC	1,100	355.87	391,457.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	21,905	133.60	2,926,508.00	
INTUIT INC	6,616	371.76	2,459,564.16	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,000	175.43	350,860.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	21,400	332.80	7,121,920.00	
MICROSOFT CORP	174,456	261.12	45,553,950.72	
MONGODB INC	1,400	286.03	400,442.00	
NORTONLIFELOCK INC	14,000	23.95	335,300.00	
OKTA INC	3,600	97.70	351,720.00	
ORACLE CORPORATION	40,056	71.17	2,850,785.52	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	39,100	8.34	326,094.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,400	491.01	1,178,424.00	
PAYCHEX INC	7,857	119.69	940,404.33	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,200	288.56	346,272.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	27,236	78.83	2,147,013.88	
PTC INC	3,000	109.55	328,650.00	

RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,100	69.30	145,530.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,600	430.33	1,118,858.00	
SALESFORCE INC	23,862	166.91	3,982,806.42	
SERVICENOW INC	4,900	452.65	2,217,985.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	5,100	158.36	807,636.00	
SPLUNK INC	3,900	101.80	397,020.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,500	59.82	329,010.00	
SYNOPSYS INC	3,700	275.99	1,021,163.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	10,600	51.92	550,352.00	
TWILIO INC - A	4,100	110.79	454,239.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,000	358.36	358,360.00	
UNITY SOFTWARE INC	1,500	39.10	58,650.00	
VERISIGN INC	2,426	165.11	400,556.86	
VISA INC-CLASS A SHARES	40,840	199.23	8,136,553.20	
VMWARE INC-CLASS A	5,093	100.18	510,216.74	
WESTERN UNION CO	11,060	17.00	188,020.00	
WIX.COM LTD	1,400	71.19	99,666.00	
WORKDAY INC-CLASS A	4,700	182.29	856,763.00	
ZENDESK INC	2,900	102.15	296,235.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,300	94.84	502,652.00	
ZSCALER INC	2,200	153.23	337,106.00	
AMPHENOL CORP-CL A	14,500	70.47	1,021,815.00	
APPLE INC	401,260	147.11	59,029,358.60	
ARISTA NETWORKS INC	5,600	108.65	608,440.00	
ARROW ELECTRONICS INC	2,000	125.07	250,140.00	
CDW CORP/DE	3,300	169.34	558,822.00	
CISCO SYSTEMS INC	103,039	49.56	5,106,612.84	
COGNEX CORP	4,800	49.98	239,904.00	
CORNING INC	19,660	35.54	698,716.40	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,532	45.09	339,617.88	
F5 INC	1,600	168.57	269,712.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	31,567	15.95	503,493.65	
HP INC	28,067	36.78	1,032,304.26	
IPG PHOTONICS CORP	800	98.40	78,720.00	
JUNIPER NETWORKS INC	7,700	30.46	234,542.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,500	136.67	615,015.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,095	215.29	881,612.55	
NETAPP INC	5,398	71.21	384,391.58	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	4,800	80.71	387,408.00	

TE CONNECTIVITY LTD	7,887	125.22	987,610.14
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,100	400.95	441,045.00
TRIMBLE INCORPORATED	6,000	65.92	395,520.00
WESTERN DIGITAL CORP	8,374	58.45	489,460.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,400	336.86	471,604.00
AT&T INC	174,363	19.84	3,459,361.92
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,588	23.00	82,524.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	9,496	24.07	228,568.72
LUMEN TECHNOLOGIES INC	20,674	11.59	239,611.66
T-MOBILE US INC	15,188	126.33	1,918,700.04
VERIZON COMMUNICATIONS	101,125	48.18	4,872,202.50
AES CORPORATION	16,000	20.24	323,840.00
ALLIANT ENERGY CORP	6,000	58.44	350,640.00
AMEREN CORPORATION	6,272	93.11	583,985.92
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,277	99.69	1,223,894.13
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,400	146.48	644,512.00
ATMOS ENERGY CORP	3,200	112.96	361,472.00
CENTRPOINT ENERGY INC	16,000	31.03	496,480.00
CMS ENERGY CORP	7,000	69.45	486,150.00
CONSOLIDATED EDISON INC	8,538	95.40	814,525.20
CONSTELLATION ENERGY	7,877	54.61	430,162.97
DOMINION ENERGY INC	19,732	83.61	1,649,792.52
DTE ENERGY COMPANY	4,727	129.81	613,611.87
DUKE ENERGY CORP	18,759	109.30	2,050,358.70
EDISON INTERNATIONAL	9,179	65.46	600,857.34
ENERGY CORP	4,819	117.17	564,642.23
ESSENTIAL UTILITIES INC	6,500	45.35	294,775.00
EVERGY INC	5,500	67.61	371,855.00
EVERSOURCE ENERGY	8,336	89.34	744,738.24
EXELON CORPORATION	23,831	46.73	1,113,622.63
FIRSTENERGY CORP	13,193	42.51	560,834.43
NEXTERA ENERGY INC	47,876	69.80	3,341,744.80
NISOURCE INC	9,300	30.32	281,976.00
NRG ENERGY INC	6,600	42.29	279,114.00
P G & E CORP	35,900	11.72	420,748.00
PPL CORPORATION	18,128	28.77	521,542.56
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12,266	68.58	841,202.28
SEMPRA ENERGY	7,765	161.06	1,250,630.90
SOUTHERN CO	25,823	73.65	1,901,863.95

	UGI CORP	5,700	38.89	221,673.00	
	VISTRA CORP	11,800	24.58	290,044.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	7,617	102.09	777,619.53	
	XCEL ENERGY INC	13,100	74.49	975,819.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,919	95.12	3,797,095.28	
	ANALOG DEVICES	13,046	158.74	2,070,922.04	
	APPLIED MATERIALS INC	22,052	111.86	2,466,736.72	
	BROADCOM INC	10,077	588.24	5,927,694.48	
	ENPHASE ENERGY INC	3,100	157.79	489,149.00	
	ENTEGRIS INC	3,300	109.24	360,492.00	
	INTEL CORP	99,357	43.60	4,331,965.20	
	KLA CORPORATION	3,670	336.42	1,234,661.40	
	LAM RESEARCH CORP	3,400	491.92	1,672,528.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	20,000	57.57	1,151,400.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,500	67.03	904,905.00	
	MICRON TECHNOLOGY	27,227	71.92	1,958,165.84	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,100	431.67	474,837.00	
	NVIDIA CORP	61,100	177.06	10,818,366.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,465	181.99	1,176,565.35	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	10,400	56.18	584,272.00	
	QORVO INC	2,625	104.81	275,126.25	
	QUALCOMM INC	27,336	134.93	3,688,446.48	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,000	103.48	413,920.00	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	1,400	232.25	325,150.00	
	TERADYNE INC	3,900	107.35	418,665.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,509	169.74	3,820,677.66	
小計	銘柄数：642			879,186,053.45	
				(113,986,471,829)	
	組入時価比率：71.1%			73.5%	
カナダドル	CAMECO CORP	9,506	28.45	270,445.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	28,664	78.62	2,253,563.68	
	CENOVUS ENERGY INC	31,766	26.01	826,233.66	
	ENBRIDGE INC	49,368	56.56	2,792,254.08	
	IMPERIAL OIL LTD	6,012	64.29	386,511.48	
	KEYERA CORP	4,900	32.38	158,662.00	
	PARKLAND CORP	4,400	34.56	152,064.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	13,269	49.32	654,427.08	
	SUNCOR ENERGY INC	35,459	46.92	1,663,736.28	
	TC ENERGY CORP	23,840	71.55	1,705,752.00	

TOURMALINE OIL CORP	7,500	68.83	516,225.00	
AGNCIO EAGLE MINES LTD	11,088	65.44	725,598.72	
BARRICK GOLD CORP	43,233	26.39	1,140,918.87	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,200	59.29	249,018.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,167	32.48	460,144.16	
FRANCO-NEVADA CORP	4,600	175.35	806,610.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	17,200	9.90	170,280.00	
KINROSS GOLD CORP	29,569	5.36	158,489.84	
LUNDIN MINING CORP	15,600	9.82	153,192.00	
NUTRIEN LTD	13,871	127.88	1,773,823.48	
PAN AMERICAN SILVER CORP	6,000	27.96	167,760.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,375	48.05	546,568.75	
WEST FRASER TIMBER CO.LTD.	2,300	111.07	255,461.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	10,929	51.28	560,439.12	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	4,400	8.87	39,028.00	
CAE INC	7,506	30.10	225,930.60	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,300	111.30	255,990.00	
WSP GLOBAL INC	2,800	134.20	375,760.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	4,500	36.18	162,810.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	2,800	79.96	223,888.00	
THOMSON REUTERS CORP	4,086	122.53	500,657.58	
AIR CANADA	3,300	20.58	67,914.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,240	142.92	2,463,940.80	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,840	89.50	1,775,680.00	
TFI INTERNATIONAL INC	2,300	104.51	240,373.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,860	78.29	537,069.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,900	40.04	196,196.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIO	6,827	66.91	456,794.57	
QUEBECOR INC -CL B	4,800	27.40	131,520.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,886	34.68	377,526.48	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,405	175.64	246,774.20	
DOLLARAMA INC	7,000	71.44	500,080.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	20,700	58.44	1,209,708.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,700	41.68	154,216.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	4,025	114.29	460,017.25	
METRO INC	5,846	69.70	407,466.20	
WESTON (GEORGE) LTD	1,837	154.11	283,100.07	
SAPUTO INC	7,000	25.94	181,580.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,524	14.00	119,336.00	

CANOPY GROWTH CORP	4,100	7.62	31,242.00	
BANK OF MONTREAL	15,753	132.01	2,079,553.53	
BANK OF NOVA SCOTIA	29,592	81.07	2,399,023.44	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,000	137.29	1,510,190.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	8,216	89.96	739,111.36	
ROYAL BANK OF CANADA	34,786	126.62	4,404,603.32	
TORONTO-DOMINION BANK	44,540	91.92	4,094,116.80	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	34,360	61.67	2,118,981.20	
IGM FINANCIAL INC	2,146	36.97	79,337.62	
ONEX CORPORATION	1,906	74.02	141,082.12	
TMX GROUP LTD	1,600	135.09	216,144.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	600	673.36	404,016.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	7,718	33.00	254,694.00	
IA FINANCIAL CORP INC	2,700	64.81	174,987.00	
INTACT FINANCIAL CORP	4,300	176.64	759,552.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	47,242	22.52	1,063,889.84	
POWER CORP OF CANADA	13,524	34.60	467,930.40	
SUN LIFE FINANCIAL INC	14,213	61.54	874,668.02	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	48.65	116,760.00	
FIRSTSERVICE CORP	1,100	159.59	175,549.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	21.97	72,501.00	
BLACKBERRY LTD	15,300	7.55	115,515.00	
CGI INC	5,218	104.51	545,333.18	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	490	1,925.64	943,563.60	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	2,200	27.64	60,808.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,700	62.44	106,148.00	
OPEN TEXT CORP	6,600	47.79	315,414.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,800	519.73	1,455,244.00	
BCE INC	2,082	68.35	142,304.70	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	8,564	64.25	550,237.00	
TELUS CORP	10,876	31.35	340,962.60	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	16,000	18.20	291,200.00	
ALTAGAS LTD	6,100	28.65	174,765.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,550	44.89	159,359.50	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,700	39.14	144,818.00	
EMERA INC	6,200	61.66	382,292.00	
FORTIS INC	11,400	62.99	718,086.00	
HYDRO ONE LTD	7,800	35.49	276,822.00	
NORTHLAND POWER INC	6,300	38.35	241,605.00	

小計	銘柄数：88 組入時価比率：3.7%			59,283,945.28 (5,953,886,624) 3.8%	
ユーロ	ENI SPA	61,308	13.64	836,241.12	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	11,752	10.52	123,689.80	
	NESTE OYJ	10,210	40.78	416,363.80	
	OMV AG	3,629	46.92	170,272.68	
	REPSOL SA	35,051	14.25	499,652.00	
	TENARIS SA	11,147	14.75	164,473.98	
	TOTALENERGIES SE	61,226	51.08	3,127,424.08	
	AIR LIQUIDE	11,553	162.40	1,876,207.20	
	AKZO NOBEL	4,506	80.10	360,930.60	
	ARCELORMITTAL	15,427	26.44	407,967.01	
	ARKEMA	1,511	115.20	174,067.20	
	BASF SE	22,349	49.38	1,103,593.62	
	COVESTRO AG	4,586	39.55	181,376.30	
	CRH PLC	18,729	37.47	701,775.63	
	ENSO OY-R SHS	13,920	17.35	241,512.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,868	25.51	149,692.68	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,314	28.26	37,133.64	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,105	51.88	212,967.40	
	KONINKLIJKE DSM NV	4,237	142.35	603,136.95	
	LANXESS	2,351	36.31	85,364.81	
	LINDE PLC	562	297.85	167,391.70	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,745	37.58	253,477.10	
	SOLVAY SA	2,055	92.42	189,923.10	
	SYMRISE AG	3,193	102.25	326,484.25	
	UMICORE	5,488	39.78	218,312.64	
	UPM-KYMMENE OYJ	12,857	31.68	407,309.76	
	VOESTALPINE AG	2,387	24.56	58,624.72	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,457	24.31	132,659.67	
	AIRBUS SE	14,364	106.36	1,527,755.04	
	ALSTOM	8,731	23.27	203,170.37	
	BOUYGUES SA	5,651	31.20	176,311.20	
	BRENNTAG SE	3,696	71.30	263,524.80	
	CNH INDUSTRIAL NV	24,611	13.79	339,385.69	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	12,258	53.65	657,641.70	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	9,809	27.40	268,815.64	
	DASSAULT AVIATION SA	590	155.70	91,863.00	

EIFFAGE	2,052	94.74	194,406.48
FERROVIAL SA	11,629	23.87	277,584.23
FERROVIAL SA-RTS	11,629	0.27	3,177.04
GEA GROUP AG	3,787	35.65	135,006.55
IMCD NV	1,376	134.60	185,209.60
KINGSPAN GROUP PLC	3,699	78.00	288,522.00
KION GROUP AG	1,785	46.64	83,252.40
KNORR-BREMSE AG	2,026	67.94	137,646.44
KONE OYJ	8,183	44.20	361,688.60
LEGRAND SA	6,468	80.32	519,509.76
MTU AERO ENGINES AG	1,295	180.45	233,682.75
PRYSMIAN SPA	6,032	28.02	169,016.64
RATIONAL AG	104	545.00	56,680.00
SAFRAN SA	8,302	96.53	801,392.06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13,180	129.48	1,706,546.40
SIEMENS AG	18,660	116.08	2,166,052.80
SIEMENS ENERGY AG	9,456	16.45	155,551.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	6,737	13.29	89,568.41
THALES SA	2,617	113.95	298,207.15
VINCI SA	13,105	92.55	1,212,867.75
WARTSILA OYJ	13,236	7.31	96,834.57
BUREAU VERITAS SA	6,952	26.39	183,463.28
RANDSTAD NV	2,956	50.58	149,514.48
RELX PLC	1,861	26.94	50,135.34
TELEPERFORMANCE	1,419	314.70	446,559.30
WOLTERS KLUWER	6,360	93.26	593,133.60
ADP	677	130.95	88,653.15
AENA SME SA	1,794	132.95	238,512.30
ATLANTIA SPA	12,119	22.87	277,161.53
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	13,582	6.92	94,041.76
DEUTSCHE POST AG	24,098	38.86	936,568.77
GETLINK SE	10,962	17.44	191,232.09
INPOST SA	3,561	5.64	20,098.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,019	77.62	622,434.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,636	69.30	113,374.80
CONTINENTAL AG	3,023	66.10	199,820.30
FAURECIA	3,307	21.96	72,621.72
FERRARI NV	3,054	186.90	570,792.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	20,839	64.32	1,340,364.48

MICHELIN (CGDE)-B	4,098	120.30	492,989.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	3,671	77.82	285,677.22	
RENAULT SA	5,362	23.60	126,543.20	
STELLANTIS NV	9,020	13.74	123,970.88	
STELLANTIS NV	40,354	13.77	555,674.58	
VALEO SA	6,412	17.89	114,710.68	
VOLKSWAGEN AG	897	193.75	173,793.75	
VOLKSWAGEN AG PFD	4,499	144.00	647,856.00	
ADIDAS AG	4,627	180.96	837,301.92	
ESSILORLUXOTTICA	6,994	149.60	1,046,302.40	
HERMES INTERNATIONAL	770	1,070.00	823,900.00	
KERING	1,823	460.10	838,762.30	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,781	581.30	3,941,795.30	
MONCLER SPA	4,901	45.36	222,309.36	
PUMA SE	2,547	65.62	167,134.14	
SEB SA	792	107.60	85,219.20	
ACCOR SA	4,665	30.69	143,168.85	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,018	105.25	422,894.50	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,641	34.96	92,329.36	
SODEXO	2,460	72.96	179,481.60	
BOLLORE SE	24,370	4.75	115,903.72	
PUBLICIS GROUPE	5,467	54.94	300,356.98	
SCOUT24 SE	1,944	57.32	111,430.08	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,024	43.66	88,367.84	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	17,498	20.41	357,134.18	
VIVENDI SA	18,900	11.02	208,278.00	
DELIVERY HERO SE	4,431	28.84	127,790.04	
INDITEX	26,386	20.54	541,968.44	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	4,997	19.45	97,191.65	
PROSUS NV	22,696	43.91	996,581.36	
ZALANDO SE	5,308	34.12	181,108.96	
CARREFOUR SA	14,882	21.03	312,968.46	
COLRUYT SA	1,154	33.18	38,289.72	
HELLOFRESH SE	4,548	39.00	177,372.00	
JERONIMO MARTINS	7,939	19.36	153,699.04	
KESKO OYJ-B SHS	7,567	24.79	187,585.93	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	25,365	26.86	681,303.90	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	21,134	53.48	1,130,246.32	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	2,295	49.16	112,822.20	

DANONE	15,864	56.17	891,080.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	14,588	10.21	148,943.48
HEINEKEN HOLDING NV	2,800	74.35	208,180.00
HEINEKEN NV	6,273	94.60	593,425.80
JDE PEET'S BV	2,944	28.64	84,316.16
KERRY GROUP PLC-A	3,834	101.45	388,959.30
PERNOD-RICARD SA	5,094	188.35	959,454.90
REMY COINTREAU	644	175.00	112,700.00
BEIERSDORF AG	2,457	93.82	230,515.74
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,256	63.02	268,213.12
HENKEL AG + CO KGAA	2,887	62.50	180,437.50
L OREAL	6,122	332.45	2,035,258.90
UNILEVER PLC	16,956	44.01	746,233.56
AMPLIFON SPA	3,498	34.25	119,806.50
BIOMERIEUX	1,172	88.52	103,745.44
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	995	116.65	116,066.75
DIASORIN SPA	576	119.10	68,601.60
FRESENIUS MEDICAL CARE	4,920	56.08	275,913.60
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,067	34.09	343,184.03
KONINKLIJKE PHILIPS NV	22,217	23.42	520,322.14
ORPEA	1,468	34.81	51,101.08
SARTORIUS AG-VORZUG	625	335.80	209,875.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,789	54.38	369,185.82
ARGENX SE	1,101	298.00	328,098.00
BAYER AG	23,940	61.54	1,473,267.60
EUROFINS SCIENTIFIC	3,224	84.18	271,396.32
GRIFOLS SA	8,425	19.70	166,014.62
IPSEN	815	94.00	76,610.00
MERCK KGAA	3,129	160.00	500,640.00
ORION OYJ	2,326	36.36	84,573.36
QIAGEN N.V.	5,506	44.17	243,200.02
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	2,290	41.34	94,668.60
SANOFI	27,756	99.79	2,769,771.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	659	298.20	196,513.80
UCB SA	3,040	88.00	267,520.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	10,626	11.58	123,049.08
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	161,891	4.85	785,171.35
BANCO ESPRITO SANTO-REG	34,679	0.12	4,161.48
BANCO SANTANDER SA	422,228	2.72	1,151,837.98

BNP PARIBAS	27,391	52.38	1,434,740.58
CAIXABANK S.A	106,442	2.88	307,510.93
COMMERZBANK AG	27,803	6.45	179,384.95
CREDIT AGRICOLE	29,644	10.28	304,918.18
ERSTE GROUP BANK AG	8,220	27.88	229,173.60
FINECOBANK SPA	16,590	12.37	205,301.25
ING GROEP NV-CVA	94,851	9.31	883,631.91
INTESA SANPAOLO	400,899	1.97	790,733.18
KBC GROEP NV	6,019	55.06	331,406.14
MEDIOBANCA SPA	15,485	9.92	153,673.14
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	3,201	12.04	38,540.04
SOCIETE GENERAL-A	19,564	23.34	456,623.76
UNICREDIT SPA	51,096	9.69	495,426.81
AMUNDI SA	1,351	55.60	75,115.60
DEUTSCHE BANK AG -REG	50,000	9.36	468,400.00
DEUTSCHE BOERSE AG	4,611	162.85	750,901.35
EURAZEO	1,152	71.40	82,252.80
EURONEXT NV	2,378	73.38	174,497.64
EXOR NV	2,652	65.40	173,440.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,612	84.74	221,340.88
SOFINA	422	281.20	118,666.40
WENDEL	576	91.30	52,588.80
AEGON NV	42,626	4.92	210,103.55
AGEAS	4,218	43.97	185,465.46
ALLIANZ SE-REG	9,963	200.50	1,997,581.50
ASSICURAZIONI GENERALI	26,756	17.73	474,517.66
AXA SA	47,394	23.00	1,090,298.97
CNP ASSURANCES	3,610	20.90	75,449.00
HANNOVER RUECK SE	1,461	144.35	210,895.35
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,402	228.50	777,357.00
NN GROUP NV	6,483	47.39	307,229.37
POSTE ITALIANE SPA	14,615	9.67	141,327.05
SAMPO OYJ-A SHS	12,071	45.59	550,316.89
AROUNDTOWN SA	28,081	4.59	129,144.51
BGP HOLDINGS PLC	293,880	0.00	0.00
COVIVIO	1,490	64.75	96,477.50
GECINA SA	1,156	104.90	121,264.40
KLEPIERRE	5,768	21.42	123,550.56
LEG IMMOBILIEN SE	1,779	94.80	168,649.20

UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,965	70.04	207,668.60	
VONOVIA SE	17,894	33.19	593,901.86	
ADYEN NV	482	1,483.80	715,191.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	10,912	58.74	640,970.88	
BECHTLE AG	2,315	40.81	94,475.15	
CAPGEMINI	3,890	184.25	716,732.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	16,112	38.10	613,947.76	
EDENRED	5,982	44.93	268,771.26	
NEMETSCHKE SE	1,309	64.44	84,351.96	
NEXI SPA	13,041	9.02	117,629.82	
SAP SE	25,479	94.59	2,410,058.61	
WORLDLINE SA	5,659	36.85	208,534.15	
NOKIA OYJ	130,629	4.69	613,760.35	
CELLNEX TELECOM SA	12,327	40.60	500,476.20	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	78,929	18.26	1,441,243.54	
ELISA OYJ	3,500	53.92	188,720.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	9,696	10.14	98,365.92	
KONINKLIJKE KPN NV	80,490	3.29	265,375.53	
ORANGE S.A.	48,259	11.66	562,989.49	
PROXIMUS	3,331	16.24	54,095.44	
TELECOM ITALIA SPA	282,706	0.27	78,535.72	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	24,323	2.93	71,485.29	
TELEFONICA SA	127,675	4.77	609,903.47	
UNITEDINTERNET AG-REG SHARE	2,803	31.36	87,902.08	
E.ON SE	54,317	9.89	537,412.39	
EDP RENOVAVEIS SA	6,786	20.39	138,366.54	
ELECTRICITE DE FRANCE	15,452	8.47	131,002.05	
ELIA GROUP SA/NV	687	147.90	101,607.30	
ENAGAS	7,026	20.76	145,859.76	
ENDESA SA	7,921	19.81	156,954.61	
ENEL SPA	197,963	5.93	1,175,306.33	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,608	4.36	290,477.48	
ENGIE	44,154	11.36	501,589.44	
FORTUM OYJ	12,188	17.00	207,196.00	
IBERDROLA SA	141,901	10.68	1,515,502.68	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,895	25.96	127,074.20	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,004	18.71	224,654.86	
RWE AG	15,561	39.97	621,973.17	
SNAM SPA	48,189	5.23	252,124.84	

	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	33,655	7.81	263,047.48	
	UNIPER SE	2,625	24.16	63,420.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	15,816	25.98	410,899.68	
	VERBUND AG	1,900	81.55	154,945.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,125	290.80	327,150.00	
	ASML HOLDING NV	10,099	525.20	5,303,994.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,717	28.59	906,947.61	
	STMICROELECTRONS NV	16,526	37.88	626,004.88	
小計	銘柄数：239			106,938,101.47	
				(14,431,296,793)	
	組入時価比率：9.0%			9.3%	
ボンド	BP PLC	481,711	4.14	1,997,655.51	
	SHELL PLC-NEW	188,097	23.03	4,332,814.39	
	ANGLO AMERICAN PLC	31,171	33.04	1,030,045.69	
	ANTOFAGASTA PLC	9,345	13.48	126,017.32	
	BHP GROUP LTD	44,183	25.96	1,146,990.68	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,346	68.68	229,803.28	
	GLENCORE PLC	241,606	4.61	1,114,649.28	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,476	23.53	128,850.28	
	MONDI PLC	11,743	15.63	183,601.80	
	RIO TINTO PLC - REG	27,393	53.20	1,457,307.60	
	ASHTREAD GROUP PLC	10,803	39.69	428,771.07	
	BAE SYSTEMS PLC	76,935	7.41	570,242.22	
	BUNZL PLC	8,088	29.32	237,140.16	
	DCC PLC	2,742	62.16	170,442.72	
	FERGUSON PLC	5,357	98.74	528,950.18	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	120,838	1.16	140,232.49	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	199,281	0.83	167,097.11	
	SMITHS GROUP PLC	11,001	15.03	165,345.03	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,764	111.85	197,303.40	
	EXPERIAN PLC	22,388	26.96	603,580.48	
	INTERTEK GROUP PLC	3,897	49.50	192,901.50	
	RELX PLC	45,254	22.93	1,037,674.22	
	RENTOKIL INITIAL PLC	44,527	5.18	230,649.86	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	28,143	4.84	136,437.26	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,137	39.87	125,072.19	
	BURBERRY GROUP PLC	9,882	15.75	155,641.50	
	PERSIMMON PLC	7,710	21.11	162,758.10	
	TAYLOR WIMPEY PLC	89,763	1.25	112,652.56	

NEW WHITBREAD PLC	5,604	26.58	148,954.32
COMPASS GROUP PLC	43,337	18.08	783,532.96
ENTAIN PLC	14,105	13.64	192,462.72
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,427	48.75	215,816.25
AUTO TRADER GROUP PLC	23,487	5.59	131,480.22
INFORMA PLC	35,952	5.41	194,500.32
PEARSON PLC	17,858	7.43	132,792.08
WPP PLC	28,046	9.84	276,140.91
JD SPORTS FASHION PLC	71,938	1.31	94,562.50
KINGFISHER PLC	51,600	2.55	131,734.80
NEXT PLC	3,171	64.80	205,480.80
OCADO GROUP PLC	13,464	8.10	109,166.11
SAINSBURY (J) PLC	48,997	2.38	117,004.83
TESCO PLC	186,149	2.81	523,450.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,844	16.68	164,247.14
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53,167	34.29	1,823,096.43
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,011	17.66	88,519.31
DIAGEO PLC	56,892	38.23	2,175,265.62
IMPERIAL BRANDS PLC	22,846	17.07	389,981.22
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,389	64.58	1,122,981.62
UNILEVER PLC	45,715	37.47	1,712,941.05
SMITH & NEPHEW PLC	21,086	12.76	269,057.36
ASTRAZENECA PLC	37,845	102.86	3,892,736.70
GLAXOSMITHKLINE PLC	122,794	17.55	2,155,525.87
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	4,931	17.24	85,010.44
BARCLAYS PLC	406,428	1.50	611,105.14
HSBC HOLDINGS PLC	496,747	5.01	2,490,689.45
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,725,596	0.43	757,105.24
NATWEST GROUP PLC	136,028	2.10	285,658.80
STANDARD CHARTERED PLC	63,028	5.81	366,444.79
3I GROUP PLC	23,427	13.10	306,893.70
ABRDN PLC	47,403	1.89	89,733.87
HARGREAVES LANSDOWN PLC	9,973	8.84	88,221.15
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	7,987	72.20	576,661.40
M&G PLC	64,778	2.13	138,560.14
SCHRODERS PLC	2,720	28.64	77,900.80
ST JAMES'S PLACE PLC	13,033	12.45	162,326.01
ADMIRAL GROUP PLC	5,370	22.49	120,771.30
AVIVA PLC	91,548	4.08	373,698.93

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	144,195	2.48	358,612.96	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	18,312	6.16	112,948.41	
	PRUDENTIAL PLC	66,706	9.60	640,377.60	
	BRITISH LAND COMPANY PLC	24,692	5.01	123,805.68	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,548	7.29	127,924.92	
	SEGRO PLC	28,958	11.12	322,157.75	
	AVEVA GROUP PLC	3,417	21.30	72,782.10	
	SAGE GROUP PLC (THE)	25,503	6.89	175,868.68	
	HALMA PLC	9,086	22.18	201,527.48	
	BT GROUP PLC	215,669	1.80	389,498.21	
	VODAFONE GROUP PLC	663,625	1.17	781,882.97	
	NEW SEVERN TRENT PLC	6,114	30.78	188,188.92	
	NATIONAL GRID PLC	88,049	12.20	1,074,197.80	
	SSE PLC	25,786	18.51	477,298.86	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,235	11.17	181,426.12	
小計	銘柄数：82			45,921,339.62	
				(7,304,707,493)	
	組入時価比率：4.6%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	6,160	17.35	106,876.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	195	820.00	159,900.00	
	GIVAUDAN-REG	224	3,643.00	816,032.00	
	HOLCIM LTD	12,665	47.29	598,927.85	
	SIKA AG-REG	3,451	263.90	910,718.90	
	ABB LTD	39,966	28.82	1,151,820.12	
	GEBERIT AG-REG	867	529.40	458,989.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	440	185.20	81,488.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,123	184.15	206,800.45	
	VAT GROUP AG	650	282.00	183,300.00	
	ADECCO GROUP AG(REG)	4,310	35.75	154,082.50	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	144	2,473.00	356,112.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,305	259.20	338,256.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-RE	12,716	106.50	1,354,254.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	800	249.00	199,200.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	1,059	47.52	50,323.68	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	84	2,260.00	189,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	9,880.00	247,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	105,400.00	316,200.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	68,806	122.54	8,431,487.24	
	ALCON INC	12,138	71.12	863,254.56	

	SONOVA HOLDING AG-REG	1,297	334.10	433,327.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,820	119.00	335,580.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	640	73.55	47,072.00	
	LONZA AG-REG	1,812	551.20	998,774.40	
	NOVARTIS AG-REG SHS	53,521	86.36	4,622,073.56	
	ROCHE HOLDING AG-BR	768	349.80	268,646.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	17,169	319.00	5,476,911.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	1,201	172.50	207,172.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	63,976	6.50	416,355.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,285	47.27	249,821.95	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	550	1,031.00	567,050.00	
	UBS GROUP AG	85,663	17.23	1,475,973.49	
	BALOISE HOLDING AG	1,085	162.20	175,987.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	761	546.80	416,114.80	
	SWISS RE AG	7,308	81.54	595,894.32	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,667	458.60	1,681,686.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,121	95.90	203,403.90	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,647	100.65	165,770.55	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4,141	59.72	247,300.52	
	SWISSCOM AG-REG	623	580.60	361,713.80	
小計	銘柄数：41			36,121,492.99	
				(4,670,509,043)	
	組入時価比率：2.9%			3.0%	
スウェーデン	LUNDIN ENERGY AB	4,749	429.80	2,041,120.20	
クローナ	BOLIDEN AB	6,565	361.60	2,373,904.00	
	BOLIDEN AB-RED SHS	6,565	15.47	101,593.37	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	14,510	174.95	2,538,524.50	
	ALFA LAVAL AB	7,491	258.40	1,935,674.40	
	ASSA ABLOY AB-B	24,268	233.20	5,659,297.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,160	108.50	7,069,860.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	37,560	93.29	3,503,972.40	
	EPIROC AB-A	15,794	182.90	2,888,722.60	
	EPIROC AB-B	9,615	159.60	1,534,554.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,729	92.30	1,082,586.70	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	3,179	232.10	737,845.90	
	LIFCO AB-B SHS	6,525	187.35	1,222,458.75	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	34,294	90.00	3,086,460.00	
	SANDVIK AB	27,286	187.45	5,114,760.70	

	SKANSKA AB-B SHS	8,367	171.75	1,437,032.25	
	SKF AB-B SHARES	9,369	169.85	1,591,324.65	
	VOLVO AB-A SHS	5,697	170.60	971,908.20	
	VOLVO AB-B SHS	34,556	162.88	5,628,481.28	
	SECURITAS AB-B SHS	6,874	106.50	732,081.00	
	ELECTROLUX AB-B	6,380	157.84	1,007,019.20	
	EVOLUTION AB	4,146	1,004.40	4,164,242.40	
	EMBRACER GROUP AB	15,766	72.35	1,140,670.10	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	17,377	129.30	2,246,846.10	
	SWEDISH MATCH AB	37,832	100.95	3,819,140.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,617	265.60	3,882,275.20	
	GETINGE AB-B SHS	5,413	292.20	1,581,678.60	
	NORDEA BANK ABP	77,777	98.56	7,665,701.12	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	39,218	108.35	4,249,270.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	34,993	97.66	3,417,416.38	
	SWEDBANK AB-A SHARES	21,748	151.20	3,288,297.60	
	EQT AB	7,065	272.90	1,928,038.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,826	248.60	951,143.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,591	245.30	880,872.30	
	INVESTOR AB-A SHS	12,021	190.80	2,293,606.80	
	INVESTOR AB-B SHS	44,263	175.92	7,786,746.96	
	KINNEVIK AB - B	6,732	173.25	1,166,319.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,181	463.50	1,010,893.50	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,932	420.50	1,232,906.00	
	SAGAX AB-B	4,563	242.00	1,104,246.00	
	SINCH AB	14,643	45.38	664,572.55	
	ERICSSON LM-B SHS	70,646	77.54	5,477,890.84	
	HEXAGON AB-B SHS	47,135	117.80	5,552,503.00	
	TELE2 AB -B SHS	11,144	132.40	1,475,465.60	
	TELIA COMPANY AB	64,795	40.82	2,644,931.90	
小計	銘柄数：45			121,884,856.45	
				(1,572,314,648)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	2,616	359.70	940,975.20	
	EQUINOR ASA	23,736	331.95	7,879,165.20	
	NORSK HYDRO ASA	32,250	68.60	2,212,350.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,598	463.20	2,129,793.60	
	ADEVINTA ASA	5,871	64.30	377,505.30	

小計	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,116	174.40	369,030.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,445	193.90	280,185.50	
	MOWI ASA	10,520	236.40	2,486,928.00	
	ORKLA ASA	18,690	76.00	1,420,440.00	
	DNB BANK ASA	25,314	185.15	4,686,887.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,694	200.00	1,138,800.00	
	TELENOR ASA	16,675	126.10	2,102,717.50	
	銘柄数：12			26,024,777.80 (345,609,049)	
組入時価比率：0.2%			0.2%		
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,930	529.20	1,550,556.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,927	427.70	2,107,277.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	155	1,734.00	268,770.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	24,476	148.14	3,625,874.64	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	76	19,150.00	1,455,400.00	
	A.P.MOLLER MAERSK	139	19,675.00	2,734,825.00	
	DSV A/S	4,949	1,056.50	5,228,618.50	
	PANDORA A/S	2,747	540.40	1,484,478.80	
	CARLSBERG AS-B	2,402	876.80	2,106,073.60	
	AMBU A/S-B	4,820	86.90	418,858.00	
	COLOPLAST-B	2,863	851.00	2,436,413.00	
	DEMANT A/S	2,275	280.00	637,000.00	
	GN STORE NORD A/S	3,468	226.80	786,542.40	
	GENMAB A/S	1,589	2,033.00	3,230,437.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,134	749.10	30,813,479.40	
	DANSKE BANK A/S	16,473	104.85	1,727,194.05	
	TRYG A/S	9,977	153.70	1,533,464.90	
	ORSTED A/S	4,571	694.50	3,174,559.50	
	銘柄数：18			65,319,822.69 (1,184,901,583)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
オーストラリ アドル	AMPOL LTD	6,766	33.92	229,502.72	
	SANTOS LIMITED	77,614	8.05	624,792.70	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,444	26.27	116,743.88	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	23,442	30.40	712,636.80	
	AMCOR PLC-CD1	11,739	18.33	215,175.87	
	BHP GROUP LIMITED	79,472	45.84	3,642,996.48	
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,675	17.64	205,947.00	

EVOLUTION MINING LTD	52,010	3.43	178,394.30
FORTESCUE METALS GROUP LTD	41,009	19.39	795,164.51
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	10,670	39.09	417,090.30
MINERAL RESOURCES LTD	4,665	54.07	252,236.55
NEWCREST MINING LTD	21,462	24.58	527,535.96
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	26,283	8.53	224,193.99
ORICA LTD	9,385	16.38	153,726.30
RIO TINTO LIMITED	9,006	105.59	950,943.54
SOUTH32 LTD	112,350	4.41	495,463.50
REECE LTD	8,204	15.93	130,689.72
BRAMBLES LTD	35,009	10.43	365,143.87
AURIZON HOLDINGS LTD	52,443	3.96	207,674.28
QANTAS AIRWAYS LTD	19,037	5.29	100,705.73
TRANSURBAN GROUP	74,435	13.92	1,036,135.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	14,472	31.62	457,604.64
CROWN RESORTS LTD	10,933	12.66	138,411.78
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,722	67.77	116,699.94
IDP EDUCATION LTD	5,932	23.17	137,444.44
TABCORP HOLDINGS LIMITED	52,786	5.18	273,431.48
REA GROUP LTD	1,488	111.31	165,629.28
SEEK LTD	8,301	24.81	205,947.81
WESFARMERS LTD	27,549	49.97	1,376,623.53
COLES GROUP LTD	32,141	18.35	589,787.35
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	31,659	7.59	240,291.81
WOOLWORTHS GROUP LTD	29,413	37.64	1,107,105.32
TREASURY WINE ESTATES LTD	20,267	11.09	224,761.03
COCHLEAR LIMITED	1,602	214.56	343,725.12
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,341	77.16	334,951.56
SONIC HEALTHCARE LIMITED	10,895	36.05	392,764.75
CSL LIMITED	11,677	280.20	3,271,895.40
AUST&NZ BANKING GROUP LTD	68,629	25.39	1,742,490.31
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	41,655	102.28	4,260,473.40
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,770	31.14	2,484,037.80
WESTPAC BANKING CORPORATION	89,365	24.00	2,144,760.00
ASX LTD	4,627	82.07	379,737.89
MACQUARIE GROUP LIMITED	8,246	183.11	1,509,925.06
INSURANSE AUSTRALIA GROUP LTD	61,076	4.62	282,171.12
MEDIBANK PRIVATE LTD	77,127	3.19	246,035.13
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	35,366	12.70	449,148.20

	SUNCORP GROUP LTD	31,231	11.85	370,087.35	
	DEXUS/AU	25,482	10.67	271,892.94	
	GENERAL PROPERTY TRUST	47,584	4.71	224,120.64	
	GOODMAN GROUP	40,734	19.67	801,237.78	
	LENDLEASE GROUP	19,516	11.35	221,506.60	
	MIRVAC GROUP	97,212	2.21	214,838.52	
	SCENTRE GROUP	125,522	2.83	355,227.26	
	STOCKLAND	56,248	3.92	220,492.16	
	VICINITY CENTRES	110,236	1.84	202,834.24	
	BLOCK INC - CDI	766	114.88	87,998.08	
	COMPUTERSHARE LIMITED	12,935	23.74	307,076.90	
	WISETECH GLOBAL LTD	3,687	41.02	151,240.74	
	XERO LTD	3,187	84.16	268,217.92	
	TELSTRA CORPORATION LTD	99,142	3.93	389,628.06	
	APA GROUP	29,063	11.23	326,377.49	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	39,368	6.80	267,702.40	
小計	銘柄数：62			39,139,226.43	
				(3,523,704,555)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31,467	7.30	229,709.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,835	21.05	333,326.75	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,687	9.39	81,570.93	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,695	4.90	258,205.50	
	MERCURY NZ LTD	12,071	5.65	68,201.15	
	MERIDIAN ENERGY LTD	36,812	4.47	164,549.64	
小計	銘柄数：6			1,135,563.07	
				(92,593,812)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	64,775	54.60	3,536,715.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	33,000	100.10	3,303,300.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	52,000	17.66	918,320.00	
	MTR CORP	38,218	42.80	1,635,730.40	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	37,000	26.85	993,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	52,000	41.55	2,160,600.00	
	SANDS CHINA LTD	56,800	15.76	895,168.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	58,600	12.54	734,844.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	47,300	19.84	938,432.00	
	WH GROUP LTD	187,500	5.42	1,016,250.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	89,000	29.70	2,643,300.00	
	HANG SENG BANK	18,400	139.30	2,563,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	29,300	328.60	9,627,980.00	
	AIA GROUP LTD	295,200	73.25	21,623,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	48,275	53.50	2,582,712.50	
	ESR CAYMAN LTD	49,800	22.95	1,142,910.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	44,000	14.30	629,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	34,259	31.65	1,084,297.35	
	LINK REIT	50,400	68.35	3,444,840.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	35,131	28.65	1,006,503.15	
	SINO LAND CO	94,704	10.82	1,024,697.28	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	31,500	94.00	2,961,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD A	11,500	44.05	506,575.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	29,000	18.58	538,820.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	41,625	38.00	1,581,750.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	97,000	11.18	1,084,460.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	19,000	55.15	1,047,850.00	
	CLP HOLDINGS LIMITED	39,400	76.10	2,998,340.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	70,723	7.76	548,810.48	
	HONG KONG & CHINA GAS	268,515	8.50	2,282,377.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	34,000	54.50	1,853,000.00	
小計	銘柄数 : 31			78,908,752.66	
				(1,303,572,593)	
	組入時価比率 : 0.8%			0.8%	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP	34,300	6.56	225,008.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	40,900	3.98	162,782.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	34,500	5.16	178,020.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	124,800	0.77	96,720.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	54,000	4.19	226,260.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	44,024	31.23	1,374,869.52	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	82,054	11.71	960,852.34	
	UNITED OVERSEAS BANK	28,600	28.49	814,814.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	9.67	212,740.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	93,752	2.70	253,130.40	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	114,911	2.27	260,847.97	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	62,300	3.79	236,117.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	1,097	1.27	1,393.19	
	CITY DEVELOPMENTS	6,900	8.18	56,442.00	

小計	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	52,800	1.76	92,928.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	62,661	1.62	101,510.82	
	UOL GROUP LIMITED	14,000	7.06	98,840.00	
	VENTURE CORP LTD	6,000	17.28	103,680.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	198,490	2.75	545,847.50	
	銘柄数：19 組入時価比率：0.3%			6,002,802.74 (559,041,019) 0.4%	
イスラエル シュケル	ICL GROUP LTD	17,649	39.03	688,840.47	
	ELBIT SYSTEMS LTD	602	695.00	418,390.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	9,016	26.16	235,858.56	
	BANK HAPOALIM BM	27,115	30.73	833,243.95	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	34,928	32.86	1,147,734.08	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	28,785	18.69	537,991.65	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,965	110.40	437,736.00	
	AZRIELI GROUP	1,219	253.60	309,138.40	
	NICE LTD	1,513	688.40	1,041,549.20	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.1%		5,650,482.31 (215,250,603) 0.1%	
合計			155,143,859,644 (155,143,859,644)		

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
ドル	株式 642銘柄	100.0%	73.5%
カナダドル	株式 88銘柄	100.0%	3.8%
ユーロ	株式 239銘柄	100.0%	9.3%
債券	株式 82銘柄	100.0%	4.7%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 45銘柄	100.0%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%	0.8%
オーストラリアドル	株式 62銘柄	100.0%	2.3%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式 31銘柄	100.0%	0.8%
シンガポールドル	株式 19銘柄	100.0%	0.4%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日立外国債券インデックスマザーファンド

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	73,416,382	118,828,377
コール・ローン	28,953,950	26,431,995
国債証券	40,400,142,707	44,897,900,917
未収利息	274,030,387	273,070,190
前払費用	7,508,503	23,511,310
流動資産合計	40,784,051,929	45,339,742,789
資産合計	40,784,051,929	45,339,742,789
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,600,000	7,800,000
未払利息	79	72
流動負債合計	25,600,079	7,800,072
負債合計	25,600,079	7,800,072
純資産の部		
元本等		
元本	16,804,600,311	18,408,482,461
剰余金		
剰余金又は欠損金()	23,953,851,539	26,923,460,256
元本等合計	40,758,451,850	45,331,942,717
純資産合計	40,758,451,850	45,331,942,717
負債純資産合計	40,784,051,929	45,339,742,789

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2.収益及び費用の計上基準	<p>受取利息</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	16,804,600,311口	18,408,482,461口
1口当たり純資産額	2.4254円	2.4626円
(1万口当たり純資産額)	(24,254円)	(24,626円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p>
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>リスク管理/コンプライアンス部門が日々投資信託協会の諸規則、信託約款等の遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスクのモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制としております。</p> <p>また、マザーファンド運用の再委託先において市場リスク等運用リスクのモニターを行っており、そのリスク管理が適正に行われているかを定期的に確認しております。</p> <p>なお、運用リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの分析・評価及び運用リスクの管理を定期的に行っております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価に関する事項

項目	2022年 5月16日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>有価証券等 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	2021年 5月17日現在	2022年 5月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	327,418,474	1,405,645,004
合計	327,418,474	1,405,645,004

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	自 2020年 5月16日 至 2021年 5月17日	自 2021年 5月18日 至 2022年 5月16日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	17,471,283,361円	16,804,600,311円
期中追加設定元本額	948,700,695円	2,459,626,876円
期中一部解約元本額	1,615,383,745円	855,744,726円
期末元本額	16,804,600,311円	18,408,482,461円
元本の内訳*		
日立バランスファンド（株式70）	1,118,103,570円	1,181,510,488円
日立バランスファンド（株式50）	982,624,169円	986,377,942円
日立バランスファンド（株式30）	355,575,472円	345,216,309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）	7,795,914,735円	9,457,003,894円
日立外国債券インデックスファンド	6,552,382,365円	6,438,373,828円

（注）*は当該親信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

(2022年 5月16日現在)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	0.125% US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,166,234.37	
		0.125% US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,061,302.34	
		0.125% US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,327,080.46	
		0.125% US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,493,933.60	
		0.125% US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,076,862.50	
		0.125% US TREASURY N/B	990,000.00	949,239.84	
		0.250% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,161,375.00	
		0.250% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,054,625.00	
		0.250% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,108,031.25	
		0.250% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,059,437.50	
		0.250% US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,378,359.37	
		0.250% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,097,625.00	
		0.375% US TREASURY N/B	950,000.00	922,242.18	
		0.375% US TREASURY N/B	1,040,000.00	996,774.99	
		0.375% US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,519,000.00	
		0.375% US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,562,472.66	
		0.375% US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,046,217.19	
		0.375% US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,369,101.57	
		0.375% US TREASURY N/B	820,000.00	716,154.69	
		0.500% US TREASURY N/B	980,000.00	950,676.56	
		0.500% US TREASURY N/B	1,100,000.00	976,250.00	
		0.500% US TREASURY N/B	800,000.00	705,187.50	
		0.500% US TREASURY N/B	900,000.00	789,539.06	
		0.625% US TREASURY N/B	990,000.00	941,273.43	
		0.625% US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,019,462.50	
		0.625% US TREASURY N/B	380,000.00	340,842.18	
		0.625% US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,314,925.00	
		0.625% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,057,125.00	
		0.625% US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,170,640.63	
		0.625% US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,289,527.35	

0.750% US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,222,041.41	
0.750% US TREASURY N/B	1,000,000.00	971,796.88	
0.750% US TREASURY N/B	780,000.00	742,218.75	
0.750% US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,457,550.00	
0.750% US TREASURY N/B	1,010,000.00	892,824.22	
0.875% US TREASURY N/B	800,000.00	777,500.00	
0.875% US TREASURY N/B	600,000.00	553,171.87	
0.875% US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,056,387.50	
1.000% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,051,875.00	
1.000% US TREASURY N/B	770,000.00	684,578.12	
1.125% US TREASURY N/B	50,000.00	47,890.62	
1.125% US TREASURY N/B	500,000.00	477,812.50	
1.125% US TREASURY N/B	970,000.00	898,310.93	
1.125% US TREASURY N/B	1,050,000.00	939,585.93	
1.125% US TREASURY N/B	2,210,000.00	1,904,398.43	
1.125% US TREASURY N/B	820,000.00	578,676.56	
1.125% US TREASURY N/B	1,330,000.00	931,103.91	
1.250% US TREASURY N/B	990,000.00	897,960.93	
1.250% US TREASURY N/B	980,000.00	887,971.87	
1.250% US TREASURY N/B	950,000.00	859,156.25	
1.250% US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,057,711.72	
1.250% US TREASURY N/B	1,050,000.00	977,156.25	
1.250% US TREASURY N/B	850,000.00	789,437.50	
1.250% US TREASURY N/B	600,000.00	545,015.62	
1.250% US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,350,937.50	
1.250% US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,564,518.75	
1.250% US TREASURY N/B	980,000.00	630,185.94	
1.375% US TREASURY N/B	640,000.00	634,000.00	
1.375% US TREASURY N/B	900,000.00	889,382.81	
1.375% US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,006,453.12	
1.375% US TREASURY N/B	520,000.00	500,946.87	
1.375% US TREASURY N/B	550,000.00	516,441.40	
1.375% US TREASURY N/B	1,000,000.00	907,109.38	
1.375% US TREASURY N/B	960,000.00	869,400.00	
1.375% US TREASURY N/B	1,690,000.00	1,471,752.35	
1.375% US TREASURY N/B	1,120,000.00	819,875.00	
1.375% US TREASURY N/B	1,410,000.00	938,310.93	
1.500% US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,019,484.37	
1.500% US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,661,825.00	

1.500% US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,295,475.00	
1.500% US TREASURY N/B	1,020,000.00	931,626.56	
1.500% US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,397,906.25	
1.625% US TREASURY N/B	660,000.00	657,164.06	
1.625% US TREASURY N/B	720,000.00	716,006.25	
1.625% US TREASURY N/B	710,000.00	702,178.90	
1.625% US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,079,679.68	
1.625% US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,571,238.28	
1.625% US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,043,109.37	
1.625% US TREASURY N/B	180,000.00	170,437.50	
1.625% US TREASURY N/B	920,000.00	842,446.87	
1.625% US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,551,999.22	
1.625% US TREASURY N/B	1,360,000.00	968,043.75	
1.750% US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,255,471.87	
1.750% US TREASURY N/B	870,000.00	845,191.41	
1.750% US TREASURY N/B	1,000,000.00	949,921.88	
1.750% US TREASURY N/B	1,020,000.00	945,492.19	
1.750% US TREASURY N/B	1,240,000.00	959,740.63	
1.875% US TREASURY N/B	950,000.00	932,335.93	
1.875% US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,076,250.00	
1.875% US TREASURY N/B	680,000.00	653,065.62	
1.875% US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,098,250.00	
1.875% US TREASURY N/B	850,000.00	794,152.34	
1.875% US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,591,953.12	
1.875% US TREASURY N/B	1,040,000.00	829,562.50	
1.875% US TREASURY N/B	800,000.00	607,625.00	
1.875% US TREASURY N/B	1,240,000.00	942,884.38	
2.000% US TREASURY N/B	630,000.00	622,764.84	
2.000% US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,471,491.41	
2.000% US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,233,203.12	
2.000% US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,664,671.87	
2.000% US TREASURY N/B	1,490,000.00	1,450,654.68	
2.000% US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,462,050.00	
2.000% US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,018,532.81	
2.000% US TREASURY N/B	1,040,000.00	813,312.50	
2.000% US TREASURY N/B	1,140,000.00	892,851.56	
2.125% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,055,031.25	
2.125% US TREASURY N/B	780,000.00	774,150.00	
2.125% US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,368,679.69	

2.125% US TREASURY N/B	870,000.00	859,872.66	
2.125% US TREASURY N/B	500,000.00	493,125.00	
2.125% US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,328,378.91	
2.125% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,186,461.72	
2.250% US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,296,316.41	
2.250% US TREASURY N/B	870,000.00	866,397.66	
2.250% US TREASURY N/B	900,000.00	895,500.00	
2.250% US TREASURY N/B	750,000.00	741,445.31	
2.250% US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,125,482.81	
2.250% US TREASURY N/B	800,000.00	788,750.00	
2.250% US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,714,589.85	
2.250% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,174,834.37	
2.250% US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,073,664.84	
2.250% US TREASURY N/B	990,000.00	955,891.41	
2.250% US TREASURY N/B	840,000.00	689,259.37	
2.250% US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,434,818.75	
2.250% US TREASURY N/B	1,120,000.00	934,237.49	
2.375% US TREASURY N/B	280,000.00	279,146.87	
2.375% US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,707,234.38	
2.375% US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,443,462.50	
2.375% US TREASURY N/B	250,000.00	241,005.86	
2.375% US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,021,823.44	
2.375% US TREASURY N/B	560,000.00	483,306.25	
2.375% US TREASURY N/B	1,130,000.00	965,973.43	
2.500% US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,203,937.50	
2.500% US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,185,209.37	
2.500% US TREASURY N/B	610,000.00	605,329.68	
2.500% US TREASURY N/B	830,000.00	818,457.80	
2.500% US TREASURY N/B	900,000.00	884,074.22	
2.500% US TREASURY N/B	710,000.00	612,264.06	
2.500% US TREASURY N/B	600,000.00	517,312.50	
2.500% US TREASURY N/B	470,000.00	405,264.84	
2.625% US TREASURY N/B	800,000.00	796,187.50	
2.625% US TREASURY N/B	830,000.00	823,580.47	
2.625% US TREASURY N/B	1,020,000.00	999,281.25	
2.750% US TREASURY N/B	670,000.00	674,082.81	
2.750% US TREASURY N/B	700,000.00	704,375.00	
2.750% US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,136,356.25	
2.750% US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,215,671.87	

2.750% US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,624,809.37	
2.750% US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,157,751.56	
2.750% US TREASURY N/B	410,000.00	373,196.09	
2.750% US TREASURY N/B	800,000.00	726,687.50	
2.750% US TREASURY N/B	990,000.00	899,739.84	
2.875% US TREASURY N/B	490,000.00	490,957.03	
2.875% US TREASURY N/B	580,000.00	581,178.12	
2.875% US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,254,389.06	
2.875% US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,243,457.03	
2.875% US TREASURY N/B	270,000.00	248,948.43	
2.875% US TREASURY N/B	210,000.00	194,610.93	
3.000% US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,055,085.93	
3.000% US TREASURY N/B	330,000.00	314,402.34	
3.000% US TREASURY N/B	610,000.00	574,591.40	
3.000% US TREASURY N/B	420,000.00	395,948.43	
3.000% US TREASURY N/B	330,000.00	311,695.31	
3.000% US TREASURY N/B	510,000.00	483,503.90	
3.000% US TREASURY N/B	400,000.00	379,687.50	
3.000% US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,292,308.60	
3.000% US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,253,382.81	
3.125% US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,685,134.37	
3.125% US TREASURY N/B	370,000.00	360,027.34	
3.125% US TREASURY N/B	430,000.00	415,386.72	
3.125% US TREASURY N/B	540,000.00	520,087.50	
3.125% US TREASURY N/B	1,620,000.00	1,589,751.57	
3.375% US TREASURY N/B	480,000.00	481,275.00	
3.500% US TREASURY N/B	160,000.00	168,012.50	
3.625% US TREASURY N/B	190,000.00	198,193.75	
3.625% US TREASURY N/B	710,000.00	739,842.18	
4.250% US TREASURY N/B	240,000.00	275,906.25	
4.250% US TREASURY N/B	330,000.00	375,555.47	
4.375% US TREASURY N/B	290,000.00	337,691.40	
4.375% US TREASURY N/B	210,000.00	244,125.00	
4.375% US TREASURY N/B	210,000.00	242,435.15	
4.500% US TREASURY N/B	150,000.00	177,386.71	
4.500% US TREASURY N/B	30,000.00	35,517.18	
4.500% US TREASURY N/B	230,000.00	272,226.56	
4.625% US TREASURY N/B	220,000.00	263,828.12	
4.750% US TREASURY N/B	50,000.00	60,640.62	

小計	5.000% US TREASURY N/B	40,000.00	49,640.62	
	5.250% US TREASURY N/B	860,000.00	977,376.56	
	5.375% US TREASURY N/B	100,000.00	118,882.81	
	6.125% US TREASURY N/B	120,000.00	139,284.37	
	6.250% US TREASURY N/B	200,000.00	209,953.12	
	6.250% US TREASURY N/B	180,000.00	222,609.37	
	銘柄数：192 組入時価比率：49.5%	185,850,000.00	173,140,343.03 (22,447,645,473) 50.0%	
カナダドル	0.250% CANADA GOV'T	340,000.00	325,332.40	
	0.250% CANADA GOV'T	450,000.00	410,341.50	
	0.500% CANADA GOV'T	650,000.00	531,505.00	
	0.750% CANADA GOV'T	270,000.00	258,214.50	
	1.000% CANADA GOV'T	290,000.00	266,249.00	
	1.250% CANADA GOV'T	200,000.00	186,372.00	
	1.250% CANADA GOV'T	670,000.00	590,739.00	
	1.500% CANADA GOV'T	200,000.00	198,042.00	
	1.500% CANADA GOV'T	410,000.00	399,524.50	
	1.500% CANADA GOV'T	330,000.00	314,661.60	
	1.500% CANADA GOV'T	530,000.00	466,203.90	
	2.000% CANADA GOV'T	680,000.00	675,648.00	
	2.000% CANADA GOV'T	250,000.00	239,030.00	
	2.000% CANADA GOV'T	620,000.00	506,050.20	
	2.250% CANADA GOV'T	430,000.00	427,342.60	
	2.250% CANADA GOV'T	740,000.00	730,653.80	
	2.250% CANADA GOV'T	350,000.00	336,770.00	
	2.500% CANADA GOV'T	280,000.00	279,193.60	
	2.750% CANADA GOV'T	330,000.00	317,064.00	
	2.750% CANADA GOV'T	180,000.00	170,082.00	
	3.500% CANADA GOV'T	370,000.00	401,453.70	
	4.000% CANADA GOV'T	150,000.00	170,722.50	
	5.000% CANADA GOV'T	120,000.00	147,992.40	
5.750% CANADA GOV'T	420,000.00	497,191.80		
5.750% CANADA GOV'T	250,000.00	314,512.50		
小計	銘柄数：25 組入時価比率：2.0%	9,510,000.00	9,160,892.50 (920,028,433) 2.0%	
メキシコペソ	10.00% MEX BONOS DESARR F	5,680,000.00	5,847,383.92	
	10.00% MEX BONOS DESARR F	1,840,000.00	2,004,312.00	

小計	5.750% MEX BONOS DESARR F	8,700,000.00	7,843,920.00	
	7.500% MEX BONOS DESARR F	5,680,000.00	5,369,872.00	
	7.750% MEX BONOS DESARR F	5,170,000.00	4,814,821.00	
	7.750% MEX BONOS DESARR F	2,800,000.00	2,592,886.80	
	7.750% MEX BONOS DESARR F	3,680,000.00	3,304,157.92	
	8.000% MEX BONOS DESARR F	4,140,000.00	4,114,236.78	
	8.000% MEX BONOS DESARR F	4,550,000.00	4,453,312.50	
	8.000% MEX BONOS DESARR F	4,300,000.00	3,877,365.90	
	8.500% MEX BONOS DESARR F	4,180,000.00	4,110,612.00	
	8.500% MEX BONOS DESARR F	3,570,000.00	3,452,859.37	
	銘柄数 : 12 組入時価比率 : 0.7%	54,290,000.00	51,785,740.19 (333,945,524) 0.7%	
ユーロ	0.000% DEUTSCHLAND REP	730,000.00	686,127.00	
	0.000% BELGIUM KINGDOM	240,000.00	209,592.00	
	0.000% BUONI POLIENNALI	290,000.00	286,375.00	
	0.000% BUONI POLIENNALI	410,000.00	404,752.00	
	0.000% BUONI POLIENNALI	140,000.00	136,612.00	
	0.000% BUONI POLIENNALI	350,000.00	327,565.00	
	0.000% BUONI POLIENNALI	300,000.00	278,460.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	500,000.00	500,800.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	410,164.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	449,235.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	450,000.00	447,300.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	420,000.00	416,052.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	330,000.00	325,512.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	540,000.00	530,280.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	720,000.00	705,024.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	390,000.00	376,623.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	406,565.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	750,000.00	700,575.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	710,000.00	658,809.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	356,618.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	388,914.00	
	0.000% DEUTSCHLAND REP	150,000.00	106,935.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	480,000.00	479,088.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	990,000.00	986,931.00	
	0.000% FRANCE GOV'T	780,000.00	769,392.00	
0.000% FRANCE GOV'T	350,000.00	341,355.00		

0.000% FRANCE GOV'T	720,000.00	692,136.00	
0.000% FRANCE GOV'T	710,000.00	650,928.00	
0.000% FRANCE GOV'T	890,000.00	797,885.00	
0.000% FRANCE GOV'T	900,000.00	789,390.00	
0.000% IRISH GOV'T	230,000.00	199,985.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	240,000.00	239,620.80	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	420,000.00	406,770.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	270,000.00	247,698.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	100,000.00	90,310.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	120,000.00	96,300.00	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	230,000.00	157,642.00	
0.000% REP OF AUSTRIA	190,000.00	189,221.00	
0.000% REP OF AUSTRIA	300,000.00	272,280.00	
0.000% REP OF AUSTRIA	240,000.00	213,720.00	
0.000% REP OF AUSTRIA	70,000.00	51,142.00	
0.000% SPANISH GOV'T	380,000.00	376,086.00	
0.100% SPANISH GOV'T	560,000.00	480,032.00	
0.125% FINNISH GOV'T	160,000.00	130,560.00	
0.200% BELGIUM KINGDOM	220,000.00	220,814.00	
0.200% IRISH GOV'T	250,000.00	227,200.00	
0.250% BUONI POLIENNALI	330,000.00	295,977.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	590,000.00	581,976.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	418,132.00	
0.250% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	426,096.00	
0.250% FRANCE GOV'T	700,000.00	683,340.00	
0.250% NETHERLANDS GOV'T	340,000.00	337,586.00	
0.250% NETHERLANDS GOV'T	360,000.00	342,036.00	
0.250% SPANISH GOV'T	350,000.00	347,620.00	
0.300% BUONI POLIENNALI	500,000.00	500,000.00	
0.350% BUONI POLIENNALI	350,000.00	341,460.00	
0.350% SPANISH GOV'T	350,000.00	350,980.00	
0.450% BUONI POLIENNALI	290,000.00	255,751.00	
0.500% BUONI POLIENNALI	280,000.00	252,672.00	
0.500% BELGIUM KINGDOM	150,000.00	150,525.00	
0.500% BUONI POLIENNALI	720,000.00	691,416.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	570,000.00	573,249.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	760,000.00	761,444.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	550,000.00	546,645.00	
0.500% DEUTSCHLAND REP	430,000.00	425,915.00	

0.500% FINNISH GOV'T	220,000.00	218,218.00	
0.500% FINNISH GOV'T	120,000.00	117,576.00	
0.500% FINNISH GOV'T	230,000.00	219,512.00	
0.500% FRANCE GOV'T	250,000.00	135,950.00	
0.500% FRANCE GOV'T	820,000.00	819,426.00	
0.500% FRANCE GOV'T	860,000.00	852,948.00	
0.500% FRANCE GOV'T	1,130,000.00	1,086,156.00	
0.500% FRANCE GOV'T	590,000.00	471,115.00	
0.500% NETHERLANDS GOV'T	340,000.00	338,606.00	
0.500% NETHERLANDS GOV'T	240,000.00	206,688.00	
0.500% REP OF AUSTRIA	370,000.00	355,311.00	
0.500% SPANISH GOV'T	440,000.00	402,952.00	
0.600% BUONI POLIENNALI	330,000.00	272,283.00	
0.600% SPANISH GOV'T	420,000.00	391,692.00	
0.650% BELGIUM KINGDOM	90,000.00	51,156.00	
0.650% BUONI POLIENNALI	540,000.00	541,458.00	
0.700% REP OF AUSTRIA	70,000.00	45,542.00	
0.700% SPANISH GOV'T	300,000.00	264,960.00	
0.750% FINNISH GOV'T	180,000.00	171,702.00	
0.750% FRANCE GOV'T	1,020,000.00	1,007,250.00	
0.750% FRANCE GOV'T	940,000.00	924,772.00	
0.750% FRANCE GOV'T	460,000.00	338,560.00	
0.750% FRANCE GOV'T	170,000.00	122,774.00	
0.750% NETHERLANDS GOV'T	350,000.00	349,895.00	
0.750% NETHERLANDS GOV'T	240,000.00	238,368.00	
0.750% REP OF AUSTRIA	320,000.00	319,456.00	
0.750% REP OF AUSTRIA	100,000.00	98,920.00	
0.800% BELGIUM KINGDOM	330,000.00	332,904.00	
0.800% BELGIUM KINGDOM	250,000.00	249,350.00	
0.800% BELGIUM KINGDOM	420,000.00	415,968.00	
0.800% SPANISH GOV'T	140,000.00	136,570.00	
0.850% BUONI POLIENNALI	420,000.00	401,310.00	
0.850% REP OF AUSTRIA	90,000.00	49,716.00	
0.850% SPANISH GOV'T	190,000.00	153,672.00	
0.875% FINNISH GOV'T	90,000.00	90,837.00	
0.900% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	364,820.00	
0.900% IRISH GOV'T	300,000.00	297,660.00	
0.950% BUONI POLIENNALI	380,000.00	321,632.00	
0.950% BUONI POLIENNALI	580,000.00	549,782.00	

0.950% BUONI POLIENNALI	490,000.00	430,318.00	
0.000% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	506,044.00	
0.000% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	487,600.00	
1.000% BELGIUM KINGDOM	390,000.00	394,992.00	
1.000% BELGIUM KINGDOM	400,000.00	387,720.00	
1.000% DEUTSCHLAND REP	640,000.00	651,200.00	
1.000% DEUTSCHLAND REP	670,000.00	683,400.00	
1.000% FRANCE GOV'T	740,000.00	749,916.00	
1.000% FRANCE GOV'T	680,000.00	685,100.00	
1.000% IRISH GOV'T	290,000.00	293,828.00	
1.000% SPANISH GOV'T	300,000.00	209,130.00	
1.125% FINNISH GOV'T	90,000.00	85,869.00	
1.200% REP OF AUSTRIA	260,000.00	265,226.00	
1.200% SPANISH GOV'T	290,000.00	237,423.00	
1.250% BELGIUM KINGDOM	180,000.00	176,184.00	
1.250% BUONI POLIENNALI	460,000.00	449,144.00	
1.250% DEUTSCHLAND REP	620,000.00	644,056.00	
1.250% FRANCE GOV'T	650,000.00	624,585.00	
1.250% FRANCE GOV'T	640,000.00	604,864.00	
1.250% SPANISH GOV'T	500,000.00	481,200.00	
1.300% IRISH GOV'T	270,000.00	260,577.00	
1.300% SPANISH GOV'T	630,000.00	636,048.00	
1.350% BUONI POLIENNALI	430,000.00	394,138.00	
1.375% FINNISH GOV'T	170,000.00	163,030.00	
1.400% SPANISH GOV'T	430,000.00	430,903.00	
1.400% SPANISH GOV'T	480,000.00	480,048.00	
1.450% BELGIUM KINGDOM	140,000.00	132,608.00	
1.450% BUONI POLIENNALI	270,000.00	271,242.00	
1.450% SPANISH GOV'T	100,000.00	65,180.00	
1.450% SPANISH GOV'T	630,000.00	634,788.00	
1.450% SPANISH GOV'T	340,000.00	338,776.00	
1.500% BUONI POLIENNALI	740,000.00	742,368.00	
1.500% BUONI POLIENNALI	120,000.00	88,524.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	530,000.00	538,798.00	
1.500% DEUTSCHLAND REP	150,000.00	154,020.00	
1.500% FRANCE GOV'T	850,000.00	865,215.00	
1.500% FRANCE GOV'T	630,000.00	577,773.00	
1.500% IRISH GOV'T	120,000.00	108,564.00	
1.500% REP OF AUSTRIA	70,000.00	59,969.00	

1.500% REP OF AUSTRIA	160,000.00	156,800.00	
1.500% SPANISH GOV'T	470,000.00	476,063.00	
1.600% BELGIUM KINGDOM	260,000.00	240,058.00	
1.600% BUONI POLIENNALI	380,000.00	378,746.00	
1.600% SPANISH GOV'T	420,000.00	429,912.00	
1.650% BUONI POLIENNALI	650,000.00	600,080.00	
1.650% BUONI POLIENNALI	550,000.00	498,245.00	
1.650% REP OF AUSTRIA	290,000.00	299,657.00	
1.700% BUONI POLIENNALI	380,000.00	275,082.00	
1.700% IRISH GOV'T	220,000.00	218,350.00	
1.750% BUONI POLIENNALI	460,000.00	466,808.00	
1.750% DEUTSCHLAND REP	670,000.00	689,832.00	
1.750% FRANCE GOV'T	810,000.00	825,876.00	
1.750% FRANCE GOV'T	680,000.00	703,188.00	
1.750% FRANCE GOV'T	630,000.00	635,418.00	
1.750% FRANCE GOV'T	320,000.00	304,960.00	
1.750% NETHERLANDS GOV'T	340,000.00	347,548.00	
1.750% REP OF AUSTRIA	290,000.00	297,569.00	
1.800% BUONI POLIENNALI	180,000.00	146,160.00	
1.850% BUONI POLIENNALI	350,000.00	356,300.00	
1.900% BELGIUM KINGDOM	290,000.00	291,682.00	
1.900% SPANISH GOV'T	110,000.00	93,401.00	
1.950% SPANISH GOV'T	380,000.00	393,148.00	
1.950% SPANISH GOV'T	650,000.00	662,805.00	
2.000% BUONI POLIENNALI	430,000.00	436,450.00	
2.000% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	420,947.00	
2.000% FINNISH GOV'T	140,000.00	144,816.00	
2.000% FRANCE GOV'T	520,000.00	534,560.00	
2.000% IRISH GOV'T	170,000.00	174,488.00	
2.000% NETHERLANDS GOV'T	260,000.00	269,750.00	
2.050% BUONI POLIENNALI	340,000.00	341,088.00	
2.100% BUONI POLIENNALI	390,000.00	395,811.00	
2.100% REP OF AUSTRIA	120,000.00	123,528.00	
2.150% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	206,380.00	
2.150% SPANISH GOV'T	580,000.00	604,882.00	
2.200% BUONI POLIENNALI	430,000.00	435,762.00	
2.250% BELGIUM KINGDOM	60,000.00	61,590.00	
2.250% BELGIUM KINGDOM	190,000.00	201,039.00	
2.250% BUONI POLIENNALI	400,000.00	365,920.00	

2.250% FRANCE GOV'T	720,000.00	749,160.00	
2.350% SPANISH GOV'T	290,000.00	298,555.00	
2.400% IRISH GOV'T	250,000.00	271,900.00	
2.400% REP OF AUSTRIA	150,000.00	165,015.00	
2.450% BUONI POLIENNALI	590,000.00	566,459.00	
2.450% BUONI POLIENNALI	410,000.00	353,584.00	
2.500% BUONI POLIENNALI	420,000.00	433,692.00	
2.500% BUONI POLIENNALI	190,000.00	196,023.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	670,000.00	860,615.00	
2.500% DEUTSCHLAND REP	550,000.00	720,775.00	
2.500% FRANCE GOV'T	950,000.00	1,046,805.00	
2.500% NETHERLANDS GOV'T	370,000.00	415,547.00	
2.600% BELGIUM KINGDOM	420,000.00	441,000.00	
2.625% FINNISH GOV'T	90,000.00	104,508.00	
2.700% BUONI POLIENNALI	310,000.00	288,579.00	
2.700% SPANISH GOV'T	340,000.00	354,756.00	
2.750% FINNISH GOV'T	250,000.00	276,775.00	
2.750% FRANCE GOV'T	830,000.00	912,419.00	
2.750% NETHERLANDS GOV'T	360,000.00	473,040.00	
2.750% SPANISH GOV'T	620,000.00	652,736.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	550,000.00	569,140.00	
2.800% BUONI POLIENNALI	330,000.00	294,558.00	
2.900% SPANISH GOV'T	390,000.00	423,891.00	
2.950% BUONI POLIENNALI	390,000.00	384,579.00	
3.000% BELGIUM KINGDOM	150,000.00	172,215.00	
3.100% BUONI POLIENNALI	310,000.00	310,310.00	
3.150% REP OF AUSTRIA	130,000.00	167,596.00	
3.250% BUONI POLIENNALI	380,000.00	389,614.00	
3.250% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	418,350.00	
3.250% FRANCE GOV'T	540,000.00	682,290.00	
3.350% BUONI POLIENNALI	380,000.00	395,618.00	
3.450% BUONI POLIENNALI	400,000.00	421,000.00	
3.450% SPANISH GOV'T	290,000.00	334,225.00	
3.500% BUONI POLIENNALI	570,000.00	613,434.00	
3.500% FRANCE GOV'T	930,000.00	1,032,300.00	
3.750% BELGIUM KINGDOM	210,000.00	278,901.00	
3.750% BUONI POLIENNALI	380,000.00	403,180.00	
3.750% NETHERLANDS GOV'T	330,000.00	463,485.00	
3.800% REP OF AUSTRIA	70,000.00	111,552.00	

3.800% SPANISH GOV'T	620,000.00	659,928.00	
4.000% BELGIUM KINGDOM	190,000.00	234,612.00	
4.000% BUONI POLIENNALI	630,000.00	704,466.00	
4.000% DEUTSCHLAND REP	640,000.00	895,744.00	
4.000% FINNISH GOV'T	110,000.00	122,001.00	
4.000% FRANCE GOV'T	610,000.00	810,385.00	
4.000% FRANCE GOV'T	390,000.00	587,223.00	
4.000% FRANCE GOV'T	340,000.00	530,230.00	
4.000% NETHERLANDS GOV'T	330,000.00	443,850.00	
4.150% REP OF AUSTRIA	340,000.00	456,110.00	
4.200% SPANISH GOV'T	490,000.00	611,569.00	
4.250% BELGIUM KINGDOM	340,000.00	461,890.00	
4.250% DEUTSCHLAND REP	380,000.00	568,252.00	
4.250% FRANCE GOV'T	1,040,000.00	1,104,064.00	
4.400% SPANISH GOV'T	420,000.00	445,494.00	
4.500% BELGIUM KINGDOM	200,000.00	230,000.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	560,000.00	597,352.00	
4.500% BUONI POLIENNALI	470,000.00	521,277.00	
4.500% FRANCE GOV'T	680,000.00	969,884.00	
4.650% SPANISH GOV'T	650,000.00	728,065.00	
4.700% SPANISH GOV'T	440,000.00	600,292.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	570,000.00	600,723.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	390,000.00	448,383.00	
4.750% BUONI POLIENNALI	310,000.00	390,879.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	280,000.00	348,544.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	440,000.00	630,696.00	
4.750% DEUTSCHLAND REP	410,000.00	656,492.00	
4.750% FRANCE GOV'T	370,000.00	506,012.00	
4.800% SPANISH GOV'T	370,000.00	398,453.00	
4.850% REP OF AUSTRIA	180,000.00	209,466.00	
4.900% SPANISH GOV'T	470,000.00	651,185.00	
5.000% BELGIUM KINGDOM	370,000.00	509,268.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	1,020,000.00	1,124,550.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	370,000.00	451,178.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	430,000.00	540,553.00	
5.000% BUONI POLIENNALI	470,000.00	595,161.00	
5.150% SPANISH GOV'T	510,000.00	626,637.00	
5.150% SPANISH GOV'T	260,000.00	385,502.00	
5.250% BUONI POLIENNALI	610,000.00	732,915.00	

	5.400% IRISH GOV'T	230,000.00	261,625.00	
	5.500% BELGIUM KINGDOM	340,000.00	430,270.00	
	5.500% DEUTSCHLAND REP	340,000.00	472,124.00	
	5.500% FRANCE GOV'T	670,000.00	869,861.00	
	5.500% NETHERLANDS GOV'T	320,000.00	403,072.00	
	5.625% DEUTSCHLAND REP	300,000.00	382,920.00	
	5.750% BUONI POLIENNALI	380,000.00	482,904.00	
	5.750% FRANCE GOV'T	760,000.00	1,077,376.00	
	5.750% SPANISH GOV'T	540,000.00	731,538.00	
	5.900% SPANISH GOV'T	500,000.00	599,550.00	
	6.000% BUONI POLIENNALI	600,000.00	762,360.00	
	6.000% FRANCE GOV'T	570,000.00	675,393.00	
	6.000% SPANISH GOV'T	370,000.00	478,299.00	
	6.250% DEUTSCHLAND REP	220,000.00	309,210.00	
	6.250% REP OF AUSTRIA	350,000.00	447,125.00	
	6.500% BUONI POLIENNALI	530,000.00	655,292.00	
	6.500% DEUTSCHLAND REP	230,000.00	298,448.00	
	7.250% BUONI POLIENNALI	130,000.00	161,031.00	
	9.000% BUONI POLIENNALI	100,000.00	112,320.00	
小計	銘柄数：279	114,660,000.00	119,868,912.80	
	組入時価比率：35.7%		(16,176,309,782)	
			36.0%	
ボンド	0.125% UK TREASURY	150,000.00	143,595.00	
	0.125% UK TREASURY	240,000.00	222,840.00	
	0.250% UK TREASURY	300,000.00	291,210.00	
	0.250% UK TREASURY	500,000.00	437,650.00	
	0.375% UK TREASURY	360,000.00	325,224.00	
	0.500% UK TREASURY	240,000.00	149,592.00	
	0.625% UK TREASURY	290,000.00	284,519.00	
	0.625% UK TREASURY	210,000.00	177,261.00	
	0.750% UK TREASURY	130,000.00	129,363.00	
	0.875% UK TREASURY	260,000.00	247,858.00	
	1.000% UK TREASURY	260,000.00	258,856.00	
	1.125% UK TREASURY	70,000.00	55,510.00	
	1.250% UK TREASURY	250,000.00	248,475.00	
	1.250% UK TREASURY	400,000.00	349,560.00	
	1.500% UK TREASURY	430,000.00	432,924.00	
	1.500% UK TREASURY	330,000.00	295,581.00	
	1.625% UK TREASURY	250,000.00	238,112.50	

	1.625% UK TREASURY	190,000.00	192,242.00	
	1.750% UK TREASURY	420,000.00	405,426.00	
	1.750% UK TREASURY	510,000.00	488,019.00	
	2.000% UK TREASURY	300,000.00	306,840.00	
	2.250% UK TREASURY	650,000.00	658,580.00	
	2.500% UK TREASURY	370,000.00	443,075.00	
	2.750% UK TREASURY	370,000.00	382,284.00	
	3.250% UK TREASURY	370,000.00	447,626.00	
	3.500% UK TREASURY	360,000.00	454,464.00	
	3.500% UK TREASURY	320,000.00	485,152.00	
	3.750% UK TREASURY	350,000.00	489,895.00	
	4.000% UK TREASURY	300,000.00	470,250.00	
	4.250% UK TREASURY	350,000.00	402,430.00	
	4.250% UK TREASURY	300,000.00	369,180.00	
	4.250% UK TREASURY	360,000.00	459,648.00	
	4.250% UK TREASURY	240,000.00	318,456.00	
	4.250% UK TREASURY	310,000.00	416,082.00	
	4.250% UK TREASURY	300,000.00	427,650.00	
	4.250% UK TREASURY	290,000.00	426,213.00	
	4.250% UK TREASURY	320,000.00	501,728.00	
	4.500% UK TREASURY	320,000.00	411,232.00	
	4.500% UK TREASURY	280,000.00	395,724.00	
	4.750% UK TREASURY	310,000.00	388,213.00	
	4.750% UK TREASURY	330,000.00	458,997.00	
	5.000% UK TREASURY	300,000.00	330,150.00	
	6.000% UK TREASURY	230,000.00	294,837.00	
小計	銘柄数：43	13,420,000.00	15,112,523.50	
			(2,403,949,113)	
	組入時価比率：5.3%		5.4%	
スウェーデンク ローナ	0.750% SWEDEN GOV'T	1,270,000.00	1,203,960.00	
	0.750% SWEDEN GOV'T	1,500,000.00	1,400,250.00	
	1.000% SWEDEN GOV'T	1,180,000.00	1,149,202.00	
	1.500% SWEDEN GOV'T	1,830,000.00	1,837,137.00	
	2.500% SWEDEN GOV'T	1,530,000.00	1,572,534.00	
	3.500% SWEDEN GOV'T	1,380,000.00	1,706,232.00	
小計	銘柄数：6	8,690,000.00	8,869,315.00	
			(114,414,163)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	

ノルウェークロ ネ	1.250% NORWEGIAN GOV'T	630,000.00	547,974.00	
	1.375% NORWEGIAN GOV'T	1,000,000.00	893,900.00	
	1.500% NORWEGIAN GOV'T	880,000.00	844,008.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	1,540,000.00	1,505,812.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	960,000.00	919,200.00	
	1.750% NORWEGIAN GOV'T	1,150,000.00	1,070,535.00	
	2.000% NORWEGIAN GOV'T	1,360,000.00	1,362,448.00	
	3.000% NORWEGIAN GOV'T	1,190,000.00	1,203,923.00	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	8,710,000.00	8,347,800.00 (110,858,784) 0.2%
デンマーククロ ネ	0.000% KINGDOM OF DENMARK	700,000.00	626,710.00	
	0.250% KINGDOM OF DENMARK	710,000.00	521,495.00	
	0.500% KINGDOM OF DENMARK	1,740,000.00	1,706,766.00	
	0.500% KINGDOM OF DENMARK	1,710,000.00	1,647,072.00	
	1.500% KINGDOM OF DENMARK	240,000.00	244,728.00	
	1.750% KINGDOM OF DENMARK	1,250,000.00	1,296,125.00	
	4.500% KINGDOM OF DENMARK	2,410,000.00	3,592,346.00	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.4%	8,760,000.00	9,635,242.00 (174,783,289) 0.4%
ポーランドズロチ	0.250% POLAND GOV'T	580,000.00	435,580.00	
	0.750% POLAND GOV'T	580,000.00	490,854.00	
	1.250% POLAND GOV'T	410,000.00	268,919.00	
	2.250% POLAND GOV'T	600,000.00	543,120.00	
	2.500% POLAND GOV'T	690,000.00	581,325.00	
	2.500% POLAND GOV'T	760,000.00	613,168.00	
	2.750% POLAND GOV'T	590,000.00	471,882.00	
	2.750% POLAND GOV'T	1,230,000.00	942,549.00	
	3.250% POLAND GOV'T	1,030,000.00	928,030.00	
	4.000% POLAND GOV'T	960,000.00	930,816.00	
	小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.4%	7,430,000.00	6,206,243.00 (178,828,547) 0.4%
オーストラリアド ル	0.250% AUSTRALIAN GOV'T	200,000.00	188,000.00	
	0.250% AUSTRALIAN GOV'T	200,000.00	182,400.00	
	0.500% AUSTRALIAN GOV'T	380,000.00	341,620.00	
	1.000% AUSTRALIAN GOV'T	180,000.00	145,245.06	
	1.250% AUSTRALIAN GOV'T	350,000.00	286,519.10	

小計	1.500% AUSTRALIAN GOV'T	630,000.00	538,149.78		
	1.750% AUSTRALIAN GOV'T	330,000.00	281,787.00		
	1.750% AUSTRALIAN GOV'T	280,000.00	181,352.92		
	2.250% AUSTRALIAN GOV'T	210,000.00	199,857.00		
	2.500% AUSTRALIAN GOV'T	740,000.00	699,448.00		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	60,000.00	60,210.00		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	180,000.00	176,714.82		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	370,000.00	360,171.32		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	280,000.00	270,235.28		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	240,000.00	220,130.40		
	2.750% AUSTRALIAN GOV'T	160,000.00	138,672.00		
	3.000% AUSTRALIAN GOV'T	250,000.00	219,075.00		
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	430,000.00	406,015.89		
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	700,000.00	708,470.00		
	3.250% AUSTRALIAN GOV'T	470,000.00	470,423.00		
	3.750% AUSTRALIAN GOV'T	320,000.00	325,408.00		
	4.250% AUSTRALIAN GOV'T	410,000.00	429,705.42		
	4.500% AUSTRALIAN GOV'T	310,000.00	340,291.03		
	4.750% AUSTRALIAN GOV'T	300,000.00	323,400.00		
	銘柄数：24	7,980,000.00	7,493,301.02		
	組入時価比率：1.5%		(674,621,890)	1.5%	
	シンガポールドル	1.875% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	49,740.00	
		2.125% SINGAPORE GOV'T	160,000.00	157,648.00	
		2.375% SINGAPORE GOV'T	60,000.00	55,374.00	
2.375% SINGAPORE GOV'T		100,000.00	99,910.00		
2.625% SINGAPORE GOV'T		140,000.00	139,958.00		
2.750% SINGAPORE GOV'T		140,000.00	136,122.00		
2.750% SINGAPORE GOV'T		190,000.00	185,345.00		
2.875% SINGAPORE GOV'T		350,000.00	353,570.00		
3.000% SINGAPORE GOV'T		200,000.00	202,960.00		
3.375% SINGAPORE GOV'T		300,000.00	315,690.00		
3.500% SINGAPORE GOV'T		310,000.00	322,989.00		
銘柄数：11		2,010,000.00	2,019,306.00		
組入時価比率：0.4%			(188,057,967)	0.4%	
マレーシアリン ギット	2.632% MALAYSIAN GOV'T	350,000.00	297,955.00		
	3.478% MALAYSIAN GOV'T	400,000.00	398,307.20		
	3.502% MALAYSIAN GOV'T	430,000.00	416,983.90		

小計	3.757% MALAYSIAN GOV'T	450,000.00	384,631.65	
	3.844% MALAYSIAN GOV'T	940,000.00	863,066.64	
	3.885% MALAYSIAN GOV'T	500,000.00	480,454.00	
	3.899% MALAYSIAN GOV'T	300,000.00	296,039.40	
	3.900% MALAYSIAN GOV'T	950,000.00	945,202.50	
	3.955% MALAYSIAN GOV'T	600,000.00	600,600.00	
	4.065% MALAYSIAN GOV'T	390,000.00	329,487.60	
	4.181% MALAYSIAN GOV'T	590,000.00	595,359.56	
	4.232% MALAYSIAN GOV'T	200,000.00	193,340.40	
	4.498% MALAYSIAN GOV'T	440,000.00	437,847.96	
	4.736% MALAYSIAN GOV'T	530,000.00	504,491.10	
	4.762% MALAYSIAN GOV'T	320,000.00	317,449.28	
	4.893% MALAYSIAN GOV'T	180,000.00	178,223.04	
	4.935% MALAYSIAN GOV'T	180,000.00	177,138.54	
小計	銘柄数：17 組入時価比率：0.5%	7,750,000.00	7,416,577.77 (218,519,822) 0.5%	
イスラエルシュケ ル	0.400% ISRAEL FIXED BOND	200,000.00	193,800.00	
	1.000% ISRAEL FIXED BOND	260,000.00	233,168.00	
	1.500% ISRAEL FIXED BOND	620,000.00	625,890.00	
	1.500% ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	333,320.00	
	1.750% ISRAEL FIXED BOND	350,000.00	352,310.00	
	2.250% ISRAEL FIXED BOND	700,000.00	707,630.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	626,820.00	
	3.750% ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	706,290.00	
	5.500% ISRAEL FIXED BOND	130,000.00	177,073.00	
	6.250% ISRAEL FIXED BOND	700,000.00	846,930.00	
小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.4%	4,610,000.00	4,803,231.00 (182,975,242) 0.4%	
オフショア元	2.260% CHINA GOV'T	1,900,000.00	1,895,614.80	
	2.280% CHINA GOV'T	1,900,000.00	1,901,126.70	
	2.480% CHINA GOV'T	1,600,000.00	1,592,956.80	
	2.560% CHINA GOV'T	5,600,000.00	5,629,993.60	
	2.680% CHINA GOV'T	2,300,000.00	2,271,581.20	
	2.690% CHINA GOV'T	3,800,000.00	3,821,485.20	
	2.750% CHINA GOV'T	1,500,000.00	1,491,961.50	
	2.800% CHINA GOV'T	1,100,000.00	1,100,179.30	
	2.840% CHINA GOV'T	4,400,000.00	4,445,474.00	

		2.890% CHINA GOV'T	2,500,000.00	2,515,877.50	
		2.910% CHINA GOV'T	2,600,000.00	2,622,313.20	
		3.020% CHINA GOV'T	3,800,000.00	3,871,151.20	
		3.280% CHINA GOV'T	2,700,000.00	2,784,958.20	
		3.530% CHINA GOV'T	2,700,000.00	2,821,872.60	
		3.720% CHINA GOV'T	1,600,000.00	1,706,529.60	
	小計	銘柄数：15	40,000,000.00	40,473,075.40	
		組入時価比率：1.7%		(772,962,888)	
				1.7%	
合計				44,897,900,917	
				(44,897,900,917)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
ドル	国債証券 192銘柄	100.0%	50.0%
カナダドル	国債証券 25銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 279銘柄	100.0%	36.0%
ポンド	国債証券 43銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 10銘柄	100.0%	0.4%
オフショア元	国債証券 15銘柄	100.0%	1.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2022年6月末現在)

日立バランスファンド（株式70）

資産総額	29,755,822,515 円
負債総額	27,545,274 円
純資産総額（ - ）	29,728,277,241 円
発行済口数	10,490,004,098 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8340 円
（1万口当たり純資産額）	（28,340 円）

日立バランスファンド（株式50）

資産総額	24,705,696,909 円
負債総額	28,270,103 円
純資産総額（ - ）	24,677,426,806 円
発行済口数	10,519,336,810 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3459 円
（1万口当たり純資産額）	（23,459 円）

日立バランスファンド（株式30）

資産総額	8,711,887,042 円
負債総額	8,766,902 円
純資産総額（ - ）	8,703,120,140 円
発行済口数	4,611,245,393 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8874 円
（1万口当たり純資産額）	（18,874 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	54,939,974,103 円
負債総額	567,588,886 円
純資産総額（ - ）	54,372,385,217 円
発行済口数	25,671,709,154 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1180 円
（1万口当たり純資産額）	（21,180 円）

日立国内債券インデックスマザーファンド

資産総額	79,735,841,600 円
負債総額	798,310,859 円
純資産総額（ - ）	78,937,530,741 円
発行済口数	57,469,166,359 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3736 円
（1万口当たり純資産額）	（13,736 円）

日立外国株式インデックスマザーファンド

資産総額	162,663,622,535 円
負債総額	29,691,326 円
純資産総額（ - ）	162,633,931,209 円
発行済口数	40,292,288,831 口
1口当たり純資産額（ / ）	4.0364 円
（1万口当たり純資産額）	（40,364 円）

日立外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	46,373,797,542 円
負債総額	39,200,172 円
純資産総額（ - ）	46,334,597,370 円
発行済口数	18,317,642,069 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5295 円
（1万口当たり純資産額）	（25,295 円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者名簿

作成しません。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

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

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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（2022年8月15日現在）

資本金
1億円
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
2019年1月31日に2億円の減資

(2) 委託会社等の機構

経営体制

取締役は、5名以内とします。

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

委託者は、株式会社日立製作所により1999年8月5日に設立された会社です。

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

2022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、20本であり、その純資産総額の合計は759,795百万円です。（なお、親投資信託18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	169,803
	私募	13	589,992
合計		20	759,795

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（2021年4月1日から2022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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第22期 (2021年3月31日現在)	第23期 (2022年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,146	1,029
未収委託者報酬	273,505	305,266
未収運用受託報酬	40	40
関係会社預け金	1 1,396,330	1 1,410,735
前払費用	31,783	32,649
その他	39	257
流動資産合計	1,702,845	1,749,979
固定資産		
無形固定資産		
ソフトウェア	745	570
無形固定資産合計	745	570
投資その他の資産		
敷金	22,882	16,545
繰延税金資産	53,996	52,415
投資その他の資産合計	76,879	68,960
固定資産合計	77,625	69,530
資産合計	1,780,470	1,819,509

（単位：千円）

	第22期 （2021年3月31日現在）		第23期 （2022年3月31日現在）			
負債の部						
流動負債						
未払金	1	3	89,972	1	3	62,192
未払費用	1		415,159	1		424,210
未払法人税等	2		3,593	2		2,518
預り金			6,203			4,464
賞与引当金			30,555			28,857
流動負債合計			545,484			522,244
固定負債						
退職給付引当金			117,263			124,570
固定負債合計			117,263			124,570
負債合計			662,748			646,814
純資産の部						
株主資本						
資本金			100,000			100,000
資本剰余金						
その他資本剰余金			200,000			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			742,722			797,695
利益剰余金合計			817,722			872,695
株主資本合計			1,117,722			1,172,695
純資産合計			1,117,722			1,172,695
負債純資産合計			1,780,470			1,819,509

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,060,420	1,064,526
運用受託報酬	455,814	445,247
営業収益計	1,516,234	1,509,773
営業費用		
支払手数料	722,167	717,337
委託計算費	47,261	52,644
調査費	236,282	245,818
営業雑経費		
通信費	3,055	2,034
印刷費	3,011	2,194
諸会費	3,831	3,409
営業雑経費計	9,898	7,639
営業費用計	1,015,609	1,023,440
一般管理費		
給料		
役員報酬	20,409	20,300
給料・手当	225,089	218,081
賞与	1,870	2,575
給料計	247,368	240,957
交際費	48	275
旅費交通費	176	57
租税公課	51	71
不動産賃借料	34,278	34,278
賞与引当金繰入額	64,853	57,714
退職給付費用	8,189	7,306
その他の人件費	41,913	41,745
その他の不動産関係費	5,404	11,531
減価償却費	411	175
諸雑費	7,290	7,103
一般管理費計	1 409,986	1 401,216
営業利益	90,638	85,116
営業外収益		
受取利息	684	835
為替差益	8	6
その他	42	44
営業外収益計	1 735	1 886
営業外費用		
為替差損	-	-
O A 機器解約違約金	416	-
その他	-	-
営業外費用合計	416	-
経常利益	90,957	86,002
特別損失		
事務過誤損失補填	-	3,272
税引前当期純利益	90,957	82,730

法人税等	2	34,961	2	26,176
法人税等調整額		6,489		1,581
法人税等合計		28,472		27,757
当期純利益		62,485		54,972

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金				
		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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当 期 首 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	680,237	755,237	1,055,237	1,055,237
当 期 変 動 額								
当期純利益					62,485	62,485	62,485	62,485
当期変動額合計	-	-	-	-	62,485	62,485	62,485	62,485
当 期 末 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	742,722	817,722	1,117,722	1,117,722

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資 本 剰 余 金		利 益 剰 余 金				
		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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当 期 首 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	742,722	817,722	1,117,722	1,117,722
当 期 変 動 額								
当期純利益					54,972	54,972	54,972	54,972
当期変動額合計	-	-	-	-	54,972	54,972	54,972	54,972
当 期 末 残 高	100,000	200,000	200,000	75,000	797,695	872,695	1,172,695	1,172,695

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. 収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (1)投資助言業務収益 投資助言業務は、投資顧問（助言）契約に基づき、有価証券の価値等または金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に関し、顧客のために助言を行う業務です。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、契約期間を通して収益として認識しております。 (2)投資一任業務収益 投資一任業務は、投資一任契約に基づき、金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に基づいて顧客の財産を投資運用する業務です。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、運用期間にわたり収益を認識しております。 (3)投信委託者報酬 投信委託者報酬は、投資信託の運営・管理を行い、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識されます。当該契約については、一定期間にわたり履行義務が充足されると判断し、運用期間にわたり収益を認識しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

会計方針の変更

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っておりますが、繰越利益剰余金の当期首残高へ与える影響はありません。また、当事業年度の損益に与える影響もありません。

表示方法の変更

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用しております。時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとし、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

注記事項

（貸借対照表関係）

第22期 (2021年3月31日現在)	第23期 (2022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 1,396,330千円 未払金 24,240千円 未払費用 586千円	1. 関係会社に対する資産及び負債 関係会社預け金 1,410,735千円 未払金 19,965千円 未払費用 3,094千円
2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 1,443千円 未払事業税 1,205千円 未払事業所税 944千円	2. 未払法人税等の内訳 未払住民税 810千円 未払事業税 801千円 未払事業所税 907千円
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22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
1. 関係会社との取引高 一般管理費 10,363千円 営業外収益 684千円	1. 関係会社との取引高 一般管理費 13,950千円 営業外収益 835千円
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22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022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	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 -	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 -	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 - (2)当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 -	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 - (2)当事業年度の末日後に行う剰余金の配当 -

（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22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
1年内	2,443千円	1,425千円
1年超	1,425千円	- 千円
合計	3,868千円	1,425千円

（金融商品関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

現金及び預金、関係会社預け金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金及び未払費用は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組み方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

リスク管理規程に基づき諸リスクの管理運営を行っております。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

現金及び預金、関係会社預け金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金及び未払費用は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

3．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

該当事項はありません。

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品
該当事項はありません。

（有価証券関係）

第22期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022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22期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）
該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第22期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）
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。 退職一時金制度については設立時に設定しております。 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。	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 117,263千円（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 124,570千円（退職給付引当金）
(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表 退職給付債務の期首残高 123,532 千円 退職給付費用 8,189 退職給付の支払額 14,458 退職給付債務の期末残高 117,263	(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表 退職給付債務の期首残高 117,263 千円 退職給付費用 7,306 退職給付の支払額 - 退職給付債務の期末残高 124,570
(2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表 非積立型制度の退職給付債務 117,263 千円 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 117,263 退職給付引当金 117,263 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 117,263	(2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表 非積立型制度の退職給付債務 124,570 千円 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 124,570 退職給付引当金 124,570 貸借対照表に計上された 負債と資産の純額 124,570
(3)退職給付費用 退職給付費用 8,189 千円	(3)退職給付費用 退職給付費用 7,306 千円

（税効果会計関係）

第22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)																																																																																				
<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別内訳 (繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">10,569</td> <td style="text-align: right;">千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">40,561</td> <td></td> </tr> <tr> <td>減価償却費</td> <td style="text-align: right;">716</td> <td></td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">1,806</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">9,956</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">63,611</td> <td></td> </tr> <tr> <td>税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当額</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>将来減算一時差異等の合計 に係る評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">9,614</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">評価性引当額小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">9,614</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">53,996</td> <td></td> </tr> </table> <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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">(%)</td> </tr> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">34.6</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;">0.0</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">3.3</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; border-bottom: 3px double black;">31.3</td> </tr> </table>	賞与引当金	10,569	千円	退職給付引当金	40,561		減価償却費	716		未払社会保険料	1,806		その他	9,956		繰延税金資産小計	63,611		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	9,614		評価性引当額小計	9,614		繰延税金資産合計	53,996			(%)	法定実効税率	34.6	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0	その他	3.3	税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.3	<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別内訳 (繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">11,658</td> <td style="text-align: right;">千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">43,088</td> <td></td> </tr> <tr> <td>減価償却費</td> <td style="text-align: right;">3,258</td> <td></td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">2,502</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">590</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">61,099</td> <td></td> </tr> <tr> <td>税務上の繰越欠損金に係る 評価性引当額</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>将来減算一時差異等の合計 に係る評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">8,684</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">評価性引当額小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">8,684</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">52,415</td> <td></td> </tr> </table> <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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">(%)</td> </tr> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">34.6</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;">2.6</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">3.6</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; border-bottom: 3px double black;">33.6</td> </tr> </table>	賞与引当金	11,658	千円	退職給付引当金	43,088		減価償却費	3,258		未払社会保険料	2,502		その他	590		繰延税金資産小計	61,099		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	8,684		評価性引当額小計	8,684		繰延税金資産合計	52,415			(%)	法定実効税率	34.6	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	2.6	その他	3.6	税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.6
賞与引当金	10,569	千円																																																																																			
退職給付引当金	40,561																																																																																				
減価償却費	716																																																																																				
未払社会保険料	1,806																																																																																				
その他	9,956																																																																																				
繰延税金資産小計	63,611																																																																																				
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	9,614																																																																																				
評価性引当額小計	9,614																																																																																				
繰延税金資産合計	53,996																																																																																				
	(%)																																																																																				
法定実効税率	34.6																																																																																				
(調整)																																																																																					
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0																																																																																				
その他	3.3																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.3																																																																																				
賞与引当金	11,658	千円																																																																																			
退職給付引当金	43,088																																																																																				
減価償却費	3,258																																																																																				
未払社会保険料	2,502																																																																																				
その他	590																																																																																				
繰延税金資産小計	61,099																																																																																				
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	8,684																																																																																				
評価性引当額小計	8,684																																																																																				
繰延税金資産合計	52,415																																																																																				
	(%)																																																																																				
法定実効税率	34.6																																																																																				
(調整)																																																																																					
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.6																																																																																				
その他	3.6																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.6																																																																																				

（ストックオプション等関係）

第22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022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22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022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22期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）																
<p>1. 当該資産除去債務の概要</p> <p>当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。</p> <p>また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。</p> <p>2. 当該資産除去債務の金額算定方法</p> <p>資産除去債務の金額は本店移転の実績を鑑み合理的に見積っており、使用見込期間は30年と見積もって計算しております。</p> <p>3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">2,713千円</td> </tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td> <td style="text-align: right;">370千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td style="text-align: right;">3,083千円</td> </tr> </table>	期首残高	2,713千円	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	3,083千円	<p>1. 当該資産除去債務の概要</p> <p>当社本店は建物管理者との不動産賃貸借契約に基づき、賃貸期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の義務に関して資産除去債務を認識しております。</p> <p>また、当会計年度末における資産除去債務は、負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関連する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当会計年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。</p> <p>2. 当該資産除去債務の金額算定方法</p> <p>資産除去債務の金額は過去の本店移転の実績を鑑み、使用見込期間は30年と見積もって計算してはりましたが、2022年5月本店移転予定に伴い、当事業年度に原状回復に係る債務の見積もり変更を行いました。また、敷金について償却に係る合理的な期間の短縮を行っており、これにより、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引き前当期純利益はそれぞれ5,967千円減少しております。</p> <p>3. 当会計年度における当該資産除去債務の総額の増減</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">3,083千円</td> </tr> <tr> <td>建物賃貸借契約に伴う 資産除去債務の増加額</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td>当年度の負担に属する償却額</td> <td style="text-align: right;">6,337千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高</td> <td style="text-align: right;">9,420千円</td> </tr> </table>	期首残高	3,083千円	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	6,337千円	期末残高	9,420千円
期首残高	2,713千円																
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	3,083千円																
期首残高	3,083千円																
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	6,337千円																
期末残高	9,420千円																

（収益認識に関する注記）

第22期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第23期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）
	1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報 当事業年度の収益の構成は次の通りです。
	セグメント 投資運用業
	主要な財又はサービスのライン
	投資助言業務収益 100,000千円
	投資一任業務収益 345,247千円
	投信委託者報酬 1,064,526千円
	合計 1,509,773千円
	収益認識の時期
	一時点で移転される財 -
	一定の期間にわたり移転されるサービス 1,509,773千円
	合計 1,509,773千円
	2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
	(1) 投資助言業務収益 投資助言業務は、投資顧問（助言）契約に基づき、有価証券の価値等または金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に関し、顧客のために助言を行う業務です。 履行義務は契約期間にわたり充足されると判断しておりますが、これは顧客は当社が助言業務を行うことにより便益を享受することができ、助言業務は契約期間にわたって継続して行うことから、契約期間の経過に伴い義務を履行していると判断しているためです。 投資助言業務に関する取引の対価は、1年間の契約に基づき、四半期ごとに概ね1か月以内に受領しており、履行義務を充足してから対価を受領するまでの期間が通常は1年以内であるため、当該顧客との契約に基づく債権について、重大な金融要素の調整は行っておりません。
	(2) 投資一任業務収益 投資一任業務は、投資一任契約に基づき、金融商品の価値等の分析に基づく投資判断に基づいて顧客の財産を投資運用する業務です。 日立企業年金基金との契約においては報酬額が投資一任契約に基づき日々の信託財産の残高に対する一定割合として計算される一方で、年間報酬額上限が定められております。 履行義務は契約期間にわたり充足されると判断しておりますが、これは顧客は当社が投資一任業務を行うことにより便益を享受することができ、投資運用業務は契約期間にわたって継続して行うことから、契約期間の経過に伴い義務を履行していると判断しているためです。 投資一任業務に関する取引の対価は、1年間の運用期間満了後、概ね1か月以内に受領しており、履行義務を充足してから対価を受領するまでの期間が通常は1年以内であるため、当該顧客との契約に基づく債権について、重大な金融要素の調整は行っておりません。

(3) 投信委託者報酬

投信委託者報酬は、投資信託の運営・管理を行う業務です。

履行義務は契約期間にわたり充足されると判断しておりますが、これは顧客は当社が投信委託業務を行うことにより便益を享受することができ、投信委託業務は契約期間にわたって継続して行うことから、契約期間の経過に伴い義務を履行していると判断しているためです。

投信委託業務に関する取引の対価は、6か月の運用期間満了後、概ね1か月以内に受領しており、履行義務を充足してから対価を受領するまでの期間が通常は1年以内であるため、当該顧客との契約に基づく債権について、重大な金融要素の調整は行っておりません。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	300,000
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	304,030
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	231,706

（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 2021年4月1日 至 2022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	300,000
日立国内株式特化型ファンド（大口）（注）	233,589
日立国内株式厳選投資ファンド（大口）（注）	223,337

（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 2020年4月1日 至 2021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				
親会社	㈱日立製作所	東京都千代田区	460,790 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	37,245	未払金	23,533
								預け金の利息	684	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,632,735	関係会社預け金	1,396,330
								親会社に対する預け金の減少	1,588,976		

(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	㈱日立リアルエステートパートナーズ	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	22,882

(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。

(ウ)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	㈱日立ドキュメントソリューションズ	東京都江東区	450 百万円	オフィスワーク支援	-	-	OA複合機レンタル	OA機器レンタル費用の支払	416	営業外費用（OA機器解約違約金）	-

(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りません。

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

親会社情報

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 2021年4月1日 至 2022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				
親会社	㈱日立製作所	東京都千代田区	461,731百万円	電機機器製造業	100.0%	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	23,533	未払金	18,829
								預け金の利息	835	未収入金	-
								親会社に対する預け金の増加	1,571,813	関係会社預け金	1,410,735
								親会社に対する預け金の減少	1,557,408		

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

2. 取引条件および取引条件の決定方法等

関係会社預け金の金利：市場金利に基づいて決定しております。

3. 役員の兼任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. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

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22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額 186,287円10銭 1株当たり当期純利益 10,414円19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 195,449円27銭 1株当たり当期純利益 9,162円16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 62,485千円 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 62,485千円 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 54,972千円 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 54,972千円 普通株式の期中平均株式数 6,000株

(重要な後発事象)

第22期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	第23期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(追加情報)

当社では、繰延税金資産の回収可能性等の会計上の見積もりは、財務諸表作成時において入手可能な情報に基づき実施しております。新型コロナウイルス感染症による当社への影響は、今後の広がり方や収束時期等の見通しが不透明な状況であるものの、現時点において業績への影響を与えるものではないと判断しております。なお、今後の新型コロナウイルス感染症の感染拡大による影響は不確定要素が多いため、引き続き今後の動向を注視してまいります。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（2022年6月末現在）

(1) 受託者（受託会社）

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

(2) 販売会社

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

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の名称、資本金の額及び事業の内容

名称	資本金の額	事業の内容
野村アセットマネジメント株式会社 （1959年12月1日設立）	17,180百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社 （1998年2月25日設立）	310百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。
MU投資顧問株式会社 （1993年9月27日設立）	1,200百万円	「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める投資運用業および投資助言・代理業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託者（受託会社）

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

(2) 販売会社

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

（ご参考）マザーファンドの運用再委託先の業務の概況

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

3【資本関係】

該当ありません。

第3【参考情報】

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

書類名	提出年月日
有価証券届出書	2021年 8月16日
有価証券報告書	2021年 8月16日
有価証券届出書の訂正届出書	2022年 2月10日
半期報告書	2022年 2月10日

独立監査人の監査報告書

2022年5月27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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

大関

康広

監査意見

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第23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。

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2022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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月27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

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士

福村

寛

業務執行社員

監査意見

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2021年5月18日から2022年5月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2022年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日立投資顧問株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月27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

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士

福村

寛

業務執行社員

監査意見

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2021年5月18日から2022年5月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2022年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日立投資顧問株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年7月27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

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士

福村

寛

業務執行社員

監査意見

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2021年5月18日から2022年5月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2022年5月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日立投資顧問株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。